

【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12月15日提出
【計算期間】	第3期（自 平成20年10月1日 至 平成21年9月30日）
【ファンド名】	すみしん DCマイセレクションS50 （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、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」（以下総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

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

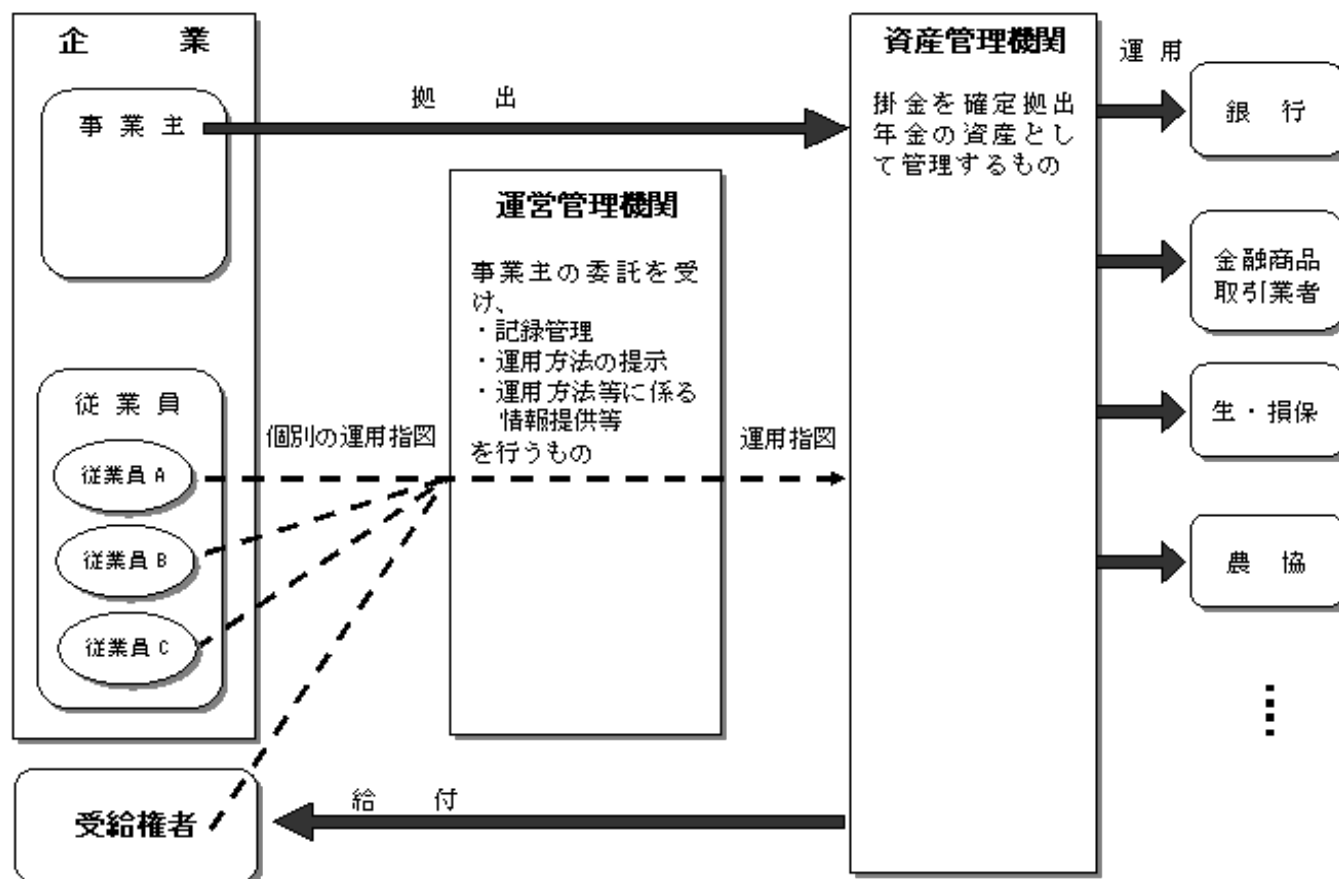
[ご参考]確定拠出年金スキーム図

確定拠出年金法で定められる確定拠出年金制度には、厚生年金適用事業所の事業主が、単独または共同で実施する「企業型年金（同法第2章に規定）」と国民年金基金連合会が実施する「個人型年金（同法第3章に規定）」があります。

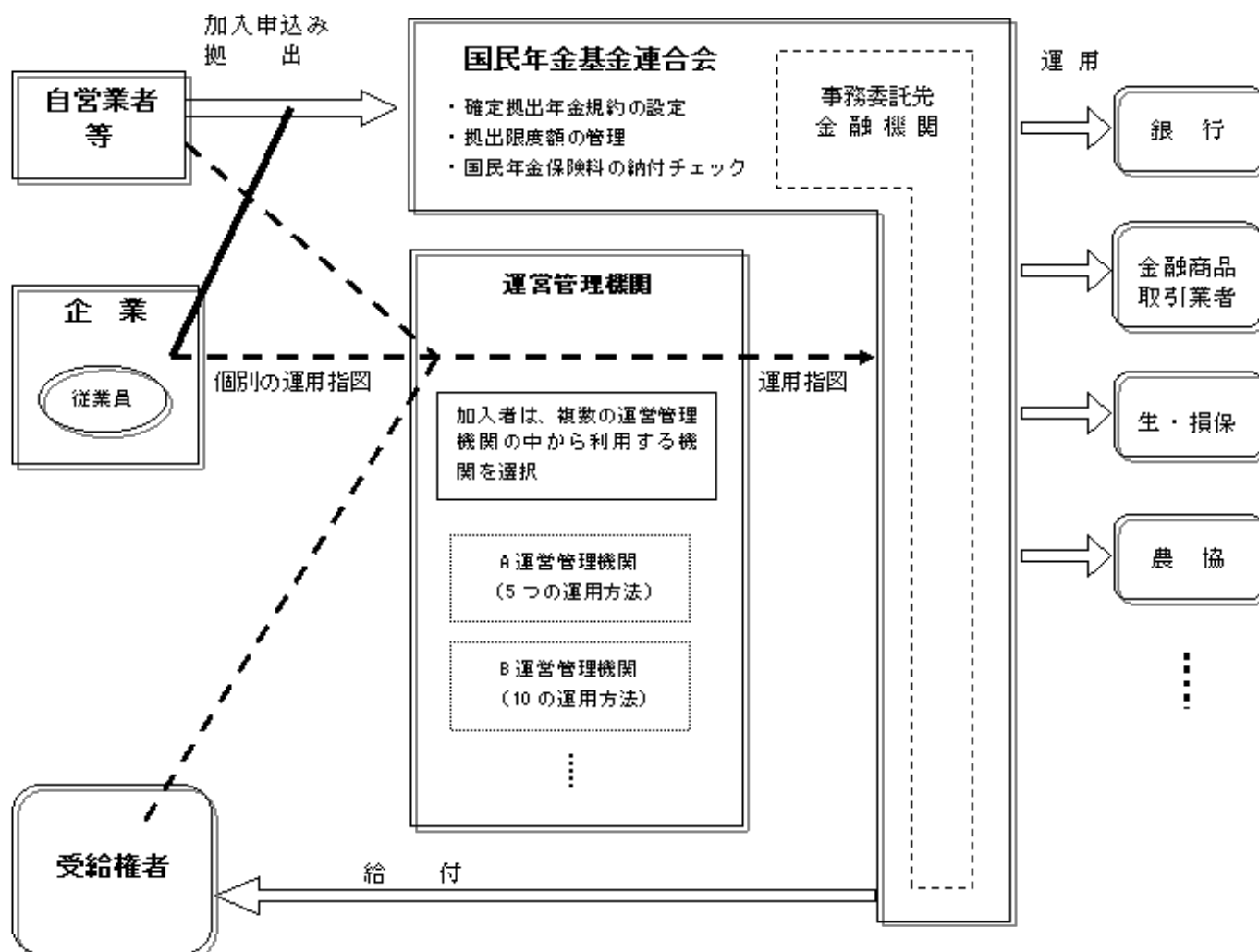
以下はそれぞれの仕組みの概要を図にしたものです。（厚生労働省「確定拠出年金法案要綱」より抜粋、加工。）

詳細は関係法令でご確認ください。

< 企業型確定拠出年金制度のイメージ図 >



< 個人型確定拠出年金制度のイメージ図 >



[ファンドの特色]

分散投資

日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、分散投資効果によりリスクを軽減しつつ安定的な収益の獲得をめざします。

資産配分の方針

- ・期待リターンとリスクのバランスを考慮し、基準となるアセットミックス（資産構成比率）を設定します。
- ・資産ごとの投資比率は、原則として、基準アセットミックスから±5%の範囲内にコントロールします。
- ・基準アセットミックスは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

資産別の運用方針

資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、市場の成長にそった運用収益の獲得および運用にともなう諸費用を極力抑制し、長期的な運用成果の向上をめざします。資産ごとの運用では、下記のインデックスに連動する投資成果を目標とします。

国内株式：東証株価指数（TOPIX）※1

国内債券：ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）※2

外国株式：MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）※3

外国債券：シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）※4

※1「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下、㈱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、㈱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、㈱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㈱東京証券取引所が有しています。
- 2) ㈱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) ㈱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) ㈱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㈱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) 本ファンドが主要投資対象とする「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。
- 6) 本ファンドおよび「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、㈱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) ㈱東京証券取引所は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者または公衆に対し、本ファンドおよび「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。
- 8) ㈱東京証券取引所は、委託者または「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

※2「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）」（以下「NOMURA-BPI総合」ということがあります。）とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。同指数は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。同指数に関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、本ファンドおよび「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

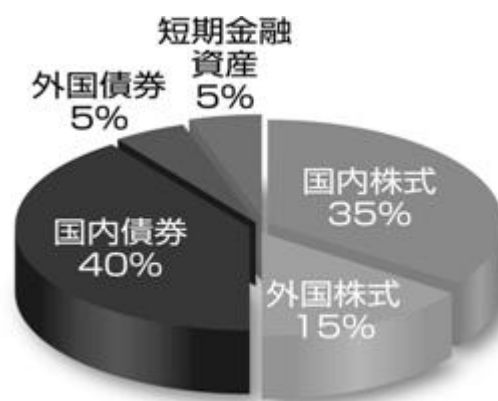
※3「MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）」とは、MSCI社が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国の株式指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。またMSCI社は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

※4「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。同指数はシティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが有しています。

住友信託銀行のアドバイスにもとづいて運用

- ・運用効率向上のため、実質的な運用は投資対象資産ごとにまとめられた各マザーファンドで行います。
- ・各マザーファンドの運用は、住友信託銀行のアドバイスを受けて行います。

<すみしん DCマイセレクションS50の基準ポートフォリオ>



[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。

①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
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産
		()
		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。

②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)		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米		
	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり ()
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
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12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	日々	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ()	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。

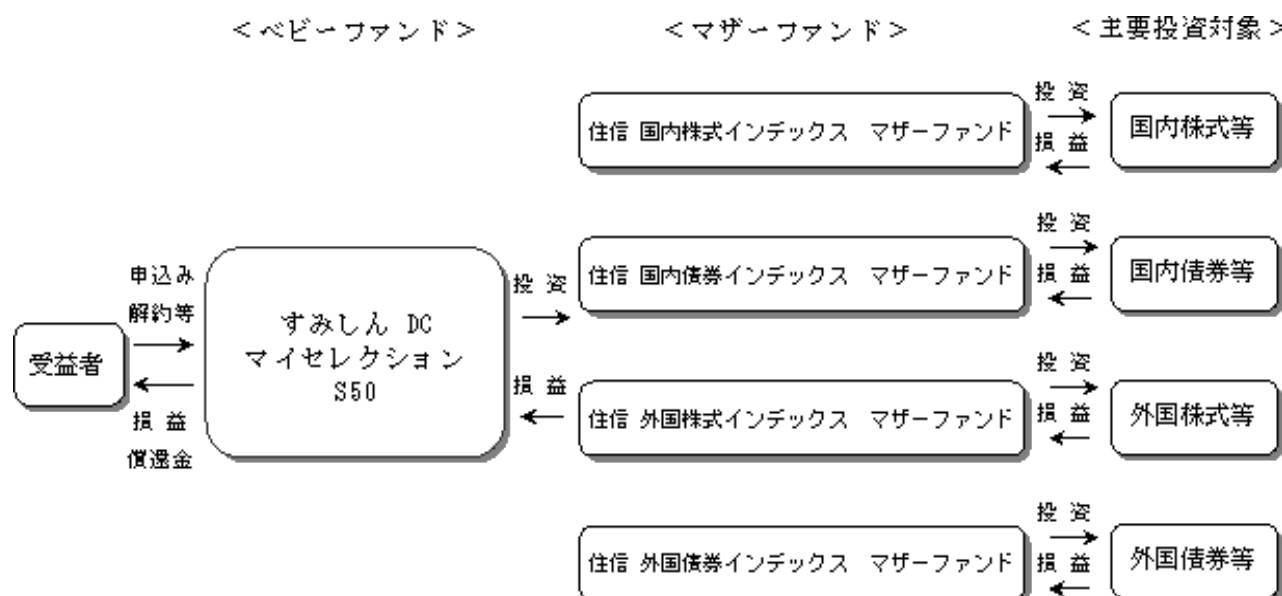
[区分における定義]

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・ファンズのことをいいます。）、実質的に複数資産（株式、債券、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（日本を含みます。）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

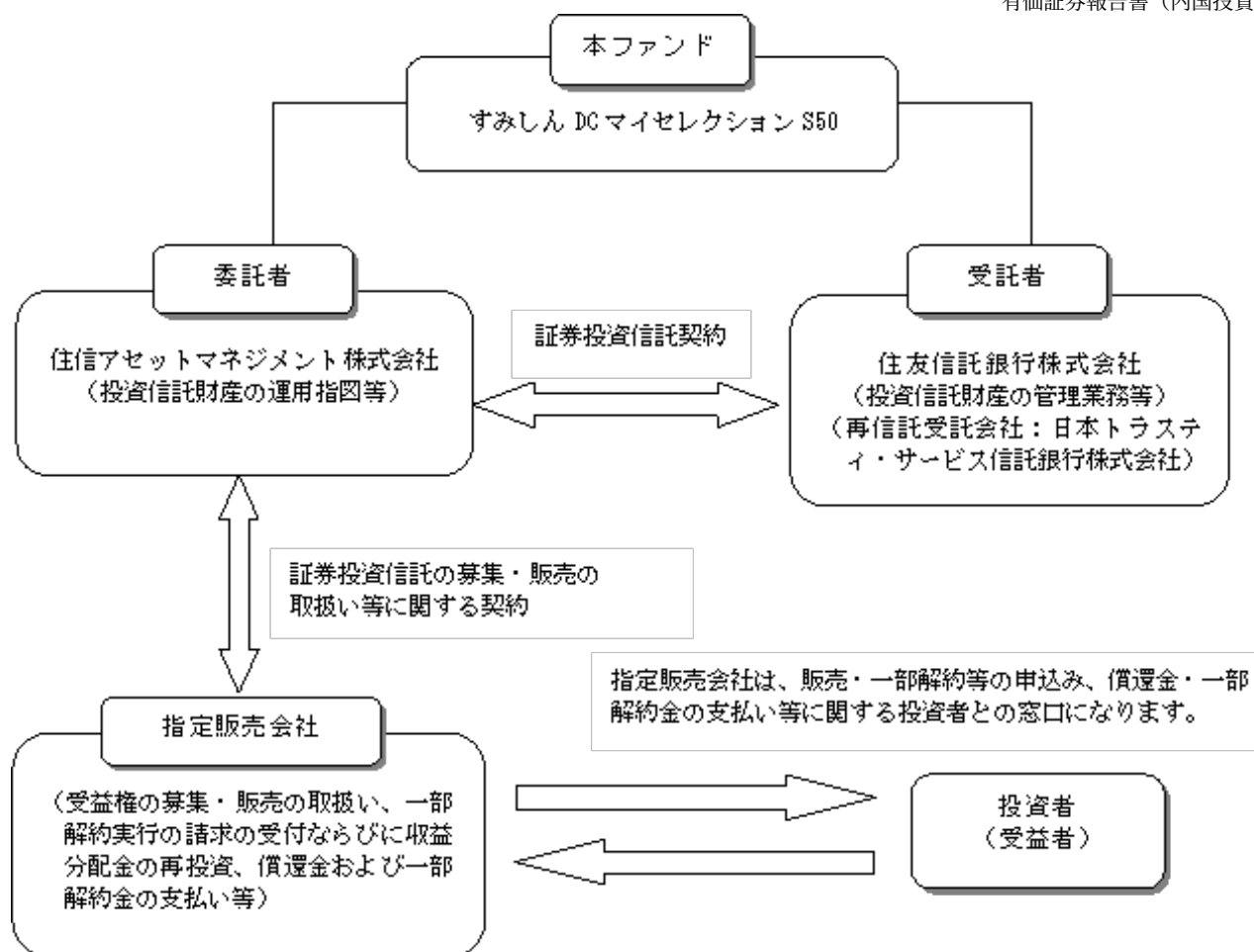
(2) 【ファンドの仕組み】

(イ) ファンドの仕組み

本ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、受益者から投資された資金をベビーファンド（本ファンド）としてまとめ、その資金を主としてマザーファンド（「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」）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。



(ロ) ファンドの関係法人図



(ハ) 委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

①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。

②指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約

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

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

(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。)

(ニ) 委託会社等の概況

①資本金

平成21年3月末日現在 3億円

②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

③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、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ) 運用方法

①主たる投資対象

「住信 国内株式インデックス マザーファンド受益証券」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド受益証券」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド受益証券」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド受益証券」を主要投資対象とします。

②投資態度

1)基準ポートフォリオは、国内株式35%、国内債券40%、外国株式15%、外国債券5%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。各資産ごとの比率に一定の変動幅を設けます。

	基準配分 (%)	変動幅 (%)
国内株式	35	±5
国内債券	40	±5
外国株式	15	±5
外国債券	5	±5
短期金融資産	5	…
合計	100	

2)各資産の基本アロケーションは、市況動向等に応じて、1年に1回程度若干の見直しを行う場合があります。

3)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用

効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

- 4) 投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 5) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 6) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(参考)「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

② 株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③ 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ 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。

⑤ 国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行いません。

③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤ 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（参考）「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

- ①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③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。
- ④国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

3.運用制限

- ①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資は、行いません。

（参考）「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

- ①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ④運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ⑤有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

3.運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（参考）「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

- ①シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③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。
- ④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避

するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

- ⑥投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

3.運用制限

- ①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(2)【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

- ②次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を主として、住信アセットマネジメント株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「住信 国内株式インデックス マザーファンド」および「住信 国内債券インデックス マザーファンド」および「住信 外国株式インデックス マザーファンド」ならびに「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の受益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きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

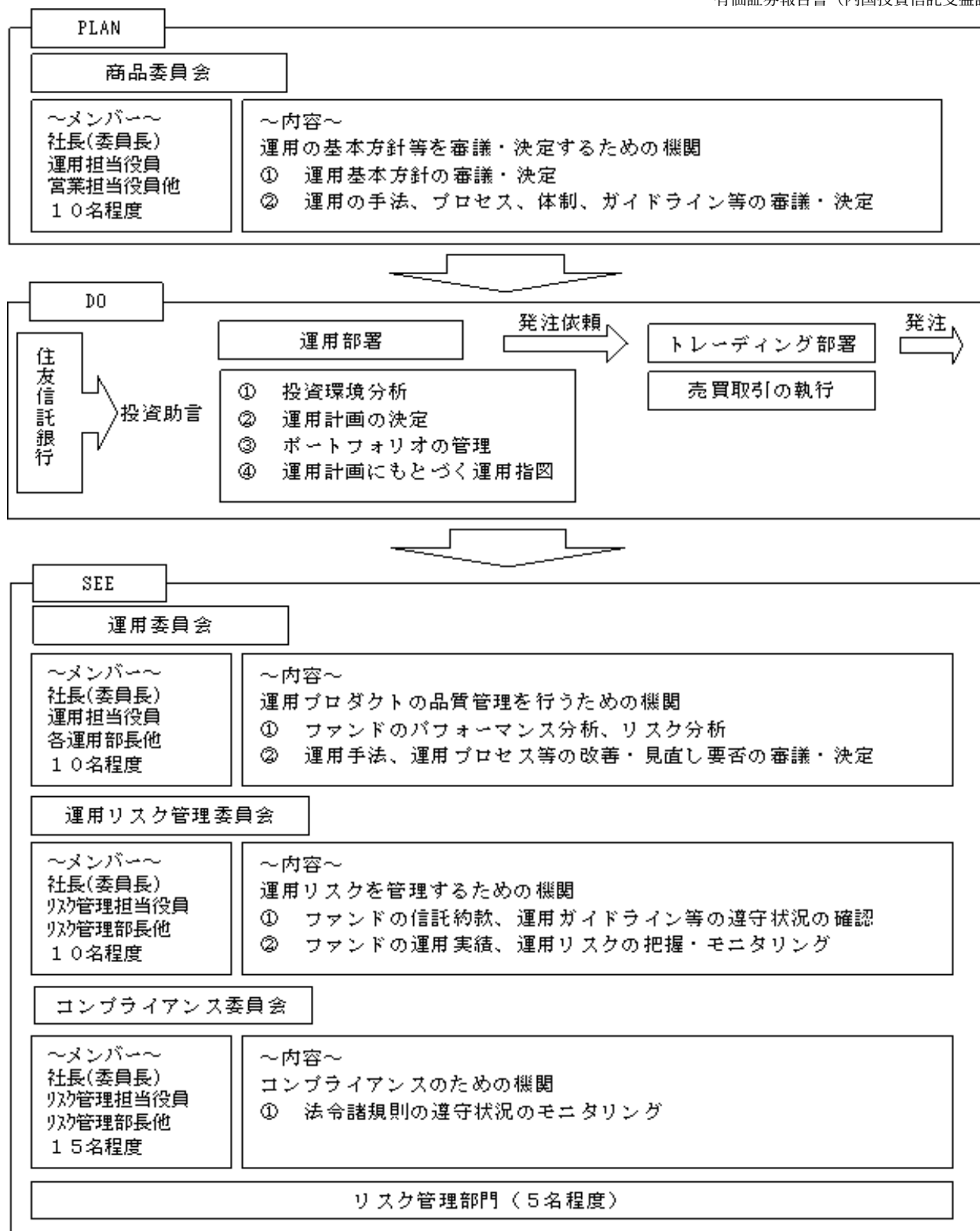
(ハ) 委託者は、信託金を、前記（ロ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

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



[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（毎年9月30日。ただし、該当日が休業日の場合は翌営業日。）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。

①分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

③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**①投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。**

1)配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2)売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②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。**(ハ) 収益分配金の再投資****①収益分配金は、原則として自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。****②受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者と別に定める「自動けいぞく投資約款」にもとづき、受益者に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。**

※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、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関の振替機関等の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

- 1) 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 3) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 4) 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 5) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 6) マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 7) 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 8) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第21条）
- 9) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第24条）
 1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 10) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同

じ。）委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第25条）

- 11) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第26条）
- 12) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第27条）
- 13) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第28条）
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額を超えないものとします。
- 14) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売付の指図は、当該売付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29条）
- 15) 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30条）
- 16) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

（投資信託約款第33条）

17)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。（投資信託約款第40条）

(a)一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(b)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。

(c)借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

※前記1)から7)における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記1)から7)に掲げる各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記11)、12)、16)における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

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

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

運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する同一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、各マザーファンド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マザーファンド受益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、各マザーファンド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。また、本ファンドの資産を株式に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。

(金利変動リスク)

- ・本ファンドは、各マザーファンド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、各マザーファンド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、各マザーファンド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いても、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。また、本ファンドの資産を外貨建資産に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。

3) カントリーリスク

- ・各マザーファンド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。また、本ファンドの資産を外貨建資産に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。

4) 信用リスク

- ・本ファンドは、各マザーファンド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マザーファンド受益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、各マザーファンドおよび本ファンドが、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、東証株価指数（TOPIX）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）のいずれかが下落すれば、各マザーファンド受益証券の基準価額が下落する要因となるため、これにより投資元本を割り込むことがあります。

- ・本ファンドの主要投資対象である各マザーファンドは、各ベンチマークへの連動を目指しますが、各マザーファンドへの入出金の影響、組入比率が100%でない影響、ファンドの銘柄ごとの組入比率と各ベンチマークの構成銘柄のウェイトが異なること、売買コストや信託報酬等の影響などから、各ベンチマークから乖離する可能性があります。各マザーファンドの各ベンチマークは前記「(1)本ファンドの基本的性格および特色」に記載された通りです。
- ・本ファンドは、ファミリーファンド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マザーファンドに対し、他のベビー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、各マザーファンド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たがって、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]

- ・資産構成比率と基準アセットミックスの乖離幅チェックを日々行い、許容範囲を超過した場合はリバランスを実行します。
- ・原則として、各マザーファンドへの投資となりますので、リスク管理は各資産ごとに行います。
- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に対して報告されており、客観的なチェックが行われています。

[各マザーファンドのリスク管理基準]

①住信 国内株式インデックス マザーファンド

- ・リスクモデルを活用したリスク分析を行います。

〔項目〕 推定トラッキングエラー※

マザーファンドの銘柄別構成比率と市場構成比率との乖離 等

※「トラッキングエラー」とは、運用のリターンとベンチマーク等とがどの程度乖離しているかを示す指標をいいます。以下同じ。

- ・パフォーマンスの要因分析を行います。

〔項目〕 トラッキングエラー実績値

業種選択要因・リスクファクター要因・銘柄選択要因

個別銘柄ごとの寄与度分析

マザーファンドの資金動向要因 等

- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に対して報告されており、客観的なチェックが行われています。

②住信 国内債券インデックス マザーファンド

- ・リスクモデルを活用し、各種要因ごとにリスク管理を行います。

〔項目〕 推定トラッキングエラー

デュレーション※

期間構造

債券種別等の乖離確認

※「デュレーション」とは、債券価格の金利変動に対する感応度で、この値が大きいほど金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

- ・パフォーマンスの要因分析を行います。

〔項目〕 トラッキングエラー実績値
 ポートフォリオ要因
 評価格差要因
 マザーファンドの資金動向要因 等

- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に対して報告されており、客観的なチェックが行われています。

③住信 外国株式インデックス マザーファンド

- ・リスクモデルを活用し、各種要因ごとにリスク管理を行います。

〔項目〕 推定トラッキングエラー
 リスクインデックス
 セクター
 国
 通貨
 システマティックリスク要因

- ・パフォーマンスの要因分析を行います。

〔項目〕 トラッキングエラー実績値
 為替評価日格差要因
 マザーファンドの資金動向要因 等

- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に対して報告されており、客観的なチェックが行われています。

④住信 外国債券インデックス マザーファンド

- ・リスクモデルを活用し、各種要因ごとにリスク管理を行います。

〔項目〕 推定トラッキングエラー
 通貨
 期間構造
 銘柄特有要因

- ・パフォーマンスの要因分析を行います。

〔項目〕 トラッキングエラー実績値
 為替評価日格差要因
 マザーファンドの資金動向要因 等

- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に対して報告されており、客観的なチェックが行われています。

（ロ）リスク管理体制

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

実質的な運用を行う各マザー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あり、そのベビーファンドである本ファンドも同様のリスク管理体制となっております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率0.1995% (税抜 [※] 0.19%)	純資産総額に対して 年率0.1050% (税抜 [※] 0.10%)	純資産総額に対して 年率0.0630% (税抜 [※] 0.06%)	純資産総額に対して 年率0.0315% (税抜 [※] 0.03%)

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

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

(4)【その他の手数料等】

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

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドです。税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、下記の内容が変更されることがあります。

確定拠出年金制度に係る掛け金、積立金および給付は、所得税、法人税、相続税ならびに道府県民税（都民税を含む）、市町村民税（特別区民税を含む）の課税について、必要な措置を講ずる（確定拠出年金法第86条）とされており、運用段階においては非課税となっております。したがって、確定拠出年金制度に係る本ファンドの期中収益分配金、ご解約による収益の分配、償還による収益の分配のいずれも非課税となります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

すみしん DCマイセレクションS50

(平成21年10月30日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
住信 国内株式インデックス マザーファンド	日本	597,883,212	33.67
住信 国内債券インデックス マザーファンド	日本	684,681,789	38.56
住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	285,070,315	16.05
住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	85,317,871	4.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		122,783,819	6.91
合計(純資産総額)		1,775,737,006	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。

(参考情報)

「すみしん DCマイセレクションS50」は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」を主要投資対象にしており、マザーファンドの平成21年10月30日現在の投資状況は以下のとおりです。

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	125,911,054,690	95.46
新株予約権証券	日本	2,079,000	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,988,263,953	4.54
合計(純資産総額)		131,901,397,643	100.00

(注)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	110,034,676,100	73.67
地方債証券	日本	9,560,416,478	6.40
特殊債券	日本	17,092,262,427	11.44
社債券	日本	10,771,933,540	7.21
	アメリカ	779,137,000	0.52
	フランス	200,692,000	0.13
	オーストラリア	103,369,000	0.07
	オランダ	103,071,000	0.07
	韓国	100,745,000	0.07
	小計	12,058,947,540	8.07

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	625,324,231	0.42
合計(純資産総額)	149,371,626,776	100.00

(注)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	58,026,450,425	48.60
	イギリス	11,632,712,253	9.74
	フランス	6,158,839,938	5.16
	カナダ	5,745,426,489	4.81
	スイス	5,328,473,010	4.46
	ドイツ	4,926,790,500	4.13
	オーストラリア	4,731,285,209	3.96
	スペイン	2,965,928,825	2.48
	オランダ	2,833,252,702	2.37
	イタリア	2,189,411,654	1.83
	スウェーデン	1,619,318,513	1.36
	香港	1,190,195,886	1.00
	シンガポール	778,979,705	0.65
	フィンランド	683,029,106	0.57
	ベルギー	670,156,360	0.56
	バミューダ	614,686,948	0.51
	アイルランド	549,734,790	0.46
	デンマーク	521,218,771	0.44
	アンティル	478,522,271	0.40
	ノルウェー	426,701,798	0.36
	ギリシャ	341,259,870	0.29
	ルクセンブルグ	305,706,933	0.26
	ポルトガル	223,588,771	0.19
	オーストリア	192,120,780	0.16
	ケイマン島	88,789,840	0.07
	ジャージー	66,419,846	0.06
	キプロス	51,065,560	0.04
	ニュージーランド	39,778,435	0.03
	パナマ	25,766,676	0.02
	モーリシャス	23,559,708	0.02
	リベリア	11,289,827	0.01
	小計	113,440,461,399	95.00

新株予約権証券	イタリア	436,451	0.00
投資信託受益証券	カナダ	111,340,255	0.09
	パナマ	102,258,877	0.09
	小計	213,599,132	0.18
投資証券	アメリカ	823,316,147	0.69
	オーストラリア	274,677,546	0.23
	イギリス	166,667,192	0.14
	フランス	133,434,036	0.11
	カナダ	31,313,288	0.03
	香港	25,560,334	0.02
	小計	1,454,968,543	1.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,296,835,281	3.60
合計(純資産総額)		119,406,300,806	100.00

(注)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	93,797,299,291	31.08
	イタリア	37,024,011,286	12.27
	ドイツ	33,385,417,797	11.06
	フランス	31,135,381,967	10.32
	イギリス	23,751,120,359	7.87
	スペイン	14,251,934,114	4.72
	ベルギー	9,526,935,437	3.16
	ギリシャ	8,096,368,140	2.68
	オランダ	8,006,061,160	2.65
	カナダ	7,911,795,359	2.62
	オーストリア	5,906,518,764	1.96
	ポルトガル	3,663,942,776	1.21
	アイルランド	2,904,905,777	0.96
	デンマーク	2,897,337,990	0.96
	ポーランド	2,738,363,780	0.91
	スウェーデン	2,157,003,436	0.71
	フィンランド	1,865,645,276	0.62
	マレーシア	1,579,150,021	0.52
	シンガポール	1,140,053,219	0.38
	ノルウェー	932,579,163	0.31
	小計	292,671,825,112	96.98

特殊債券	オーストラリア	2,126,293,077	0.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,981,673,931	2.31
合計(純資産総額)		301,779,792,120	100.00

(注)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】(平成21年10月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	住信 国内債券インデックス マザーファンド	587,457,563	1.1703	687,507,025	1.1655	684,681,789	38.56
日本	親投資信託 受益証券	住信 国内株式インデックス マザーファンド	891,431,657	0.6812	607,270,924	0.6707	597,883,212	33.67
日本	親投資信託 受益証券	住信 外国株式インデックス マザーファンド	323,392,303	0.8639	279,388,469	0.8815	285,070,315	16.05
日本	親投資信託 受益証券	住信 外国債券インデックス マザーファンド	44,057,770	1.8966	83,563,410	1.9365	85,317,871	4.80

(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(%)
親投資信託受益証券	93.09
合計	93.09

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

「すみしん DCマイセレクションS50」は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」を主要投資対象にしており、マザーファンドの平成21年10月30日現在の投資資産は以下のとおりです。

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,474,600	3,794.34	5,595,138,000	3,660.00	5,397,036,000	4.09
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,642,300	590.82	3,924,432,400	495.00	3,287,938,500	2.49
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	915,500	2,750.00	2,517,625,000	2,880.00	2,636,640,000	2.00
日本	株式	キヤノン	電気機器	665,500	3,170.86	2,110,213,000	3,530.00	2,349,215,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	580,300	3,736.06	2,168,037,703	3,160.00	1,833,748,000	1.39
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,198,000	214.72	1,975,073,684	183.00	1,683,234,000	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	446,400	3,960.00	1,767,744,000	3,750.00	1,674,000,000	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	846,300	1,806.18	1,528,576,700	1,977.00	1,673,135,100	1.27
日本	株式	ソニー	電気機器	572,800	2,496.46	1,429,974,500	2,785.00	1,595,248,000	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	422,100	3,754.36	1,584,717,000	3,650.00	1,540,665,000	1.17
日本	株式	東京電力	電気・ガス業	675,000	2,390.00	1,613,250,000	2,225.00	1,501,875,000	1.14
日本	株式	任天堂	その他製品	60,600	25,684.48	1,556,480,000	23,180.00	1,404,708,000	1.06
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,049,100	1,368.00	1,435,168,800	1,292.00	1,355,437,200	1.03
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,053,100	688.24	1,413,032,650	655.00	1,344,780,500	1.02
日本	株式	東芝	電気機器	2,416,000	376.08	908,621,000	530.00	1,280,480,000	0.97
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,399	142,500.00	1,339,357,500	131,900.00	1,239,728,100	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	199,600	5,680.00	1,133,728,000	5,810.00	1,159,676,000	0.88
日本	株式	三井物産	卸売業	912,700	1,215.98	1,109,827,800	1,223.00	1,116,232,100	0.85
日本	株式	新日本製鐵	鉄鋼	3,154,000	362.30	1,142,700,000	353.00	1,113,362,000	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	743,000	1,563.71	1,161,842,000	1,404.00	1,043,172,000	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	430,100	2,795.00	1,202,129,500	2,385.00	1,025,788,500	0.78
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	463,200	1,759.19	814,857,500	2,175.00	1,007,460,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	452,300	2,279.71	1,031,115,500	2,005.00	906,861,500	0.69
日本	株式	小松製作所	機械	498,300	1,385.00	690,145,500	1,818.00	905,909,400	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	184,800	4,980.00	920,304,000	4,890.00	903,672,000	0.69
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,288,900	571.00	735,961,900	672.00	866,140,800	0.66
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	442,300	2,070.00	915,561,000	1,957.00	865,581,100	0.66
日本	株式	ファナック	電気機器	111,000	7,661.97	850,479,000	7,710.00	855,810,000	0.65
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,758	496,832.76	873,432,000	484,000.00	850,872,000	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	237,500	3,230.00	767,125,000	3,370.00	800,375,000	0.61

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	95.46
新株予約権証券	0.00
合計	95.46

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.44
		建設業	1.92
		食料品	3.26
		繊維製品	0.88
		パルプ・紙	0.38
		化学	5.51
		医薬品	4.14
		石油・石炭製品	0.69
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	1.13
		鉄鋼	2.51
		非鉄金属	1.20
		金属製品	0.65
		機械	4.40
		電気機器	13.78
		輸送用機器	9.74
		精密機器	1.48
		その他製品	2.16
		電気・ガス業	4.78
		陸運業	3.75
		海運業	0.48
		空運業	0.43
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	5.33
		卸売業	4.64
		小売業	3.46
		銀行業	9.14
		証券、商品先物取引業	1.82
		保険業	2.01
		その他金融業	0.63
		不動産業	2.30
		サービス業	1.55
合計			95.46

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 ／ 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	686	6,367,496,680	6,132,840,000	6,132,840,000	4.65

