

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年1月28日提出
【発行者名】	住信アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平田 誠一
【本店の所在の場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6259-3801
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	SBI資産設計オープン（資産成長型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限5,000億円
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

SBI資産設計オープン（資産成長型）

（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。）

愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

本ファンドについて、委託者である住信アセットマネジメント株式会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

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

<お問い合わせ先>

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.sumishinam.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-417434

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時とします。）

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

（イ）一般コース（収益の分配がなされた場合、税金を差し引いた後の分配金を受領するコースです。以下同じ。）

1万口以上1万口単位

（ロ）自動けいぞく投資（再投資）コース（税金を差し引いた後の分配金が自動的に無手数料で再投資されるコースです。以下同じ。）

1万円以上1円単位

積立買付サービスの場合、買付単位は1千円以上1円単位となりますのでご注意ください。

分配金の再投資および確定拠出年金制度にもとづくお申込みの場合、1円以上1円単位です。

(7) 【申込期間】

継続募集期間

平成23年1月31日から平成24年1月30日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みの指定販売会社とします。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(11) 【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

振替受益権について

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

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