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

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第284回利付国債 (10年)	1,970,000,000	103.68	2,042,574,200	104.68	2,062,373,300	1.7	2016/12/20	1.38
日本	国債 証券	第288回利付国債 (10年)	1,900,000,000	102.76	1,952,535,000	104.27	1,981,168,000	1.7	2017/09/20	1.33
日本	国債 証券	第60回利付国債 (5年)	1,870,000,000	101.83	1,904,405,500	101.77	1,903,117,700	1.2	2011/09/20	1.27
日本	国債 証券	第296回利付国債 (10年)	1,830,000,000	100.40	1,837,484,700	101.87	1,864,294,200	1.5	2018/09/20	1.25
日本	国債 証券	第84回利付国債 (5年)	1,810,000,000	100.31	1,815,621,800	100.29	1,815,267,100	0.7	2014/06/20	1.22
日本	国債 証券	第289回利付国債 (10年)	1,600,000,000	100.99	1,615,932,500	102.56	1,640,992,000	1.5	2017/12/20	1.10
日本	国債 証券	第81回利付国債 (5年)	1,590,000,000	100.42	1,596,792,700	100.87	1,603,880,700	0.8	2014/03/20	1.07
日本	国債 証券	第269回利付国債 (10年)	1,510,000,000	102.00	1,540,297,900	102.94	1,554,469,500	1.3	2015/03/20	1.04
日本	国債 証券	第285回利付国債 (10年)	1,470,000,000	103.24	1,517,715,400	104.58	1,537,458,300	1.7	2017/03/20	1.03
日本	国債 証券	第235回利付国債 (10年)	1,410,000,000	102.47	1,444,829,400	102.38	1,443,628,500	1.4	2011/12/20	0.97
日本	国債 証券	第69回利付国債 (5年)	1,410,000,000	101.04	1,424,692,200	101.55	1,431,967,800	0.9	2012/12/20	0.96
日本	国債 証券	第237回利付国債 (10年)	1,290,000,000	102.90	1,327,536,900	102.82	1,326,416,700	1.5	2012/03/20	0.89
日本	国債 証券	第225回利付国債 (10年)	1,290,000,000	102.44	1,321,599,500	101.91	1,314,716,400	1.9	2010/12/20	0.88
日本	国債 証券	第264回利付国債 (10年)	1,260,000,000	103.16	1,299,866,400	103.99	1,310,286,600	1.5	2014/09/20	0.88
日本	国債 証券	第256回利付国債 (10年)	1,240,000,000	102.79	1,274,596,000	103.42	1,282,494,800	1.4	2013/12/20	0.86

日本	国債証券	第259回利付国債（10年）	1,230,000,000	103.20	1,269,458,400	103.89	1,277,945,400	1.5	2014/03/20	0.86
日本	国債証券	第66回利付国債（5年）	1,240,000,000	101.78	1,262,084,400	102.10	1,266,089,600	1.1	2012/09/20	0.85
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	1,220,000,000	102.47	1,250,254,800	102.91	1,255,514,200	1.3	2015/06/20	0.84
日本	国債証券	第273回利付国債（10年）	1,150,000,000	103.49	1,190,246,300	103.98	1,195,827,500	1.5	2015/09/20	0.80
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	1,170,000,000	101.53	1,187,912,800	101.14	1,183,431,600	1.5	2019/06/20	0.79
日本	国債証券	第52回利付国債（5年）	1,160,000,000	100.83	1,169,628,000	100.68	1,167,922,800	0.8	2010/12/20	0.78
日本	国債証券	第298回利付国債（10年）	1,160,000,000	98.98	1,148,222,500	99.91	1,159,048,800	1.3	2018/12/20	0.78
日本	国債証券	第71回利付国債（5年）	1,120,000,000	102.48	1,147,878,400	102.88	1,152,356,800	1.3	2013/03/20	0.77
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	1,090,000,000	103.90	1,132,513,700	105.18	1,146,472,900	1.8	2017/06/20	0.77
日本	国債証券	第70回利付国債（5年）	1,100,000,000	100.59	1,106,512,000	101.22	1,113,519,000	0.8	2013/03/20	0.75
日本	国債証券	第80回利付国債（5年）	1,100,000,000	100.10	1,101,199,000	100.98	1,110,857,000	0.8	2013/12/20	0.74
日本	国債証券	第61回利付国債（5年）	1,070,000,000	101.94	1,090,786,700	101.96	1,091,004,100	1.2	2011/12/20	0.73
日本	国債証券	第229回利付国債（10年）	1,040,000,000	101.91	1,059,907,600	101.61	1,056,785,600	1.4	2011/03/21	0.71
日本	国債証券	第234回利付国債（10年）	980,000,000	102.29	1,002,449,400	102.13	1,000,923,000	1.4	2011/09/20	0.67
日本	国債証券	第300回利付国債（10年）	980,000,000	101.37	993,466,500	101.41	993,876,800	1.5	2019/03/20	0.67

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	73.67
地方債証券	6.40
特殊債券	11.44
社債券	8.07
合計	99.58

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	326,730	6,330.39	2,068,328,716	6,762.90	2,209,643,101	1.85
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	537,011	1,869.94	1,004,182,645	2,580.43	1,385,722,946	1.16
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,163,999	825.12	960,450,494	1,031.18	1,200,298,773	1.01
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,235,893	769.11	950,540,137	887.96	1,097,424,783	0.92
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	59,917	12,350.80	740,022,931	17,954.24	1,075,764,437	0.90
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	190,953	4,808.82	918,260,438	5,444.33	1,039,612,597	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	251,327	3,351.27	842,266,143	4,055.36	1,019,222,468	0.85
スイス	株式	NESTLE SA — REGISTERED	食品・飲料・タバコ	233,079	3,527.56	822,202,021	4,310.27	1,004,634,633	0.84
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	88,641	9,572.85	848,547,315	11,235.23	995,902,270	0.83
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	177,923	4,986.22	887,163,790	5,473.59	973,879,048	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	715,527	1,206.09	862,992,535	1,359.71	972,911,220	0.81
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	132,440	6,017.66	796,979,738	7,127.74	943,998,945	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	388,592	2,252.16	875,174,156	2,398.47	932,026,720	0.78
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	530,755	1,293.87	686,731,156	1,604.77	851,740,762	0.71
スペイン	株式	BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	銀行	544,793	1,018.35	554,793,220	1,539.05	838,469,114	0.70
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	387,052	1,692.55	655,106,565	2,150.66	832,420,660	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	575,232	1,052.47	605,416,954	1,438.35	827,385,637	0.69
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,961	37,542.52	599,216,174	50,388.01	804,243,059	0.67
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	138,723	5,433.49	753,750,310	5,695.19	790,055,229	0.66
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	289,480	2,264.96	655,663,168	2,612.44	756,249,362	0.63
スペイン	株式	TELEFONICA	電気通信サービス	290,030	2,070.61	600,539,598	2,602.16	754,705,624	0.63
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,530,539	177.13	625,392,617	210.37	742,720,548	0.62
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	233,761	2,847.47	665,628,369	3,107.78	726,477,994	0.61

アメリカ	株式	HEWLETT-PACKARD CO	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	159,125	3,172.96	504,898,533	4,421.12	703,511,356	0.59
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	152,121	4,530.85	689,237,737	4,608.57	701,061,189	0.59
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	46,766	12,916.46	604,051,355	14,828.35	693,462,709	0.58
オランダ	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	241,740	2,490.52	602,060,722	2,809.98	679,285,532	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	136,299	4,288.53	584,523,168	4,945.98	674,133,436	0.56
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	139,298	3,850.70	536,395,365	4,793.18	667,680,944	0.56
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	377,438	1,437.43	542,543,270	1,757.47	663,338,528	0.56

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	95.00
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.18
投資証券	1.22
合計	96.40

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	11.93
		素材	6.54
		資本財	6.87
		商業・専門サービス	0.66
		運輸	1.66
		自動車・自動車部品	0.99
		耐久消費財・アパレル	1.09
		消費者サービス	1.20
		メディア	2.21
		小売	2.30
		食品・生活必需品小売り	2.47
		食品・飲料・タバコ	6.07
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	2.72
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.24

	銀行	9.20
	各種金融	5.79
	保険	3.96
	不動産	0.59
	ソフトウェア・サービス	4.42
	テクノロジー・ハードウェア および機器	5.14
	電気通信サービス	4.39
	公益事業	4.35
	半導体・半導体製造装置	1.43
合計		95.00

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の 種類	資産の名称	取引所	買建 ／ 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引 所	買建	アメリカドル	95	25,248,085	25,213,000	2,305,476,720	1.93
	FTSE 100	ロンドン国際金 融先物オプション 取引所	買建	イギリスポンド	61	3,117,940	3,119,235	472,252,179	0.40
	S&P/TSE 60	モントリオール 取引所	買建	カナダドル	28	3,739,606	3,670,800	314,183,772	0.26
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取 引所	買建	オーストラリアドル	30	3,452,115	3,420,750	286,316,775	0.24
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ ドイツ金融先物 取引所	買建	ユーロ	181	5,117,365.5	5,095,150	690,902,340	0.58
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ チューリッヒ取 引所	買建	スイスフラン	38	2,416,444	2,414,900	216,761,424	0.18

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

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
------	----	-----	----	-------------------	-------------------	------------------	------------------	-----------	------	-----------------

アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	24,600,000	8,883.68	2,185,387,425	8,869.68	2,181,941,280	3.125	2019/05/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/12	22,000,000	9,207.57	2,025,667,462	9,228.29	2,030,225,175	1.750	2012/08/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/11	20,300,000	9,136.85	1,854,781,818	9,174.00	1,862,322,760	0.875	2011/04/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.875% 01/31/13	19,000,000	9,495.47	1,804,139,775	9,501.18	1,805,225,625	2.875	2013/01/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.125% 06/30/11	19,500,000	9,144.71	1,783,219,303	9,201.15	1,794,224,250	1.125	2011/06/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	18,000,000	9,889.80	1,780,165,350	9,904.09	1,782,737,100	4.250	2015/08/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/11	19,000,000	9,155.43	1,739,531,700	9,182.57	1,744,689,487	0.875	2011/01/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/18	18,500,000	9,238.29	1,709,085,037	9,348.31	1,729,437,580	3.750	2018/11/15	0.57
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/13	11,000,000	14,110.08	1,552,109,550	14,409.12	1,585,003,992	4.250	2013/08/01	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 05/31/14	17,000,000	9,043.98	1,537,477,875	9,135.42	1,553,022,675	2.250	2014/05/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.0% 02/15/15	15,800,000	9,759.79	1,542,047,017	9,809.79	1,549,948,005	4.000	2015/02/15	0.51
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	10,800,000	13,845.78	1,495,344,770	14,339.15	1,548,629,020	4.250	2019/04/25	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	9,780,000	14,631.24	1,430,935,272	15,570.13	1,522,759,144	6.000	2031/05/01	0.50
イタリア	国債証券	BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000	14,394.36	1,482,619,117	14,590.83	1,502,855,613	4.750	2013/02/01	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/11	16,000,000	9,148.28	1,463,725,800	9,179.71	1,468,755,000	0.875	2011/02/28	0.49
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	10,700,000	12,984.15	1,389,304,142	13,530.98	1,447,815,031	3.750	2021/04/25	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.375% 06/30/13	15,000,000	9,638.34	1,445,752,125	9,635.49	1,445,323,500	3.375	2013/06/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.0% 08/15/18	15,000,000	9,441.18	1,416,177,000	9,538.33	1,430,750,250	4.000	2018/08/15	0.47
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 03/07/13	8,800,000	16,140.81	1,420,391,651	16,223.64	1,427,680,804	4.500	2013/03/07	0.47
ドイツ	国債証券	DBR 5.0% 07/04/12	9,660,000	14,744.29	1,424,298,868	14,694.70	1,419,508,097	5.000	2012/07/04	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	15,500,000	9,176.86	1,422,413,494	9,142.57	1,417,098,543	2.375	2014/08/31	0.47
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	8,500,000	15,454.95	1,313,671,094	16,430.38	1,396,582,368	6.500	2027/11/01	0.46
イギリス	国債証券	UKT 5% 03/07/12	8,400,000	16,379.78	1,375,901,723	16,305.65	1,369,675,345	5.000	2012/03/07	0.45
ドイツ	国債証券	DBR 5.0% 01/04/12	9,280,000	14,664.31	1,360,848,231	14,561.27	1,351,285,893	5.000	2012/01/04	0.45
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 01/04/14	9,200,000	14,485.50	1,332,666,358	14,575.37	1,340,934,297	4.250	2014/01/04	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000	13,453.29	1,291,516,125	13,956.76	1,339,849,497	3.750	2016/08/01	0.44

ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000	14,508.21	1,327,501,845	14,603.98	1,336,264,572	4.250	2014/07/04	0.44
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/11	14,500,000	9,147.57	1,326,397,921	9,158.28	1,327,951,687	1.000	2011/09/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.5% 09/30/11	13,500,000	9,846.94	1,329,337,575	9,766.93	1,318,536,225	4.500	2011/09/30	0.44
フランス	国債証券	FRTR 4.75% 10/25/12	9,000,000	14,617.50	1,315,575,486	14,649.27	1,318,434,732	4.750	2012/10/25	0.44

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.98
特殊債券	0.70
合計	97.69

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1期計算期間末 (平成19年10月 1日)	(分配付)	203,671,394	(分配付)	1.0403
	(分配落)	203,671,394	(分配落)	1.0403
第2期計算期間末 (平成20年 9月30日)	(分配付)	818,223,908	(分配付)	0.8701
	(分配落)	818,223,908	(分配落)	0.8701
第3期計算期間末 (平成21年 9月30日)	(分配付)	1,643,020,812	(分配付)	0.8271
	(分配落)	1,643,020,812	(分配落)	0.8271
平成20年10月末日		858,879,404		0.7746
11月末日		837,467,598		0.7571
12月末日		918,728,620		0.7680
平成21年 1月末日		1,010,978,672		0.7351
2月末日		998,083,531		0.7254
3月末日		1,091,269,684		0.7411
4月末日		1,209,477,737		0.7747
5月末日		1,320,835,759		0.8014

6月末日	1,416,279,040	0.8165
7月末日	1,583,253,997	0.8311
8月末日	1,599,988,924	0.8404
9月末日	1,643,020,812	0.8271
10月末日	1,775,737,006	0.8243

②【分配の推移】

期 間	1口当たりの分配金(円)
第1期計算期間（平成18年10月30日～平成19年10月 1日）	0.0000
第2期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	0.0000
第3期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	0.0000

③【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間（平成18年10月30日～平成19年10月 1日）	4.0
第2期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	△16.4
第3期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	△4.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

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

平成18年10月30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】

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。

1)申込手続

- (イ) 本ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドです。したがって、受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法第8条第1項に規定される事業主が締結する下記に掲げる契約にもとづいて受益権の取得申込みを企図する当該契約の相手方および同法第55条に規定される規約にもとづいて受益権の取得申込みを企図する同法第2条第5項に定める連合会（同法第61条にもとづき連合会が事務を委託した者を含みます。）に対してのみ行われます。
 - 1. 信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金または企業年金基金を相手方とする運用の方法を特定する信託の契約
 - 2. 生命保険会社を相手方とする生命保険の契約
 - 3. 農業協同組合連合会を相手方とする生命共済の契約
 - 4. 損害保険会社を相手方とする損害保険の契約
- (ロ) 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。
- (ハ) 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営業所等で受け付けます。
- (ニ) 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。
- (ホ) 本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
- (ヘ) 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。
- (ト) 本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、分配金自動けいぞく投資に関する契約を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金自動けいぞく投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、こ

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

- （チ）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

1円以上1円単位

3) 申込手数料

ありません。

2【換金（解約）手続等】

1) 受益権の買取請求

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

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は、振替受益権をもって行うものとします。

- （イ）受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時（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。
- （ロ）受益者が前記（イ）のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、受益権をもって行うものとします。
- （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営業日の基準価額（解約価額）とします。信託財産留保金の控除はありません。
- （ホ）確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドに係る期中収益分配金、ご解約による収益の分配、償還による収益の分配のいずれも非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。
- （ヘ）解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。
- （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ま

たは運営管理機関等にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

＜お問い合わせ先＞

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.sumishinam.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-417434

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時（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】

1)基準価額の算出方法

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

[主要な投資対象の評価方法]

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

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

1.日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

2.価格情報会社の提供する価額

3.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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

2)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。

3)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、指定販売会社および運営管理機関等で入手できます。

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または運営管理機関等にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

＜お問い合わせ先＞

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.sumishinam.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-417434

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時（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「マイ S 50」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18年10月30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】

本ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。（第1計算期間は平成18年10月30日から平成19年10月1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5億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、前記(a)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) 前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (d) 前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託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、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(c)前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(d)前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。

(e)委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

※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、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

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、指定販売会社の営業所等において行われます。

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

3) 解約請求権

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

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い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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成19年10月2日から平成20年9月30日まで）及び第3期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

すみしん DCマイセレクションS50

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成20年9月30日現在)	第3期 (平成21年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,722,270	79,939,624
親投資信託受益証券	776,338,299	1,564,573,720
未収入金	70,000	50,000
未収利息	507	174
流動資産合計	819,131,076	1,644,563,518
資産合計	819,131,076	1,644,563,518
負債の部		
流動負債		
未払解約金	165,227	43,395
未払受託者報酬	112,677	226,959
未払委託者報酬	600,901	1,210,390
その他未払費用	28,363	61,962
流動負債合計	907,168	1,542,706
負債合計	907,168	1,542,706
純資産の部		
元本等		
元本	940,386,086	1,986,490,860
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△122,162,178	△343,470,048
元本等合計	818,223,908	1,643,020,812
純資産合計	818,223,908	1,643,020,812
負債純資産合計	819,131,076	1,644,563,518

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自 平成19年10月 2 日 至 平成20年 9 月30日)	第3期 (自 平成20年10月 1 日 至 平成21年 9 月30日)
営業収益		
受取利息	132,944	71,369
有価証券売買等損益	△107,301,640	8,015,421
営業収益合計	△107,168,696	8,086,790
営業費用		
受託者報酬	170,982	372,513
委託者報酬	911,788	1,986,605
その他費用	28,363	61,962
営業費用合計	1,111,133	2,421,080
営業利益又は営業損失（△）	△108,279,829	5,665,710
経常利益又は経常損失（△）	△108,279,829	5,665,710
当期純利益又は当期純損失（△）	△108,279,829	5,665,710
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（△）	△409,599	△1,640,889
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,888,505	△122,162,178
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	4,274,848
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	4,274,848
剰余金減少額又は欠損金増加額	22,180,453	232,889,317
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	45,278	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	22,135,175	232,889,317
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△122,162,178	△343,470,048

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 2 期 (自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	第 3 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第 2 期 (平成20年9月30日現在)	第 3 期 (平成21年9月30日現在)
1.期首元本額	195,782,889円	940,386,086円
期中追加設定元本額	752,993,459円	1,072,967,920円
期中一部解約元本額	8,390,262円	26,863,146円
期末元本額	940,386,086円	1,986,490,860円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を122,162,178円下回っております。	純資産額は、元本を343,470,048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	940,386,086口	1,986,490,860口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 2 期 (自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	第 3 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
分配金の 計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(0円)、経費控除後繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(24,932円)及び分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は24,932円(1万口当たり0円26銭)であります。分配は見送りとさせていただきます。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(53,695円)、経費控除後繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(52,661円)及び分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は106,356円(1万口当たり0円53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)

第2期(平成20年9月30日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	776,338,299	△105,829,907
合 計	776,338,299	△105,829,907

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

第3期（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,564,573,720	24,246,087
合 計	1,564,573,720	24,246,087

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

（デリバティブ取引に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

第 2 期 (自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	第 3 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
該当事項はありません。	同左

II 取引の時価等に関する事項

第 2 期 (平成20年9月30日現在)	第 3 期 (平成21年9月30日現在)
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第 2 期 (自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	第 3 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

第 2 期 (平成20年9月30日現在)	第 3 期 (平成21年9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 0.8701円	1口当たり純資産額 = 0.8271円

(4) 【附属明細表】（平成21年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②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	838,850,754	572,180,099
	住信 外国株式インデックス マザーファンド	308,351,845	266,508,499
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	553,094,423	647,341,712
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	41,412,744	78,543,410
合計		1,741,709,766	1,564,573,720

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](#)

（参考）

「すみしん DCマイセレクションS50」は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」を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、すべてこれらマザーファンドの受益証券です。

これらマザーファンドの状況は次の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（平成20年 9月30日現在）	（平成21年 9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,109,359,629	3,814,385,289
株式	123,486,006,840	125,893,906,760
新株予約権証券	—	2,079,000
派生商品評価勘定	—	1,371,520
未収入金	12,694,600	3,316,000
未収配当金	1,100,042,160	877,773,776
未収利息	84,418	8,306
前払金	242,724,000	184,034,000
差入委託証拠金	405,540,000	190,800,000
流動資産合計	132,356,451,647	130,967,674,651
資産合計	132,356,451,647	130,967,674,651
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	618,334,880	153,459,400
未払金	29,516,000	33,356,000
未払解約金	44,503,865	32,920,515
流動負債合計	692,354,745	219,735,915
負債合計	692,354,745	219,735,915
純資産の部		
元本等		
元本	164,766,241,169	191,683,384,340
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△33,102,144,267	△60,935,445,604
元本等合計	131,664,096,902	130,747,938,736
純資産合計	131,664,096,902	130,747,938,736

負債純資産合計	132,356,451,647	130,967,674,651
---------	-----------------	-----------------

（注）「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセクションS50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成20年9月30日及び平成21年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
1.資産の評価基準及び評価方法	（1）株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、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。 — （2）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	（1）株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 （2）新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 （3）先物取引 同左
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

	（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
1.期首元本額	127,378,550,728円	164,766,241,169円
期中追加設定元本額	51,665,220,388円	70,240,878,133円
期中一部解約元本額	14,277,529,947円	43,323,734,962円
期末元本額	164,766,241,169円	191,683,384,340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）	12,676,791,431円	11,945,936,467円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	249,481,641円	481,710,451円
SBI資産設計オープン（分配型）	45,217,439円	48,432,597円

STAM TOPIXインデックス・オープン	658,123,573円	3,231,633,352円
世界経済インデックスファンド	—	19,633,188円
住信 国内バランス30	715,836,264円	754,999,856円
住信 国内バランス60	613,367,191円	645,169,937円
すみしん マイセレクション25	179,744,350円	190,206,912円
すみしん マイセレクション50	301,529,207円	372,331,025円
すみしん マイセレクション75	276,949,806円	294,730,215円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	16,891,191,813円	20,724,756,220円
すみしん DCマイセレクション25	2,531,121,998円	3,376,759,532円
すみしん DCマイセレクション50	9,177,259,715円	12,211,968,349円
すみしん DCマイセレクション75	8,327,031,872円	10,702,542,588円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	1,613,198,301円	2,337,326,895円
すみしん DCマイセレクションS25	58,386,139円	147,719,835円
すみしん DCマイセレクションS50	357,761,140円	838,850,754円
すみしん DCマイセレクションS75	284,354,893円	655,093,582円
すみしん DC日本株式インデックス・オープンS	147,576,451円	366,430,165円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	11,213,519円	19,435,593円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,841,753円	24,415,161円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,300,670円	18,600,963円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	804,061円	5,639,585円
STAM 日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	649,705,705円	1,739,631,736円
住信 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	486,128,845円	537,738,752円
すみしん マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	942,169,963円	991,368,592円
すみしん マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	435,079,439円	435,819,849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）	4,386,251,160円	4,048,646,235円
住信 国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）	17,057,250円	20,295,697円
住信 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	77,016,635円	85,515,345円
すみしん マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	9,632,632円	7,713,517円
すみしん バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,914,165,324円	2,129,727,830円
すみしん バランス50VA1（適格機関投資家専用）	7,358,273,178円	7,685,348,149円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	19,992,954,677円	20,585,340,402円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	5,934,427,383円	5,975,553,194円
すみしん バランスA(25)VA1（適格機関投資家専用）	10,845,771,631円	12,611,834,078円
すみしん バランスB(37.5)VA1（適格機関投資家専用）	2,051,421,234円	2,626,913,809円
すみしん バランスC(50)VA1（適格機関投資家専用）	12,122,374,478円	14,718,719,960円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,430,241,558円	5,656,303,453円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,642,967,023円	4,416,235,343円
すみしん バランスD(35)VA1（適格機関投資家専用）	1,552,667,981円	3,649,862,393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）	3,875,353,748円	5,771,112,326円
すみしん バランスE(25)VA1（適格機関投資家専用）	—	1,165,627,478円
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）	19,324,408,737円	23,904,324,522円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,596,089,361円	2,628,151,748円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	—	877,276,710円

2.元本の欠損	純資産額は、元本を 33,102,144,267円下回っておりま す。	純資産額は、元本を 60,935,445,604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	164,766,241,169口	191,683,384,340口

（有価証券に関する注記）

（平成20年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	123,486,006,840	△32,196,534,985
合 計	123,486,006,840	△32,196,534,985

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

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
1.取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 デリバティブ取引には、市場リスクがあります。当ファンドが利用するデリバティブ取引は、約款に基づき、取引所取引のみであり、信用リスクはないものと考えられます。なお、デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。	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 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 同左

3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左
---	-------------------------------

II取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	(平成20年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	TOPIX株価指数先物	8,774,084,000	—	8,155,860,000	△618,224,000
合 計		8,774,084,000	—	8,155,860,000	△618,224,000

区分	種 類	(平成21年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	TOPIX先物	5,020,519,000	—	4,868,500,000	△152,019,000
合 計		5,020,519,000	—	4,868,500,000	△152,019,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

- 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19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

(平成20年9月30日現在)	(平成21年9月30日現在)
----------------	----------------

1口当たり純資産額 = 0.7991円	1口当たり純資産額 = 0.6821円
---------------------	---------------------

(3) 附属明細表（平成21年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

① 株式

銘 柄	株数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	51,000	193.00	9,843,000	
日本水産	138,500	267.00	36,979,500	
マルハニチロホールディングス	212,000	137.00	29,044,000	
サカタのタネ	22,000	1,371.00	30,162,000	
ホクト	11,100	2,075.00	23,032,500	
ショーボンドホールディングス	10,700	1,755.00	18,778,500	
住石ホールディングス	33,300	101.00	3,363,300	
日鉄鉱業	31,000	482.00	14,942,000	
三井松島産業	39,000	131.00	5,109,000	
国際石油開発帝石	550	766,000.00	421,300,000	
関東天然瓦斯開発	14,000	631.00	8,834,000	
石油資源開発	17,100	4,580.00	78,318,000	
間組	50,000	94.00	4,700,000	
東急建設	42,680	266.00	11,352,880	
コムシスホールディングス	59,000	984.00	58,056,000	
ミサワホーム	10,900	319.00	3,477,100	
高松コンストラクショングループ	9,200	1,440.00	13,248,000	
東建コーポレーション	5,760	2,920.00	16,819,200	
ヤマウラ	15,000	204.00	3,060,000	
大成建設	548,000	178.00	97,544,000	
大林組	340,000	393.00	133,620,000	
清水建設	345,000	353.00	121,785,000	
長谷工コーポレーション	590,500	88.00	51,964,000	
松井建設	20,000	346.00	6,920,000	
鹿島建設	506,000	230.00	116,380,000	
鉄建建設	57,000	77.00	4,389,000	
安藤建設	40,000	130.00	5,200,000	
太平工業	10,000	275.00	2,750,000	
三井住友建設	63,100	84.00	5,300,400	
前田建設工業	83,000	289.00	23,987,000	
奥村組	115,000	338.00	38,870,000	
東鉄工業	15,000	635.00	9,525,000	

戸田建設	134,000	317.00	42,478,000	
熊谷組	79,000	67.00	5,293,000	
青木あすなろ建設	8,000	485.00	3,880,000	
三井ホーム	22,000	519.00	11,418,000	
矢作建設工業	15,000	613.00	9,195,000	
大東建託	52,400	3,920.00	205,408,000	
N I P P O	24,000	733.00	17,592,000	
前田道路	35,000	807.00	28,245,000	
日本道路	45,000	206.00	9,270,000	
東亜建設工業	105,000	103.00	10,815,000	
五洋建設	150,000	116.00	17,400,000	
大成ロテック	28,000	133.00	3,724,000	
大林道路	21,000	175.00	3,675,000	
住友林業	83,900	755.00	63,344,500	
日本基礎技術	19,700	230.00	4,531,000	
巴コーポレーション	16,300	240.00	3,912,000	
パナホーム	46,000	548.00	25,208,000	
大和ハウス工業	303,000	940.00	284,820,000	
ライト工業	28,200	211.00	5,950,200	
積水ハウス	339,000	810.00	274,590,000	
北陸電気工事	8,000	285.00	2,280,000	
コミュニチュア	11,000	654.00	7,194,000	
ユアテック	19,000	587.00	11,153,000	
西部電気工業	13,000	404.00	5,252,000	
四電工	11,000	484.00	5,324,000	
中電工	17,500	1,482.00	25,935,000	
関電工	55,000	621.00	34,155,000	
大明	17,000	886.00	15,062,000	
きんでん	71,000	751.00	53,321,000	
東京エネシス	14,000	731.00	10,234,000	
トーエネック	17,000	556.00	9,452,000	
住友電設	11,100	461.00	5,117,100	
日本電設工業	24,000	848.00	20,352,000	
協和エクシオ	43,000	881.00	37,883,000	
新日本空調	12,400	617.00	7,650,800	
日本工営	38,000	283.00	10,754,000	
東電通	23,000	167.00	3,841,000	
日本電話施設	23,000	305.00	7,015,000	
九電工	22,000	570.00	12,540,000	
三機工業	32,000	753.00	24,096,000	
日揮	122,000	1,836.00	223,992,000	

中外炉工業	53,000	272.00	14,416,000	
ヤマト	17,000	310.00	5,270,000	
太平電業	18,000	1,089.00	19,602,000	
高砂熱学工業	38,000	779.00	29,602,000	
日立プラントテクノロジー	39,000	609.00	23,751,000	
三晃金属工業	13,000	286.00	3,718,000	
NEC ネットエスアイ	10,700	1,223.00	13,086,100	
朝日工業社	21,000	367.00	7,707,000	
アタカ大機	10,000	244.00	2,440,000	
大気社	18,400	1,206.00	22,190,400	
ダイダン	20,000	529.00	10,580,000	
日比谷総合設備	16,000	837.00	13,392,000	
東芝プラントシステム	21,000	1,196.00	25,116,000	
日本製粉	76,000	488.00	37,088,000	
日清製粉グループ本社	109,000	1,256.00	136,904,000	
日東富士製粉	10,000	313.00	3,130,000	
昭和産業	54,000	298.00	16,092,000	
鳥越製粉	10,500	775.00	8,137,500	
協同飼料	42,000	120.00	5,040,000	
中部飼料	12,000	780.00	9,360,000	
日本配合飼料	34,000	109.00	3,706,000	
ユニ・チャーム ペットケア	6,900	3,340.00	23,046,000	
日本甜菜製糖	67,000	245.00	16,415,000	
三井製糖	47,000	317.00	14,899,000	
日本M&Aセンター	19	407,000.00	7,733,000	
アコーディア・ゴルフ	294	84,800.00	24,931,200	
パソナグループ	112	66,200.00	7,414,400	
リンクアンドモチベーション	13	47,250.00	614,250	
テンプホールディングス	13,100	814.00	10,663,400	
森永製菓	127,000	200.00	25,400,000	
中村屋	28,000	472.00	13,216,000	
江崎グリコ	43,000	999.00	42,957,000	
名糖産業	4,900	1,264.00	6,193,600	
不二家	65,000	161.00	10,465,000	
山崎製パン	88,000	1,216.00	107,008,000	
モロゾフ	18,000	305.00	5,490,000	
雪印乳業	132,000	335.00	44,220,000	
森永乳業	103,000	448.00	46,144,000	
ヤクルト本社	64,500	2,395.00	154,477,500	
明治ホールディングス	34,100	3,830.00	130,603,000	
プリマハム	71,000	108.00	7,668,000	

日本ハム	91,000	1,154.00	105,014,000	
伊藤ハム	91,000	350.00	31,850,000	
丸大食品	40,000	281.00	11,240,000	
米久	11,500	927.00	10,660,500	
S Foods	6,500	860.00	5,590,000	
学情	4,800	327.00	1,569,600	
スタジオアリス	5,200	949.00	4,934,800	
シミック	180	24,760.00	4,456,800	
システムプロ	80	44,000.00	3,520,000	
NECフィールドینگ	9,100	1,401.00	12,749,100	
新日鉄ソリューションズ	7,400	1,645.00	12,173,000	
総合警備保障	37,400	1,065.00	39,831,000	
日本駐車場開発	1,367	4,110.00	5,618,370	
コア	4,500	634.00	2,853,000	
カカクコム	86	330,000.00	28,380,000	
ルネサンス	6,000	348.00	2,088,000	
新日本科学	7,200	669.00	4,816,800	
ソネット・エムスリー	52	315,000.00	16,380,000	
ディー・エヌ・エー	146	248,000.00	36,208,000	
博報堂DYホールディングス	15,540	4,890.00	75,990,600	
ぐるなび	59	222,000.00	13,098,000	
一休	84	44,600.00	3,746,400	
ジャパンベストレスキューシステム	32	47,000.00	1,504,000	
ジェイコム	13	101,500.00	1,319,500	
パシフィックゴルフグループインターナショナル ホールディングス	297	62,800.00	18,651,600	
サッポロホールディングス	172,000	458.00	78,776,000	
アサヒビール	209,300	1,642.00	343,670,600	
麒麟ホールディングス	492,000	1,376.00	676,992,000	
宝ホールディングス	102,000	621.00	63,342,000	
オエノンホールディングス	35,000	200.00	7,000,000	
メルシャン	36,000	232.00	8,352,000	
養命酒製造	9,000	881.00	7,929,000	
三国コカ・コーラボトリング	16,100	779.00	12,541,900	
四国コカ・コーラボトリング	5,600	969.00	5,426,400	
コカ・コーラウエスト	29,600	1,757.00	52,007,200	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	13,500	1,250.00	16,875,000	
ダイドードリンコ	5,500	2,970.00	16,335,000	
伊藤園	27,400	1,662.00	45,538,800	
伊藤園(優)	6,100	977.00	5,959,700	
キーコーヒー	9,800	1,592.00	15,601,600	

ユニカフェ	2,800	1,000.00	2,800,000	
ジャパンフーズ	2,200	866.00	1,905,200	
日清オイリオグループ	52,000	488.00	25,376,000	
不二製油	32,100	1,267.00	40,670,700	
Jーオイルミルズ	46,000	304.00	13,984,000	
ローソン	33,200	4,170.00	138,444,000	
インターニックス	6,500	344.00	2,236,000	
サンエー	4,100	3,620.00	14,842,000	
麒麟堂	4,700	471.00	2,213,700	
ダイユーエイト	1,900	632.00	1,200,800	
カワチ薬品	7,500	2,055.00	15,412,500	
エービーシー・マート	11,200	2,795.00	31,304,000	
ハードオフコーポレーション	5,200	475.00	2,470,000	
高千穂交易	4,500	989.00	4,450,500	
アスクル	8,900	1,950.00	17,355,000	
ゲオ	199	87,500.00	17,412,500	
ポイント	9,530	5,940.00	56,608,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	10,000	133.00	1,330,000	
伊藤忠食品	2,600	3,180.00	8,268,000	
くらコーポレーション	33	288,700.00	9,527,100	
キャンドゥ	48	97,900.00	4,699,200	
高千穂電気	7,000	1,057.00	7,399,000	
J A L U X	3,000	1,229.00	3,687,000	
エディオン	43,000	779.00	33,497,000	
サーラコーポレーション	10,500	577.00	6,058,500	
トーマンデバイス	1,500	1,689.00	2,533,500	
バルス	59	73,100.00	4,312,900	
あみやき亭	19	154,800.00	2,941,200	
双日	657,700	171.00	112,466,700	
アルフレッサ ホールディングス	24,700	3,660.00	90,402,000	
ハニーズ	7,920	647.00	5,124,240	
キッコーマン	105,000	1,118.00	117,390,000	
味の素	327,000	899.00	293,973,000	
キューピー	62,200	1,025.00	63,755,000	
ハウス食品	44,400	1,503.00	66,733,200	
カゴメ	46,500	1,814.00	84,351,000	
焼津水産化学工業	6,100	1,160.00	7,076,000	
アリアケジャパン	9,900	1,486.00	14,711,400	
ニチレイ	135,000	355.00	47,925,000	
横浜冷凍	23,000	633.00	14,559,000	
東洋水産	48,000	2,430.00	116,640,000	

日清食品ホールディングス	38,200	3,450.00	131,790,000	
永谷園	11,000	868.00	9,548,000	
フジッコ	13,000	1,066.00	13,858,000	
ロック・フィールド	5,800	1,269.00	7,360,200	
日本たばこ産業	2,665	308,000.00	820,820,000	
わらべや日洋	6,400	1,176.00	7,526,400	
なとり	5,200	793.00	4,123,600	
片倉工業	13,800	1,044.00	14,407,200	
グンゼ	77,000	411.00	31,647,000	
昭栄	18,700	721.00	13,482,700	
神栄	13,000	129.00	1,677,000	
川島織物セルコン	41,000	77.00	3,157,000	
山下医科器械	1,300	1,340.00	1,742,000	
ラサ商事	4,700	342.00	1,607,400	
アルペン	8,100	1,637.00	13,259,700	
ビックカメラ	270	32,500.00	8,775,000	
DCM Japanホールディングス	53,400	613.00	32,734,200	
あい ホールディングス	24,900	315.00	7,843,500	
ユニバース	1,400	1,504.00	2,105,600	
J. フロント リテイリング	268,000	541.00	144,988,000	
ドトール・日レスホールディングス	15,200	1,377.00	20,930,400	
マツモトキヨシホールディングス	19,700	2,240.00	44,128,000	
ココカラファイン ホールディングス	6,200	1,969.00	12,207,800	
三越伊勢丹ホールディングス	193,900	1,031.00	199,910,900	
東洋紡績	399,000	154.00	61,446,000	
ユニチカ	254,000	80.00	20,320,000	
富士紡ホールディングス	47,000	142.00	6,674,000	
日清紡ホールディングス	80,000	955.00	76,400,000	
倉敷紡績	120,000	187.00	22,440,000	
ダイワボウホールディングス	79,000	373.00	29,467,000	
シキボウ	73,000	207.00	15,111,000	
日東紡績	110,000	177.00	19,470,000	
トヨタ紡織	37,600	1,771.00	66,589,600	
クリエイトSDホールディングス	3,800	2,070.00	7,866,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,800	527.00	7,272,600	
日本毛織	38,000	680.00	25,840,000	
ダイドーリミテッド	16,100	674.00	10,851,400	
野村不動産ホールディングス	37,300	1,459.00	54,420,700	
ヒューリック	30,100	664.00	19,986,400	
帝国繊維	12,000	520.00	6,240,000	
ブックオフコーポレーション	5,900	1,346.00	7,941,400	

日本コークス工業	68,500	103.00	7,055,500	
ミタチ産業	4,300	471.00	2,025,300	
J F E商事ホールディングス	71,000	328.00	23,288,000	
あさひ	3,600	1,735.00	6,246,000	
サークルKサンクス	25,900	1,355.00	35,094,500	
日本調剤	2,050	2,120.00	4,346,000	
コスモス薬品	4,100	2,360.00	9,676,000	
グリーンホスピタルサプライ	100	63,500.00	6,350,000	
セブン&アイ・ホールディングス	422,800	2,150.00	909,020,000	
ツルハホールディングス	7,900	3,740.00	29,546,000	
サンマルクホールディングス	3,500	2,840.00	9,940,000	
フェリシモ	3,100	1,729.00	5,359,900	
トリドール	24	197,600.00	4,742,400	
帝人	460,000	280.00	128,800,000	
東レ	747,000	544.00	406,368,000	
三菱レイヨン	280,000	308.00	86,240,000	
クラレ	166,000	980.00	162,680,000	
旭化成	701,000	457.00	320,357,000	
稲葉製作所	5,600	927.00	5,191,200	
三協・立山ホールディングス	175,000	87.00	15,225,000	
トーカロ	7,900	1,632.00	12,892,800	
アルファC o	6,800	529.00	3,597,200	
SUMCO	60,300	2,040.00	123,012,000	
住江織物	28,000	144.00	4,032,000	
日本フェルト	6,500	400.00	2,600,000	
イチカワ	9,000	199.00	1,791,000	
日本バイリーン	16,000	503.00	8,048,000	
芦森工業	36,000	145.00	5,220,000	
アツギ	105,000	121.00	12,705,000	
ダイニック	21,000	139.00	2,919,000	
共和レザー	6,700	386.00	2,586,200	
セーレン	28,100	589.00	16,550,900	
小松精練	21,000	370.00	7,770,000	
ワコールホールディングス	67,000	1,172.00	78,524,000	
ホギメディカル	5,500	5,030.00	27,665,000	
サンエー・インターナショナル	8,200	1,228.00	10,069,600	
レナウン	19,000	172.00	3,268,000	
クラウドシア	2,400	1,578.00	3,787,200	
I Tホールディングス	34,800	1,239.00	43,117,200	
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	76,000	244.00	18,544,000	

ドワンゴ	57	205,800.00	11,730,600	
ベリサーブ	10	176,100.00	1,761,000	
マクロミル	64	134,500.00	8,608,000	
ティーガイア	88	143,900.00	12,663,200	
GMOペイメントゲートウェイ	24	121,800.00	2,923,200	
ザッパラス	35	169,400.00	5,929,000	
インターネットイニシアティブ	66	209,100.00	13,800,600	
ソネットエンタテインメント	61	184,800.00	11,272,800	
S R Aホールディングス	5,900	810.00	4,779,000	
J B I Sホールディングス	13,700	359.00	4,918,300	
朝日ネット	9,000	283.00	2,547,000	
王子製紙	461,000	405.00	186,705,000	
三菱製紙	165,000	122.00	20,130,000	
北越製紙	64,500	474.00	30,573,000	
中越パルプ工業	43,000	217.00	9,331,000	
大王製紙	48,000	843.00	40,464,000	
紀州製紙	37,000	94.00	3,478,000	
日本製紙グループ本社	52,600	2,590.00	136,234,000	
レンゴー	88,000	550.00	48,400,000	
トーモク	40,000	209.00	8,360,000	
ザ・パック	7,100	1,369.00	9,719,900	
コープケミカル	15,000	168.00	2,520,000	
昭和電工	585,000	183.00	107,055,000	
住友化学	827,000	374.00	309,298,000	
日本化成	21,000	202.00	4,242,000	
住友精化	21,000	385.00	8,085,000	
日産化学工業	75,000	1,294.00	97,050,000	
ラサ工業	48,000	116.00	5,568,000	
クレハ	73,000	553.00	40,369,000	
テイカ	19,000	280.00	5,320,000	
石原産業	160,000	74.00	11,840,000	
片倉チッカリン	9,000	320.00	2,880,000	
日本曹達	67,000	379.00	25,393,000	
東ソー	302,000	227.00	68,554,000	
トクヤマ	170,000	658.00	111,860,000	
セントラル硝子	115,000	399.00	45,885,000	
東亜合成	123,000	305.00	37,515,000	
ダイソー	45,000	281.00	12,645,000	
関東電化工業	26,000	686.00	17,836,000	
電気化学工業	236,000	370.00	87,320,000	
イビデン	75,400	3,340.00	251,836,000	

信越化学工業	187,100	5,520.00	1,032,792,000	
堺化学工業	39,000	396.00	15,444,000	
エア・ウォーター	80,000	1,034.00	82,720,000	
大陽日酸	175,000	1,069.00	187,075,000	
日本化学工業	40,000	252.00	10,080,000	
日本パーカライジング	27,000	1,119.00	30,213,000	
高压ガス工業	17,000	550.00	9,350,000	
四国化成工業	16,000	553.00	8,848,000	
戸田工業	18,000	724.00	13,032,000	
ステラ ケミファ	5,400	4,960.00	26,784,000	
保土谷化学工業	28,000	249.00	6,972,000	
日本触媒	75,000	795.00	59,625,000	
大日精化工業	41,000	297.00	12,177,000	
カネカ	140,000	645.00	90,300,000	
協和発酵キリン	154,000	1,137.00	175,098,000	
三菱瓦斯化学	193,000	488.00	94,184,000	
三井化学	344,000	320.00	110,080,000	
J S R	102,300	1,840.00	188,232,000	
東京応化工業	21,700	2,020.00	43,834,000	
三菱ケミカルホールディングス	652,500	373.00	243,382,500	
日本合成化学工業	30,000	615.00	18,450,000	
ダイセル化学工業	146,000	542.00	79,132,000	
住友ベークライト	114,000	476.00	54,264,000	
積水化学工業	252,000	522.00	131,544,000	
日本ゼオン	97,000	411.00	39,867,000	
アイカ工業	35,000	959.00	33,565,000	
宇部興産	471,000	236.00	111,156,000	
積水樹脂	16,000	788.00	12,608,000	
タキロン	26,000	263.00	6,838,000	
旭有機材工業	40,000	240.00	9,600,000	
日立化成工業	48,600	1,834.00	89,132,400	
ニチバン	13,000	327.00	4,251,000	
リケンテクノス	20,000	219.00	4,380,000	
大倉工業	27,000	267.00	7,209,000	
積水化成品工業	29,000	387.00	11,223,000	
群栄化学工業	30,000	215.00	6,450,000	
タイガースポリマー	5,600	421.00	2,357,600	
日本カーリット	9,000	454.00	4,086,000	
日本化薬	79,000	795.00	62,805,000	
イーピーエス	30	373,000.00	11,190,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,400	2,380.00	5,712,000	

アミューズ	2,800	1,020.00	2,856,000	
野村総合研究所	52,500	2,135.00	112,087,500	
ドリームインキュベータ	47	60,100.00	2,824,700	
サイバネットシステム	97	37,900.00	3,676,300	
TAC	5,600	403.00	2,256,800	
電通	111,200	2,090.00	232,408,000	
インテージ	2,900	1,525.00	4,422,500	
シンプレクス・テクノロジー	189	42,750.00	8,079,750	
イオンファンタジー	3,800	1,104.00	4,195,200	
日本精化	9,300	765.00	7,114,500	
ADEKA	48,400	898.00	43,463,200	
日油	98,000	450.00	44,100,000	
ミヨシ油脂	41,000	146.00	5,986,000	
ハリマ化成	10,000	458.00	4,580,000	
花王	288,000	2,220.00	639,360,000	
第一工業製薬	19,000	272.00	5,168,000	
三洋化成工業	35,000	529.00	18,515,000	
武田薬品工業	394,600	3,740.00	1,475,804,000	
アステラス製薬	237,700	3,690.00	877,113,000	
大日本住友製薬	79,500	979.00	77,830,500	
塩野義製薬	164,000	2,125.00	348,500,000	
田辺三菱製薬	112,000	1,197.00	134,064,000	
わかもと製薬	13,000	358.00	4,654,000	
あすか製薬	12,000	870.00	10,440,000	
日本新薬	28,000	1,270.00	35,560,000	
中外製薬	111,800	1,857.00	207,612,600	
科研製薬	48,000	843.00	40,464,000	
エーザイ	138,300	3,380.00	467,454,000	
ロート製薬	51,000	1,225.00	62,475,000	
小野薬品工業	56,400	4,670.00	263,388,000	
久光製薬	34,900	3,640.00	127,036,000	
有機合成薬品工業	9,000	275.00	2,475,000	
持田製薬	46,000	950.00	43,700,000	
大正製薬	100,000	1,815.00	181,500,000	
参天製薬	34,800	3,300.00	114,840,000	
エスエス製薬	27,000	493.00	13,311,000	
扶桑薬品工業	38,000	283.00	10,754,000	
日本ケミファ	18,000	309.00	5,562,000	
ツムラ	33,000	3,240.00	106,920,000	
テルモ	77,300	4,940.00	381,862,000	
みらかホールディングス	21,400	2,930.00	62,702,000	

キッセイ薬品工業	23,000	2,300.00	52,900,000	
生化学工業	21,500	1,300.00	27,950,000	
栄研化学	7,300	1,070.00	7,811,000	
日水製薬	4,500	764.00	3,438,000	
鳥居薬品	6,700	1,714.00	11,483,800	
東和薬品	4,600	4,410.00	20,286,000	
沢井製薬	7,300	5,200.00	37,960,000	
ゼリア新薬工業	16,000	982.00	15,712,000	
第一三共	330,700	1,853.00	612,787,100	
キョーリン	27,000	1,525.00	41,175,000	
大日本塗料	67,000	102.00	6,834,000	
日本ペイント	124,000	488.00	60,512,000	
関西ペイント	127,000	700.00	88,900,000	
中国塗料	32,000	564.00	18,048,000	
日本特殊塗料	9,300	326.00	3,031,800	
藤倉化成	13,100	505.00	6,615,500	
太陽インキ製造	8,200	2,290.00	18,778,000	
D I C	373,000	128.00	47,744,000	
サカタインクス	23,000	391.00	8,993,000	
東洋インキ製造	111,000	336.00	37,296,000	
アルプス技研	5,800	556.00	3,224,800	
ダイオーズ	2,100	485.00	1,018,500	
日本空調サービス	2,600	716.00	1,861,600	
オリエンタルランド	30,300	6,320.00	191,496,000	
ダスキン	33,700	1,687.00	56,851,900	
パーク 2 4	60,900	1,034.00	62,970,600	
明光ネットワークジャパン	9,300	571.00	5,310,300	
ファルコバイオシステムズ	6,300	997.00	6,281,100	
クレスコ	3,600	454.00	1,634,400	
フジ・メディア・ホールディングス	1,104	147,000.00	162,288,000	
秀英予備校	3,500	632.00	2,212,000	
田谷	1,800	719.00	1,294,200	
ラウンドワン	18,300	761.00	13,926,300	
リゾートトラスト	19,800	1,159.00	22,948,200	
オービック	3,330	15,190.00	50,582,700	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,700	728.00	1,965,600	
ヤフー	7,749	30,500.00	236,344,500	
ビー・エム・エル	5,900	2,600.00	15,340,000	
ワタベウェディング	3,300	1,279.00	4,220,700	
トレンドマイクロ	42,000	3,350.00	140,700,000	
もしもしホットライン	8,100	1,752.00	14,191,200	

東急コミュニティー	2,900	2,045.00	5,930,500	
リソー教育	1,324	5,370.00	7,109,880	
日本オラクル	17,000	4,000.00	68,000,000	
アルファシステムズ	3,100	1,840.00	5,704,000	
フューチャーアーキテクト	137	38,000.00	5,206,000	
ウェアハウス	3,900	440.00	1,716,000	
シーエーシー	6,300	708.00	4,460,400	
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	669.00	2,007,000	
トーセ	3,200	623.00	1,993,600	
ユー・エス・エス	15,260	5,350.00	81,641,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,400	4,970.00	16,898,000	
日立ビジネスソリューション	3,900	692.00	2,698,800	
伊藤忠テクノソリューションズ	13,200	2,765.00	36,498,000	
アイティフォー	13,400	335.00	4,489,000	
東京個別指導学院	8,900	235.00	2,091,500	
東計電算	2,400	1,190.00	2,856,000	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	51,500	584.00	30,076,000	
エックスネット	14	138,000.00	1,932,000	
テー・オー・ダブリュー	2,500	548.00	1,370,000	
大塚商会	8,500	5,370.00	45,645,000	
総合メディカル	2,600	2,355.00	6,123,000	
サイボウズ	195	23,240.00	4,531,800	
アグレックス	2,500	825.00	2,062,500	
セントラルスポーツ	3,500	830.00	2,905,000	
電通国際情報サービス	8,200	641.00	5,256,200	
ウェザーニューズ	3,300	1,436.00	4,738,800	
C I J	11,800	305.00	3,599,000	
富士フイルムホールディングス	274,300	2,690.00	737,867,000	
コニカミノルタホールディングス	283,500	851.00	241,258,500	
資生堂	191,000	1,565.00	298,915,000	
ライオン	130,000	466.00	60,580,000	
高砂香料工業	40,000	507.00	20,280,000	
マンダム	11,300	2,570.00	29,041,000	
ミルボン	4,600	2,400.00	11,040,000	
ファンケル	19,600	1,423.00	27,890,800	
コーセー	18,200	2,190.00	39,858,000	
ドクターシーラボ	75	183,500.00	13,762,500	
エステー	7,900	1,098.00	8,674,200	
コニシ	8,800	872.00	7,673,600	
長谷川香料	13,000	1,525.00	19,825,000	
小林製薬	15,600	4,090.00	63,804,000	

荒川化学工業	9,400	1,042.00	9,794,800	
メック	7,600	720.00	5,472,000	
日本高純度化学	30	312,000.00	9,360,000	
荏原ユーザライト	1,200	1,839.00	2,206,800	
アース製薬	8,500	2,890.00	24,565,000	
イハラケミカル工業	21,000	337.00	7,077,000	
北興化学工業	12,000	333.00	3,996,000	
大成ラミック	3,200	2,245.00	7,184,000	
クミアイ化学工業	29,000	363.00	10,527,000	
日本農薬	23,000	649.00	14,927,000	
新日本石油	781,000	504.00	393,624,000	
昭和シェル石油	100,400	981.00	98,492,400	
コスモ石油	311,000	250.00	77,750,000	
富士興産	41,000	73.00	2,993,000	
ニチレキ	14,000	357.00	4,998,000	
東燃ゼネラル石油	151,000	877.00	132,427,000	
ユシロ化学工業	5,600	1,300.00	7,280,000	
ビーピー・カストロール	3,800	346.00	1,314,800	
新日鉱ホールディングス	464,000	442.00	205,088,000	
AOCホールディングス	26,000	570.00	14,820,000	
出光興産	13,300	7,410.00	98,553,000	
横浜ゴム	137,000	441.00	60,417,000	
東洋ゴム工業	105,000	216.00	22,680,000	
ブリヂストン	324,800	1,611.00	523,252,800	
住友ゴム工業	78,800	847.00	66,743,600	
藤倉ゴム工業	7,000	405.00	2,835,000	
オカモト	47,000	343.00	16,121,000	
アキレス	92,000	146.00	13,432,000	
フコク	5,300	559.00	2,962,700	
ニッタ	10,100	1,380.00	13,938,000	
クリエートメディック	3,300	909.00	2,999,700	
東海ゴム工業	20,800	991.00	20,612,800	
三ツ星ベルト	34,000	369.00	12,546,000	
バンドー化学	40,000	251.00	10,040,000	
鬼怒川ゴム工業	27,000	169.00	4,563,000	
旭硝子	514,000	725.00	372,650,000	
日本板硝子	360,000	300.00	108,000,000	
有沢製作所	15,200	646.00	9,819,200	
日本山村硝子	55,000	300.00	16,500,000	
日本電気硝子	182,000	819.00	149,058,000	
オハラ	5,300	1,462.00	7,748,600	

住友大阪セメント	215,000	170.00	36,550,000	
太平洋セメント	448,000	120.00	53,760,000	
デイ・シイ	11,400	273.00	3,112,200	
リゾートソリューション	13,000	149.00	1,937,000	
日本ヒューム	11,000	297.00	3,267,000	
東海カーボン	106,000	424.00	44,944,000	
日本カーボン	57,000	295.00	16,815,000	
東洋炭素	4,900	4,650.00	22,785,000	
ノリタケカンパニーリミテド	58,000	277.00	16,066,000	
TOTO	173,000	562.00	97,226,000	
日本碍子	135,000	2,080.00	280,800,000	
日本特殊陶業	99,000	1,146.00	113,454,000	
MARUWA	3,600	2,290.00	8,244,000	
品川白煉瓦	35,000	219.00	7,665,000	
黒崎播磨	31,000	158.00	4,898,000	
東京窯業	16,000	200.00	3,200,000	
ニッカトー	6,000	414.00	2,484,000	
フジミインコーポレーテッド	11,300	1,607.00	18,159,100	
ニチアス	49,000	335.00	16,415,000	
新日本製鐵	2,948,000	328.00	966,944,000	
住友金属工業	1,921,000	221.00	424,541,000	
神戸製鋼所	1,560,000	157.00	244,920,000	
日新製鋼	432,000	160.00	69,120,000	
中山製鋼所	65,000	172.00	11,180,000	
合同製鐵	69,000	176.00	12,144,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	286,600	3,080.00	882,728,000	
東京製鐵	46,500	1,100.00	51,150,000	
共英製鋼	9,000	2,155.00	19,395,000	
大和工業	26,400	2,530.00	66,792,000	
東京鐵鋼	24,000	310.00	7,440,000	
大阪製鐵	7,100	1,574.00	11,175,400	
淀川製鋼所	83,000	378.00	31,374,000	
東洋鋼板	24,000	393.00	9,432,000	
住友鋼管	7,700	525.00	4,042,500	
丸一鋼管	31,300	1,795.00	56,183,500	
モリ工業	19,000	199.00	3,781,000	
大同特殊鋼	171,000	326.00	55,746,000	
日本高周波鋼業	34,000	95.00	3,230,000	
日本金属工業	64,000	161.00	10,304,000	
日本冶金工業	59,500	448.00	26,656,000	
山陽特殊製鋼	56,000	333.00	18,648,000	

愛知製鋼	61,000	377.00	22,997,000	
日立金属	73,000	919.00	67,087,000	
日本金属	29,000	163.00	4,727,000	
大太平洋金属	78,000	681.00	53,118,000	
日本電工	49,000	626.00	30,674,000	
日本製鋼所	161,000	1,032.00	166,152,000	
三菱製鋼	66,000	183.00	12,078,000	
日亜鋼業	17,000	341.00	5,797,000	
日本精線	10,000	262.00	2,620,000	
日本軽金属	249,000	93.00	23,157,000	
大紀アルミニウム工業所	17,000	211.00	3,587,000	
三井金属鉱業	325,000	230.00	74,750,000	
東邦亜鉛	60,000	431.00	25,860,000	
三菱マテリアル	682,000	248.00	169,136,000	
住友金属鉱山	291,000	1,474.00	428,934,000	
DOWAホールディングス	142,000	544.00	77,248,000	
古河機械金属	189,000	126.00	23,814,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	2,570.00	28,527,000	
東邦チタニウム	18,500	1,217.00	22,514,500	
住友軽金属工業	159,000	90.00	14,310,000	
古河スカイ	55,000	155.00	8,525,000	
古河電気工業	353,000	365.00	128,845,000	
住友電気工業	370,300	1,174.00	434,732,200	
フジクラ	168,000	440.00	73,920,000	
三菱電線工業	72,000	86.00	6,192,000	
昭和電線ホールディングス	134,000	94.00	12,596,000	
タツタ電線	26,000	233.00	6,058,000	
日立電線	88,000	263.00	23,144,000	
沖電線	12,000	133.00	1,596,000	
カナレ電気	1,200	1,019.00	1,222,800	
平河ヒューテック	3,200	702.00	2,246,400	
リョービ	70,000	285.00	19,950,000	
アサヒホールディングス	15,700	1,523.00	23,911,100	
東洋製罐	86,700	1,727.00	149,730,900	
ホッカンホールディングス	35,000	234.00	8,190,000	
コロナ	5,300	1,225.00	6,492,500	
横河ブリッジホールディングス	22,000	723.00	15,906,000	
三和ホールディングス	113,000	309.00	34,917,000	
文化シャッター	29,000	341.00	9,889,000	
東洋シャッター	2,400	669.00	1,605,600	
住生活グループ	135,800	1,575.00	213,885,000	

日本ファイルコン	11,700	475.00	5,557,500	
ノーリツ	18,800	1,203.00	22,616,400	
長府製作所	12,100	1,902.00	23,014,200	
リンナイ	21,700	4,240.00	92,008,000	
ユニプレス	15,000	1,275.00	19,125,000	
ダイニチ工業	6,800	663.00	4,508,400	
日東精工	21,000	232.00	4,872,000	
三洋工業	15,000	162.00	2,430,000	
岡部	24,300	340.00	8,262,000	
日立ツール	6,800	830.00	5,644,000	
東プレ	23,700	836.00	19,813,200	
高周波熱錬	16,800	698.00	11,726,400	
東京製綱	81,000	323.00	26,163,000	
パイオラックス	5,000	1,635.00	8,175,000	
日本発條	74,000	741.00	54,834,000	
中央発條	18,000	265.00	4,770,000	
三浦工業	16,700	2,540.00	42,418,000	
タクマ	44,000	255.00	11,220,000	
ツガミ	33,000	172.00	5,676,000	
オークマ	68,000	452.00	30,736,000	
東芝機械	62,000	331.00	20,522,000	
アマダ	172,000	604.00	103,888,000	
アイダエンジニアリング	29,100	298.00	8,671,800	
牧野フライス製作所	54,000	346.00	18,684,000	
オーエスジー	46,400	922.00	42,780,800	
旭ダイヤモンド工業	28,000	652.00	18,256,000	
森精機製作所	48,300	1,079.00	52,115,700	
ディスコ	10,300	5,980.00	61,594,000	
日東工器	6,500	1,807.00	11,745,500	
豊田自動織機	86,900	2,465.00	214,208,500	
大阪機工	37,000	83.00	3,071,000	
東洋機械金属	6,900	138.00	952,200	
オーエム製作所	9,000	304.00	2,736,000	
津田駒工業	32,000	125.00	4,000,000	
島精機製作所	13,400	2,085.00	27,939,000	
日本スピンドル製造	18,000	144.00	2,592,000	
日阪製作所	13,000	995.00	12,935,000	
やまびこ	4,000	1,210.00	4,840,000	
ペガサスミシン製造	14,600	173.00	2,525,800	
ナブテスコ	47,000	1,071.00	50,337,000	
三井海洋開発	8,000	1,836.00	14,688,000	

レオン自動機	13,000	256.00	3,328,000	
SMC	33,500	11,040.00	369,840,000	
新川	10,000	1,744.00	17,440,000	
ホソカワミクロン	20,000	371.00	7,420,000	
ユニオンツール	6,200	2,865.00	17,763,000	
オイレス工業	12,400	1,536.00	19,046,400	
サトー	11,900	1,222.00	14,541,800	
日本エアーテック	4,200	620.00	2,604,000	
日精樹脂工業	11,000	285.00	3,135,000	
ワイエイシイ	7,100	834.00	5,921,400	
小松製作所	499,100	1,682.00	839,486,200	
住友重機械工業	283,000	438.00	123,954,000	
日立建機	57,400	1,927.00	110,609,800	
日工	16,000	270.00	4,320,000	
巴工業	4,300	1,469.00	6,316,700	
井関農機	114,000	361.00	41,154,000	
丸山製作所	25,000	180.00	4,500,000	
北川鉄工所	57,000	106.00	6,042,000	
シンニッタン	9,700	260.00	2,522,000	
クボタ	514,000	747.00	383,958,000	
荏原実業	3,000	1,370.00	4,110,000	
東洋エンジニアリング	83,000	306.00	25,398,000	
三菱化工機	34,000	251.00	8,534,000	
月島機械	17,000	580.00	9,860,000	
帝国電機製作所	4,500	1,730.00	7,785,000	
東京機械製作所	37,000	152.00	5,624,000	
新東工業	22,700	684.00	15,526,800	
澁谷工業	6,600	800.00	5,280,000	
アイチ コーポレーション	19,100	455.00	8,690,500	
小森コーポレーション	31,900	1,090.00	34,771,000	
鶴見製作所	9,000	675.00	6,075,000	
住友精密工業	20,000	332.00	6,640,000	
酒井重工業	21,000	152.00	3,192,000	
荏原製作所	241,000	395.00	95,195,000	
西島製作所	10,200	1,470.00	14,994,000	
千代田化工建設	100,000	707.00	70,700,000	
ダイキン工業	117,200	3,230.00	378,556,000	
オルガノ	20,000	683.00	13,660,000	
トーヨーカネツ	71,000	171.00	12,141,000	
栗田工業	62,000	3,220.00	199,640,000	
椿本チエイン	59,000	367.00	21,653,000	

大同工業	26,000	149.00	3,874,000	
T C M	35,000	192.00	6,720,000	
日機装	32,000	780.00	24,960,000	
木村化工機	10,300	975.00	10,042,500	
新興プランテック	22,000	879.00	19,338,000	
アネスト岩田	24,000	309.00	7,416,000	
ダイフク	46,000	601.00	27,646,000	
加藤製作所	26,000	195.00	5,070,000	
油研工業	20,000	138.00	2,760,000	
タダノ	52,000	442.00	22,984,000	
フジテック	32,000	510.00	16,320,000	
シーケーディ	31,400	647.00	20,315,800	
キトー	25	92,000.00	2,300,000	
平和	20,000	990.00	19,800,000	
理想科学工業	8,700	1,122.00	9,761,400	
SANKYO	29,300	5,620.00	164,666,000	
日本金銭機械	11,900	879.00	10,460,100	
マースエンジニアリング	5,300	3,310.00	17,543,000	
福島工業	3,600	860.00	3,096,000	
キヤノンファインテック	9,900	1,165.00	11,533,500	
オーイズミ	7,100	218.00	1,547,800	
ダイコク電機	4,400	2,025.00	8,910,000	
アマノ	32,500	778.00	25,285,000	
サンデン	61,000	255.00	15,555,000	
ブラザー工業	129,500	1,076.00	139,342,000	
マックス	19,000	936.00	17,784,000	
モリタホールディングス	17,000	485.00	8,245,000	
グローリー	32,600	2,205.00	71,883,000	
大和冷機工業	17,000	518.00	8,806,000	
セガサミーホールディングス	122,700	1,168.00	143,313,600	
日本ピストンリング	42,000	104.00	4,368,000	
リケン	50,000	325.00	16,250,000	
帝国ピストンリング	16,000	426.00	6,816,000	
ホシザキ電機	21,600	1,293.00	27,928,800	
大豊工業	10,400	686.00	7,134,400	
日本精工	222,000	557.00	123,654,000	
NTN	212,000	372.00	78,864,000	
ジェイテクト	108,200	1,046.00	113,177,200	
不二越	113,000	203.00	22,939,000	
ミネベア	160,000	412.00	65,920,000	
日本トムソン	36,000	509.00	18,324,000	

THK	66,900	1,758.00	117,610,200	
ユーシン精機	5,100	1,565.00	7,981,500	
前澤給装工業	4,400	1,460.00	6,424,000	
イーグル工業	16,000	471.00	7,536,000	
日本ピラー工業	14,000	445.00	6,230,000	
キット	50,000	452.00	22,600,000	
日立製作所	1,795,000	276.00	495,420,000	
東芝	2,115,000	471.00	996,165,000	
三菱電機	1,002,000	680.00	681,360,000	
富士電機ホールディングス	249,000	166.00	41,334,000	
東洋電機製造	23,000	839.00	19,297,000	
安川電機	118,000	648.00	76,464,000	
シンフォニアテクノロジー	69,000	247.00	17,043,000	
明電舎	99,000	470.00	46,530,000	
オリジン電気	17,000	228.00	3,876,000	
デンヨー	11,600	738.00	8,560,800	
日立工機	36,900	1,011.00	37,305,900	
三桜工業	13,700	635.00	8,699,500	
マキタ	65,300	2,850.00	186,105,000	
東芝テック	78,000	420.00	32,760,000	
芝浦メカトロニクス	21,000	286.00	6,006,000	
マブチモーター	14,600	4,570.00	66,722,000	
日本電産	53,200	7,290.00	387,828,000	
高岳製作所	42,000	310.00	13,020,000	
ダイヘン	56,000	368.00	20,608,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	404,800	48.00	19,430,400	
日新電機	22,000	552.00	12,144,000	
大崎電気工業	17,000	1,028.00	17,476,000	
オムロン	127,500	1,694.00	215,985,000	
日東工業	16,400	900.00	14,760,000	
I D E C	15,100	711.00	10,736,100	
エルピーダメモリ	72,600	1,177.00	85,450,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	190,000	820.00	155,800,000	
サクサホールディングス	28,000	202.00	5,656,000	
メルコホールディングス	6,000	1,600.00	9,600,000	
テクノメディカ	8	295,000.00	2,360,000	
日本電気	1,082,000	282.00	305,124,000	
富士通	1,130,000	587.00	663,310,000	
沖電気工業	342,000	80.00	27,360,000	
岩崎通信機	47,000	86.00	4,042,000	
電気興業	28,000	461.00	12,908,000	

サンケン電気	64,000	308.00	19,712,000	
ナカヨ通信機	14,000	191.00	2,674,000	
アイホン	7,600	1,610.00	12,236,000	
NECエレクトロニクス	21,700	798.00	17,316,600	
セイコーエプソン	81,300	1,346.00	109,429,800	
ワコム	213	213,900.00	45,560,700	
アルバック	17,200	2,365.00	40,678,000	
ナナオ	9,200	2,140.00	19,688,000	
日本信号	27,100	862.00	23,360,200	
京三製作所	25,000	424.00	10,600,000	
能美防災	14,000	750.00	10,500,000	
ホーチキ	11,000	534.00	5,874,000	
マスプロ電工	8,200	888.00	7,281,600	
日本無線	42,000	229.00	9,618,000	
パナソニック	1,144,100	1,323.00	1,513,644,300	
シャープ	518,000	998.00	516,964,000	
アンリツ	51,000	307.00	15,657,000	
富士通ゼネラル	26,000	312.00	8,112,000	
日立国際電気	32,000	698.00	22,336,000	
ソニー	568,900	2,655.00	1,510,429,500	
TDK	56,100	5,190.00	291,159,000	
帝国通信工業	26,000	240.00	6,240,000	
三洋電機	1,060,000	213.00	225,780,000	
ミツミ電機	37,900	1,938.00	73,450,200	
タムラ製作所	33,000	309.00	10,197,000	
アルプス電気	91,900	518.00	47,604,200	
池上通信機	34,000	82.00	2,788,000	
パイオニア	84,000	216.00	18,144,000	
日本電波工業	8,500	1,742.00	14,807,000	
日本トリム	1,550	1,830.00	2,836,500	
ローランド ディー. ジー.	4,200	1,288.00	5,409,600	
フォスター電機	11,300	1,982.00	22,396,600	
クラリオン	47,000	83.00	3,901,000	
SMK	34,000	579.00	19,686,000	
ヨコオ	9,100	590.00	5,369,000	
東光	49,000	143.00	7,007,000	
ホシデン	26,700	1,217.00	32,493,900	
ヒロセ電機	18,700	10,120.00	189,244,000	
日本航空電子工業	26,000	536.00	13,936,000	
TOA	14,000	615.00	8,610,000	
日立マクセル	23,200	1,735.00	40,252,000	

アルパイン	23,600	841.00	19,847,600	
スミダコーポレーション	8,700	600.00	5,220,000	
アイコム	6,000	2,300.00	13,800,000	
船井電機	9,800	4,100.00	40,180,000	
横河電機	117,200	795.00	93,174,000	
新電元工業	38,000	262.00	9,956,000	
山武	27,500	2,020.00	55,550,000	
日本光電工業	21,400	1,499.00	32,078,600	
チノー	23,000	251.00	5,773,000	
共和電業	11,000	267.00	2,937,000	
日本電子材料	5,800	665.00	3,857,000	
堀場製作所	17,100	2,330.00	39,843,000	
アドバンテスト	73,100	2,490.00	182,019,000	
小野測器	12,000	425.00	5,100,000	
エスベック	10,400	539.00	5,605,600	
サンクス	9,500	320.00	3,040,000	
キーエンス	22,100	19,180.00	423,878,000	
日置電機	5,200	1,710.00	8,892,000	
シスメックス	20,500	3,880.00	79,540,000	
メガチップス	9,900	1,941.00	19,215,900	
O B A R A	7,400	815.00	6,031,000	
日本電産コパル電子	11,200	531.00	5,947,200	
ミヤチテクノス	6,000	656.00	3,936,000	
東京電波	4,100	654.00	2,681,400	
澤藤電機	9,000	180.00	1,620,000	
デンソー	235,600	2,640.00	621,984,000	
コーセル	14,300	1,188.00	16,988,400	
日立メディコ	8,000	854.00	6,832,000	
新日本無線	10,000	231.00	2,310,000	
オブテックス	7,400	1,106.00	8,184,400	
千代田インテグレ	5,700	1,190.00	6,783,000	
東光電気	8,000	524.00	4,192,000	
スタンレー電気	75,300	1,820.00	137,046,000	
岩崎電気	40,000	180.00	7,200,000	
ウシオ電機	60,500	1,565.00	94,682,500	
岡谷電機産業	6,000	253.00	1,518,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	198.00	2,356,200	
日本セラミック	7,900	1,274.00	10,064,600	
新神戸電機	11,000	1,070.00	11,770,000	
日本デジタル研究所	10,200	1,266.00	12,913,200	
古河電池	8,000	794.00	6,352,000	

双信電機	5,300	394.00	2,088,200	
図研	7,500	698.00	5,235,000	
日本電子	40,000	403.00	16,120,000	
カシオ計算機	102,300	733.00	74,985,900	
ファナック	103,700	8,050.00	834,785,000	
日本シイエムケイ	22,200	766.00	17,005,200	
エンプラス	6,300	1,725.00	10,867,500	
ローム	53,700	6,280.00	337,236,000	
浜松ホトニクス	39,100	2,150.00	84,065,000	
三井ハイテック	14,200	1,132.00	16,074,400	
新光電気工業	31,600	1,599.00	50,528,400	
京セラ	95,600	8,330.00	796,348,000	
協栄産業	17,000	200.00	3,400,000	
太陽誘電	52,000	1,059.00	55,068,000	
村田製作所	120,100	4,260.00	511,626,000	
ユーシン	15,300	472.00	7,221,600	
双葉電子工業	19,000	1,465.00	27,835,000	
日東電工	98,400	2,750.00	270,600,000	
北陸電気工業	49,000	177.00	8,673,000	
パナソニック電工	175,000	1,073.00	187,775,000	
東海理化電機製作所	28,300	1,611.00	45,591,300	
ニチコン	33,800	1,147.00	38,768,600	
日本ケミコン	58,000	438.00	25,404,000	
KOA	15,300	808.00	12,362,400	
三井造船	388,000	233.00	90,404,000	
日立造船	477,500	114.00	54,435,000	
佐世保重工業	65,000	186.00	12,090,000	
三菱重工業	1,911,000	340.00	649,740,000	
川崎重工業	890,000	228.00	202,920,000	
I H I	737,000	182.00	134,134,000	
日本車輛製造	49,000	578.00	28,322,000	
日本輸送機	13,000	209.00	2,717,000	
近畿車輛	18,000	820.00	14,760,000	
日産自動車	1,355,400	607.00	822,727,800	
いすゞ自動車	509,000	190.00	96,710,000	
トヨタ自動車	1,378,400	3,570.00	4,920,888,000	
日野自動車	153,000	341.00	52,173,000	
三菱自動車工業	2,398,000	148.00	354,904,000	
武蔵精密工業	10,400	1,718.00	17,867,200	
トヨタ車体	23,400	1,750.00	40,950,000	
日産車体	37,000	721.00	26,677,000	

関東自動車工業	16,300	904.00	14,735,200	
新明和工業	44,000	352.00	15,488,000	
極東開発工業	21,400	358.00	7,661,200	
日信工業	19,700	1,309.00	25,787,300	
トピー工業	97,000	198.00	19,206,000	
ティラド	33,000	231.00	7,623,000	
曙ブレーキ工業	29,900	660.00	19,734,000	
タチエス	14,200	753.00	10,692,600	
NOK	57,700	1,338.00	77,202,600	
フタバ産業	23,300	376.00	8,760,800	
カヤバ工業	75,000	319.00	23,925,000	
シロキ工業	22,000	152.00	3,344,000	
市光工業	32,000	152.00	4,864,000	
大同メタル工業	19,000	296.00	5,624,000	
プレス工業	43,000	180.00	7,740,000	
カルソニックカンセイ	64,000	254.00	16,256,000	
太平洋工業	23,000	425.00	9,775,000	
ケーヒン	24,700	1,488.00	36,753,600	
河西工業	16,000	240.00	3,840,000	
アイシン精機	98,200	2,190.00	215,058,000	
マツダ	425,000	201.00	85,425,000	
ダイハツ工業	114,000	917.00	104,538,000	
愛知機械工業	27,000	236.00	6,372,000	
今仙電機製作所	7,900	999.00	7,892,100	
本田技研工業	916,900	2,765.00	2,535,228,500	
スズキ	216,900	2,095.00	454,405,500	
富士重工業	365,000	349.00	127,385,000	
ヤマハ発動機	124,100	1,107.00	137,378,700	
ショーワ	23,000	549.00	12,627,000	
小糸製作所	54,000	1,245.00	67,230,000	
T B K	14,000	154.00	2,156,000	
エクセディ	13,000	1,978.00	25,714,000	
ミツバ	23,000	414.00	9,522,000	
豊田合成	30,300	2,625.00	79,537,500	
愛三工業	13,000	650.00	8,450,000	
ヨロズ	7,200	1,206.00	8,683,200	
エフ・シー・シー	15,800	1,564.00	24,711,200	
新家工業	24,000	132.00	3,168,000	
シマノ	41,600	3,880.00	161,408,000	
タカタ	19,100	1,641.00	31,343,100	
テイ・エス テック	22,700	1,587.00	36,024,900	

小野建	9,100	900.00	8,190,000	
はるやま商事	5,500	406.00	2,233,000	
佐島電機	9,800	618.00	6,056,400	
カップ・クリエイト	6,250	2,280.00	14,250,000	
エコートレーディング	2,400	1,069.00	2,565,600	
伯東	7,300	873.00	6,372,900	
中山福	6,700	598.00	4,006,600	
ライトオン	8,300	880.00	7,304,000	
ナガイレーベン	5,800	1,890.00	10,962,000	
ジーンズメイト	3,400	520.00	1,768,000	
菱食	10,300	2,295.00	23,638,500	
良品計画	11,200	4,650.00	52,080,000	
三城ホールディングス	15,000	841.00	12,615,000	
松田産業	7,700	1,482.00	11,411,400	
メディセオ・パルタックホールディングス	114,100	1,263.00	144,108,300	
アドヴァン	9,000	630.00	5,670,000	
S PK	2,700	1,245.00	3,361,500	
アズワン	6,900	1,710.00	11,799,000	
スズデン	4,200	477.00	2,003,400	
尾家産業	3,800	780.00	2,964,000	
シモジマ	7,300	1,300.00	9,490,000	
ドウシシャ	5,600	1,888.00	10,572,800	
コナカ	14,100	285.00	4,018,500	
高速	6,400	647.00	4,140,800	
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	487.00	1,704,500	
イオン北海道	6,600	299.00	1,973,400	
コジマ	9,500	463.00	4,398,500	
コーナン商事	12,700	1,014.00	12,877,800	
黒田電気	16,200	1,100.00	17,820,000	
ネットワンシステムズ	258	135,000.00	34,830,000	
エコス	2,900	609.00	1,766,100	
ワタミ	13,900	1,888.00	26,243,200	
マルシェ	2,700	740.00	1,998,000	
ドン・キホーテ	19,500	2,130.00	41,535,000	
丸文	8,400	562.00	4,720,800	
メガネトップ	6,300	1,700.00	10,710,000	
西松屋チェーン	28,000	943.00	26,404,000	
ゼンショー	36,200	623.00	22,552,600	
ハピネット	2,900	1,240.00	3,596,000	
幸楽苑	6,500	1,199.00	7,793,500	

トーメンエレクトロニクス	3,300	1,010.00	3,333,000	
ユニマットライフ	4,200	961.00	4,036,200	
ハークスレイ	3,200	869.00	2,780,800	
サイゼリヤ	15,700	1,638.00	25,716,600	
エクセル	5,400	1,135.00	6,129,000	
マルカキカイ	4,300	733.00	3,151,900	
アルゴグラフィックス	4,500	1,040.00	4,680,000	
ガリバーインターナショナル	2,890	6,330.00	18,293,700	
ポプラ	3,100	642.00	1,990,200	
ユナイテッドアローズ	14,700	787.00	11,568,900	
進和	6,100	1,235.00	7,533,500	
エスケイジャパン	6,100	326.00	1,988,600	
ダイトエレクトロン	6,100	467.00	2,848,700	
ハイデイ日高	4,900	1,096.00	5,370,400	
京都きもの友禅	7,000	1,007.00	7,049,000	
コロワイド	24,500	603.00	14,773,500	
田中商事	5,000	444.00	2,220,000	
オーハシテクニカ	6,900	544.00	3,753,600	
壺番屋	3,700	2,175.00	8,047,500	
マクニカ	4,300	1,449.00	6,230,700	
白銅	4,600	604.00	2,778,400	
トップカルチャー	4,700	454.00	2,133,800	
スギホールディングス	16,900	1,905.00	32,194,500	
島津製作所	118,000	650.00	76,700,000	
JMS	18,000	402.00	7,236,000	
アロカ	6,700	870.00	5,829,000	
長野計器	6,500	629.00	4,088,500	
スター精密	20,500	835.00	17,117,500	
東京計器	40,000	122.00	4,880,000	
愛知時計電機	12,000	270.00	3,240,000	
日本電産トーソク	3,300	734.00	2,422,200	
東京精密	20,500	1,209.00	24,784,500	
ニコン	187,000	1,642.00	307,054,000	
トプコン	25,400	412.00	10,464,800	
オリンパス	117,500	2,380.00	279,650,000	
理研計器	9,300	698.00	6,491,400	
大日本スクリーン製造	122,000	340.00	41,480,000	
キヤノン電子	9,700	1,674.00	16,237,800	
タムロン	9,900	1,067.00	10,563,300	
HOYA	246,400	2,120.00	522,368,000	
ノーリツ銅機	10,100	806.00	8,140,600	

キヤノン	622,100	3,630.00	2,258,223,000	
リコー	347,000	1,308.00	453,876,000	
日本電産コパル	10,900	1,221.00	13,308,900	
日本電産サンキョー	32,000	509.00	16,288,000	
シチズンホールディングス	139,500	505.00	70,447,500	
リズム時計工業	56,000	131.00	7,336,000	
S R I スポーツ	73	88,000.00	6,424,000	
バンダイナムコホールディングス	116,600	919.00	107,155,400	
共立印刷	13,900	158.00	2,196,200	
フランスベッドホールディングス	72,000	128.00	9,216,000	
パイロットコーポレーション	108	100,000.00	10,800,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	20,400	833.00	16,993,200	
トッパン・フォームズ	23,000	1,232.00	28,336,000	
フジシールインターナショナル	12,000	1,821.00	21,852,000	
タカラトミー	32,300	742.00	23,966,600	
スルガ	2,900	1,573.00	4,561,700	
アロン化成	8,000	380.00	3,040,000	
タカノ	5,200	589.00	3,062,800	
プロネクス	13,100	710.00	9,301,000	
ウッドワン	22,000	291.00	6,402,000	
大建工業	51,000	239.00	12,189,000	
きもと	9,300	930.00	8,649,000	
凸版印刷	326,000	850.00	277,100,000	
大日本印刷	327,000	1,236.00	404,172,000	
図書印刷	23,000	230.00	5,290,000	
共同印刷	36,000	291.00	10,476,000	
日本写真印刷	16,500	4,590.00	75,735,000	
光村印刷	10,000	335.00	3,350,000	
藤森工業	7,500	1,285.00	9,637,500	
宝印刷	5,200	787.00	4,092,400	
前澤化成工業	7,900	960.00	7,584,000	
コンビ	7,000	724.00	5,068,000	
アシックス	107,000	835.00	89,345,000	
ツツミ	4,000	2,090.00	8,360,000	
J S P	7,400	804.00	5,949,600	
ニチハ	13,600	606.00	8,241,600	
ローランド	7,700	1,022.00	7,869,400	
エフピコ	5,600	4,650.00	26,040,000	
小松ウオール工業	4,000	1,180.00	4,720,000	
ヤマハ	85,400	1,062.00	90,694,800	
河合楽器製作所	40,000	109.00	4,360,000	

クリナップ	12,200	700.00	8,540,000	
ピジョン	6,800	3,570.00	24,276,000	
天馬	8,000	1,099.00	8,792,000	
パラマウントベッド	10,600	1,931.00	20,468,600	
キングジム	8,200	696.00	5,707,200	
リンテック	20,400	1,710.00	34,884,000	
信越ポリマー	22,100	642.00	14,188,200	
東リ	29,000	199.00	5,771,000	
イトーキ	19,000	240.00	4,560,000	
任天堂	56,600	23,000.00	1,301,800,000	
三菱鉛筆	10,300	1,105.00	11,381,500	
タカスタンダード	49,000	540.00	26,460,000	
コクヨ	55,800	821.00	45,811,800	
ナカバヤシ	27,000	216.00	5,832,000	
ニフコ	23,300	1,791.00	41,730,300	
ダイワ精工	53,000	116.00	6,148,000	
サンウエーブ工業	18,000	250.00	4,500,000	
岡村製作所	45,000	444.00	19,980,000	
日本バルカー工業	44,000	181.00	7,964,000	
伊藤忠商事	792,000	595.00	471,240,000	
丸紅	926,000	453.00	419,478,000	
ムトウ	12,700	403.00	5,118,100	
F & A アクアホールディングス	9,200	1,100.00	10,120,000	
三陽商会	51,000	295.00	15,045,000	
長瀬産業	55,000	1,110.00	61,050,000	
蝶理	66,000	97.00	6,402,000	
豊田通商	106,200	1,354.00	143,794,800	
オンワードホールディングス	76,000	668.00	50,768,000	
三共生興	22,300	225.00	5,017,500	
兼松	225,000	80.00	18,000,000	
美津濃	53,000	431.00	22,843,000	
ファミリーマート	32,500	2,890.00	93,925,000	
三井物産	912,000	1,174.00	1,070,688,000	
日本紙パルプ商事	55,000	343.00	18,865,000	
東京エレクトロン	78,200	5,730.00	448,086,000	
日立ハイテクノロジーズ	36,700	1,877.00	68,885,900	
カメイ	14,000	517.00	7,238,000	
東都水産	25,000	171.00	4,275,000	
スターゼン	36,000	238.00	8,568,000	
セイコーホールディングス	39,000	225.00	8,775,000	
山善	40,800	332.00	13,545,600	

椿本興業	15,000	212.00	3,180,000	
住友商事	624,900	925.00	578,032,500	
日本ユニシス	26,300	808.00	21,250,400	
内田洋行	25,000	297.00	7,425,000	
三菱商事	791,000	1,816.00	1,436,456,000	
第一実業	23,000	271.00	6,233,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,200	1,589.00	55,932,800	
西華産業	46,000	232.00	10,672,000	
佐藤商事	10,500	495.00	5,197,500	
菱洋エレクトロ	10,800	774.00	8,359,200	
東京産業	10,500	292.00	3,066,000	
ユアサ商事	116,000	99.00	11,484,000	
神鋼商事	27,000	157.00	4,239,000	
阪和興業	106,000	324.00	34,344,000	
カナデン	12,000	549.00	6,588,000	
菱電商事	15,000	579.00	8,685,000	
ニプロ	26,000	2,100.00	54,600,000	
フルサト工業	7,100	681.00	4,835,100	
岩谷産業	119,000	276.00	32,844,000	
すてきナイスグループ	43,000	191.00	8,213,000	
昭光通商	38,000	112.00	4,256,000	
ニチモウ	15,000	163.00	2,445,000	
極東貿易	12,000	132.00	1,584,000	
イワキ	15,000	262.00	3,930,000	
兼松エレクトロニクス	7,200	908.00	6,537,600	
三愛石油	28,000	446.00	12,488,000	
稲畑産業	28,400	373.00	10,593,200	
明和産業	8,400	165.00	1,386,000	
ゴールドウイン	25,000	192.00	4,800,000	
東京スタイル	38,000	774.00	29,412,000	
ユニ・チャーム	23,000	8,520.00	195,960,000	
デサント	32,000	412.00	13,184,000	
ヤマトインターナショナル	9,400	402.00	3,778,800	
東邦ホールディングス	24,400	1,240.00	30,256,000	
サンゲツ	18,300	2,015.00	36,874,500	
ミツウロコ	17,400	647.00	11,257,800	
シナネン	25,000	480.00	12,000,000	
伊藤忠エネクス	27,400	523.00	14,330,200	
サンリオ	29,900	758.00	22,664,200	
サンワテクノス	7,100	439.00	3,116,900	
リョーサン	16,100	2,310.00	37,191,000	

新光商事	11,300	770.00	8,701,000	
トーヨー	22,000	338.00	7,436,000	
三信電気	12,900	723.00	9,326,700	
東陽テクニカ	16,400	921.00	15,104,400	
モスフードサービス	15,000	1,564.00	23,460,000	
加賀電子	11,500	937.00	10,775,500	
三益半導体工業	8,500	1,283.00	10,905,500	
ソーダニッカ	10,000	313.00	3,130,000	
立花エレテック	7,100	717.00	5,090,700	
木曽路	12,100	2,005.00	24,260,500	
千趣会	19,200	640.00	12,288,000	
ケーヨー	21,800	454.00	9,897,200	
アデランスホールディングス	13,100	1,281.00	16,781,100	
上新電機	25,000	696.00	17,400,000	
日本瓦斯	11,400	1,510.00	17,214,000	
ベスト電器	33,500	425.00	14,237,500	
マルエツ	22,000	438.00	9,636,000	
ロイヤルホールディングス	17,700	1,012.00	17,912,400	
いなげや	12,000	934.00	11,208,000	
島忠	24,000	2,355.00	56,520,000	
チヨダ	15,300	1,276.00	19,522,800	
ライフコーポレーション	6,800	1,540.00	10,472,000	
カスミ	22,000	433.00	9,526,000	
リンガーハット	8,100	1,158.00	9,379,800	
MrMax	12,600	492.00	6,199,200	
テンアライド	7,200	314.00	2,260,800	
AOKIホールディングス	11,500	1,009.00	11,603,500	
オークワ	15,000	992.00	14,880,000	
コメリ	14,500	2,660.00	38,570,000	
青山商事	27,000	1,541.00	41,607,000	
しまむら	11,000	8,810.00	96,910,000	
CFSコーポレーション	13,000	598.00	7,774,000	
高島屋	143,000	718.00	102,674,000	
松屋	21,600	720.00	15,552,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,000	564.00	38,916,000	
丸栄	15,000	164.00	2,460,000	
ニッセンホールディングス	25,500	291.00	7,420,500	
パルコ	30,600	830.00	25,398,000	
丸井グループ	138,000	643.00	88,734,000	
クレディセゾン	91,100	1,056.00	96,201,600	
原信ナルスホールディングス	6,500	1,050.00	6,825,000	

セディナ	76,300	155.00	11,826,500	
ダイエー	49,000	366.00	17,934,000	
イズミヤ	35,000	490.00	17,150,000	
イオン	427,000	859.00	366,793,000	
ユニー	80,000	672.00	53,760,000	
イズミ	29,100	1,249.00	36,345,900	
東武ストア	14,000	293.00	4,102,000	
平和堂	21,500	1,248.00	26,832,000	
フジ	11,800	1,750.00	20,650,000	
ヤオコー	6,000	3,240.00	19,440,000	
ゼビオ	11,200	2,115.00	23,688,000	
ケーズホールディングス	18,700	3,010.00	56,287,000	
O l y m p i c	7,100	620.00	4,402,000	
新生銀行	618,000	138.00	85,284,000	
あおぞら銀行	378,000	130.00	49,140,000	
三菱U F J フィナンシャル・グループ	6,209,000	482.00	2,992,738,000	
りそなホールディングス	364,000	1,155.00	420,420,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	540,000	333.00	179,820,000	
三井住友フィナンシャルグループ	575,900	3,130.00	1,802,567,000	
第四銀行	148,000	363.00	53,724,000	
北越銀行	120,000	172.00	20,640,000	
西日本シティ銀行	345,000	227.00	78,315,000	
札幌北洋ホールディングス	160,600	319.00	51,231,400	
千葉銀行	418,000	556.00	232,408,000	
横浜銀行	726,000	440.00	319,440,000	
常陽銀行	411,000	441.00	181,251,000	
群馬銀行	247,000	494.00	122,018,000	
武蔵野銀行	16,100	2,715.00	43,711,500	
千葉興業銀行	20,300	729.00	14,798,700	
関東つくば銀行	30,200	308.00	9,301,600	
東京都民銀行	20,300	1,465.00	29,739,500	
七十七銀行	179,000	512.00	91,648,000	
青森銀行	66,000	359.00	23,694,000	
秋田銀行	72,000	364.00	26,208,000	
山形銀行	64,000	463.00	29,632,000	
岩手銀行	7,100	4,850.00	34,435,000	
東邦銀行	82,000	399.00	32,718,000	
荘内銀行	54,000	149.00	8,046,000	
東北銀行	55,000	144.00	7,920,000	
みちのく銀行	55,000	205.00	11,275,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	458,000	373.00	170,834,000	

静岡銀行	331,000	948.00	313,788,000	
十六銀行	137,000	307.00	42,059,000	
スルガ銀行	120,000	849.00	101,880,000	
八十二銀行	200,000	500.00	100,000,000	
山梨中央銀行	71,000	434.00	30,814,000	
大垣共立銀行	139,000	309.00	42,951,000	
福井銀行	91,000	293.00	26,663,000	
北國銀行	122,000	375.00	45,750,000	
清水銀行	3,600	3,680.00	13,248,000	
滋賀銀行	99,000	563.00	55,737,000	
南都銀行	105,000	489.00	51,345,000	
百五銀行	104,000	462.00	48,048,000	
京都銀行	183,000	825.00	150,975,000	
三重銀行	48,000	296.00	14,208,000	
池田銀行	9,700	4,290.00	41,613,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	742,000	210.00	155,820,000	
広島銀行	312,000	371.00	115,752,000	
山陰合同銀行	64,000	765.00	48,960,000	
中国銀行	87,000	1,137.00	98,919,000	
鳥取銀行	36,000	247.00	8,892,000	
伊予銀行	121,000	810.00	98,010,000	
百十四銀行	124,000	406.00	50,344,000	
四国銀行	77,000	320.00	24,640,000	
阿波銀行	94,000	516.00	48,504,000	
鹿児島銀行	74,000	714.00	52,836,000	
大分銀行	67,000	351.00	23,517,000	
宮崎銀行	55,000	374.00	20,570,000	
肥後銀行	84,000	530.00	44,520,000	
佐賀銀行	65,000	279.00	18,135,000	
十八銀行	68,000	268.00	18,224,000	
沖縄銀行	8,700	3,190.00	27,753,000	
琉球銀行	22,300	1,105.00	24,641,500	
住友信託銀行	1,005,000	477.00	479,385,000	
みずほ信託銀行	1,005,000	95.00	95,475,000	
八千代銀行	6,400	2,725.00	17,440,000	
みずほフィナンシャルグループ	8,082,400	178.00	1,438,667,200	
紀陽ホールディングス	419,000	114.00	47,766,000	
山口フィナンシャルグループ	99,000	931.00	92,169,000	
芙蓉総合リース	11,300	2,020.00	22,826,000	
興銀リース	14,800	1,295.00	19,166,000	
東京センチュリーリース	24,900	981.00	24,426,900	

S B I ホールディングス	8,433	17,760.00	149,770,080	
日本証券金融	41,100	668.00	27,454,800	
大阪証券金融	13,500	196.00	2,646,000	
ポケットカード	10,000	224.00	2,240,000	
長野銀行	41,000	201.00	8,241,000	
名古屋銀行	102,000	388.00	39,576,000	
愛知銀行	3,900	8,070.00	31,473,000	
第三銀行	65,000	213.00	13,845,000	
中京銀行	49,000	282.00	13,818,000	
東日本銀行	57,000	188.00	10,716,000	
愛媛銀行	66,000	250.00	16,500,000	
トマト銀行	41,000	218.00	8,938,000	
みなと銀行	110,000	125.00	13,750,000	
京葉銀行	95,000	459.00	43,605,000	
関西アーバン銀行	150,000	125.00	18,750,000	
栃木銀行	57,000	436.00	24,852,000	
北日本銀行	3,600	2,775.00	9,990,000	
香川銀行	40,000	355.00	14,200,000	
徳島銀行	31,000	368.00	11,408,000	
福島銀行	130,000	54.00	7,020,000	
大東銀行	72,000	74.00	5,328,000	
リコーリース	7,300	1,973.00	14,402,900	
イオンクレジットサービス	47,100	904.00	42,578,400	
アコム	47,880	1,382.00	66,170,160	
プロミス	49,450	490.00	24,230,500	
ジャックス	64,000	206.00	13,184,000	
日立キャピタル	25,000	1,102.00	27,550,000	
オリックス	62,370	5,480.00	341,787,600	
三菱UFJリース	26,870	2,710.00	72,817,700	
ジャフコ	16,500	2,745.00	45,292,500	
大和証券グループ本社	875,000	463.00	405,125,000	
野村ホールディングス	1,586,300	553.00	877,223,900	
みずほ証券	271,000	327.00	88,617,000	
みずほインベスターズ証券	247,000	92.00	22,724,000	
岡三証券グループ	90,000	400.00	36,000,000	
丸三証券	35,800	550.00	19,690,000	
東洋証券	42,000	186.00	7,812,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,000	283.00	35,375,000	
水戸証券	35,000	215.00	7,525,000	
いちよし証券	24,600	616.00	15,153,600	
松井証券	80,800	732.00	59,145,600	

だいがう証券ビジネス	5,000	448.00	2,240,000	
マネックスグループ	559	32,500.00	18,167,500	
カブドットコム証券	228	108,500.00	24,738,000	
極東証券	15,500	603.00	9,346,500	
岩井証券	11,100	732.00	8,125,200	
三井住友海上グループホールディングス	252,600	2,475.00	625,185,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	377	257,900.00	97,228,300	
日本興亜損害保険	408,000	562.00	229,296,000	
損害保険ジャパン	494,000	604.00	298,376,000	
ニッセイ同和損害保険	117,000	459.00	53,703,000	
あいおい損害保険	277,000	458.00	126,866,000	
富士火災海上保険	127,000	106.00	13,462,000	
東京海上ホールディングス	455,600	2,600.00	1,184,560,000	
N E C キャピタルソリューション	3,700	1,378.00	5,098,600	
T & D ホールディングス	155,150	2,430.00	377,014,500	
三井不動産	470,000	1,519.00	713,930,000	
三菱地所	742,000	1,412.00	1,047,704,000	
平和不動産	77,000	308.00	23,716,000	
東京建物	149,000	439.00	65,411,000	
ダイビル	28,500	781.00	22,258,500	
サンケイビル	17,200	605.00	10,406,000	
東急不動産	215,000	359.00	77,185,000	
京阪神不動産	15,000	469.00	7,035,000	
住友不動産	270,000	1,643.00	443,610,000	
東宝不動産	14,000	517.00	7,238,000	
大京	131,000	208.00	27,248,000	
テーオーシー	44,900	395.00	17,735,500	
東京楽天地	21,000	373.00	7,833,000	
レオパレス 2 1	76,500	721.00	55,156,500	
フジ住宅	15,300	349.00	5,339,700	
空港施設	12,600	533.00	6,715,800	
住友不動産販売	5,200	3,210.00	16,692,000	
ゴールドクレスト	8,790	2,715.00	23,864,850	
東急リバブル	14,000	755.00	10,570,000	
サンヨーハウジング名古屋	61	77,500.00	4,727,500	
イオンモール	48,600	1,869.00	90,833,400	
リサ・パートナーズ	148	58,000.00	8,584,000	
エス・ティ・ティ都市開発	664	82,400.00	54,713,600	
東武鉄道	458,000	548.00	250,984,000	
相鉄ホールディングス	148,000	395.00	58,460,000	
東京急行電鉄	589,000	430.00	253,270,000	

京浜急行電鉄	276,000	761.00	210,036,000	
小田急電鉄	344,000	810.00	278,640,000	
京王電鉄	278,000	613.00	170,414,000	
京成電鉄	172,000	596.00	102,512,000	
富士急行	29,000	422.00	12,238,000	
新京成電鉄	14,000	352.00	4,928,000	
東日本旅客鉄道	199,900	6,460.00	1,291,354,000	
西日本旅客鉄道	999	340,000.00	339,660,000	
東海旅客鉄道	859	645,000.00	554,055,000	
アートコーポレーション	2,200	1,538.00	3,383,600	
西日本鉄道	140,000	357.00	49,980,000	
ハマキョウレックス	3,300	2,435.00	8,035,500	
サカイ引越センター	2,000	2,285.00	4,570,000	
近畿日本鉄道	969,000	347.00	336,243,000	
阪急阪神ホールディングス	720,000	430.00	309,600,000	
南海電気鉄道	224,000	413.00	92,512,000	
京阪電気鉄道	241,000	401.00	96,641,000	
名糖運輸	4,400	780.00	3,432,000	
名古屋鉄道	376,000	301.00	113,176,000	
日本通運	460,000	365.00	167,900,000	
ヤマトホールディングス	213,000	1,475.00	314,175,000	
山九	130,000	387.00	50,310,000	
日新	41,000	234.00	9,594,000	
丸運	7,700	258.00	1,986,600	
丸全昭和運輸	33,000	310.00	10,230,000	
センコー	37,000	375.00	13,875,000	
トナミホールディングス	25,000	244.00	6,100,000	
日本梱包運輸倉庫	30,000	1,070.00	32,100,000	
日本石油輸送	12,000	199.00	2,388,000	
福山通運	84,000	479.00	40,236,000	
セイノーホールディングス	83,000	777.00	64,491,000	
神奈川中央交通	13,000	518.00	6,734,000	
日立物流	22,300	1,248.00	27,830,400	
日本郵船	580,000	347.00	201,260,000	
商船三井	563,000	532.00	299,516,000	
川崎汽船	256,000	333.00	85,248,000	
新和海運	43,000	237.00	10,191,000	
乾汽船	14,000	647.00	9,058,000	
飯野海運	58,000	434.00	25,172,000	
第一中央汽船	72,000	202.00	14,544,000	
全日本空輸	1,435,000	258.00	370,230,000	

日本航空	1,563,000	132.00	206,316,000	
三菱倉庫	76,000	1,087.00	82,612,000	
三井倉庫	46,000	341.00	15,686,000	
住友倉庫	85,000	434.00	36,890,000	
澁澤倉庫	33,000	341.00	11,253,000	
ヤマタネ	57,000	137.00	7,809,000	
東陽倉庫	18,000	202.00	3,636,000	
日本トランスシティ	22,000	315.00	6,930,000	
ケイヒン	22,000	119.00	2,618,000	
安田倉庫	7,700	675.00	5,197,500	
東洋埠頭	31,000	170.00	5,270,000	
宇徳	7,800	269.00	2,098,200	
上組	128,000	733.00	93,824,000	
サンリツ	3,000	625.00	1,875,000	
キムラユニティー	2,400	774.00	1,857,600	
キューソー流通システム	3,000	964.00	2,892,000	
郵船航空サービス	8,400	1,160.00	9,744,000	
近鉄エクスプレス	9,600	2,100.00	20,160,000	
東海運	6,700	234.00	1,567,800	
バンテック	49	125,000.00	6,125,000	
東京放送ホールディングス	63,500	1,527.00	96,964,500	
日本テレビ放送網	10,150	12,900.00	130,935,000	
テレビ朝日	269	152,000.00	40,888,000	
テレビ東京	4,200	2,580.00	10,836,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	814	41,250.00	33,577,500	
アイ・ティー・シーネットワーク	24	195,000.00	4,680,000	
イー・アクセス	480	62,700.00	30,096,000	
N E Cモバイリング	4,100	2,405.00	9,860,500	
日本電信電話	486,800	4,160.00	2,025,088,000	
K D D I	1,644	506,000.00	831,864,000	
光通信	13,800	1,961.00	27,061,800	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	10,250	143,400.00	1,469,850,000	
学習研究社	35,000	239.00	8,365,000	
ゼンリン	15,600	1,308.00	20,404,800	
昭文社	6,500	626.00	4,069,000	
角川グループホールディングス	9,300	2,015.00	18,739,500	
インプレスホールディングス	11,200	269.00	3,012,800	
東京電力	676,100	2,355.00	1,592,215,500	
中部電力	363,300	2,180.00	791,994,000	
関西電力	445,300	2,170.00	966,301,000	
中国電力	160,700	1,974.00	317,221,800	

北陸電力	110,100	2,285.00	251,578,500	
東北電力	268,100	2,000.00	536,200,000	
四国電力	111,000	2,740.00	304,140,000	
九州電力	237,000	2,035.00	482,295,000	
北海道電力	100,400	1,868.00	187,547,200	
沖縄電力	7,600	5,360.00	40,736,000	
電源開発	77,700	2,845.00	221,056,500	
東京瓦斯	1,358,000	373.00	506,534,000	
大阪瓦斯	1,150,000	315.00	362,250,000	
東邦瓦斯	280,000	410.00	114,800,000	
北海道瓦斯	21,000	256.00	5,376,000	
西部瓦斯	121,000	255.00	30,855,000	
静岡瓦斯	33,000	694.00	22,902,000	
アイネット	5,700	498.00	2,838,600	
松竹	59,000	787.00	46,433,000	
東宝	75,700	1,521.00	115,139,700	
エイチ・アイ・エス	10,300	1,852.00	19,075,600	
東映	45,000	506.00	22,770,000	
葵プロモーション	6,000	483.00	2,898,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	655	287,600.00	188,378,000	
共立メンテナンス	5,100	1,520.00	7,752,000	
イチネンホールディングス	13,300	424.00	5,639,200	
建設技術研究所	6,200	541.00	3,354,200	
燦ホールディングス	2,500	1,705.00	4,262,500	
スバル興業	8,000	282.00	2,256,000	
東京テアトル	40,000	173.00	6,920,000	
吉本興業	16,900	1,339.00	22,629,100	
ホリプロ	4,000	802.00	3,208,000	
よみうりランド	27,000	330.00	8,910,000	
東京都競馬	77,000	157.00	12,089,000	
常磐興産	37,000	155.00	5,735,000	
カナモト	14,000	416.00	5,824,000	
東京ドーム	86,000	275.00	23,650,000	
D T S	10,500	821.00	8,620,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,100	2,430.00	65,853,000	
シーイーシー	6,800	560.00	3,808,000	
日立ソフトウェアエンジニアリング	15,300	2,645.00	40,468,500	
カプコン	22,700	1,764.00	40,042,800	
日本空港ビルデング	26,300	1,125.00	29,587,500	
トランス・コスモス	15,400	826.00	12,720,400	
乃村工藝社	22,000	251.00	5,522,000	

ジャステック	6,200	523.00	3,242,600	
住商情報システム	11,100	1,494.00	16,583,400	
藤田観光	33,000	378.00	12,474,000	
近畿日本ツーリスト	35,000	88.00	3,080,000	
日本管財	4,100	1,680.00	6,888,000	
白洋舎	14,000	258.00	3,612,000	
セコム	108,800	4,520.00	491,776,000	
日本システムウエア	5,800	303.00	1,757,400	
セントラル警備保障	5,000	938.00	4,690,000	
日立情報システムズ	8,800	2,895.00	25,476,000	
アイネス	13,500	763.00	10,300,500	
丹青社	11,000	199.00	2,189,000	
メイテック	18,700	1,524.00	28,498,800	
TKC	10,300	1,960.00	20,188,000	
アサツー ディ・ケイ	19,500	1,895.00	36,952,500	
富士ソフト	13,300	1,512.00	20,109,600	
ソラン	11,500	464.00	5,336,000	
応用地質	12,900	904.00	11,661,600	
船井総合研究所	14,200	512.00	7,270,400	
日本システムディベロップメント	19,200	968.00	18,585,600	
進学会	5,500	334.00	1,837,000	
コナミ	48,000	1,830.00	87,840,000	
ベネッセコーポレーション	39,000	4,400.00	171,600,000	
イオンディライト	8,300	1,269.00	10,532,700	
ナック	2,800	906.00	2,536,800	
福井コンピュータ	3,800	306.00	1,162,800	
ニチイ学館	26,800	897.00	24,039,600	
ダイセキ	16,600	1,770.00	29,382,000	
元気寿司	3,300	1,200.00	3,960,000	
トラスコ中山	12,100	1,555.00	18,815,500	
ヤマダ電機	51,420	6,080.00	312,633,600	
オートバックスセブン	16,200	3,300.00	53,460,000	
アークランドサカモト	7,800	1,149.00	8,962,200	
ニトリ	22,900	7,650.00	175,185,000	
ユーエスシー	4,600	1,083.00	4,981,800	
グルメ杵屋	8,000	629.00	5,032,000	
愛眼	8,700	565.00	4,915,500	
吉野家ホールディングス	243	108,200.00	26,292,600	
加藤産業	15,300	1,538.00	23,531,400	
富士エレクトロニクス	6,200	774.00	4,798,800	
松屋フーズ	5,100	1,295.00	6,604,500	

J B C Cホールディングス	9,100	637.00	5,796,700	
J Kホールディングス	10,400	381.00	3,962,400	
ユニダックス	6,500	405.00	2,632,500	
サガミチェーン	13,000	785.00	10,205,000	
日伝	4,400	2,705.00	11,902,000	
杉本商事	5,800	940.00	5,452,000	
因幡電機産業	10,200	2,150.00	21,930,000	
住金物産	55,000	204.00	11,220,000	
プレナス	13,300	1,344.00	17,875,200	
ミニストップ	7,800	1,420.00	11,076,000	
アークス	12,600	1,434.00	18,068,400	
バロー	21,100	818.00	17,259,800	
ミスミグループ本社	35,600	1,881.00	66,963,600	
江守商事	3,200	689.00	2,204,800	
アルテック	4,500	197.00	886,500	
ベルク	4,800	846.00	4,060,800	
大庄	6,400	1,235.00	7,904,000	
タキヒヨー	19,000	498.00	9,462,000	
ファーストリテイリング	21,200	11,360.00	240,832,000	
ソフトバンク	432,500	1,973.00	853,322,500	
スズケン	37,600	3,100.00	116,560,000	
サンドラッグ	20,200	2,430.00	49,086,000	
ジェコス	8,600	424.00	3,646,400	
ヤマザワ	2,800	1,282.00	3,589,600	
やまや	2,400	822.00	1,972,800	
ベルーナ	8,850	380.00	3,363,000	
合計	152,799,728		125,893,906,760	

②株式以外の有価証券

種類	銘 柄	口数(口)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	DOWAホールディングス	77,000	2,079,000	
新株予約権証券計		77,000	2,079,000	

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[次へ](#)

「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年 9月30日現在)	(平成21年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,019,230,633	1,516,863,604
国債証券	104,491,272,700	108,800,534,100
地方債証券	9,137,399,893	9,399,449,167
特殊債券	17,941,857,619	17,099,060,533
社債券	11,583,502,060	11,992,401,950
未収利息	318,687,366	326,311,671
前払費用	16,503,179	21,919,519
流動資産合計	144,508,453,450	149,156,540,544
資産合計	144,508,453,450	149,156,540,544
負債の部		
流動負債		
未払金	—	1,096,944,200
未払解約金	7,228,070	45,310,000
流動負債合計	7,228,070	1,142,254,200
負債合計	7,228,070	1,142,254,200
純資産の部		
元本等		
元本	127,492,516,880	126,462,206,194
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	17,008,708,500	21,552,080,150
元本等合計	144,501,225,380	148,014,286,344
純資産合計	144,501,225,380	148,014,286,344
負債純資産合計	144,508,453,450	149,156,540,544

(注) 「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクションS50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成20年9月30日及び平成21年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
--	----------------------------------	----------------------------------

資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 同左
---------------	---	---------------------------

（貸借対照表に関する注記）

	（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
1.期首元本額	118,202,328,264円	127,492,516,880円
期中追加設定元本額	29,971,787,312円	40,774,691,779円
期中一部解約元本額	20,681,598,696円	41,805,002,465円
期末元本額	127,492,516,880円	126,462,206,194円
元本額の内訳		
住信 エマージング株式オープン	10,940,920円	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	184,024,856円	216,744,457円
SBI資産設計オープン（分配型）	35,094,859円	21,599,438円
STAM 国内債券インデックス・オープン	332,343,358円	780,018,621円
世界経済インデックスファンド	—	9,337,842円
住信 国内バランス30	720,502,064円	619,613,638円
住信 国内バランス60	158,585,868円	122,264,966円
すみしん マイセレクション25	407,542,040円	333,331,263円
すみしん マイセレクション50	248,369,510円	248,587,925円
すみしん マイセレクション75	72,289,087円	58,131,929円
すみしん DCマイセレクション25	5,460,097,379円	5,914,528,106円
すみしん DCマイセレクション50	7,885,040,154円	8,202,929,398円
すみしん DCマイセレクション75	2,029,163,831円	2,179,362,191円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	253,986,565円	309,672,023円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	16,980,070,108円	22,006,428,915円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	5,228,900,964円	5,643,683,930円
すみしん DCマイセレクションS25	132,741,535円	253,520,919円
すみしん DCマイセレクションS50	293,584,642円	553,094,423円
すみしん DCマイセレクションS75	69,996,173円	131,235,601円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	26,320,697円	35,397,616円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	5,530,201円	28,842,450円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	960,828円	11,198,954円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	259,556円	1,459,618円
STAM 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	298,150,916円	2,617,946,979円
住信 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	125,600,281円	101,710,539円
すみしん マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	772,666,885円	691,094,269円
すみしん マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	116,639,651円	84,645,260円
住信 国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）	17,079,564円	15,465,393円
住信 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	18,796,054円	15,762,955円

すみしん マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	7,835,075円	5,480,030円
すみしん バランス30VA1（適格機関投資家専用）	2,837,595,431円	2,419,864,847円
すみしん バランス50VA1（適格機関投資家専用）	4,430,092,721円	3,761,762,486円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	15,045,542,807円	12,223,314,037円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,303,091,404円	1,034,400,132円
すみしん バランスA(25)VA1（適格機関投資家専用）	20,748,158,579円	18,979,705,905円
すみしん バランスB(37.5)VA1（適格機関投資家専用）	2,143,566,541円	2,103,728,946円
すみしん バランスC(50)VA1（適格機関投資家専用）	8,292,445,505円	7,201,189,442円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,110,885,235円	4,197,871,532円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,639,148,567円	6,009,197,451円
すみしん バランス D(35)VA1（適格機関投資家専用）	1,846,932,504円	3,222,409,359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）	2,002,453,191円	2,487,378,787円
すみしん バランスE(25)VA1（適格機関投資家専用）	—	2,134,111,821円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,395,644,685円	1,920,041,596円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	2,803,846,089円	7,543,199,285円
2.計算期間末日における受益権の総数	127,492,516,880口	126,462,206,194口

（有価証券に関する注記）

（平成20年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	104,491,272,700	1,793,991,600
地方債証券	9,137,399,893	179,947,322
特殊債券	17,941,857,619	262,611,412
社債券	11,583,502,060	52,619,480
合 計	143,154,032,272	2,289,169,814

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

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
該当事項はありません。	同左

II取引の時価等に関する事項

（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 1.1334円	1口当たり純資産額 = 1.1704円

（3）附属明細表（平成21年9月30日現在）

1）有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	300,000,000	308,709,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	169,540,800	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	148,227,800	
	第103回利付国債（20年）	360,000,000	375,724,800	
	第104回利付国債（20年）	160,000,000	161,956,800	
	第105回利付国債（20年）	450,000,000	454,932,000	
	第106回利付国債（20年）	360,000,000	369,640,800	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	191,970,300	
	第108回利付国債（20年）	560,000,000	548,044,000	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	195,554,000	
	第10回利付国債（30年）	120,000,000	97,024,800	
	第110回利付国債（20年）	520,000,000	525,075,200	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	204,930,000	
	第112回利付国債（20年）	580,000,000	584,889,400	
	第11回利付国債（30年）	40,000,000	36,712,000	

第12回利付国債（30年）	90,000,000	89,146,800	
第13回利付国債（30年）	90,000,000	87,363,000	
第14回利付国債（30年）	140,000,000	146,312,600	
第15回利付国債（20年）	80,000,000	87,550,400	
第15回利付国債（30年）	170,000,000	180,766,100	
第16回利付国債（30年）	170,000,000	180,691,300	
第17回利付国債（30年）	120,000,000	125,210,400	
第18回利付国債（20年）	80,000,000	91,796,800	
第18回利付国債（30年）	120,000,000	122,859,600	
第19回利付国債（30年）	140,000,000	143,120,600	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	44,884,800	
第1回利付国債（40年）	150,000,000	156,903,000	
第20回利付国債（20年）	110,000,000	126,912,500	
第20回利付国債（30年）	190,000,000	201,749,600	
第21回利付国債（30年）	130,000,000	132,822,300	
第225回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,316,896,500	
第226回利付国債（10年）	260,000,000	265,109,000	
第227回利付国債（10年）	260,000,000	265,366,400	
第228回利付国債（10年）	300,000,000	305,754,000	
第229回利付国債（10年）	1,040,000,000	1,058,366,400	
第22回利付国債（20年）	120,000,000	140,108,400	
第22回利付国債（30年）	200,000,000	212,340,000	
第230回利付国債（10年）	340,000,000	344,545,800	
第231回利付国債（10年）	550,000,000	560,191,500	
第232回利付国債（10年）	470,000,000	477,910,100	
第233回利付国債（10年）	710,000,000	724,363,300	
第234回利付国債（10年）	920,000,000	940,893,200	
第235回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,322,714,400	
第236回利付国債（10年）	370,000,000	380,197,200	
第237回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,328,519,400	
第238回利付国債（10年）	410,000,000	421,246,300	
第239回利付国債（10年）	630,000,000	648,780,300	
第23回利付国債（20年）	40,000,000	47,856,800	
第23回利付国債（30年）	120,000,000	127,340,400	
第240回利付国債（10年）	880,000,000	903,865,600	
第241回利付国債（10年）	630,000,000	648,093,600	
第242回利付国債（10年）	260,000,000	266,705,400	
第243回利付国債（10年）	120,000,000	122,743,200	
第244回利付国債（10年）	320,000,000	326,544,000	
第245回利付国債（10年）	570,000,000	579,849,600	
第246回利付国債（10年）	350,000,000	354,994,500	
第247回利付国債（10年）	400,000,000	405,588,000	
第248回利付国債（10年）	70,000,000	70,727,300	
第249回利付国債（10年）	400,000,000	402,932,000	
第24回利付国債（20年）	20,000,000	23,665,600	

第24回利付国債（30年）	200,000,000	212,308,000	
第250回利付国債（10年）	290,000,000	290,846,800	
第251回利付国債（10年）	560,000,000	569,811,200	
第252回利付国債（10年）	440,000,000	449,231,200	
第253回利付国債（10年）	350,000,000	365,725,500	
第254回利付国債（10年）	550,000,000	570,432,500	
第255回利付国債（10年）	340,000,000	353,953,600	
第256回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,287,045,600	
第257回利付国債（10年）	460,000,000	475,557,200	
第258回利付国債（10年）	310,000,000	320,595,800	
第259回利付国債（10年）	1,230,000,000	1,282,754,700	
第25回利付国債（20年）	60,000,000	69,397,200	
第25回利付国債（30年）	250,000,000	255,122,500	
第260回利付国債（10年）	490,000,000	513,603,300	
第261回利付国債（10年）	410,000,000	433,611,900	
第262回利付国債（10年）	480,000,000	509,846,400	
第263回利付国債（10年）	470,000,000	492,987,700	
第264回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,315,553,400	
第265回利付国債（10年）	500,000,000	522,330,000	
第266回利付国債（10年）	460,000,000	478,220,600	
第267回利付国債（10年）	370,000,000	382,691,000	
第268回利付国債（10年）	320,000,000	334,502,400	
第269回利付国債（10年）	1,510,000,000	1,562,110,100	
第26回利付国債（20年）	20,000,000	23,794,600	
第26回利付国債（30年）	280,000,000	291,328,800	
第270回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,117,389,600	
第271回利付国債（10年）	330,000,000	339,517,200	
第272回利付国債（10年）	130,000,000	135,242,900	
第273回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,202,969,000	
第273回利付国債（2年）	530,000,000	533,450,300	
第274回利付国債（10年）	430,000,000	450,063,800	
第274回利付国債（2年）	390,000,000	391,860,300	
第275回利付国債（10年）	230,000,000	239,292,000	
第275回利付国債（2年）	230,000,000	231,177,600	
第276回利付国債（10年）	230,000,000	242,098,000	
第276回利付国債（2年）	610,000,000	612,525,400	
第277回利付国債（10年）	300,000,000	315,795,000	
第277回利付国債（2年）	780,000,000	782,386,800	
第278回利付国債（10年）	330,000,000	351,549,000	
第278回利付国債（2年）	620,000,000	621,959,200	
第279回利付国債（10年）	140,000,000	150,913,000	
第279回利付国債（2年）	270,000,000	270,861,300	
第27回利付国債（20年）	50,000,000	60,722,500	
第27回利付国債（30年）	320,000,000	339,555,200	
第280回利付国債（10年）	830,000,000	889,527,600	

第280回利付国債（2年）	450,000,000	451,440,000	
第281回利付国債（10年）	220,000,000	237,256,800	
第282回利付国債（10年）	800,000,000	846,624,000	
第282回利付国債（2年）	200,000,000	200,300,000	
第283回利付国債（10年）	310,000,000	330,215,100	
第283回利付国債（2年）	960,000,000	961,324,800	
第284回利付国債（10年）	1,970,000,000	2,084,437,300	
第285回利付国債（10年）	1,470,000,000	1,553,775,300	
第286回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,159,018,800	
第287回利付国債（10年）	500,000,000	535,455,000	
第288回利付国債（10年）	1,900,000,000	2,002,467,000	
第289回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,658,160,000	
第28回利付国債（20年）	20,000,000	24,641,400	
第28回利付国債（30年）	240,000,000	254,829,600	
第290回利付国債（10年）	610,000,000	626,091,800	
第292回利付国債（10年）	520,000,000	546,457,600	
第293回利付国債（10年）	410,000,000	433,320,800	
第294回利付国債（10年）	600,000,000	629,100,000	
第295回利付国債（10年）	540,000,000	557,161,200	
第296回利付国債（10年）	1,830,000,000	1,883,545,800	
第297回利付国債（10年）	940,000,000	956,769,600	
第298回利付国債（10年）	1,160,000,000	1,170,579,200	
第299回利付国債（10年）	420,000,000	422,486,400	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	72,224,400	
第29回利付国債（30年）	480,000,000	500,073,600	
第2回利付国債（30年）	60,000,000	63,336,600	
第2回利付国債（40年）	90,000,000	89,245,800	
第300回利付国債（10年）	800,000,000	818,984,000	
第301回利付国債（10年）	1,020,000,000	1,041,613,800	
第302回利付国債（10年）	470,000,000	475,687,000	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	93,922,400	
第30回利付国債（30年）	310,000,000	316,103,900	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	93,780,800	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	59,230,500	
第33回利付国債（20年）	340,000,000	407,503,600	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	59,247,000	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	11,709,300	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	80,617,600	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	81,195,800	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	22,588,800	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	560,615,000	
第3回利付国債（30年）	110,000,000	114,151,400	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	109,473,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	337,972,800	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	89,738,400	

第４３回利付国債（２０年）	140,000,000	160,885,200	
第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	188,948,200	
第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	319,359,600	
第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	183,780,200	
第４７回利付国債（２０年）	150,000,000	161,941,500	
第４８回利付国債（２０年）	150,000,000	166,309,500	
第４９回利付国債（２０年）	30,000,000	31,963,200	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	125,447,300	
第５０回利付国債（２０年）	300,000,000	313,110,000	
第５１回利付国債（２０年）	80,000,000	84,193,600	
第５２回利付国債（２０年）	60,000,000	63,682,800	
第５２回利付国債（５年）	1,160,000,000	1,168,804,400	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	84,733,600	
第５３回利付国債（５年）	510,000,000	515,100,000	
第５４回利付国債（２０年）	150,000,000	160,585,500	
第５４回利付国債（５年）	600,000,000	607,962,000	
第５５回利付国債（２０年）	240,000,000	251,407,200	
第５５回利付国債（５年）	610,000,000	620,748,200	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	156,832,500	
第５６回利付国債（５年）	300,000,000	305,721,000	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	248,126,400	
第５７回利付国債（５年）	550,000,000	560,983,500	
第５８回利付国債（２０年）	80,000,000	82,620,000	
第５８回利付国債（５年）	640,000,000	653,868,800	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	201,302,000	
第５９回利付国債（５年）	460,000,000	468,404,200	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	50,894,500	
第６０回利付国債（２０年）	260,000,000	252,129,800	
第６０回利付国債（５年）	1,870,000,000	1,904,987,700	
第６１回利付国債（２０年）	220,000,000	201,700,400	
第６１回利付国債（５年）	1,000,000,000	1,020,630,000	
第６２回利付国債（２０年）	350,000,000	311,006,500	
第６２回利付国債（５年）	320,000,000	327,305,600	
第６３回利付国債（２０年）	180,000,000	182,404,800	
第６３回利付国債（５年）	910,000,000	930,520,500	
第６４回利付国債（２０年）	260,000,000	266,016,400	
第６４回利付国債（５年）	800,000,000	825,880,000	
第６５回利付国債（２０年）	250,000,000	255,282,500	
第６５回利付国債（５年）	440,000,000	453,054,800	
第６６回利付国債（２０年）	130,000,000	131,111,500	
第６６回利付国債（５年）	1,240,000,000	1,268,160,400	
第６７回利付国債（２０年）	80,000,000	81,524,800	
第６７回利付国債（５年）	300,000,000	308,571,000	
第６８回利付国債（２０年）	140,000,000	148,036,000	
第６８回利付国債（５年）	460,000,000	470,943,400	

第69回利付国債（20年）	70,000,000	73,121,300	
第69回利付国債（5年）	1,410,000,000	1,434,590,400	
第6回利付国債（30年）	70,000,000	73,616,900	
第70回利付国債（20年）	220,000,000	237,978,400	
第70回利付国債（5年）	1,100,000,000	1,115,367,000	
第71回利付国債（20年）	290,000,000	306,158,800	
第71回利付国債（5年）	1,120,000,000	1,154,742,400	
第72回利付国債（20年）	590,000,000	614,113,300	
第72回利付国債（5年）	630,000,000	654,834,600	
第73回利付国債（20年）	200,000,000	205,266,000	
第73回利付国債（5年）	470,000,000	485,096,400	
第74回利付国債（20年）	140,000,000	145,535,600	
第74回利付国債（5年）	480,000,000	490,161,600	
第75回利付国債（20年）	140,000,000	145,252,800	
第75回利付国債（5年）	440,000,000	451,035,200	
第76回利付国債（20年）	240,000,000	242,460,000	
第76回利付国債（5年）	670,000,000	689,409,900	
第77回利付国債（20年）	120,000,000	122,827,200	
第77回利付国債（5年）	420,000,000	428,899,800	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	171,346,400	
第78回利付国債（5年）	390,000,000	396,591,000	
第79回利付国債（20年）	150,000,000	153,297,000	
第7回利付国債（30年）	150,000,000	154,956,000	
第80回利付国債（20年）	210,000,000	217,314,300	
第80回利付国債（5年）	1,100,000,000	1,114,058,000	
第81回利付国債（20年）	70,000,000	71,293,600	
第81回利付国債（5年）	1,590,000,000	1,609,382,100	
第82回利付国債（20年）	520,000,000	537,009,200	
第82回利付国債（5年）	790,000,000	803,066,600	
第83回利付国債（20年）	220,000,000	226,857,400	
第83回利付国債（5年）	220,000,000	223,480,400	
第84回利付国債（20年）	380,000,000	386,623,400	
第84回利付国債（5年）	1,810,000,000	1,822,036,500	
第85回利付国債（20年）	120,000,000	123,549,600	
第86回利付国債（20年）	270,000,000	285,687,000	
第87回利付国債（20年）	230,000,000	240,154,500	
第88回利付国債（20年）	420,000,000	443,553,600	
第89回利付国債（20年）	240,000,000	250,080,000	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	47,006,000	
第90回利付国債（20年）	450,000,000	467,613,000	
第91回利付国債（20年）	220,000,000	231,880,000	
第92回利付国債（20年）	670,000,000	685,155,400	
第93回利付国債（20年）	120,000,000	120,702,000	
第94回利付国債（20年）	540,000,000	550,902,600	
第95回利付国債（20年）	480,000,000	503,433,600	

	第96回利付国債（20年）	190,000,000	193,623,300	
	第97回利付国債（20年）	510,000,000	526,253,700	
	第98回利付国債（20年）	230,000,000	233,811,100	
	第99回利付国債（20年）	640,000,000	649,843,200	
	第9回利付国債（30年）	70,000,000	60,604,600	
	小計	105,480,000,000	108,800,534,100	
地方債証券	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,266,000	
	第116回神奈川県公募公債	14,000,000	14,365,680	
	第124回神奈川県公募公債	10,000,000	10,335,500	
	第12回す号名古屋市長公募公債	100,000,000	105,105,000	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	105,839,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	104,038,662	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	103,983,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,315,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	99,457,000	
	第18回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,614,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,352,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	99,855,000	
	第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,647,000	
	第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,378,000	
	第247回大阪府公募公債（10年）	20,000,000	20,359,200	
	第248回大阪府公募公債（10年）	16,550,000	16,940,083	
	第262回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,875,000	
	第26回1号宮城県公募公債	20,000,000	20,369,800	
	第271回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,801,000	
	第284回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,743,000	
	第28回1号宮城県公募公債	116,000,000	117,140,280	
	第291回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,221,000	
	第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,293,000	
	第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,483,000	
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,504,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,484,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,002,000	
	第3回共同発行市場公募地方債	20,000,000	19,970,400	
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,339,000	
	第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	129,223,200	
	第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,033,000	
	第458回名古屋市長公募公債（10年）	100,000,000	104,892,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	104,681,000	
	第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,101,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	167,140,512	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,441,000	
	第573回東京都公募公債	20,000,000	20,361,800	
	第587回東京都公募公債	10,000,000	10,252,100	
	第588回東京都公募公債	117,000,000	119,999,880	

第591回東京都公募公債	108,000,000	110,226,960	
第593回東京都公募公債	143,000,000	144,588,730	
第5回名古屋市長公募公債（30年）	100,000,000	101,992,000	
第602回東京都公募公債	20,000,000	20,676,200	
第611回東京都公募公債	40,000,000	42,190,800	
第618回東京都公募公債	100,000,000	103,724,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	102,764,000	
第623回東京都公募公債	100,000,000	102,928,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	137,977,110	
第639回東京都公募公債	50,000,000	52,998,500	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	168,795,276	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	101,135,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,894,000	
第75回川崎市公募公債	22,000,000	22,558,360	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	101,885,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	100,255,000	
平成12年度第1回新潟県公募公債	11,000,000	11,199,980	
平成12年度第2回千葉県公募公債	13,000,000	13,241,540	
平成12年度第5回横浜市公募公債	15,000,000	15,278,250	
平成13年度第2回横浜市公募公債	266,000,000	270,889,080	
平成13年度第2回京都府公募公債	10,000,000	10,228,900	
平成13年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	102,364,000	
平成13年度第2回福岡市公募公債	18,000,000	18,349,740	
平成13年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,228,900	
平成14年度第1回愛知県公募公債	20,000,000	20,509,600	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,153,300	
平成14年度第1回仙台市公募公債	20,000,000	20,495,600	
平成14年度第1回千葉市公募公債	100,100,000	102,589,487	
平成14年度第2回愛知県公募公債	120,000,000	123,086,400	
平成14年度第2回埼玉県公募公債	20,040,000	20,533,785	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,023,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,360,562	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	103,305,000	
平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	75,260,379	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,388,000	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	128,068,864	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,335,500	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,805,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,723,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,862,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	156,528,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,858,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	103,015,000	
平成17年度第11回北海道公募公債（5年）	100,000,000	100,535,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	103,849,000	

	平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	208,958,000	
	平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	102,864,000	
	平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,313,000	
	平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	102,753,000	
	平成17年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,719,000	
	平成17年度第4回京都府公募公債	101,810,000	103,006,267	
	平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	103,844,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	105,989,000	
	平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	104,838,000	
	平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,016,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	105,593,000	
	平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	105,550,000	
	平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,377,000	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	104,283,000	
	平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	104,658,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,323,000	
	平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,567,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	204,004,000	
	平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	101,939,000	
	小計	9,090,280,000	9,399,449,167	
特殊債券	い第667号農林債券	100,000,000	100,635,000	
	い第670号農林債券	100,000,000	101,037,000	
	い第671号商工債券	100,000,000	101,828,000	
	い第671号農林債券	200,000,000	203,374,000	
	い第672号商工債券	100,000,000	101,992,000	
	い第672号農林債	100,000,000	101,842,000	
	い第673号商工債	100,000,000	101,993,000	
	い第674号商工債	100,000,000	102,429,000	
	い第676号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,644,000	
	い第676号商工債	100,000,000	101,942,000	
	い第682号農林債	100,000,000	101,827,000	
	い第685号農林債	100,000,000	102,685,000	
	い第689号農林債	100,000,000	102,729,000	
	い第690号農林債	100,000,000	102,153,000	
	い第694号農林債	100,000,000	101,705,000	
	い第695号農林債	100,000,000	101,708,000	
	第105回放送債券	10,000,000	10,168,200	
	第108回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	102,182,000	
	第108号商工債（3年）	100,000,000	101,385,000	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	90,915,000	92,178,718	
	第11回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,288,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,215,000	
	第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	185,469,060	
	第12回都市再生債券	100,000,000	102,399,000	
	第134回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,036,000	

第135回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,702,200	
第13回政府保証国民生活債券	100,000,000	101,388,000	
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	113,862,020	
第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,059,000	
第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,632,000	
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,334,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	97,589,000	98,531,709	
第14回都市再生債券	100,000,000	105,734,000	
第154回政府保証中小企業債券	14,000,000	14,262,640	
第157回政府保証中小企業債券	254,000,000	258,203,700	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	98,558,000	99,173,987	
第171回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,226,320	
第176回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,855,200	
第17回公営企業債券	100,000,000	104,278,000	
第182回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,412,800	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,581,000	
第192回しんきん中金債券	100,000,000	100,702,000	
第1回公営企業債券（5年）	200,000,000	204,282,000	
第1回政府保証新東京国際空港債券	11,000,000	11,303,820	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	208,417,540	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,631,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	104,837,000	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,283,000	
第1回政府保証農林漁業金融公庫債券	12,000,000	12,334,440	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	76,122,000	77,167,155	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,535,000	88,511,459	
第1回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,839,000	
第1回日本鉄道建設債券	100,000,000	102,510,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,033,000	
第203回信金中金債（5年）	100,000,000	102,011,000	
第205回信金中金債（5年）	100,000,000	102,138,000	
第212回信金中金債（5年）	100,000,000	103,128,000	
第214回信金中金債（5年）	100,000,000	102,369,000	
第21回道路債券	100,000,000	105,466,000	
第222回信金中金債（5年）	100,000,000	102,750,000	
第224回信金中金債（5年）	100,000,000	102,981,000	
第226回信金中金債（5年）	100,000,000	102,683,000	
第233回信金中金債（5年）	100,000,000	102,694,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,368,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,329,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,779,000	101,778,918	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,338,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	105,814,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,530,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	154,142,730	

第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	77,824,000	79,900,344	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,244,000	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,906,400	
第312回政府保証道路債券	20,000,000	20,342,600	
第313回政府保証道路債券	100,000,000	102,734,000	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	226,932,750	
第316回政府保証道路債券	120,000,000	120,560,400	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,469,800	
第322回東京交通債券	10,000,000	11,569,100	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	104,002,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	104,093,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	118,702,500	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	107,713,020	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	50,241,120	
第344回東京交通債券	100,000,000	98,024,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	148,253,820	
第346回東京交通債券	20,000,000	18,232,800	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	186,587,470	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,098,000	
第35回政府保証関西国際空港債券	50,000,000	50,846,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	229,196,450	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,891,000	79,704,055	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,210,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,393,000	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,955,000	80,479,794	
第3回公営企業債券	40,000,000	41,015,200	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	9,057,100	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	108,324,070	
第3回政府保証住宅金融公庫債券	25,000,000	25,478,250	
第3回政府保証日本政策投資銀行債券	22,000,000	22,425,700	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,640,000	83,074,521	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,770,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,170,000	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,761,000	82,708,955	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,951,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,673,000	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,368,000	87,343,415	
第4回国際協力銀行債券	120,000,000	123,223,200	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	102,254,000	
第4回政府保証日本政策投資銀行債券	24,000,000	24,463,680	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	81,312,000	82,158,457	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,859,000	89,561,183	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,896,000	86,687,961	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	30,638,700	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	113,295,480	

第５７６回あおぞら債券	100,000,000	99,389,000	
第５回公営企業債券	100,000,000	100,921,000	
第５回新東京国際空港債券	100,000,000	104,702,000	
第５回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	81,641,600	
第５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,900,000	
第５回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	201,240,000	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	63,491,000	63,211,004	
第５回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	201,240,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,107,000	
第６０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,127,000	
第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	188,683,450	
第６回公営企業債券	10,000,000	10,047,700	
第６回国際協力銀行債券	100,000,000	102,125,000	
第６回阪神高速道路債券	100,000,000	103,483,000	
第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	103,704,000	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	138,548,000	142,198,739	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	84,134,000	84,355,272	
第６回都市基盤整備債券	100,000,000	101,359,000	
第７９６回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,942,000	
第７９７回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,196,400	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,052,000	
第７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,651,000	
第７回日本学生支援債券	100,000,000	102,416,000	
第８００回政府保証公営企業債券	187,000,000	190,203,310	
第８０５回政府保証公営企業債券	113,500,000	115,898,255	
第８０８回政府保証公営企業債券	110,000,000	112,367,200	
第８１０回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,523,000	
第８１４回政府保証公営企業債券	122,000,000	125,315,960	
第８１５回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,786,000	
第８１８回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,705,790	
第８２１回政府保証公営企業債券	110,000,000	112,425,500	
第８２７回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,466,000	
第８３６回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,318,200	
第８３９回政府保証公営企業債券	28,000,000	29,153,600	
第８４０回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,596,830	
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,796,000	
第８５５回政府保証公営企業債券	140,000,000	144,313,400	
第８５９回政府保証公営企業債券	131,000,000	136,614,660	
第８６２回政府保証公営企業債券	200,000,000	212,256,000	
第８６６回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,430,000	
第８６７回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,081,000	
第８７２回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,017,000	
第８７４回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,209,000	
第８７５回政府保証公営企業債券	312,000,000	328,083,600	
第８７６回政府保証公営企業債券	122,000,000	130,055,660	

	第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,273,000	
	第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,873,600	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,895,000	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	70,893,000	72,272,577	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	87,227,000	88,310,359	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,594,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,314,000	
	第99号商工債（3年）	200,000,000	201,782,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	103,608,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	71,498,000	73,070,956	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,596,000	
	小計	16,624,295,000	17,099,060,533	
社債券	第102回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,900,000	
	第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,540,000	
	第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	102,202,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債（2003）	200,000,000	182,576,000	
	第11回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	97,196,000	
	第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,920,000	
	第12回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,137,000	
	第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	202,986,000	
	第14回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,314,000	
	第14回メルリリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	97,466,000	
	第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	105,243,000	
	第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,630,000	
	第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	203,706,000	
	第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,117,000	
	第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,278,000	
	第17回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,190,000	
	第17回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,126,000	
	第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	99,411,000	
	第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,146,000	
	第1回A号日本生命2009基金特定目的会社特定社債（一般担保付）	100,000,000	100,594,000	
	第1回みずほ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,734,000	
	第1回ラポバンク円貨社債	100,000,000	98,979,000	
	第1回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,696,000	
	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	203,452,000	
	第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,273,000	
	第20回三菱重工株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,522,000	
	第21回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,658,000	
	第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,886,000	
	第23回住友商事株式会社無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,940,000	
	第248回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	119,364,000	
	第24回シャープ株式会社無担保社債社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,938,000	
	第24回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,896,000	
	第24回三井不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,952,000	

第24回日立キャピタル株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,999,000	
第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,165,000	
第261回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	31,000,000	34,831,910	
第264回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	10,174,200	
第26回日本郵船株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,013,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,924,000	
第285回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,815,000	
第286回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,908,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,290,000	
第29回韓国産業銀行円貨債券（期限前償還権条項付）	100,000,000	100,111,000	
第2回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債（2008）	100,000,000	102,158,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	306,588,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,491,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・リース株式会社無担保社債	100,000,000	101,633,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,646,000	
第316回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,502,000	
第337回中国電力株式会社社債（一般担保付）	130,000,000	133,402,100	
第346回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,849,000	
第35回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,785,000	
第360回九州電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	20,361,400	
第362回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,534,000	
第363回九州電力株式会社社債（一般担保付）	12,000,000	12,243,960	
第376回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	116,866,000	
第380回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	117,496,000	
第382回東北電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	22,973,800	
第383回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	113,379,000	
第387回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,870,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,381,000	
第3回フランス電力円貨社債（2009）	200,000,000	200,536,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	103,502,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	203,902,000	
第402回東北電力株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	10,163,800	
第405回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	59,084,500	
第408回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,458,000	
第408回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	58,511,000	
第425回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,922,000	
第425回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	120,283,000	
第431回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,693,000	
第451回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,816,000	
第455回東京電力株式会社社債（一般担保付）	120,000,000	127,797,600	
第459回東京電力株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	11,186,300	
第462回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,230,000	
第463回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,926,000	
第464回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,589,000	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,275,000	

第４６回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	102,271,000	
第４７３回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,534,000	
第４７４回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,540,000	
第４７７回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,019,000	
第４８０回東京電力株式会社社債（一般担保付）	13,000,000	13,226,330	
第４８３回東京電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	20,351,200	
第４８９回東京電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	20,419,400	
第４９５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	205,336,000	
第４９８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,922,000	
第４回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,969,000	
第４回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,976,000	
第４回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,828,000	
第５０１回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	30,402,900	
第５０５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	30,241,200	
第５１０回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,253,000	
第５１８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,963,000	
第５１回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,794,000	
第５２１回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,632,000	
第５２８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,578,000	
第５３６回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,693,000	
第５３回三井物産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,564,000	
第５４２回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,925,000	
第５４４回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,930,000	
第５４回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	104,768,000	
第５５回新日本製鐵株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,366,000	
第５回アフラック・インコーポレーテッド円貨社債（２００７）	100,000,000	94,842,000	
第５回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,522,000	
第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,620,000	
第７回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,229,000	
第７回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	104,769,000	
第７回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	97,458,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,059,800	
第８２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,688,000	
第８回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,707,000	
第８回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,132,000	
第９回株式会社日興コーディアルグループ無担保社債	100,000,000	96,969,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	19,000,000	20,186,550	
第９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,484,000	
小計	11,615,000,000	11,992,401,950	
合計	142,809,575,000	147,291,445,750	

２）信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

３）デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年 9月30日現在)	(平成21年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	743,885,834	1,784,284,167
コール・ローン	73,370,356	123,580,968
株式	95,543,131,351	114,391,945,390
新株予約権証券	—	510,011
投資信託受益証券	415,036,700	215,804,940
投資証券	1,477,855,671	1,474,105,309
派生商品評価勘定	2,593,062	8,623,066
未収配当金	176,930,396	155,603,271
未収利息	871	269
差入委託証拠金	3,952,435,889	681,797,044
流動資産合計	102,385,240,130	118,836,254,435
資産合計	102,385,240,130	118,836,254,435
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	337,430,442	12,826,643
未払解約金	43,925,394	36,733,607
流動負債合計	381,355,836	49,560,250
負債合計	381,355,836	49,560,250
純資産の部		
元本等		
元本	103,220,867,299	137,441,585,574
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△1,216,983,005	△18,654,891,389
元本等合計	102,003,884,294	118,786,694,185
純資産合計	102,003,884,294	118,786,694,185
負債純資産合計	102,385,240,130	118,836,254,435

(注) 「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクションS50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成20年9月30日及び平成21年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
--	----------------------------------	----------------------------------

1.資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 — (2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (3) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (4) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。 —	(1) 株式 同左 (2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (3) 投資信託受益証券 同左 (4) 投資証券 同左 (5) 先物取引 同左 (6) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。
------------------------	---	--

2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。	同左
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。	受取配当金 受取配当金は、原則として、株式・投資信託受益証券・投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	(平成20年9月30日現在)	(平成21年9月30日現在)
1.期首元本額	78,056,776,791円	103,220,867,299円
期中追加設定元本額	35,849,894,421円	84,318,124,033円
期中一部解約元本額	10,685,803,913円	50,097,405,758円
期末元本額	103,220,867,299円	137,441,585,574円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	190,468,084円	427,603,020円
SBI資産設計オープン（分配型）	34,390,572円	38,617,430円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	2,113,872,176円	8,728,632,321円
世界経済インデックスファンド	—	109,965,432円
すみしん マイセクション25	33,660,707円	42,997,098円
すみしん マイセクション50	99,050,594円	136,762,135円
すみしん マイセクション75	102,854,623円	122,328,795円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,143,908,831円	1,370,810,459円
すみしん DCマイセクション25	483,455,243円	734,867,845円
すみしん DCマイセクション50	2,984,089,688円	4,489,192,809円
すみしん DCマイセクション75	3,191,565,438円	4,242,576,125円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	2,243,100,753円	3,138,818,926円
すみしん DCマイセクションS25	10,648,916円	31,878,439円
すみしん DCマイセクションS50	117,475,857円	308,351,845円
すみしん DCマイセクションS75	108,309,874円	274,835,572円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	4,179,488円	8,183,613円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,433,340円	10,303,300円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	486,519円	7,821,445円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	300,002円	2,385,235円
すみしん DCマルチアセット ファンド	121,823円	157,212円
STAM 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	719,519,150円	2,285,575,423円
すみしん マイセクション50 V A 1（適格機関投資家専用）	309,871,854円	359,925,091円

すみしん マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	162,343,799円	187,651,383円
すみしん 外国株式インデックス・オープンVA1 （適格機関投資家専用）	746,551,562円	713,742,558円
すみしん マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	3,197,617円	2,783,887円
すみしん バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,465,837,101円	1,781,087,546円
すみしん バランス50VA1（適格機関投資家専用）	5,639,871,112円	6,418,743,484円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,756,386,094円	17,236,862,551円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	4,379,455,190円	5,004,073,268円
すみしん バランスA(25)VA1（適格機関投資家専用）	5,389,067,029円	7,036,524,679円
すみしん バランスB(37.5)VA1（適格機関投資家専用）	1,388,932,341円	1,925,301,294円
すみしん バランスC(50)VA1（適格機関投資家専用）	9,314,083,017円	12,288,388,192円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	20,044,849,675円	23,261,698,926円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	21,359,609,888円	10,913,146,714円
すみしん バランスD(35)VA1（適格機関投資家専用）	866,336,035円	2,347,392,307円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 （適格機関投資家専用）	1,188,251,319円	1,835,002,100円
すみしん バランスE(25)VA1（適格機関投資家専用）	—	413,711,067円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,312,434,207円	1,492,277,970円
住信 グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	385,582,424円	383,733,128円
住信 FOFs用外国株式インデックス・オープン （適格機関投資家専用）	925,315,357円	7,483,239,642円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	—	9,843,635,308円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 1,216,983,005円下回っており ます。	純資産額は、元本を 18,654,891,389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	103,220,867,299口	137,441,585,574口

（有価証券に関する注記）

（平成20年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	95,543,131,351	△23,836,940,795
投資信託受益証券	415,036,700	△107,232,856
投資証券	1,477,855,671	△219,055,056
合 計	97,436,023,722	△24,163,228,707

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

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

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

合 計	116,082,365,650	16,900,927,523
-----	-----------------	----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

(自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
1.取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行うことができます。 当ファンドの利用することができるデリバティブ取引は、先物取引（わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引、通貨に係る市場デリバティブ取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引）、スワップ取引、為替先渡取引、外国為替予約取引であります。 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 当ファンドのデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクがあります。デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。 3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 同左 3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左

II 取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	(平成20年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 FUTU	2,669,928,438	—	2,462,324,965	△207,603,473
	S&P/TSE 60	202,546,915	—	185,890,950	△16,655,965
	SPI 200 FUTU	172,172,783	—	170,780,564	△1,392,219
	FTSE 100	623,030,768	—	576,022,431	△47,008,337
	SWISS MKT IX	288,208,449	—	267,273,200	△20,935,249
	DJ EURO STOXX	896,496,995	—	855,254,862	△41,242,133
合 計		4,852,384,348	—	4,517,546,972	△334,837,376

区分	種 類	(平成21年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 FUTU	1,318,617,613	—	1,308,360,735	△10,256,878
	S&P/TSE 60	228,250,628	—	225,834,423	△2,416,205
	SPI 200 FUTU	156,516,486	—	159,635,406	3,118,920
	FTSE 100	351,987,306	—	355,073,928	3,086,621
	SWISS MKT IX	82,382,784	—	82,482,938	100,154
	DJ EURO STOXX	498,540,442	—	500,746,752	2,206,311
合 計		2,636,295,259	—	2,632,134,182	△4,161,077

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

1. 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等および時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。

通貨関連

区分	種 類	(平成20年 9月30日現在)				(平成21年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評価損益 (円)	契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超				うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	アメリカドル	—	—	—	—	45,142,500	—	45,100,000	△42,500
合 計		—	—	—	—	45,142,500	—	45,100,000	△42,500

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
 - ② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち該当日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しています。

(関連当事者との取引に関する注記)

（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 0.9882円	1口当たり純資産額 = 0.8643円

（3）附属明細表（平成21年9月30日現在）

1）有価証券明細表

①株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	3 M COMPANY	47,434	73.94	3,507,269.96	
	ABBOTT LABORATORIES	103,972	49.10	5,105,025.20	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,546	33.27	117,975.42	
	ACCENTURE PLC-CL A	46,766	37.25	1,742,033.50	
	ACE LTD	22,249	53.41	1,188,319.09	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	47,557	12.42	590,657.94	
	ADOBE SYSTEMS INC	33,801	32.68	1,104,616.68	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,975	39.19	234,160.25	
	ADVANCED MICRO DEVICES	42,360	5.78	244,840.80	
	AES CORP	46,748	15.24	712,439.52	
	AETNA INC	31,085	28.25	878,151.25	
	AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	5,350	55.32	295,962.00	
	AFLAC	37,463	42.83	1,604,540.29	
	AGCO CORP	5,243	27.57	144,549.51	
	AGILENT TECHNOLOGIES	26,933	27.90	751,430.70	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	15,015	78.11	1,172,821.65	
	AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	19,213	20.25	389,063.25	
	ALCOA	70,971	13.31	944,624.01	
	ALLEGHENY ENERGY INC	8,487	26.94	228,639.78	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	5,607	35.34	198,151.38	
	ALLERGAN INC	19,312	57.00	1,100,784.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,905	61.70	302,638.50	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,459	28.22	182,272.98	

ALLSTATE CORP	32,522	30.94	1,006,230.68	
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,400	35.53	298,452.00	
ALTERA CORPORATION	15,751	20.36	320,690.36	
ALTRIA GROUP INC	141,618	17.90	2,534,962.20	
AMAZON.COM	22,726	91.72	2,084,428.72	
AMEREN CORPORATION	17,978	25.82	464,191.96	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	8,779	16.96	148,891.84	
AMERICAN ELECTRIC POWER	29,219	31.05	907,249.95	
AMERICAN EXPRESS	71,331	33.99	2,424,540.69	
AMERICAN TOWER-A	29,224	36.39	1,063,461.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,415	32.34	401,501.10	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,054	21.98	418,806.92	
AMETEK INC	6,324	35.38	223,743.12	
AMGEN	71,502	60.46	4,323,010.92	
AMPHENOL CORPORATION	15,600	37.45	584,220.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	33,113	63.20	2,092,741.60	
ANALOG DEVICES	16,404	27.28	447,501.12	
AON CORP	19,492	41.24	803,850.08	
APACHE CORP	22,190	91.53	2,031,050.70	
APOLLO GROUP INC-CLA	9,023	72.61	655,160.03	
APPLE INC	61,199	185.38	11,345,070.62	
APPLIED MATERIALS	103,861	13.28	1,379,274.08	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,762	68.06	187,981.72	
ARCH COAL INC	6,304	22.33	140,768.32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	38,774	28.20	1,093,426.80	
ASSURANT INC	7,478	32.15	240,417.70	
AT&T INC	401,543	27.20	10,921,969.60	
AUTODESK INC	23,346	24.20	564,973.20	
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,885	39.37	1,255,312.45	
AUTOZONE INC	2,291	145.98	334,440.18	
AVERY DENNISON CORP	9,057	36.56	331,123.92	
AVNET INC	10,554	26.10	275,459.40	
AVON PRODUCTS INC	33,942	33.59	1,140,111.78	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,070	30.41	397,458.70	
BAKER HUGHES	23,331	43.03	1,003,932.93	
BALL CORP	7,916	49.87	394,770.92	
BANK NEW YORK CO	81,743	29.33	2,397,522.19	
BANK OF AMERICA CORP	591,608	17.16	10,151,993.28	
BARD C R INC	7,190	78.41	563,767.90	
BAXTER INTERNATIONAL	42,248	56.79	2,399,263.92	
BB&T CORP	51,658	27.43	1,416,978.94	

BECKMAN COULTER INC	2,819	69.44	195,751.36	
BECTON DICKINSON & CO	18,491	70.37	1,301,211.67	
BED BATH & BEYOND INC	20,272	37.63	762,835.36	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	733	3,341.00	2,448,953.00	
BEST BUY COMPANY INC	22,784	37.86	862,602.24	
BIOGEN IDEC INC	20,268	51.41	1,041,977.88	
BJ SERVICES CO	28,083	19.52	548,180.16	
BLACK & DECKER CORP	5,232	46.50	243,288.00	
BLOCK H & R INC	26,761	18.57	496,951.77	
BMC SOFTWARE	13,788	37.90	522,565.20	
BOEING CO	45,000	54.62	2,457,900.00	
BORGWARNER INC	6,419	30.68	196,934.92	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	113,833	10.68	1,215,736.44	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	133,424	22.88	3,052,741.12	
BROADCOM CORP-CL A	27,954	29.73	831,072.42	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,782	48.70	184,183.40	
BUNGE LIMITED	9,564	61.88	591,820.32	
BURLINGTON NTHN SANTA FE	23,221	80.93	1,879,275.53	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,741	57.50	790,107.50	
CA INC	31,854	22.34	711,618.36	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,540	23.96	324,418.40	
CABOT OIL & GAS CORP	5,110	35.74	182,631.40	
CALPINE CORP	28,138	11.86	333,716.68	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	13,570	38.11	517,152.70	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,508	32.91	510,368.28	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,962	35.29	1,057,358.98	
CARDINAL HEALTH	26,413	26.90	710,509.70	
CAREFUSION CORP	13,206	21.99	290,399.94	
CARMAX INC	14,025	20.82	292,000.50	
CATERPILLAR	44,238	51.60	2,282,680.80	
CBS CORP-CL B	51,773	12.41	642,502.93	
CELANESE CORP-SERIES A	5,171	25.44	131,550.24	
CELGENE CORP	31,396	55.11	1,730,233.56	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,188	12.60	178,768.80	
CENTURYTEL INC	18,042	33.78	609,458.76	
CEPHALON INC	4,382	58.13	254,725.66	
CERNER CORP	6,383	73.97	472,150.51	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,587	85.84	222,068.08	
CHARLES RIVER LABORATORIES	6,659	37.09	246,982.31	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,681	28.59	1,277,429.79	
CHEVRON CORP	135,743	70.91	9,625,536.13	

CHUBB CORPORATION	26,556	50.85	1,350,372.60	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,024	56.40	452,553.60	
CIGNA CORP	13,044	28.60	373,058.40	
CIMAREX ENERGY CO	4,193	42.70	179,041.10	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,776	26.10	385,653.60	
CINTAS CORP	7,308	30.52	223,040.16	
CISCO SYSTEMS	397,800	23.30	9,268,740.00	
CITIGROUP	1,104,155	4.70	5,189,528.50	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	38.47	401,780.68	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,027	33.05	529,692.35	
CLOROX COMPANY	11,660	58.52	682,343.20	
CME GROUP INC	4,336	305.68	1,325,428.48	
COACH INC	25,683	33.08	849,593.64	
COCA-COLA CO	141,032	53.31	7,518,415.92	
COCA-COLA ENTERPRISES	15,702	21.03	330,213.06	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,209	38.79	861,487.11	
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,276	76.55	2,623,827.80	
COMCAST CORP-CL A	141,986	17.38	2,467,716.68	
COMCAST CORP-SPECIAL A	56,313	16.53	930,853.89	
COMERICA INC	6,937	29.82	206,861.34	
COMPUTER SCIENCES CORP	14,198	53.25	756,043.50	
CONAGRA	28,112	21.84	613,966.08	
CONOCOPHILLIPS	95,359	45.22	4,312,133.98	
CONSOL ENERGY INC	15,572	45.32	705,723.04	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,151	41.29	666,874.79	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,171	15.35	202,174.85	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	15,742	32.53	512,087.26	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	8,702	37.43	325,715.86	
CORNING	112,959	15.18	1,714,717.62	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,940	56.49	1,634,820.60	
COVANCE INC	3,077	54.59	167,973.43	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,122	19.94	201,832.68	
COVIDIEN PLC	32,787	42.87	1,405,578.69	
CROWN CASTLE INTL CORP	22,701	31.29	710,314.29	
CSX CORP	27,022	43.07	1,163,837.54	
CUMMINS INC	15,013	44.48	667,778.24	
CVS CAREMARK CORPORATION	100,807	36.07	3,636,108.49	
DANAHER CORP	17,231	67.38	1,161,024.78	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,691	36.15	278,029.65	
DAVITA INC	6,455	56.18	362,641.90	
DEAN FOODS CO	15,400	17.78	273,812.00	

DEERE&CO	28,199	43.20	1,218,196.80	
DELL INC	124,446	15.17	1,887,845.82	
DELTA AIR LINES INC	12,000	9.20	110,400.00	
DENBURY RESOURCES INC	25,598	15.01	384,225.98	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,288	34.50	216,936.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	27,847	67.67	1,884,406.49	
DEVRY INC	4,732	54.97	260,118.04	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,830	96.32	368,905.60	
DIRECTV GROUP INC	37,577	27.48	1,032,615.96	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,849	15.97	412,808.53	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	15,466	25.67	397,012.22	
DISH NETWORK CORPORATION-A	9,617	19.29	185,511.93	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,192	38.03	273,511.76	
DOLLAR TREE INC	4,494	48.17	216,475.98	
DOMINION RESOURCES	39,527	34.73	1,372,772.71	
DONNELLEY (RR) & SONS	9,177	21.46	196,938.42	
DOVER CORP	17,323	38.66	669,707.18	
DOW CHEMICAL CO	79,712	26.35	2,100,411.20	
DR HORTON INC	12,142	11.87	144,125.54	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	23,218	28.55	662,873.90	
DST SYSTEMS INC	2,801	45.63	127,809.63	
DTE ENERGY COMPANY	11,642	35.58	414,222.36	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	60,885	32.52	1,979,980.20	
DUKE ENERGY CORP	87,830	15.86	1,392,983.80	
DUN & BRADSTREET CORP	5,041	74.82	377,167.62	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,165	55.05	229,283.25	
EATON CORP	14,039	57.50	807,242.50	
EBAY	81,224	23.87	1,938,816.88	
ECOLAB INC	15,315	45.89	702,805.35	
EDISON INTL	23,626	33.95	802,102.70	
EL PASO CORP	38,373	10.48	402,149.04	
ELECTRONIC ARTS INC	26,678	19.14	510,616.92	
EMC CORP	138,773	17.02	2,361,916.46	
EMERSON ELECTRIC CO	50,047	40.12	2,007,885.64	
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,821	65.02	183,421.42	
ENSCO INTERNATIONAL	8,157	42.73	348,548.61	
ENTERGY CORP	12,184	80.46	980,324.64	
EOG RESOURCES INC	18,885	81.64	1,541,771.40	
EQT CORPORATION	7,431	42.90	318,789.90	
EQUIFAX INC	11,358	29.12	330,744.96	
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,408	36.71	492,207.68	

EVEREST RE GROUP LTD	4,962	88.99	441,568.38	
EXELON CORP	44,360	50.10	2,222,436.00	
EXPEDIA INC	8,366	23.87	199,696.42	
EXPEDITORS INTL WASH INC	17,335	35.00	606,725.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	17,966	77.92	1,399,910.72	
EXXON MOBIL	336,825	69.07	23,264,502.75	
FAMILY DOLLAR STORES	13,686	25.95	355,151.70	
FASTENAL CO	7,628	38.81	296,042.68	
FEDEX CORP	18,559	75.04	1,392,667.36	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,524	15.47	224,686.28	
FIDERITY NATIONAL INFORMATIO	12,615	25.40	320,421.00	
FIFTH THIRD BANCORP	42,747	9.94	424,905.18	
FIRST AMERICAN CORPORATION	10,809	33.41	361,128.69	
FIRST SOLAR INC	3,146	152.05	478,349.30	
FIRSTENERGY CORP	20,133	46.15	929,137.95	
FISERV INC	14,260	47.96	683,909.60	
FLEXTRONICS INTL LTD	38,648	7.19	277,879.12	
FLIR SYSTEMS INC	6,143	28.06	172,372.58	
FLOWSERVE CORP	3,048	97.85	298,246.80	
FLUOR CORP	10,916	51.06	557,370.96	
FMC TECHNOLOGIES INC	7,192	52.81	379,809.52	
FORD MOTOR COMPANY	195,356	7.45	1,455,402.20	
FOREST LABORATORIES INC	24,089	29.71	715,684.19	
FORTUNE BRANDS INC	14,594	43.48	634,547.12	
FOSTER WHEELER AG	7,970	31.69	252,569.30	
FPL GROUP	25,260	55.14	1,392,836.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,535	101.25	1,269,168.75	
FREEPORT-MCMOR-B	28,608	68.32	1,954,498.56	
GAMESTOP CORP-CLASS A	13,385	26.79	358,584.15	
GAP	38,076	21.45	816,730.20	
GARMIN LTD	5,605	37.57	210,579.85	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,953	64.47	1,479,779.91	
GENERAL ELECTRIC CO	732,473	16.71	12,239,623.83	
GENERAL MILLS INC	21,943	63.57	1,394,916.51	
GENUINE PARTS CO	16,220	37.60	609,872.00	
GENZYME CORP	18,028	56.95	1,026,694.60	
GILEAD SCIENCES INC	61,908	46.48	2,877,483.84	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,246	183.58	5,919,720.68	
GOODRICH CORP	10,643	53.79	572,486.97	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,638	17.09	215,983.42	
GOOGLE INC-CL A	16,422	498.53	8,186,859.66	

GRAINGER (WW) INC	5,017	89.74	450,225.58	
HALLIBURTON CO	57,555	27.31	1,571,827.05	
HANSEN NATURAL CORPORATION	2,571	36.76	94,509.96	
HARLEY-DAVIDSON	13,114	22.89	300,179.46	
HARRIS CORP	7,133	37.70	268,914.10	
HARSCO CORP	8,300	35.03	290,749.00	
HARTFORD FINANCIAL SUCS	26,575	27.44	729,218.00	
HASBRO INC	6,411	27.53	176,494.83	
HEINZ (H.J) CO	22,322	39.78	887,969.16	
HELMERICH & PAYNE	5,096	39.64	202,005.44	
HENRY SCHEIN INC	3,983	55.07	219,343.81	
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,258	39.05	361,524.90	
HESS CORP	19,594	53.70	1,052,197.80	
HEWLETT-PACKARD CO	164,474	47.44	7,802,646.56	
HOLOGIC INC	14,356	16.61	238,453.16	
HOME DEPOT	117,385	26.83	3,149,439.55	
HONEYWELL INTL INC	49,050	37.25	1,827,112.50	
HORMEL FOODS CORP	7,863	35.69	280,630.47	
HOSPIRA INC	14,718	44.82	659,660.76	
HUDSON CITY BANCORP INC	36,142	13.21	477,435.82	
HUMANA INC	10,030	38.02	381,340.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,494	43.09	1,270,896.46	
ILLUMINA INC	7,572	42.10	318,781.20	
IMS HEALTH INC	23,255	15.54	361,382.70	
INGERSOLL-RAND PLC	26,014	31.08	808,515.12	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,217	36.31	153,119.27	
INTEL CORP	390,255	19.48	7,602,167.40	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,788	95.04	550,091.52	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	18,645	7.59	141,515.55	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	92,299	118.81	10,966,044.19	
INT'L GAME TECHNOLOGY	16,833	21.40	360,226.20	
INT'L PAPER CO	27,292	22.77	621,438.84	
INTUIT INC	23,674	28.25	668,790.50	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,734	256.59	701,517.06	
INVESCO PLC	27,215	22.10	601,451.50	
IRON MOUNTAIN INC	15,113	27.17	410,620.21	
ITT CORPORATION	12,627	52.33	660,770.91	
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	2,733	110.05	300,766.65	
J.C. PENNEY CO INC	12,308	33.71	414,902.68	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,540	46.51	443,705.40	
JM SMUCKER CO	11,126	53.98	600,581.48	

JOHNSON & JOHNSON	184,561	60.93	11,245,301.73	
JOHNSON CONTROLS INC	39,165	25.94	1,015,940.10	
JOY GLOBAL INC	4,753	49.19	233,800.07	
JPMORGAN CHASE & CO	257,090	44.88	11,538,199.20	
JUNIPER NETWORKS INC	42,419	26.55	1,126,224.45	
KBR INC	8,033	23.32	187,329.56	
KELLOGG CO	18,640	49.45	921,748.00	
KEY CORP	40,412	6.55	264,698.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,696	57.62	1,653,463.52	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	4,685	47.36	221,881.60	
KLA-TENCOR CORP	8,767	35.35	309,913.45	
KOHL'S CORP	22,157	56.39	1,249,433.23	
KRAFT FOODS INC-A	99,328	26.02	2,584,514.56	
KROGER CO	50,589	20.68	1,046,180.52	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,951	81.15	726,373.65	
LABORATORY CRP OF AMER	7,180	65.88	473,018.40	
LAM RESEARCH CORP	15,561	33.57	522,382.77	
LEGG MASON INC	6,964	31.43	218,878.52	
LEGGETT & PLATT INC	18,913	19.54	369,560.02	
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,281	24.78	329,103.18	
LIBERTY GLOBAL INC-A	7,254	23.14	167,857.56	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	12,091	22.94	277,367.54	
LIBERTY MEDIA CORP-ENTERTAINMENT SER A	31,731	30.91	980,805.21	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	22,303	11.04	246,225.12	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	16,542	46.27	765,398.34	
LILLY (ELI) & CO	73,367	33.42	2,451,925.14	
LIMITED	13,735	17.15	235,555.25	
LINCOLN NATIONAL CORP	22,628	26.02	588,780.56	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,243	27.50	611,682.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,736	79.05	1,797,280.80	
LOEWS CORP	27,741	34.44	955,400.04	
LORILLARD INC	11,999	74.74	896,805.26	
LOWES COMPANIES	107,587	21.21	2,281,920.27	
LSI CORP	29,582	5.46	161,517.72	
LUBRIZOL CORP	4,700	71.91	337,977.00	
M & T BANK CORP	5,689	62.47	355,391.83	
MACY'S INC	20,360	18.26	371,773.60	
MANPOWER INC	3,337	57.94	193,345.78	
MARATHON OIL CORP	47,555	32.10	1,526,515.50	
MARRIOTT INTL A	24,374	27.27	664,678.98	

MARSH & MCLENNAN COS	35,470	24.80	879,656.00	
MARSHALL & ILSLEY CORP	10,286	8.28	85,168.08	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,111	94.20	387,256.20	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	33,238	15.92	529,148.96	
MASCO CORP	17,549	13.39	234,981.11	
MASTERCARD INC-CLASS A	5,884	206.74	1,216,458.16	
MATTEL INC	20,665	18.38	379,822.70	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,262	17.75	430,650.50	
MCAFEE INC	12,216	43.25	528,342.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,802	34.05	367,808.10	
MCDERMOTT INTL INC	12,068	25.87	312,199.16	
MCDONALD'S CORP	82,509	57.17	4,717,039.53	
MCGRAW-HILL COS	26,317	26.11	687,136.87	
MCKESSON CORP	18,873	58.78	1,109,354.94	
MDU RESOURCES GROUP INC	13,224	20.87	275,984.88	
MEADWESTVACO CORP	16,500	23.26	383,790.00	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	35,784	56.05	2,005,693.20	
MEDTRONIC	76,064	37.14	2,825,016.96	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	10,541	16.55	174,453.55	
MERCK & CO	144,508	31.85	4,602,579.80	
METLIFE INC	55,297	38.59	2,133,911.23	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	10,957	9.62	105,406.34	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,110	26.32	529,295.20	
MICRON TECHNOLOGY	41,085	8.40	345,114.00	
MICROSOFT CORP	550,676	25.75	14,179,907.00	
MILLIPORE CORP	3,637	70.95	258,045.15	
MIRANT CORP	9,569	16.63	159,132.47	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,000	48.59	97,180.00	
MOLSON COORS BREWING CO —B	10,378	48.66	504,993.48	
MONSANTO CO	37,765	77.23	2,916,590.95	
MOODY'S CORP	11,832	20.81	246,223.92	
MORGAN STANLEY	82,732	31.09	2,572,137.88	
MOSAIC CO/THE	11,889	48.77	579,826.53	
MOTOROLA	155,786	8.41	1,310,160.26	
MURPHY OIL CORP	14,351	58.10	833,793.10	
MYLAN INC	20,715	16.15	334,547.25	
NABORS INDUSTRIES LTD	14,725	20.67	304,365.75	
NASDAQ OMX GROUP	6,109	21.34	130,366.06	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	25,837	43.11	1,113,833.07	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CO	10,576	14.33	151,554.08	
NETAPP INC	26,201	26.15	685,156.15	

NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,543	11.36	324,248.48	
NEWELL RUBBERMAID	30,166	15.62	471,192.92	
NEWFIELD EXPLORATION CO	7,866	42.20	331,945.20	
NEWMONT MINING CORP	33,308	43.73	1,456,558.84	
NEWS CORP -CLASS A	105,026	11.90	1,249,809.40	
NEWS CORP -CLASS B	44,011	13.98	615,273.78	
NII HOLDINGS INC	15,979	30.12	481,287.48	
NIKE B	28,399	60.09	1,706,495.91	
NISOURCE INC	28,405	13.91	395,113.55	
NOBLE CORP	20,806	37.76	785,634.56	
NOBLE ENERGY INC	14,158	66.46	940,940.68	
NORDSTROM INC	9,299	30.75	285,944.25	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,634	43.85	1,124,050.90	
NORTHEAST UTILITIES	9,301	24.00	223,224.00	
NORTHERN TRUST CORP	14,743	58.45	861,728.35	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,653	52.75	1,036,695.75	
NRG ENERGY INC	11,265	28.57	321,841.05	
NSTAR	6,269	32.07	201,046.83	
NUCOR CORP	20,331	46.80	951,490.80	
NVIDIA CORP	47,284	14.56	688,455.04	
NYSE EURONEXT	18,884	28.74	542,726.16	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,868	78.29	4,452,195.72	
OMNICARE INC	8,264	22.91	189,328.24	
OMNICOM GROUP	24,535	37.90	929,876.50	
ONEOK INC	9,996	36.70	366,853.20	
ORACLE CORP	273,696	21.12	5,780,459.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,072	36.17	328,134.24	
OWENS-ILLINOIS INC	14,238	37.24	530,223.12	
PACCAR INC	25,070	37.97	951,907.90	
PACTIV CORPORATION	7,982	26.54	211,842.28	
PALL CORP	9,890	32.95	325,875.50	
PARKER HANNIFIN CORP	14,412	52.91	762,538.92	
PARTNERRE LTD	3,488	77.66	270,878.08	
PATTERSON COMPANIES INC	4,686	27.43	128,536.98	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	5,004	14.99	75,009.96	
PAYCHEX INC	25,091	28.85	723,875.35	
PEABODY ENERGY CORP	21,117	37.47	791,253.99	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	31,782	15.79	501,837.78	
PEPCO HOLDINGS INC	22,432	15.03	337,152.96	
PEPSI BOTTLING GROUP INC	14,771	36.44	538,255.24	
PEPSIAMERICAS INC	10,509	28.52	299,716.68	

PEPSICO INC	104,848	58.51	6,134,656.48	
PERRIGO CO	9,997	33.53	335,199.41	
PETROHAWK ENERGY CORP	25,129	23.97	602,342.13	
PETSMART INC	16,301	21.88	356,665.88	
PFIZER	455,905	16.77	7,645,526.85	
PG&E CORP	25,184	40.93	1,030,781.12	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	12,728	21.81	277,597.68	
PHILIP MORRIS INTERNAT	136,023	48.72	6,627,040.56	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,587	33.03	184,538.61	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,540	36.36	274,154.40	
PITNEY BOWES INC	19,594	25.12	492,201.28	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	7,152	27.64	197,681.28	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,667	47.99	1,567,689.33	
POLO RALPH LAUREN CORP	5,758	77.38	445,554.04	
PPG INDUSTRIES INC	8,909	58.74	523,314.66	
PPL CORPORATION	26,415	30.66	809,883.90	
PRAXAIR INC	19,451	81.00	1,575,531.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	10,821	102.87	1,113,156.27	
PRICE T ROWE GROUP INC	18,463	45.96	848,559.48	
PRICELINE.COM INC	1,825	167.00	304,775.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	8,258	30.80	254,346.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,608	27.83	573,520.64	
PROCTER & GAMBLE CO	197,118	57.91	11,415,103.38	
PROGRESS ENERGY INC	17,783	39.32	699,227.56	
PROGRESSIVE CORP	46,881	16.74	784,787.94	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,962	49.96	1,646,781.52	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,134	31.62	1,079,317.08	
PULTE HOMES INC	23,502	11.37	267,217.74	
QUALCOMM	111,589	45.50	5,077,299.50	
QUANTA SERVICES INC	9,788	22.90	224,145.20	
QUEST DIAGNOSTICS	9,549	52.26	499,030.74	
QUESTAR CORP	13,644	37.59	512,877.96	
QWEST COMMUNI. INT'L	127,570	3.74	477,111.80	
RALCORP HOLDINGS INC	3,259	59.27	193,160.93	
RANGE RESOURCES CORP	12,122	49.81	603,796.82	
RAYTHEON COMPANY	25,435	48.30	1,228,510.50	
REGIONS FINL CORP	59,525	6.45	383,936.25	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,182	55.26	396,877.32	
REPUBLIC SERVICES INC	23,520	26.75	629,160.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	13,981	45.13	630,962.53	
ROBERT HALF INTL INC	14,803	25.50	377,476.50	

ROCKWELL AUTOMATION INC	15,323	42.82	656,130.86	
ROCKWELL COLLIN	9,217	50.63	466,656.71	
ROPER INDUSTRIES INC	5,535	51.45	284,775.75	
ROSS STORES INC	11,464	48.09	551,303.76	
ROWAN COMPANIES INC	15,609	23.27	363,221.43	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,783	24.24	140,179.92	
SAFEWAY INC	27,342	19.81	541,645.02	
SAIC INC	20,507	17.43	357,437.01	
SALESFORCE.COM INC	6,953	57.16	397,433.48	
SANDISK CORP	10,986	21.76	239,055.36	
SARA LEE CORP	60,162	10.97	659,977.14	
SCANA CORP	10,661	35.30	376,333.30	
SCHERING-PLOUGH CORP	114,483	28.13	3,220,406.79	
SCHLUMBERGER	80,759	60.42	4,879,458.78	
SCHWAB (CHARLES) CORP	64,082	19.27	1,234,860.14	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,147	15.16	396,388.52	
SEALED AIR CORP	7,400	19.89	147,186.00	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,100	65.80	203,980.00	
SEMPRA ENERGY	18,158	50.16	910,805.28	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,549	60.26	454,902.74	
SIGMA-ALDRICH	12,068	53.99	651,551.32	
SLM CORP	24,967	8.91	222,455.97	
SMITH INTERNATIONAL INC	15,332	29.19	447,541.08	
SOUTHERN CO	55,840	31.97	1,785,204.80	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,575	9.66	53,854.50	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,771	42.31	1,048,061.01	
SPECTRA ENERGY CORP	43,626	19.14	835,001.64	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	205,733	4.04	831,161.32	
SPX CORP	2,708	61.94	167,733.52	
ST JUDE MEDICAL INC	24,710	39.74	981,975.40	
STAPLES INC	47,917	23.26	1,114,549.42	
STARBUCKS CORP	60,024	20.38	1,223,289.12	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,446	32.66	406,486.36	
STATE STREET CORP	33,026	52.66	1,739,149.16	
STERICYCLE INC	4,579	48.51	222,127.29	
STRYKER CORP	19,281	45.63	879,792.03	
SUN MICROSYSTEMS INC	61,490	9.05	556,484.50	
SUNOCO INC	9,912	27.96	277,139.52	
SUNPOWER CORP-CLASS A	6,170	30.44	187,814.80	
SUNTRUST BANKS	31,651	22.55	713,730.05	
SUPERVALU INC	9,130	15.20	138,776.00	

SYMANTEC CORP	62,232	16.02	996,956.64	
SYNOPSYS INC	16,933	22.97	388,951.01	
SYSCO CORP	41,749	24.95	1,041,637.55	
TARGET (DAYTON HUDSON)	50,358	47.28	2,380,926.24	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,038	20.06	502,262.28	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS, INC	4,655	31.23	145,375.65	
TERADATA CORP	18,128	27.77	503,414.56	
TEXAS INSTRUMENTS	88,034	23.55	2,073,200.70	
TEXTRON	11,892	18.71	222,499.32	
THE STANLEY WORKS	9,366	42.48	397,867.68	
THE WALT DISNEY CO	118,545	27.94	3,312,147.30	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,335	43.61	1,453,739.35	
TIFFANY & CO	6,367	38.33	244,047.11	
TIM HORTONS INC	18,657	28.39	529,672.23	
TIME WARNER CABLE-A	24,854	43.75	1,087,362.50	
TIME WARNER INC	80,304	29.23	2,347,285.92	
TJX COMPANIES INC	33,444	37.00	1,237,428.00	
TOLL BROTHERS INC	13,598	19.96	271,416.08	
TORCHMARK CORP	6,355	43.96	279,365.80	
TRANSOCEAN LTD	21,907	85.54	1,873,924.78	
TRAVELERS COS INC/THE	43,203	48.96	2,115,218.88	
TYCO ELECTRONICS LTD	34,925	22.08	771,144.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	33,105	34.15	1,130,535.75	
TYSON FOODS INC	18,584	12.62	234,530.08	
ULTRA PETROLEUM CORP	12,456	49.10	611,589.60	
UNION PACIFIC CORP	33,783	59.14	1,997,926.62	
UNITED HEALTHCARE CORP	86,681	25.68	2,225,968.08	
UNITED PARCEL SERVICE B	49,463	56.78	2,808,509.14	
UNITED STATES STEEL CORP	10,830	45.56	493,414.80	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,661	61.31	3,473,885.91	
UNUM GROUP	26,499	21.69	574,763.31	
URS CORP	7,501	44.08	330,644.08	
US BANCORP	129,110	21.75	2,808,142.50	
VALERO ENERGY CORP	43,571	19.46	847,891.66	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,586	42.06	361,127.16	
VERISIGN INC	20,216	22.96	464,159.36	
VERIZON COMMUNICATIONS	190,933	30.16	5,758,539.28	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,915	37.79	412,477.85	
VF CORP	6,032	73.20	441,542.40	
VIACOM INC-CLASS B	38,693	28.24	1,092,690.32	
VIRGIN MEDIA INC	19,536	13.33	260,414.88	

VISA INC-CLASS A SHARES	32,775	69.57	2,280,156.75	
VMWARE INC-CLASS A	3,534	39.52	139,663.68	
VULCAN MATERIALS CO	9,076	54.63	495,821.88	
WALGREEN CO	66,831	37.35	2,496,137.85	
WAL-MART STORES	157,194	49.23	7,738,660.62	
WASHINGTON POST -CL B	379	471.32	178,630.28	
WASTE MANAGEMENT INC	31,640	30.00	949,200.00	
WATERS CORP	5,383	55.40	298,218.20	
WEATHERFORD INTL LTD	46,437	21.14	981,678.18	
WELLPOINT INC	33,407	49.28	1,646,296.96	
WELLS FARGO & CO	298,392	28.35	8,459,413.20	
WESTERN DIGITAL CORP	12,687	36.17	458,888.79	
WESTERN UNION CO	56,152	19.26	1,081,487.52	
WEYERHAEUSER CO	12,597	37.38	470,875.86	
WHIRLPOOL CORP	4,577	70.30	321,763.10	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	1,216	307.00	373,312.00	
WHOLE FOODS MKT INC	6,046	30.36	183,556.56	
WILLIAMS COS	45,429	18.17	825,444.93	
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	8,355	28.26	236,112.30	
WINDSTREAM CORP	25,612	9.80	250,997.60	
WISCONSIN ENERGY CORP	12,999	45.58	592,494.42	
WR BERKLEY CORP	12,367	25.26	312,390.42	
WYETH	90,873	48.65	4,420,971.45	
WYNN RESORTS LTD	3,477	73.25	254,690.25	
XCEL ENERGY INC	24,991	19.56	488,823.96	
XEROX CORP	48,261	7.92	382,227.12	
XILINX INC	26,445	23.20	613,524.00	
XL CAPITAL LTD	24,000	17.35	416,400.00	
XTO ENERGY INC	37,011	41.85	1,548,910.35	
YAHOO	94,927	17.45	1,656,476.15	
YUM BRANDS INC	30,516	32.78	1,000,314.48	
ZIMMER HOLDINGS INC	17,477	53.60	936,767.20	
小計	21,163,518		674,744,210.92 (60,868,675,267)	

カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES	11,282	71.56	807,339.92	
	AGRIUM INC	11,876	54.40	646,054.40	
	BANK MONTREAL	34,815	54.07	1,882,447.05	
	BANK NOVA SCOTIA	69,206	48.94	3,386,941.64	
	BARRICK GOLD CORP	58,102	40.67	2,363,008.34	
	BCE INC	19,827	26.41	523,631.07	
	BIOVAIL CORPORATION	4,923	16.10	79,260.30	
	BOMBARDIER B	76,905	4.93	379,141.65	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	43,454	24.69	1,072,879.26	
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	13,706	12.14	166,390.84	
	CAE INC	39,723	9.00	357,507.00	
	CAMECO CORP	27,391	29.75	814,882.25	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	29,714	65.84	1,956,369.76	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,527	53.16	1,675,975.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,692	72.50	2,587,670.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,346	57.25	306,058.50	
	CP RAILWAY LIMITED	9,120	50.67	462,110.40	
	ELDORADO GOLD CORP	37,288	11.98	446,710.24	
	ENBRIDGE	24,955	41.30	1,030,641.50	
	ENCANA CORP	52,541	62.64	3,291,168.24	
	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	19,559	16.59	324,483.81	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,439	412.50	593,587.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	5,505	68.68	378,083.40	
	FORTIS INC	20,279	24.99	506,772.21	
	GERDAU AMERISTEEL CORP	6,476	8.65	56,017.40	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,688	21.29	142,387.52	
	GOLDCORP INC	52,896	43.28	2,289,338.88	
	GREAT-WEST LIFECO INC	28,523	26.79	764,131.17	
	HUSKY ENERGY INC	22,863	30.25	691,605.75	
	IAMGOLD CORP	23,046	14.99	345,459.54	
	IGM FINANCIAL INC	8,085	42.23	341,429.55	
	IMPERIAL OIL	24,590	40.77	1,002,534.30	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,121	29.88	362,175.48	
	INMET MINING CORPORATION	2,135	58.35	124,577.25	
	IVANHOE MINES LTD	17,000	13.92	236,640.00	
	KINROSS GOLD CORP	43,707	23.43	1,024,055.01	
	LOBLAW COMPANIES LTD	13,560	31.50	427,140.00	
	MAGNA INTERNATIONAL A	10,485	46.38	486,294.30	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	114,944	22.46	2,581,642.24	
	METRO INC -A	6,203	35.32	219,089.96	

	NATIONAL BANK OF CANADA	12,306	60.45	743,897.70	
	NEXEN INC	40,693	24.61	1,001,454.73	
	NIKO RESOURCES LTD	2,317	83.10	192,542.70	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,822	98.60	2,053,049.20	
	POWER CORP OF CANADA	32,040	29.55	946,782.00	
	POWER FINANCIAL CORP	19,663	30.52	600,114.76	
	RESEARCH IN MOTION	36,232	73.41	2,659,791.12	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,750	30.24	990,360.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	96,222	57.50	5,532,765.00	
	SAPUTO INC	12,443	25.57	318,167.51	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,343	19.37	432,783.91	
	SHERITT INTERNATIONAL CORP	17,548	7.53	132,136.44	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	12,366	44.25	547,195.50	
	SILVER WHEATON CORP	15,580	13.30	207,214.00	
	SINO-FOREST CORPORATION	5,455	16.85	91,916.75	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	14,546	48.41	704,171.86	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	36,836	33.35	1,228,480.60	
	SUNCOR ENERGY	106,657	37.20	3,967,640.40	
	TALTSMAN ENERGY INC	72,957	18.77	1,369,402.89	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	31,360	29.60	928,256.00	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	17,177	33.20	570,276.40	
	THOMSON REUTERS CORP	24,748	36.26	897,362.48	
	TORONTO-DOMINION BANK	57,704	69.49	4,009,850.96	
	TRANSALTA CORP	13,808	21.68	299,357.44	
	TRANSCANADA CORP	46,461	33.20	1,542,505.20	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	10,603	13.74	145,685.22	
	VITERRA INC	34,567	10.49	362,607.83	
	YAMANA GOLD INC	56,928	11.31	643,855.68	
小計		1,980,629		70,253,257.23 (5,849,286,196)	
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	28,437	13.70	389,586.90	
	ALUMINA LIMITED	88,029	1.85	162,853.65	
	AMCOR	88,785	5.46	484,766.10	
	AMP LTD	156,171	6.43	1,004,179.53	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,795	5.11	65,382.45	
	ARROW ENERGY LTD	88,325	4.23	373,614.75	
	ASCIANO GROUP	190,000	1.64	312,550.00	
	ASX LTD	19,593	34.75	680,856.75	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	160,923	24.73	3,979,625.79	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	69,022	4.25	293,343.50	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	9,635	9.19	88,545.65	

BHP BILLITON LTD	233,761	37.99	8,880,580.39	
BLUESCOPE STEEL LTD	203,266	2.96	601,667.36	
BORAL LIMITED	86,788	6.01	521,595.88	
BRAMBLES LTD	101,968	8.32	848,373.76	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	5,372	12.24	65,753.28	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	63,697	9.93	632,511.21	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	103,165	52.10	5,374,896.50	
COMPUTERSHARE LIMITED	63,114	11.20	706,876.80	
CROWN LTD	30,964	8.70	269,386.80	
CSL LIMITED	44,929	33.75	1,516,353.75	
CSR LIMITED	230,417	1.89	435,488.13	
FAIRFAX MEDIA LTD	232,284	1.68	391,398.54	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	68,760	3.90	268,164.00	
FOSTERS GROUP LTD	125,781	5.65	710,662.65	
INCITEC PIVOT LTD	146,018	2.82	411,770.76	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	132,776	3.81	505,876.56	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	6,945	36.91	256,339.95	
LEND LEASE	16,796	10.65	178,877.40	
MACQUARIE GROUP LIMITED	23,489	57.53	1,351,322.17	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP	122,870	1.50	184,305.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	133,842	31.22	4,178,547.24	
NEWCREST MINING LIMITED	30,054	31.93	959,624.22	
NUFARM LTD	28,542	11.45	326,805.90	
ONESTEEL LIMITED	181,031	3.04	550,334.24	
ORICA LTD	36,134	23.99	866,854.66	
ORIGIN ENERGY LIMITED	70,297	16.23	1,140,920.31	
OZ MINERALS LTD	219,000	1.12	246,375.00	
PALADIN ENERGY LIMITED	69,601	4.46	310,420.46	
QANTIS AIRWAYS LIMITED	72,702	2.83	205,746.66	
QBE INSURANCE GROUP	75,426	24.38	1,838,885.88	
RIO TINTO LTD	28,810	59.67	1,719,092.70	
SANTOS	49,534	15.05	745,486.70	
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	9,732	22.50	218,970.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	28,774	13.88	399,383.12	
SP AUSNET	374,271	0.86	323,744.41	
SUNCORP-METWAY LIMITED	96,090	8.70	835,983.00	
TABCORP HOLDINGS	36,079	7.13	257,243.27	
TATTS GROUP LTD	68,739	2.47	169,785.33	
TELSTRA CORP	294,127	3.26	958,854.02	
TOLL HOLDINGS LIMITED	36,909	8.56	315,941.04	
TRANSURBAN GROUP	66,950	4.09	273,825.50	

	WESFARMERS LIMITED	78,827	26.49	2,088,127.23	
	WESFARMERS LTD-PPP	5,050	26.49	133,774.50	
	WESTPAC BANKING	200,659	26.43	5,303,417.37	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,743	51.90	1,803,161.70	
	WOOLWORTHS LTD	86,833	29.33	2,546,811.89	
	WORLEYPARSONS LTD	8,741	29.66	259,258.06	
小計		5,376,372		60,924,880.37 (4,810,628,554)	
イギリスポンド	3I GROUP PLC	66,128	2.86	189,655.10	
	AMEC PLC	16,811	7.62	128,099.82	
	ANGLO AMERICAN PLC	92,780	20.43	1,895,959.30	
	ANTOFAGASTA PLC	19,564	7.55	147,806.02	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,157	8.42	253,921.94	
	ASTRAZENECA	98,297	28.35	2,786,719.95	
	AUTONOMY CORP PLC	15,441	16.36	252,614.76	
	AVIVA PIC	181,247	4.31	781,537.06	
	BAE SYSTEMS PLC	245,504	3.44	845,024.76	
	BARCLAYS	771,914	3.69	2,850,292.44	
	BG GROUP	222,461	10.95	2,435,947.95	
	BHP BILLITTON PLC	150,019	17.28	2,592,328.32	
	BP PLC	1,262,047	5.58	7,053,580.68	
	BRITISH AIRWAYS	18,593	2.16	40,272.43	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	138,675	19.85	2,752,698.75	
	BRITISH SKY BROADCASTING	92,795	5.74	533,107.27	
	BT GROUP PLC	485,141	1.30	634,806.99	
	CABLE & WIRELESS	173,953	1.43	249,622.55	
	CADBURY PLC	90,499	7.99	723,087.01	
	CAIRN ENERGY PLC	13,575	27.40	371,955.00	
	CAPITA GROUP PLC	59,867	7.23	432,838.41	
	CARNIVAL PLC	17,356	21.74	377,319.44	
	CENTRICA PLC	351,364	2.53	892,113.19	
	COBHAM PLC	81,313	2.16	175,636.08	
	COMPASS GROUP PLC	146,403	3.72	545,204.77	
	DIAGEO	157,525	9.66	1,522,479.12	
	DRAX GROUP PLC	33,208	4.72	156,741.76	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	14,320	8.63	123,581.60	
	EXPERIAN PLC	61,085	5.27	322,223.37	
	FIRSTGROUP PLC	28,507	4.24	121,069.22	
	FRESNILLO PLC	24,532	7.75	190,123.00	
	FRIENDS PROVIDENT PLC	124,255	0.84	104,995.47	
	G4S PLC	83,681	2.22	186,524.94	

GLAXOSMITHKLINE	349,696	12.43	4,346,721.28	
HOME RETAIL GROUP	60,978	2.80	170,738.40	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,189,258	7.25	8,631,634.56	
ICAP PLC	60,261	4.26	256,711.86	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	69,168	17.97	1,242,948.96	
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,581	8.25	120,293.25	
INTERNATIONAL POWER PLC	127,632	2.96	378,045.98	
INVENSYS PLC	40,482	2.92	118,369.36	
INVESTEC PLC	17,043	4.52	77,136.61	
KAZAKHMYS PLC	10,504	10.74	112,812.96	
KINGFISHER PLC	159,840	2.08	333,426.24	
LADBROKES PLC	72,990	1.89	138,462.03	
LEGAL & GENERAL GROUP	411,506	0.82	340,521.21	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,043,309	1.04	1,093,387.83	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,152	8.42	85,530.60	
LONMIN PLC	7,466	16.48	123,039.68	
MAN GROUP PLC	95,601	3.08	294,546.68	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,508	3.74	436,671.98	
MORRISON SUPERMARKETS	174,252	2.78	485,291.82	
NATIONAL GRID PLC	167,956	6.01	1,009,415.56	
NEXT PLC	18,970	18.50	350,945.00	
OLD MUTUAL PLC	453,122	1.00	453,122.00	
PEARSON	67,203	7.77	522,167.31	
PETROFAC LTD	14,000	9.92	138,950.00	
PRUDENTIAL	168,874	5.98	1,010,710.89	
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,208	43.20	311,385.60	
RECKITT BENCKISER PLC	39,491	30.56	1,206,844.96	
REED ELSEVIER PLC	85,192	4.73	403,724.88	
REXAM	58,992	2.61	153,969.12	
RIO TINTO PLC REG	95,920	26.70	2,561,543.60	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	136,686	4.75	650,488.67	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,098,475	0.52	571,207.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	241,740	18.04	4,362,198.30	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	189,060	17.55	3,318,003.00	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	186,940	1.30	243,208.94	
SABMILLER PLC	70,362	15.18	1,068,095.16	
SAGE GROUP PLC	115,664	2.28	264,292.24	
SAINSBURY (J) PLC	91,670	3.26	299,394.22	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	57,346	11.64	667,507.44	
SERCO GROUP PLC	31,787	5.06	161,001.15	
SEVERN TRENT PLC	22,688	9.65	219,052.64	

	SHIRE PLC	46,042	10.92	502,778.64	
	SMITH & NEPHEW PLC	70,804	5.57	394,732.30	
	SMITHS GROUP PLC	26,047	8.38	218,273.86	
	STANDARD CHARTERED PLC	138,227	15.35	2,121,784.45	
	STANDARD LIFE PLC	204,595	2.13	436,196.54	
	TESCO	579,211	3.96	2,295,992.40	
	THOMAS COOK GROUP PLC	18,352	2.40	44,191.61	
	TOMKINS PLC	73,790	1.92	141,971.96	
	TULLOW OIL PLC	60,133	11.55	694,536.15	
	UNILEVER PLC	82,809	17.72	1,467,375.48	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	57,208	4.54	260,124.77	
	VEDANTA RESOURCES PLC	6,800	19.19	130,492.00	
	VODAFONE GROUP PLC	3,530,539	1.41	4,995,712.68	
	WHITBREAD PLC	22,168	12.30	272,666.40	
	WOLSELEY PLC	17,526	14.52	254,477.52	
	WPP PLC	92,790	5.44	504,777.60	
	XSTRATA PLC	126,188	9.21	1,162,191.48	
小計		17,972,819		87,301,683.28 (12,580,172,560)	
スイスフラン	ABB LTD	155,706	20.86	3,248,027.16	
	ACTELION LTD-REG	6,648	64.30	427,466.40	
	ADECCO	12,284	55.05	676,234.20	
	BALOISE HOLDING-REG	3,080	98.55	303,534.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	38,934	29.34	1,142,323.56	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	79,402	57.60	4,573,555.20	
	GEBERIT AG-REG	2,657	156.30	415,289.10	
	GIVAUDAN-REG	650	782.00	508,300.00	
	HOLCIM LTD	18,465	70.50	1,301,782.50	
	JULIUS BAER HOLDING AG-REG	13,317	51.35	683,827.95	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,646	89.35	593,820.10	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,085	18.93	153,049.05	
	LONZA GROUP AG-REG	4,895	114.20	559,009.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	238,491	44.08	10,512,683.28	
	NOBEL BIOCARE HLDGS AG-REG	15,037	34.08	512,460.96	
	NOVARTIS	139,298	51.30	7,145,987.40	
	PARGESA HOLDING SA-BR	4,001	87.95	351,887.95	
	ROCHE HOLDING GENUSS	48,320	168.90	8,161,248.00	
	SGS SA	321	1,388.00	445,548.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,693	105.60	389,980.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,390	268.50	373,215.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	3,539	240.00	849,360.00	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,964	118.60	232,930.40	
	SWISS RE-REG	22,358	46.52	1,040,094.16	
	SWISSCOM	2,184	374.50	817,908.00	
	SYNGENTA AG	6,503	236.00	1,534,708.00	
	SYNTHES INC	3,640	123.70	450,268.00	
	UBS AG-REG	249,768	19.20	4,795,545.60	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,585	243.30	2,575,330.50	
小計		1,101,861		54,775,374.27 (4,770,387,345)	
香港ドル	BANK EAST ASIA	105,160	27.90	2,933,964.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	216,000	17.12	3,697,920.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	100,000	98.00	9,800,000.00	
	CLP HOLDINGS	134,500	52.00	6,994,000.00	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	67,800	52.00	3,525,600.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	116,000	38.05	4,413,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	133,000	27.75	3,690,750.00	
	HANG SENG BANK	53,200	109.80	5,841,360.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	84,000	49.40	4,149,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	333,390	19.00	6,334,410.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	82,300	141.50	11,645,450.00	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	80,500	42.05	3,385,025.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	172,000	55.70	9,580,400.00	
	LI & FUNG	202,400	30.95	6,264,280.00	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	160,000	2.72	435,200.00	
	MTR CORP	135,000	26.50	3,577,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	190,000	16.42	3,119,800.00	
	NWS HOLDINGS LTD	73,000	14.76	1,077,480.00	
	PCCW LTD	190,000	2.00	380,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	194,000	14.58	2,828,520.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	114.60	12,033,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	63,500	89.00	5,651,500.00	
	WHARF HOLDINGS	178,000	39.75	7,075,500.00	
小計		3,168,750		118,435,059.00 (1,378,584,086)	

シンガポールドル	CAPITALAND LTD	160,500	3.68	590,640.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	67,000	10.28	688,760.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	27,000	1.22	32,940.00	
	DBS GROUP	110,000	13.10	1,441,000.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	837,000	0.43	359,910.00	
	KEPPEL CORP LTD	123,000	8.17	1,004,910.00	
	NOBLE GROUP LTD	140,000	2.47	345,800.00	
	OCBC BANK	164,000	7.75	1,271,000.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	116,000	2.48	287,680.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	131,000	3.35	438,850.00	
	SINGAPORE AIRLINES	64,533	13.50	871,195.50	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	53,000	8.34	442,020.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	190,000	3.76	714,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	496,243	3.21	1,592,940.03	
	UNITED OVERSEAS BANK	99,000	16.64	1,647,360.00	
	UOL GROUP LIMITED	67,300	3.39	228,147.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	59,000	6.51	384,090.00	
小計		2,904,576		12,341,642.53 (786,039,212)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,671	8.45	343,669.95	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	100,769	2.63	265,022.47	
小計		141,440		608,692.42 (39,425,008)	
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	44,762	83.00	3,715,246.00	
	ASSA ABLOY B	20,871	113.80	2,375,119.80	
	ATLAS COPCO A	88,793	90.40	8,026,887.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,899	162.25	2,579,612.75	
	ERICSSON (LM) B	197,401	70.70	13,956,250.70	
	HENNES & MAURITZ B	34,318	392.00	13,452,656.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,801	47.60	1,037,727.60	
	INVESTOR AB-B SHS	29,092	127.00	3,694,684.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	30,081	55.90	1,681,527.90	
	MILlicom INTL CELLULAR-SDR	3,678	511.00	1,879,458.00	
	NORDEA BANK AB	231,900	70.70	16,395,330.00	
	SANDVIK AB	76,861	77.90	5,987,471.90	
	SCA SV CELLULOSA B	29,385	93.60	2,750,436.00	
	SECURITAS B	16,078	68.80	1,106,166.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	87,952	47.70	4,195,310.40	
	SKANSKA B	45,732	104.50	4,778,994.00	
	SSAB AB-A SHS	8,042	109.50	880,599.00	

	SSAB AB-B SHS	7,164	100.00	716,400.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	39,150	179.00	7,007,850.00	
	SWEDBANK AB-A	20,650	65.75	1,357,737.50	
	SWEDBANK AB-A-RIGHTS	20,650	13.30	274,645.00	
	SWEDISH MATCH AB	22,946	139.00	3,189,494.00	
	TELE2 AB-B SHS	32,642	93.90	3,065,083.80	
	TELIASONERA AB	157,677	45.70	7,205,838.90	
	VOLVO A	40,798	64.00	2,611,072.00	
	VOLVO B	86,874	66.00	5,733,684.00	
小計		1,411,197		119,655,282.85 (1,541,160,043)	
ノルウェークローネ	DNB NOR ASA	37,683	68.10	2,566,212.30	
	NORSK HYDRO	74,592	37.82	2,821,069.44	
	ORKLA	48,060	54.00	2,595,240.00	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	8,799	48.86	429,919.14	
	SEADRILL LTD	15,470	116.20	1,797,614.00	
	STATOILHYDRO ASA	86,829	130.80	11,357,233.20	
	TELENOR ASA	72,599	66.70	4,842,353.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,974	179.10	3,040,043.40	
小計		361,006		29,449,684.78 (455,586,623)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	39	34,000.00	1,326,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	72	35,000.00	2,520,000.00	
	CARLSBERG AS-B	6,802	363.00	2,469,126.00	
	DANSKE BANK A/S	37,439	131.00	4,904,509.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	31,748	321.75	10,214,919.00	
	NOVOZYMES A/S	3,520	478.75	1,685,200.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	15,093	367.75	5,550,450.75	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,057	367.00	754,919.00	
小計		96,770		29,425,123.75 (520,824,690)	
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	30,766	15.43	474,719.38	
	ACCIONA SA	3,728	94.00	350,432.00	
	ACCOR	10,500	37.94	398,422.50	
	ACEA SPA	16,258	8.70	141,539.22	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	13,951	36.00	502,236.00	
	ADIDAS AG	12,936	35.91	464,531.76	
	ADP	3,832	62.67	240,151.44	
	AEGON	91,751	5.74	526,834.24	
	AEM SPA	155,506	1.34	209,051.38	
	AHOLD (KON.)	84,369	8.24	695,200.56	

AIR FRANCE-KLM	5,870	12.34	72,465.15	
AIR LIQUIDE	15,412	78.81	1,214,619.72	
AKZO NOBEL	19,048	42.13	802,492.24	
ALCATEL-LUCENT	122,138	3.13	382,414.07	
ALLIANZ SE-REG	32,026	83.83	2,684,739.58	
ALPHA BANK	20,921	12.78	267,370.38	
ALSTOM RGPT	14,834	50.62	750,897.08	
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	45,054	0.00	0.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	50,946	31.10	1,584,675.33	
ARCELORMITTAL	58,950	25.98	1,531,815.75	
ASML HOLDING NV	30,266	20.10	608,346.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	70,978	18.59	1,319,588.19	
ATLANTIA SPA	22,274	16.75	373,115.11	
ATOS ORIGIN	5,184	34.16	177,111.36	
AXA	112,020	17.98	2,014,119.60	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	152,990	1.44	220,507.54	
BANCA POPOLARE DI MILANO	23,667	5.17	122,506.07	
BANCO BILBAO VIZCAYA	235,630	12.34	2,908,852.35	
BANCO DE SABADELL SA	72,060	4.97	358,498.50	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	48,447	4.83	233,999.01	
BANCO POPOLARE SPA	51,421	6.70	344,747.98	
BANCO POPULAR ESPANOL	52,378	6.83	358,003.63	
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	573,992	11.14	6,394,270.88	
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	66,301	5.30	351,395.30	
BASF SE	65,652	36.07	2,368,067.64	
BAYER	51,441	48.84	2,512,378.44	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,782	33.68	834,657.76	
BEIERSDORF AG	7,607	39.91	303,595.37	
BELGACOM	10,340	26.81	277,267.10	
BIOMERIEUX	2,565	74.97	192,298.05	
BNP PARIBAS	58,045	57.90	3,360,805.50	
BOUYGUES ORD	19,053	34.80	663,044.40	
BRISA	53,742	6.89	370,497.34	
BUREAU VERITAS SA	3,882	38.06	147,768.33	
CAP GEMINI SA	10,890	35.82	390,134.25	
CARREFOUR	47,981	31.23	1,498,446.63	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,113	54.20	168,724.60	
CELESIO AG	11,471	18.80	215,654.80	
CHRISTIAN DIOR	4,084	67.66	276,323.44	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	8,365	16.23	135,763.95	

CINTRA CONCESIONES DE INFRAE	17,008	8.13	138,360.08	
CNP ASSURANCES	1,483	71.10	105,441.30	
CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE	2,944	37.02	108,986.88	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	10,048	18.10	181,868.80	
COLRUYT SA	1,757	159.90	280,944.30	
COMMERZBANK AG	60,719	8.79	533,720.01	
CREDIT AGRICOLE SA	70,644	14.39	1,016,567.16	
CRH	55,849	19.04	1,063,755.90	
CRITERIA CAIXACORP SA	78,496	3.48	273,558.56	
DAIMLER AG	65,951	34.30	2,262,119.30	
DANONE (GROUPE)	40,244	40.50	1,629,882.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,239	38.30	162,353.70	
DELHAIZE GROUP	9,287	47.61	442,154.07	
DEUTSCHE BANK NAMEN	40,627	53.70	2,181,873.03	
DEUTSCHE BOERSE	13,721	56.48	774,962.08	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	13,444	12.10	162,739.62	
DEUTSCHE POST AG-REG	59,428	12.85	763,649.80	
DEUTSCHE POSTBANK AG	3,844	24.25	93,217.00	
DEUTSCHE TELEKOM	190,203	9.45	1,797,418.35	
DEXIA	38,440	6.25	240,519.08	
E.ON AG	122,993	29.23	3,595,085.39	
EFG EUROBANK ERGASIAS	15,905	10.66	169,547.30	
ELAN CORPORATION PLC	33,000	4.95	163,383.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	14,088	40.38	568,873.44	
ELISA A	17,883	14.13	252,686.79	
ENAGAS	21,654	14.20	307,486.80	
ENEL	417,607	4.32	1,807,227.70	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	130,587	3.10	405,472.63	
ENI	172,756	17.13	2,959,856.18	
ERAMET	276	230.75	63,687.00	
ERSTE GROUP BANK AG	12,153	30.14	366,291.42	
ESSILOR INTERNATIONAL	16,454	38.62	635,453.48	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	34,952	14.97	523,231.44	
FIAT ORD	50,706	8.73	443,149.65	
FINMECCANICA SPA	36,873	11.97	441,554.17	
FORTIS GROUP	156,334	3.15	492,452.10	
FORTUM OYJ	33,799	17.43	589,116.57	
FRANCE TELECOM	132,149	18.52	2,447,399.48	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,845	33.91	469,483.95	
FRESENIUS SE-PFD	5,950	39.43	234,608.50	

FUGRO NV-CVA	2,322	39.40	91,486.80	
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	17,343	15.46	268,122.78	
GAS NATURAL SDG SA	15,954	14.79	235,959.66	
GDF SUEZ	82,365	30.22	2,489,070.30	
GEA GROUP AG	7,328	14.32	104,936.96	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,233	63.70	460,742.10	
HEINEKEN HOLDING NV	6,244	28.00	174,832.00	
HEINEKEN NV	17,641	31.65	558,337.65	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	15,126	11.40	172,436.40	
HENKEL AG & CO KGAA	13,069	24.86	324,895.34	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,404	29.37	276,195.48	
HERMES INTERNATIONAL	2,942	100.60	295,965.20	
HOCHTIEF AG	1,512	52.91	79,999.92	
IBERDROLA RENOVABLES	111,457	3.34	372,266.38	
IBERDROLA SA	266,194	6.71	1,786,161.74	
ILIAD SA	2,551	76.75	195,789.25	
INDITEX	15,717	40.03	629,151.51	
INFINEON TECHNOLOGIES	76,000	3.67	278,920.00	
ING GROEP	141,036	11.83	1,668,455.88	
INTESA SANPAOLO	534,486	3.02	1,618,717.57	
INTESA SANPAOLO-RNC	107,572	2.40	258,217.98	
IPSEN	4,764	37.82	180,174.48	
JERONIMO MARTINS	45,898	5.98	274,470.04	
K+S AG	12,064	36.83	444,317.12	
KBC GROEP NV	14,067	34.61	486,858.87	
KERRY GROUP PLC-A	10,002	19.50	195,039.00	
KESKO OYJ-B SHS	5,286	22.88	120,943.68	
KONE OYJ-B	6,847	25.46	174,324.62	
KONINKLIJKE DSM NV	14,528	28.21	409,834.88	
KPN (KON.)	119,217	11.44	1,364,438.56	
LAFARGE (FRANCE)	14,579	61.18	891,943.22	
LAGADERE S.C.A	6,212	32.75	203,443.00	
LINDE AG	9,219	74.95	690,964.05	
LOREAL	17,539	67.94	1,191,599.66	
LVMH	18,230	69.11	1,259,875.30	
MAN SE	6,052	56.97	344,782.44	
MARFIN INVESTMENT GROUP SA	33,441	3.08	102,998.28	
MEDIASET	48,203	4.86	234,558.20	
MEDIOBANCA	53,354	9.42	502,636.29	
MEDIOLANUM SPA	20,848	4.70	98,014.57	
MERCK KGAA	5,011	68.43	342,902.73	

METRO STAMM	7,976	38.85	309,867.60	
METSO OYJ	7,437	19.26	143,236.62	
MICHELIN	12,615	54.48	687,265.20	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,476	108.19	1,457,968.44	
NATIONAL BANK OF GREECE	41,344	24.50	1,012,928.00	
NEOPOST SA	2,617	59.55	155,842.35	
NESTE OIL OYJ	17,330	12.60	218,358.00	
NOKIA CORP	251,588	10.19	2,563,681.72	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,383	16.00	102,128.00	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	5,243	34.21	179,363.03	
OMV AG	7,607	27.65	210,333.55	
OPAP SA	15,018	17.40	261,313.20	
OUTOKUMPU OYJ	5,782	13.15	76,033.30	
PARMALAT SPA	81,884	1.90	156,319.83	
PERNOD-RICARD	15,243	53.71	818,701.53	
PEUGEOT SA	16,476	21.15	348,467.40	
PHILIPS ELECTRS (KON.)	74,888	16.99	1,272,721.56	
PIRAEUS BANK S.A.	29,764	12.42	369,668.88	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,262	53.40	441,190.80	
PORTUGAL TELECOM	44,165	7.22	318,871.30	
PPR	3,957	84.85	335,751.45	
PRYSMIAN SPA	19,003	13.02	247,491.84	
PUBLICIS GROUPE	8,802	27.59	242,847.18	
PUMA AG	387	222.06	85,937.22	
QIAGEN N.V.	14,531	14.34	208,374.54	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	2,570	43.10	110,767.00	
RANDSTAD HOLDING NV	7,218	29.70	214,374.60	
RAUTARUUKKI OYJ	4,353	16.50	71,824.50	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,972	34.67	345,729.24	
REED ELSEVIER NV	36,091	7.77	280,751.88	
RENAULT SA	11,236	32.08	360,450.88	
REPSOL YPF	49,615	18.88	936,731.20	
RWE STAMM	32,095	63.59	2,040,921.05	
SACYR VALLEHERMOSO SA	4,392	13.11	57,579.12	
SAFRAN SA	20,436	12.92	264,135.30	
SAINT-GOBAIN	24,431	35.16	859,116.11	
SAIPEM	24,574	20.51	504,252.33	
SALZGITTER AG	1,792	66.89	119,866.88	
SAMPO OYJ-A SHS	34,106	17.44	594,808.64	
SANOFI-AVENTIS SA	70,861	50.38	3,569,977.18	
SAP AG	58,514	33.17	1,940,909.38	

SBM OFFSHORE NV	20,235	14.63	296,038.05	
SCHNEIDER ELECTRIC	14,544	70.24	1,021,570.56	
SCOR SE	10,315	18.54	191,291.67	
SES	21,822	15.52	338,677.44	
SIEMENS	58,722	64.81	3,805,772.82	
SNAM RETE GAS	143,844	3.32	477,819.56	
SOCIETE GENERALE	31,744	56.39	1,790,044.16	
SODEXO	9,982	41.02	409,511.55	
SOLARWORLD AG	3,722	16.01	59,589.22	
SOLVAY SA	3,621	72.67	263,138.07	
STMICROELECTRONICS	39,816	6.45	256,932.64	
STORA ENSO OYJ R	46,822	4.72	220,999.84	
SUEDZUCKER AG	10,861	13.83	150,207.63	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	25,590	15.55	398,052.45	
TECHNIP S.A.	10,053	43.54	437,757.88	
TELECOM ITALIA ORD	679,072	1.23	837,682.84	
TELECOM ITALIA RNC	457,591	0.85	390,691.19	
TELEFONICA	300,522	18.99	5,706,912.78	
TELEKOM AUSTRIA AG	22,811	12.12	276,469.32	
TENARIS SA	27,528	12.29	338,373.62	
TERNA SPA	89,251	2.66	237,952.98	
THALES SA	5,087	34.20	173,975.40	
THYSSEN KRUPP	20,680	23.60	488,048.00	
TNT NV	32,196	18.40	592,406.40	
TOTAL SA	142,695	40.76	5,816,961.67	
UCB (GROUPE)	6,442	29.83	192,197.07	
UMICORE	8,305	20.36	169,089.80	
UNICREDIT SPA	976,353	2.71	2,647,400.68	
UNILEVER NV-CVA	103,611	19.68	2,039,064.48	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	47,684	10.43	497,369.39	
UPM KYMMENE CORP	42,407	8.30	351,978.10	
VALLOUREC	4,146	117.65	487,776.90	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,686	26.15	619,388.90	
VINCI S.A.	31,042	38.90	1,207,533.80	
VIVENDI	84,225	21.12	1,779,253.12	
VOESTALPINE AG	14,209	23.80	338,174.20	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,288	78.05	646,878.40	
VOLKSWAGEN STAMM	5,940	114.80	681,912.00	
WACKER CHEMIE AG	2,349	104.18	244,718.82	
WARTSILA OYJ	5,704	27.90	159,141.60	
WOLTERS KLUWER	25,934	14.63	379,414.42	

	ZARDOYA OTIS SA	8,625	14.92	128,685.00	
小計		11,578,724		157,843,727.65 (20,791,175,806)	
合計		67,257,662		(114,391,945,390)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 546銘柄	100.0%	53.2%
カナダドル	株式 68銘柄	100.0%	5.1%
ユーロ	株式 214銘柄	100.0%	18.2%
イギリスポンド	株式 91銘柄	100.0%	11.0%
スイスフラン	株式 29銘柄	100.0%	4.2%
スウェーデンクローナ	株式 26銘柄	100.0%	1.3%
ノルウェークローネ	株式 8銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 8銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	100.0%	4.2%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	100.0%	0.03%
香港ドル	株式 23銘柄	100.0%	1.2%
シンガポールドル	株式 17銘柄	100.0%	0.7%

②株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
新株予約権証券	ユーロ	UBI BANCA SCPA-CW11 WRT	47,684.00	3,871.94	
	小計		47,684.00	3,871.94 (510,011)	
新株予約権証券計				(510,011)	
投資信託受益証券	アメリカドル	CARNIVAL CORP	36,451.00	1,221,108.50	
	小計		36,451.00	1,221,108.50 (110,156,197)	
	カナダドル	CANADIAN OIL SANDS TRUST	15,270.00	458,100.00	
		ENERPLUS RESOURCES FUND	10,868.00	267,678.84	
		PENN WEST ENERGY TRUST	32,464.00	543,122.72	
	小計		58,602.00	1,268,901.56 (105,648,743)	
投資信託受益証券計				(215,804,940)	

投資証券	アメリカドル	AMB PROPERTY CORP	6,586.00	152,465.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,804.00	690,679.08	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,328.00	391,501.44	
		BOSTON PROPERTIES	11,277.00	740,560.59	
		DUKE REALTY CORP	10,100.00	119,180.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	15,267.00	469,002.24	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,758.00	354,520.06	
		HCP INC	19,972.00	579,387.72	
		HEALTH CARE REIT INC	5,100.00	216,546.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	63,175.00	747,360.25	
		KIMCO REALTY CORP	38,050.00	506,826.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	13,105.00	407,041.30	
		PROLOGIS	29,000.00	355,250.00	
		PUBLIC STORAGE	9,770.00	746,623.40	
		REGENCY CENTERS CORP	4,899.00	181,752.90	
		SIMON PROPERTY GROUP	21,812.00	1,512,007.84	
		VENTAS INC	7,622.00	297,105.56	
		VORNADO REALTY TRUST	12,753.00	826,011.81	
	小計		317,378.00	9,293,822.09 (838,395,690)	
	カナダドル	CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,811.00	359,082.60	
	小計		9,811.00	359,082.60 (29,897,217)	
	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	419,000.00	255,590.00	
		GPT GROUP	429,235.00	287,587.45	
		MIRVAC GROUP	141,866.00	224,148.28	
		STOCKLAND	193,339.00	773,356.00	
		WESTFIELD GROUP	158,199.00	2,230,605.90	
	小計		1,341,639.00	3,771,287.63 (297,780,871)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	74,861.00	360,830.02	
		HAMMERSON PLC	77,739.00	313,288.17	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	40,984.00	261,477.92	
		LIBERTY INTERNATIONAL PLC	35,499.00	177,388.50	
	小計		229,083.00	1,112,984.61 (160,381,082)	
	香港ドル	LINK REIT	125,500.00	2,146,050.00	
	小計		125,500.00	2,146,050.00 (24,980,022)	
	ユーロ	KLEPIERRE	4,974.00	135,044.10	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	5,576.00	796,252.80	

	小計		10,550.00	931,296.90 (122,670,427)	
投資証券計				(1,474,105,309)	
合計				(1,690,420,260)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入新株予約権証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	—	11.6%	—	56.1%
	投資証券18銘柄	—	—	88.4%	
カナダドル	投資信託受益証券3銘柄	—	77.9%	—	8.0%
	投資証券1銘柄	—	—	22.1%	
ユーロ	新株予約権証券1銘柄	0.4%	—	—	7.3%
	投資証券2銘柄	—	—	99.6%	
イギリスポンド	投資証券4銘柄	—	—	100.0%	9.5%
オーストラリアドル	投資証券5銘柄	—	—	100.0%	17.6%
香港ドル	投資証券1銘柄	—	—	100.0%	1.5%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[次へ](#)

「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年 9月30日現在)	(平成21年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	741,612,255	856,882,951
コール・ローン	1,499,765,853	1,472,024,167
国債証券	337,453,902,084	289,193,323,387
特殊債券	1,411,160,662	1,918,567,750
派生商品評価勘定	32,130,690	317,840
未収入金	4,404,538,218	5,616,903,803
未収利息	5,113,024,635	3,824,609,105
前払費用	217,529,592	223,512,447
流動資産合計	350,873,663,989	303,106,141,450
資産合計	350,873,663,989	303,106,141,450
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,198,645	12,301,340
未払金	4,719,005,793	7,832,725,936
未払解約金	87,758,133	73,016,366
流動負債合計	4,827,962,571	7,918,043,642
負債合計	4,827,962,571	7,918,043,642
純資産の部		
元本等		
元本	171,364,485,697	155,643,938,944
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	174,681,215,721	139,544,158,864
元本等合計	346,045,701,418	295,188,097,808
純資産合計	346,045,701,418	295,188,097,808
負債純資産合計	350,873,663,989	303,106,141,450

(注) 「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセクションS50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成20年9月30日及び平成21年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30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、原則 として時価評価しております。時価 評価にあたっては、金融商品取引業 者等の提示する価格、価格情報会社 の提供する価格又は業界団体が公表 する売買参考統計値等で評価してお ります。 (2) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価してお ります。	(1) 国債証券、特殊債券 同左 (2) 外国為替予約 同左
2.外貨建資産・負債の本邦通貨へ の換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・ 負債の円換算は、原則として我が国 における計算期間末日の対顧客電信 売買相場の仲値によって計算してお ります。 なお、外貨建資産等の会計処理は 「投資信託財産の計算に関する規則 （平成12年総理府令第133号）」第 60条及び第61条に基づいておりま す。	同左

(貸借対照表に関する注記)

	(平成20年9月30日現在)	(平成21年9月30日現在)
1.期首元本額	172,113,960,574円	171,364,485,697円
期中追加設定元本額	25,232,197,462円	22,914,866,546円
期中一部解約元本額	25,981,672,339円	38,635,413,299円
期末元本額	171,364,485,697円	155,643,938,944円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン（毎月決算型）	25,887,862,965円	23,113,412,755円
住信 外国債券オープン（3ヶ月決算型）	851,545,204円	774,949,902円
住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	12,401,145,454円	10,160,175,395円
住信財産四分法ファンド（毎月決算型）	9,800,153,767円	6,598,509,944円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	115,599,900円	168,390,002円
SBI資産設計オープン（分配型）	22,097,911円	16,865,019円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	542,245,579円	1,244,975,588円
世界経済インデックスファンド	—	45,656,370円
すみしん マイセレクション25	37,891,066円	35,026,029円
すみしん マイセレクション50	17,169,616円	18,467,296円
すみしん マイセレクション75	12,079,028円	10,027,073円
すみしん DCマイセレクション25	510,651,684円	591,622,068円
すみしん DCマイセレクション50	545,848,898円	607,505,012円
すみしん DCマイセレクション75	336,682,077円	389,914,030円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	607,457,670円	745,909,694円
すみしん DCマイセレクションS25	12,342,300円	25,822,564円
すみしん DCマイセレクションS50	20,606,566円	41,412,744円

すみしん DCマイセクションS75	11,580,527円	23,090,466円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,160,981円	1,873,162円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	299,406円	1,672,158円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	76,337円	909,534円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	38,119円	191,563円
すみしん DCマルチアセット ファンド	67,493円	69,914円
STAM 外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	31,555,153円	485,606,624円
すみしん マイセクション50V A 1（適格機関投資家専用）	54,321,271円	51,674,281円
すみしん マイセクション75V A 1（適格機関投資家専用）	18,445,166円	15,368,997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）	791,507,296円	753,533,319円
すみしん マイセクション50V A 2（適格機関投資家専用）	543,189円	413,385円
すみしん バランス30V A 1（適格機関投資家専用）	1,805,595,914円	1,669,655,445円
すみしん バランス50V A 1（適格機関投資家専用）	2,974,782,127円	2,676,406,035円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	39,787,290,586円	36,721,350,476円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,935,909,862円	3,552,769,868円
すみしん バランスA(25)VA1（適格機関投資家専用）	10,961,000,895円	10,875,388,914円
すみしん バランスB(37.5)VA1（適格機関投資家専用）	1,436,118,723円	1,556,674,179円
すみしん バランスC(50)VA1（適格機関投資家専用）	5,279,646,811円	5,129,062,839円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,630,948,405円	5,256,601,332円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	14,000,578,855円	5,744,704,262円
すみしん バランスD(35)VA1（適格機関投資家専用）	968,835,162円	1,885,109,094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）	2,816,279,320円	3,792,586,060円
すみしん バランスE(25)VA1（適格機関投資家専用）	—	423,464,176円
住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	19,682,325,003円	21,438,645,610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	3,131,933,014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）	6,119,733,624円	4,164,754,176円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	359,340,334円	313,548,841円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	—	1,388,239,735円
2.計算期間末日における受益権の総数	171,364,485,697口	155,643,938,944口

（有価証券に関する注記）

（平成20年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	337,453,902,084	6,212,083,280
特殊債券	1,411,160,662	54,761,076
合 計	338,865,062,746	6,266,844,356

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

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	289,193,323,387	6,659,368,944

特殊債券	1,918,567,750	16,819,625
合 計	291,111,891,137	6,676,188,569

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

(デリバティブ取引に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

(自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日)	(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
1.取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行うことができます。 当ファンドの利用することができるデリバティブ取引は、先物取引（わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引、金利に係る市場デリバティブ取引、通貨に係る市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引）、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引及び外国為替予約取引であります。 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 当ファンドのデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクがあります。デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。 3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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 2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 同左 3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種 類	(平成20年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			

市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,614,711,560	—	1,594,208,000	△20,503,560
	シンガポールドル	25,677,085	—	25,312,000	△365,085
	ポーランドズロチ	24,618,000	—	24,288,000	△330,000
	売建				
	カナダドル	480,790,250	—	468,872,500	11,917,750
	オーストラリアドル	136,585,280	—	132,528,000	4,057,280
	デンマーククローネ	60,858,900	—	59,940,000	918,900
	ユーロ	998,702,760	—	983,466,000	15,236,760
合 計		3,341,943,835	—	3,288,614,500	10,932,045

区分	種 類	(平成21年 9月30日現在)			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	4,189,200,800	—	4,185,280,000	△3,920,800
	イギリスポンド	208,612,660	—	208,930,500	317,840
	売建				
	カナダドル	116,120,760	—	116,550,000	△429,240
	ユーロ	2,428,683,700	—	2,436,635,000	△7,951,300
合 計		6,942,617,920	—	6,947,395,500	△11,983,500

(注) 時価の算定方法

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

① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち該当日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

（自 平成19年10月 2日 至 平成20年 9月30日）	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

（平成20年9月30日現在）	（平成21年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 2.0194円	1口当たり純資産額 = 1.8966円

(3) 附属明細表（平成21年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 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	19,071,250.00	
		T 0.875% 02/28/11	16,000,000.00	16,052,500.00	
		T 0.875% 03/31/11	2,300,000.00	2,306,468.75	
		T 0.875% 04/30/11	20,300,000.00	20,344,406.25	
		T 0.875% 12/31/10	11,700,000.00	11,745,703.12	
		T 1% 07/31/11	4,100,000.00	4,108,968.75	
		T 1% 09/30/11	14,500,000.00	14,501,132.81	
		T 1.125% 01/15/12	12,000,000.00	11,992,500.00	
		T 1.125% 06/30/11	19,500,000.00	19,603,593.75	
		T 1.125% 12/15/11	5,000,000.00	5,002,343.75	
		T 1.25% 11/30/10	6,000,000.00	6,052,500.00	
		T 1.375% 02/15/12	1,500,000.00	1,506,796.87	
		T 1.375% 03/15/12	13,500,000.00	13,554,843.75	
		T 1.375% 04/15/12	8,200,000.00	8,229,468.75	
		T 1.375% 09/15/12	8,000,000.00	7,979,375.00	
		T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	5,999,921.87	
		T 1.75% 08/15/12	22,000,000.00	22,209,687.50	
		T 1.75% 11/15/11	8,400,000.00	8,522,062.50	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	7,726,875.00	
		T 1.875% 06/15/12	12,000,000.00	12,176,250.00	
		T 2% 09/30/10	10,000,000.00	10,157,812.50	
		T 2.25% 05/31/14	17,000,000.00	17,037,187.50	

T 2.375% 08/31/14	15,500,000.00	15,546,015.62	
T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,137,406.25	
T 2.625% 02/29/16	10,000,000.00	9,895,312.50	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	8,983,406.25	
T 2.75% 02/15/19	14,100,000.00	13,472,109.37	
T 2.75% 02/28/13	7,000,000.00	7,263,593.75	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,547,812.50	
T 2.875% 01/31/13	19,000,000.00	19,813,437.50	
T 3% 08/31/16	10,500,000.00	10,562,343.75	
T 3.125% 05/15/19	24,600,000.00	24,242,531.24	
T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,667,890.62	
T 3.25% 06/30/16	7,600,000.00	7,784,062.50	
T 3.25% 07/31/16	13,500,000.00	13,816,406.25	
T 3.375% 06/30/13	15,000,000.00	15,874,218.75	
T 3.375% 07/31/13	10,800,000.00	11,434,500.00	
T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,877,812.50	
T 3.5% 02/15/18	7,700,000.00	7,870,843.75	
T 3.5% 02/15/39	7,900,000.00	7,195,171.87	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,264,648.43	
T 3.625% 08/15/19	6,900,000.00	7,091,906.25	
T 3.625% 12/31/12	5,800,000.00	6,183,343.75	
T 3.75% 11/15/18	18,500,000.00	19,167,734.37	
T 3.875% 02/15/13	7,400,000.00	7,949,218.75	
T 3.875% 05/15/18	6,700,000.00	7,029,765.62	
T 3.875% 10/31/12	3,700,000.00	3,969,406.25	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,892,812.50	
T 4.0% 08/15/18	15,000,000.00	15,853,125.00	
T 4.0% 02/15/15	15,800,000.00	17,012,156.25	
T 4.0% 11/15/12	1,700,000.00	1,832,015.62	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,249,609.37	
T 4.125% 08/31/12	5,600,000.00	6,035,750.00	
T 4.25% 01/15/11	5,500,000.00	5,761,250.00	
T 4.25% 05/15/39	6,500,000.00	6,760,000.00	
T 4.25% 08/15/13	12,600,000.00	13,737,937.50	
T 4.25% 08/15/14	11,700,000.00	12,782,250.00	
T 4.25% 08/15/15	18,000,000.00	19,589,062.50	
T 4.25% 09/30/12	6,400,000.00	6,931,000.00	
T 4.25% 10/15/10	5,200,000.00	5,405,562.50	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,566,968.75	
T 4.25% 11/15/14	10,000,000.00	10,915,625.00	
T 4.25% 11/15/17	9,600,000.00	10,350,000.00	

T 4.375% 02/15/38	7,700,000.00	8,155,984.37	
T 4.375% 08/15/12	4,200,000.00	4,557,000.00	
T 4.375% 12/15/10	8,800,000.00	9,209,750.00	
T 4.5% 02/28/11	8,100,000.00	8,540,437.50	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,163,125.00	
T 4.5% 02/15/16	7,700,000.00	8,495,265.62	
T 4.5% 02/15/36	9,700,000.00	10,466,906.25	
T 4.5% 03/31/12	4,000,000.00	4,323,125.00	
T 4.5% 04/30/12	8,200,000.00	8,879,062.50	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,626,390.62	
T 4.5% 08/15/39	7,000,000.00	7,582,968.74	
T 4.5% 09/30/11	13,500,000.00	14,442,890.62	
T 4.5% 11/15/10	5,000,000.00	5,225,000.00	
T 4.5% 11/15/15	11,600,000.00	12,781,750.00	
T 4.5% 11/30/11	6,000,000.00	6,439,687.50	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,541,406.25	
T 4.625% 02/29/12	1,000,000.00	1,082,187.50	
T 4.625% 08/31/11	7,100,000.00	7,599,218.75	
T 4.625% 10/31/11	5,000,000.00	5,370,312.50	
T 4.625% 12/31/11	7,700,000.00	8,299,156.25	
T 4.75% 01/31/12	8,000,000.00	8,663,750.00	
T 4.75% 02/15/37	6,400,000.00	7,179,000.00	
T 4.75% 03/31/11	6,300,000.00	6,682,921.87	
T 4.75% 05/15/14	8,400,000.00	9,358,125.00	
T 4.75% 05/31/12	6,300,000.00	6,869,953.12	
T 4.75% 08/15/17	9,500,000.00	10,596,953.12	
T 4.875% 02/15/12	8,000,000.00	8,698,750.00	
T 4.875% 04/30/11	6,000,000.00	6,391,875.00	
T 4.875% 05/31/11	4,900,000.00	5,233,812.50	
T 4.875% 06/30/12	3,700,000.00	4,056,125.00	
T 4.875% 07/31/11	2,000,000.00	2,145,937.50	
T 4.875% 08/15/16	2,700,000.00	3,038,343.75	
T 5% 02/15/11	5,000,000.00	5,300,000.00	
T 5.0% 05/15/37	3,600,000.00	4,195,687.50	
T 5.0% 08/15/11	6,140,000.00	6,612,971.87	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,616,531.25	
T 5.125% 06/30/11	3,500,000.00	3,761,953.12	
T 5.25% 02/15/29	2,050,000.00	2,390,171.87	
T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,214,984.37	
T 5.375% 02/15/31	5,410,000.00	6,455,651.56	
T 5.5% 08/15/28	3,700,000.00	4,431,328.12	

	T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	2,737,968.75	
	T 6.125% 08/15/29	3,000,000.00	3,868,593.75	
	T 6.125% 11/15/27	5,220,000.00	6,654,684.37	
	T 6.25% 05/15/30	5,780,000.00	7,594,378.12	
	T 6.25% 08/15/23	6,390,000.00	8,029,434.37	
	T 6.375% 08/15/27	1,900,000.00	2,478,312.50	
	T 6.5% 11/15/26	2,110,000.00	2,769,704.68	
	T 6.625% 02/15/27	2,850,000.00	3,791,835.93	
	T 6.75% 08/15/26	2,000,000.00	2,682,500.00	
	T 6.875% 08/15/25	3,100,000.00	4,178,703.12	
	T 7.25% 05/15/16	7,650,000.00	9,684,421.87	
	T 7.25% 08/15/22	3,700,000.00	5,000,781.25	
	T 7.5% 11/15/16	6,100,000.00	7,870,906.25	
	T 7.5% 11/15/24	600,000.00	846,468.75	
	T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	4,857,750.00	
	T 7.875% 02/15/21	900,000.00	1,256,625.00	
	T 8.0% 11/15/21	7,810,000.00	11,074,335.93	
	T 8.125% 05/15/21	4,100,000.00	5,832,250.00	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,930,812.50	
	T 8.125% 8/15/21	2,900,000.00	4,137,484.37	
	T 8.5% 02/15/20	3,400,000.00	4,888,031.25	
	T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,109,875.00	
	T 8.75% 05/15/17	7,800,000.00	10,817,625.00	
	T 8.875% 02/15/19	6,700,000.00	9,702,437.50	
小計		974,510,000.00	1,046,670,043.55 (94,420,104,628)	
カナダドル	CAN 1% 09/01/11	1,700,000.00	1,691,109.00	
	CAN 1.25% 06/01/11	2,700,000.00	2,707,857.00	
	CAN 1.25% 12/01/11	1,900,000.00	1,891,089.00	
	CAN 2% 09/01/12	2,300,000.00	2,306,003.00	
	CAN 2% 12/01/14	2,300,000.00	2,236,382.00	
	CAN 2.75% 12/01/10	2,000,000.00	2,048,860.00	
	CAN 3.0% 06/01/14	3,800,000.00	3,889,110.00	
	CAN 3.5% 06/01/13	3,900,000.00	4,080,804.00	
	CAN 3.75% 06/01/12	2,600,000.00	2,736,318.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,800,000.00	3,930,834.00	
	CAN 3.75% 09/01/11	3,900,000.00	4,082,598.00	
	CAN 4% 06/01/16	3,800,000.00	4,067,254.00	
	CAN 4% 06/01/17	4,900,000.00	5,227,565.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,255,506.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	3,800,000.00	4,107,040.00	

	CAN 4.5% 06/01/15	4,500,000.00	4,934,295.00	
	CAN 5% 06/01/14	3,700,000.00	4,112,402.00	
	CAN 5% 06/01/37	4,300,000.00	5,128,223.00	
	CAN 5.25% 06/01/12	3,270,000.00	3,569,237.70	
	CAN 5.25% 06/01/13	4,420,000.00	4,897,757.80	
	CAN 5.75% 06/01/33	4,710,000.00	5,988,152.70	
	CAN 5.75% 06/01/29	4,060,000.00	5,038,216.40	
	CAN 6% 06/01/11	5,320,000.00	5,752,250.00	
	CAN 8% 06/01/23	1,700,000.00	2,458,217.00	
	CAN 8% 06/01/27	2,400,000.00	3,619,152.00	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	556,881.50	
小計		84,330,000.00	93,313,114.10 (7,769,249,879)	
イギリスポンド	UKT 2.25% 03/07/14	1,800,000.00	1,773,779.40	
	UKT 3.25% 12/07/11	5,200,000.00	5,400,215.60	
	UKT 4% 03/07/22	1,500,000.00	1,522,105.50	
	UKT 4% 09/07/16	6,900,000.00	7,316,780.70	
	UKT 4.25% 03/07/11	4,000,000.00	4,192,968.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	6,100,000.00	6,231,125.60	
	UKT 4.25% 06/07/32	4,810,000.00	4,975,468.81	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,000,000.00	1,023,525.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	5,000,000.00	5,192,085.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	5,300,000.00	5,483,242.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,800,000.00	2,898,019.60	
	UKT 4.25% 12/07/55	6,700,000.00	6,974,773.70	
	UKT 4.5% 03/07/13	8,800,000.00	9,459,164.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	7,600,000.00	8,135,822.80	
	UKT 4.5% 09/07/34	800,000.00	853,652.80	
	UKT 4.5% 12/07/42	6,600,000.00	7,081,199.40	
	UKT 4.75% 03/07/20	1,100,000.00	1,199,839.30	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,400,000.00	5,972,929.20	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,600,000.00	5,073,882.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	7,600,000.00	8,449,132.80	
	UKT 5% 03/07/12	8,400,000.00	9,072,982.80	
	UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	2,012,545.80	
	UKT 5% 03/07/25	3,270,000.00	3,663,979.41	
	UKT 5.0% 09/07/14	3,860,000.00	4,278,088.18	
	UKT 5.25% 06/07/12	6,700,000.00	7,293,197.90	
	UKT 6% 12/07/28	4,410,000.00	5,641,029.45	
	UKT 6.25% 11/25/10	6,050,000.00	6,430,036.80	
	UKT 8% 06/07/21	3,940,000.00	5,515,247.46	

	UKT 8% 09/27/13	2,400,000.00	2,923,461.60	
	UKT 8% 12/07/15	2,145,000.00	2,762,483.29	
	UKT 8.75% 08/25/17	5,310,000.00	7,307,021.97	
	UKT 9.0% 07/12/11	1,200,000.00	1,366,242.00	
小計		143,095,000.00	157,476,028.87 (22,692,295,760)	
シンガポールドル	SIGB 1.625% 04/01/13	2,000,000.00	2,052,160.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,200,000.00	1,256,616.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	350,000.00	351,837.50	
	SIGB 2.5% 10/01/12	700,000.00	736,799.00	
	SIGB 2.625% 04/01/12	1,100,000.00	1,155,693.00	
	SIGB 3.125% 02/01/11	1,300,000.00	1,345,799.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,124,563.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	800,000.00	840,952.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,400,000.00	1,459,150.00	
	SIGB 3.5% 07/01/12	1,500,000.00	1,617,945.00	
	SIGB 3.625% 07/01/11	1,200,000.00	1,264,536.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	800,000.00	885,160.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,600,000.00	1,773,408.00	
	SIGB 4% 09/01/18	1,500,000.00	1,699,440.00	
小計		16,550,000.00	17,564,058.50 (1,118,654,885)	
マレーシアリングgit	MGS 2.509% 08/27/12	1,600,000.00	1,583,572.80	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,911,946.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	3,200,000.00	2,783,715.20	
	MGS 3.702% 02/25/13	2,500,000.00	2,532,917.50	
	MGS 3.718% 06/15/12	14,300,000.00	14,617,674.50	
	MGS 3.756% 04/28/11	9,100,000.00	9,290,799.70	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	1,963,088.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	400,752.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	11,300,000.00	11,526,000.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	1,700,000.00	1,728,900.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,676,907.20	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,200,000.00	3,382,400.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,800,000.00	1,946,221.20	
小計		57,600,000.00	58,344,894.30 (1,510,549,313)	

スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	15,200,000.00	15,091,168.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	12,500,000.00	11,530,250.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	15,631,369.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	19,400,000.00	20,774,490.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	7,500,000.00	8,115,075.00	
	SGB 5% 12/01/20	20,000,000.00	22,819,400.00	
	SGB 5.25% 03/15/11	15,290,000.00	16,263,973.00	
	SGB 5.5% 10/08/12	22,500,000.00	24,736,950.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	24,600,000.00	28,895,160.00	
小計		152,090,000.00	163,857,835.00 (2,110,488,914)	
ノルウェークローネ	NGB 4.25% 05/19/17	8,500,000.00	8,627,245.00	
	NGB 5% 05/15/15	16,000,000.00	17,008,800.00	
	NGB 6% 05/16/11	13,800,000.00	14,519,532.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	15,700,000.00	17,297,789.00	
小計		54,000,000.00	57,453,366.00 (888,803,572)	
デンマーククローネ	DGB 4% 11/15/15	21,700,000.00	22,762,649.00	
	DGB 4% 11/15/17	17,000,000.00	17,767,720.00	
	DGB 4% 11/15/19	7,600,000.00	7,894,652.00	
	DGB 4.0% 11/15/10	10,100,000.00	10,408,858.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	27,100,000.00	29,511,900.00	
	DGB 5% 11/15/13	20,890,000.00	22,835,694.60	
	DGB 6% 11/15/11	26,500,000.00	28,815,305.00	
	DGB 7% 11/10/24	7,440,000.00	10,056,648.00	
小計		138,330,000.00	150,053,426.60 (2,655,945,650)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/12	2,000,000.00	1,782,720.00	
	POLGB 0% 07/25/11	3,900,000.00	3,581,409.00	
	POLGB 4.25% 05/24/11	8,100,000.00	8,040,060.00	
	POLGB 4.75% 04/25/12	11,600,000.00	11,501,864.00	
	POLGB 5% 10/24/13	9,600,000.00	9,423,360.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	6,700,000.00	6,679,230.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	8,400,000.00	7,985,796.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,700,000.00	4,469,512.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	5,700,000.00	5,706,441.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,800,000.00	7,462,806.00	
	POLGB 6% 11/24/10	9,500,000.00	9,662,545.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,700,000.00	8,882,613.00	
小計		86,700,000.00	85,178,356.00 (2,636,270,118)	

ユーロ	BGB 2% 03/28/12	1,400,000.00	1,411,354.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,600,000.00	3,626,964.00	
	BGB 3.5% 03/28/11	3,000,000.00	3,108,330.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,036,320.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,188,360.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,444,854.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,500,000.00	2,592,175.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,200,000.00	3,234,368.00	
	BGB 4.0% 03/28/13	3,600,000.00	3,818,448.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	4,000,000.00	4,184,080.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,000,000.00	2,055,980.00	
	BGB 4.25% 09/28/13	5,800,000.00	6,222,820.00	
	BGB 4.25% 9/28/14	5,000,000.00	5,375,650.00	
	BGB 5% 03/28/35	4,200,000.00	4,644,696.00	
	BGB 5% 09/28/12	6,000,000.00	6,537,900.00	
	BGB 5.0% 09/28/11	4,600,000.00	4,926,876.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,800,000.00	4,425,556.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	3,800,000.00	4,358,524.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	2,000,000.00	2,528,180.00	
	BKO 1.25% 03/11/11	1,500,000.00	1,506,765.00	
	BKO 2.25% 12/10/10	9,200,000.00	9,358,516.00	
	BTNS 1.5% 09/12/11	1,400,000.00	1,405,964.00	
	BTNS 2.5% 01/12/14	5,300,000.00	5,333,920.00	
	BTNS 3% 01/12/11	7,700,000.00	7,911,134.00	
	BTNS 3% 07/12/14	300,000.00	306,765.00	
	BTNS 3.5% 07/12/11	7,300,000.00	7,599,592.00	
	BTNS 3.75% 01/12/12	4,000,000.00	4,205,480.00	
	BTNS 3.75% 01/12/13	5,400,000.00	5,702,832.00	
	BTNS 4.5% 07/12/12	5,300,000.00	5,696,016.00	
	BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,084,300.00	
	BTPS 2.5% 07/01/12	2,600,000.00	2,635,282.00	
	BTPS 3% 03/01/12	1,500,000.00	1,541,535.00	
	BTPS 3.5% 03/15/11	8,700,000.00	8,995,626.00	
	BTPS 3.5% 06/01/14	4,000,000.00	4,119,880.00	
	BTPS 3.75% 02/01/11	7,000,000.00	7,248,150.00	
	BTPS 3.75% 08/01/15	9,100,000.00	9,447,711.00	
	BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000.00	9,890,976.00	
	BTPS 3.75% 08/01/21	7,500,000.00	7,260,825.00	
	BTPS 3.75% 09/15/11	5,400,000.00	5,633,712.00	
	BTPS 3.75% 12/15/13	4,100,000.00	4,277,612.00	
	BTPS 4% 02/01/17	7,500,000.00	7,800,900.00	

BTPS 4% 02/01/37	7,200,000.00	6,422,256.00	
BTPS 4% 04/15/12	7,900,000.00	8,321,860.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	7,400,000.00	7,882,480.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	7,400,000.00	7,675,650.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,000,000.00	1,062,450.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	11,000,000.00	11,719,290.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	9,065,505.00	
BTPS 4.25% 09/01/11	2,600,000.00	2,735,460.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,800,000.00	2,867,452.00	
BTPS 4.25% 10/15/12	3,700,000.00	3,930,251.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	7,100,000.00	7,545,809.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	9,300,000.00	9,690,042.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	7,600,000.00	7,984,560.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,500,000.00	6,875,180.00	
BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000.00	11,114,730.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,300,000.00	5,529,384.00	
BTPS 5% 02/01/12	8,970,000.00	9,635,753.40	
BTPS 5% 03/01/25	2,800,000.00	2,971,080.00	
BTPS 5% 08/01/34	6,200,000.00	6,411,668.00	
BTPS 5% 09/01/40	300,000.00	309,951.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	6,300,000.00	6,551,244.00	
BTPS 5.25% 08/01/11	8,360,000.00	8,939,682.40	
BTPS 5.25% 08/01/17	6,340,000.00	7,092,684.80	
BTPS 5.25% 11/01/29	8,500,000.00	9,173,795.00	
BTPS 5.5% 11/01/10	5,800,000.00	6,088,434.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	5,000,000.00	5,693,400.00	
BTPS 6% 05/01/31	9,780,000.00	11,415,509.40	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,500,000.00	10,439,530.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	3,100,000.00	4,092,248.00	
BTPS 9% 11/01/23	4,050,000.00	6,026,116.50	
DBR 3.25% 07/04/15	7,600,000.00	7,870,028.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,369,920.00	
DBR 3.5% 07/04/19	7,400,000.00	7,564,946.00	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,582,788.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,070,711.00	
DBR 3.75% 01/04/19	5,000,000.00	5,228,650.00	
DBR 3.75% 07/04/13	8,900,000.00	9,425,901.00	
DBR 4% 01/04/37	7,400,000.00	7,436,852.00	
DBR 4% 07/04/16	8,400,000.00	9,018,744.00	
DBR 4.0% 01/04/18	6,500,000.00	6,927,310.00	
DBR 4.25% 01/04/14	9,200,000.00	9,937,472.00	

DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000.00	9,910,456.50	
DBR 4.25% 07/04/17	7,200,000.00	7,817,544.00	
DBR 4.25% 07/04/18	7,800,000.00	8,459,724.00	
DBR 4.25% 07/04/39	4,400,000.00	4,647,852.00	
DBR 4.5% 01/04/13	7,300,000.00	7,888,453.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,800,000.00	4,195,048.00	
DBR 4.75% 07/04/34	6,200,000.00	6,895,206.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,500,000.00	2,855,425.00	
DBR 5.0% 01/04/12	9,280,000.00	10,010,614.40	
DBR 5.0% 07/04/11	9,070,000.00	9,674,696.90	
DBR 5.0% 07/04/12	9,660,000.00	10,514,620.20	
DBR 5.25% 01/04/11	5,480,000.00	5,782,660.40	
DBR 5.5% 01/04/31	5,900,000.00	7,112,509.00	
DBR 5.625% 01/04/28	3,670,000.00	4,449,361.20	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	666,517.60	
DBR 6.25% 01/04/24	3,500,000.00	4,475,975.00	
DBR 6.25% 01/04/30	2,400,000.00	3,128,856.00	
DBR 6.5% 07/04/27	4,000,000.00	5,297,480.00	
FRTR 3% 10/25/15	7,700,000.00	7,790,860.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	8,300,000.00	8,471,229.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	8,500,000.00	8,859,720.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	7,100,000.00	7,405,797.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	10,700,000.00	10,781,855.00	
FRTR 4% 04/25/14	7,500,000.00	8,006,325.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,800,000.00	7,152,308.00	
FRTR 4% 04/25/55	4,900,000.00	4,833,703.00	
FRTR 4% 10/25/13	8,400,000.00	8,958,936.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,951,896.00	
FRTR 4% 10/25/38	5,900,000.00	5,828,610.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	7,500,000.00	7,986,375.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	10,800,000.00	11,508,588.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	6,200,000.00	6,651,174.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	2,400,000.00	2,562,216.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,600,000.00	6,891,720.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	1,500,000.00	1,604,550.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	6,100,000.00	6,733,241.00	
FRTR 4.75% 10/25/12	9,000,000.00	9,765,540.00	
FRTR 5% 04/25/12	5,900,000.00	6,398,255.00	
FRTR 5% 10/25/16	7,810,000.00	8,790,779.80	
FRTR 5.0% 10/25/11	4,620,000.00	4,963,404.60	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,980,000.00	5,933,072.40	

FRTR 5.5% 10/25/10	6,360,000.00	6,681,943.20	
FRTR 5.75% 10/25/32	6,700,000.00	8,340,026.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,480,904.00	
FRTR 6.5% 04/25/11	7,620,000.00	8,264,271.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	3,800,000.00	5,673,134.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,600,569.60	
GGB 3.6% 07/20/16	2,400,000.00	2,391,792.00	
GGB 3.7% 07/20/15	4,600,000.00	4,657,914.00	
GGB 3.8% 03/20/11	2,800,000.00	2,901,164.00	
GGB 3.9% 08/20/11	2,300,000.00	2,397,865.00	
GGB 4% 08/20/13	1,000,000.00	1,040,190.00	
GGB 4.1% 08/20/12	3,100,000.00	3,252,148.00	
GGB 4.3% 03/20/12	3,200,000.00	3,367,040.00	
GGB 4.3% 07/20/17	3,700,000.00	3,781,252.00	
GGB 4.5% 05/20/14	3,600,000.00	3,805,812.00	
GGB 4.5% 09/20/37	3,400,000.00	3,107,634.00	
GGB 4.6% 05/20/13	2,600,000.00	2,762,344.00	
GGB 4.6% 07/20/18	2,400,000.00	2,472,936.00	
GGB 4.6% 09/20/40	1,600,000.00	1,462,848.00	
GGB 4.7% 03/20/24	3,300,000.00	3,277,659.00	
GGB 5.25% 05/18/12	3,080,000.00	3,322,334.40	
GGB 5.35% 05/18/11	2,100,000.00	2,231,124.00	
GGB 5.5% 08/20/14	1,500,000.00	1,646,070.00	
GGB 5.9% 10/22/22	2,800,000.00	3,182,060.00	
GGB 6% 07/19/19	4,900,000.00	5,486,187.00	
GGB 6.5% 01/11/14	1,860,000.00	2,117,889.00	
GGB 6.5% 10/22/19	2,470,000.00	2,891,233.80	
IRISH 3.9% 03/05/12	1,300,000.00	1,356,693.00	
IRISH 4% 01/15/14	700,000.00	725,102.00	
IRISH 4% 11/11/11	1,500,000.00	1,571,355.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,300,000.00	2,279,898.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,400,000.00	4,328,588.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	2,300,000.00	2,325,231.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,400,000.00	2,517,624.00	
IRISH 5% 04/18/13	3,600,000.00	3,874,464.00	
NETHER 2.5% 01/15/12	2,000,000.00	2,045,820.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,204,164.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	2,400,000.00	2,463,120.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	5,300,000.00	5,595,422.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,193,708.00	
NETHER 4% 01/15/37	3,900,000.00	3,879,993.00	

NETHER 4% 07/15/16	4,300,000.00	4,559,849.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,800,000.00	2,917,012.00	
NETHER 4.0% 01/15/11	4,700,000.00	4,888,611.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	3,100,000.00	3,248,273.00	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,900,000.00	5,264,168.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,900,000.00	5,326,839.00	
NETHER 5% 07/15/11	5,500,000.00	5,870,205.00	
NETHER 5.0% 07/15/12	4,200,000.00	4,567,962.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	3,200,000.00	3,798,816.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,700,000.00	2,356,030.00	
OBL 2.25% 04/11/14	4,600,000.00	4,595,124.00	
OBL 2.5% 10/08/10	4,400,000.00	4,480,872.00	
OBL 3.5% 04/08/11	9,100,000.00	9,441,341.00	
OBL 3.5% 04/12/13	7,300,000.00	7,673,176.00	
OBL 3.5% 10/14/11	5,400,000.00	5,640,948.00	
OBL 4% 04/13/12	5,400,000.00	5,730,102.00	
OBL 4.25% 10/12/12	5,900,000.00	6,324,269.00	
PGB 3.2% 04/15/11	1,900,000.00	1,958,501.00	
PGB 3.35% 10/15/15	3,400,000.00	3,451,170.00	
PGB 3.85% 04/15/21	2,100,000.00	2,084,229.00	
PGB 4.1% 04/15/37	1,800,000.00	1,709,424.00	
PGB 4.2% 10/15/16	1,300,000.00	1,374,399.00	
PGB 4.35% 10/16/17	2,000,000.00	2,115,420.00	
PGB 4.375% 06/16/14	1,300,000.00	1,393,691.00	
PGB 4.45% 06/15/18	2,300,000.00	2,438,092.00	
PGB 4.75% 06/14/19	2,100,000.00	2,254,665.00	
PGB 4.95% 10/25/23	1,600,000.00	1,734,176.00	
PGB 5% 06/15/12	2,200,000.00	2,380,488.00	
PGB 5.15% 06/15/11	1,900,000.00	2,022,664.00	
PGB 5.45% 09/23/13	2,200,000.00	2,445,410.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	620,454.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,700,000.00	3,820,287.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,400,000.00	3,283,414.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	4,700,000.00	4,956,949.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	2,940,803.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,700,000.00	3,897,543.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,300,000.00	2,260,785.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	3,400,000.00	3,659,148.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	2,100,000.00	2,236,731.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,600,000.00	1,692,416.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	4,500,000.00	4,885,695.00	

		RAGB 4.85% 03/15/26	1,100,000.00	1,189,694.00	
		RAGB 5.0% 07/15/12	3,100,000.00	3,364,027.00	
		RAGB 5.25% 01/04/11	2,500,000.00	2,635,025.00	
		RAGB 6.25% 07/15/27	2,000,000.00	2,510,600.00	
		RFGB 3.125% 09/15/14	1,600,000.00	1,642,864.00	
		RFGB 3.875% 09/15/17	2,000,000.00	2,088,920.00	
		RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,616,535.00	
		RFGB 4.25% 09/15/12	2,000,000.00	2,137,080.00	
		RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,713,232.00	
		RFGB 5.375% 07/04/13	2,200,000.00	2,451,592.00	
		RFGB 5.75% 02/23/11	1,700,000.00	1,812,506.00	
		SPGB 2.75% 04/30/12	2,900,000.00	2,977,865.00	
		SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,927,783.00	
		SPGB 3.8% 01/31/17	4,600,000.00	4,741,588.00	
		SPGB 3.9% 10/31/12	3,500,000.00	3,704,960.00	
		SPGB 4.1% 04/30/11	4,500,000.00	4,707,405.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	5,400,000.00	5,605,092.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	4,500,000.00	4,327,380.00	
		SPGB 4.2% 07/30/13	7,400,000.00	7,913,930.00	
		SPGB 4.25% 01/31/14	600,000.00	642,534.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	1,900,000.00	1,982,365.00	
		SPGB 4.4% 01/31/15	4,600,000.00	4,961,054.00	
		SPGB 4.6% 07/30/19	4,400,000.00	4,708,352.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,200,000.00	1,243,632.00	
		SPGB 4.75% 07/30/14	7,900,000.00	8,664,562.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,400,000.00	3,644,120.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	3,800,000.00	4,088,762.00	
		SPGB 5.0% 07/30/12	5,200,000.00	5,649,696.00	
		SPGB 5.35% 10/31/11	4,700,000.00	5,079,713.00	
		SPGB 5.4% 07/30/11	4,600,000.00	4,940,584.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	4,346,592.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	4,100,000.00	4,867,192.00	
		SPGB 6.0% 01/31/29	5,200,000.00	6,302,660.00	
		SPGB 6.15% 01/31/13	4,500,000.00	5,080,500.00	
	小計		1,088,790,000.00	1,164,522,932.50 (153,390,960,668)	
国債証券計				(289,193,323,387)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	3,200,000.00	3,173,152.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,301,407.00	
		NSWTC 6% 05/01/12	2,000,000.00	2,046,720.00	

		NSWTC 7% 12/01/10	500,000.00	515,525.00	
		QTC 6% 06/14/11	2,400,000.00	2,454,774.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,800,000.00	2,862,272.00	
		QTC 6% 09/14/17	6,450,000.00	6,577,163.50	
		QTC 6% 10/14/15	3,300,000.00	3,366,957.00	
	小計		23,950,000.00	24,297,970.50 (1,918,567,750)	
特殊債券計				(1,918,567,750)	
合計				(291,111,891,137)	

(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 128銘柄	100.0%	32.4%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.7%
ユーロ	国債証券 239銘柄	100.0%	52.7%
イギリスポンド	国債証券 32銘柄	100.0%	7.8%
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 8銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	特殊債券 8銘柄	100.0%	0.7%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成21年10月30日現在）

すみしん DCマイセレクションS50

I 資産総額	1,776,059,927 円
II 負債総額	322,921 円
III 純資産総額（I－II）	1,775,737,006 円
IV 発行済口数	2,154,284,580 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.8243 円

（参考情報）

住信 国内株式インデックス マザーファンド

I 資産総額	136,587,946,950 円
II 負債総額	4,686,549,307 円
III 純資産総額（I－II）	131,901,397,643 円
IV 発行済口数	196,665,573,852 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.6707 円

住信 国内債券インデックス マザーファンド

I 資産総額	149,986,076,185 円
II 負債総額	614,449,409 円
III 純資産総額（I－II）	149,371,626,776 円
IV 発行済口数	128,157,556,878 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1655 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

I 資産総額	119,438,861,639 円
II 負債総額	32,560,833 円
III 純資産総額（I－II）	119,406,300,806 円
IV 発行済口数	135,453,594,160 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.8815 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

I 資産総額	305,563,563,842 円
II 負債総額	3,783,771,722 円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	301,779,792,120 円
Ⅳ 発行済口数	155,837,382,387 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9365 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期計算期間 (平成18年10月30日～平成19年10月 1日)	195,971,982	189,093	195,782,889
第2期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	752,993,459	8,390,262	940,386,086
第3期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	1,072,967,920	26,863,146	1,986,490,860

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

第三部【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年間に於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、累積投票にはよりません。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了するときまでとします。

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

取締役会は、取締役会長が招集し、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）
 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10月30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	89	765,261
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	89	765,261

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	※1 140,181	※1 104,428
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 (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)
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 (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)
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	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	その他有価証券 時価のあるもの 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。） 時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。	その他有価証券 時価のあるもの 同 左 時価のないもの 同 左
2 固定資産の減価 償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。 （会計方針の変更）	有形固定資産 同 左

	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。 当該変更に伴う損益に与える影響は軽微であります。 （追加情報） 平成19年3月31日以前に取得したものについては、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。 当該変更に伴う損益に与える影響は軽微であります。 無形固定資産 定額法によっております。 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。	— — 無形固定資産 同 左
3 引当金の計上基準	（1）賞与引当金 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。 （2）退職給付引当金 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。	（1）賞与引当金 同 左 （2）退職給付引当金 同 左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同 左

会計方針の変更

前事業年度 (自 平成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

—	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。
---	---

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)
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。 (貸借対照表) 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。 (損益計算書) 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。	—

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)												
※1 有形固定資産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建 物</td><td>5,783千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>63,941千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>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	※1 有形固定資産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建 物</td><td>24,134千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>93,840千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>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												
※2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>預金</td><td>3,075,396千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>455,445千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>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	※2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>預金</td><td>2,832,577千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>305,246千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>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)
※1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料 5,362,458千円 受取利息 6,195千円 支払保証料 125千円	※1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料 4,504,556千円 受取利息 5,343千円 支払保証料 64千円 ※2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。 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

（リース取引関係）

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 (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)												
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。 2. 退職給付債務及びその他に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>44,738千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>44,738千円</td></tr> </table> (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。 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>41,193千円</td></tr> </table> (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。 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。	退職給付債務	44,738千円	退職給付引当金	44,738千円	退職給付費用	41,193千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務及びその他に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>91,962千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>91,962千円</td></tr> </table> (1) 同左 (2) 同左 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>65,654千円</td></tr> </table> (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。 4. 退職給付債務等の計算基礎 同左	退職給付債務	91,962千円	退職給付引当金	91,962千円	退職給付費用	65,654千円
退職給付債務	44,738千円												
退職給付引当金	44,738千円												
退職給付費用	41,193千円												
退職給付債務	91,962千円												
退職給付引当金	91,962千円												
退職給付費用	65,654千円												

（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)								
1. 繰延税金資産の発生 の主な原因別の内訳 (繰延税金資産) <table> <tr> <td>未払事業税</td><td>47,126千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td><td>24,388千円</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	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (繰延税金資産) <table> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td><td>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>37,419千円</td></tr> </table>	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
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								
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								

退職給付引当金損金算入限度超過額	18,203千円	有価証券評価差額	17,125千円
その他	5,742千円	その他	811千円
繰延税金資産 合計	95,460千円	繰延税金資産 合計	87,900千円
		(繰延税金負債)	
		未収還付事業税	6,459千円
		繰延税金負債 合計	6,459千円
		差引 繰延税金資産の純額	81,441千円
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		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す。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 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す。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 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おりません。		同左	

(注) 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成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。

- ①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。）。
- ②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。）。

③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④⑤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。

④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。

⑤前記③④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」）

①資本金の額

平成21年3月末日現在 287,537百万円

②事業の内容

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

2【関係業務の概要】

(1)「受託者」は、以下の業務を行います。

- ①投資信託財産の保管・管理
- ②投資信託財産の計算
- ③投資信託財産に関する報告書の作成
- ④その他前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。

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

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。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

（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。）

<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、当該計算期間において次の書類を提出しています。

提出年月日	書類名
平成20年12月15日	有価証券報告書
平成20年12月15日	有価証券届出書
平成21年6月19日	半期報告書
平成21年6月19日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成21年10月23日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 壁 谷 恵 嗣 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているすみしん DCマイセレクションS50の平成20年10月1日から平成21年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、すみしん DCマイセレクションS50の平成21年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

-
1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. 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10月31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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているすみしん DCマイセレクションS50の平成19年10月2日から平成20年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、すみしん DCマイセレクションS50の平成20年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成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
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。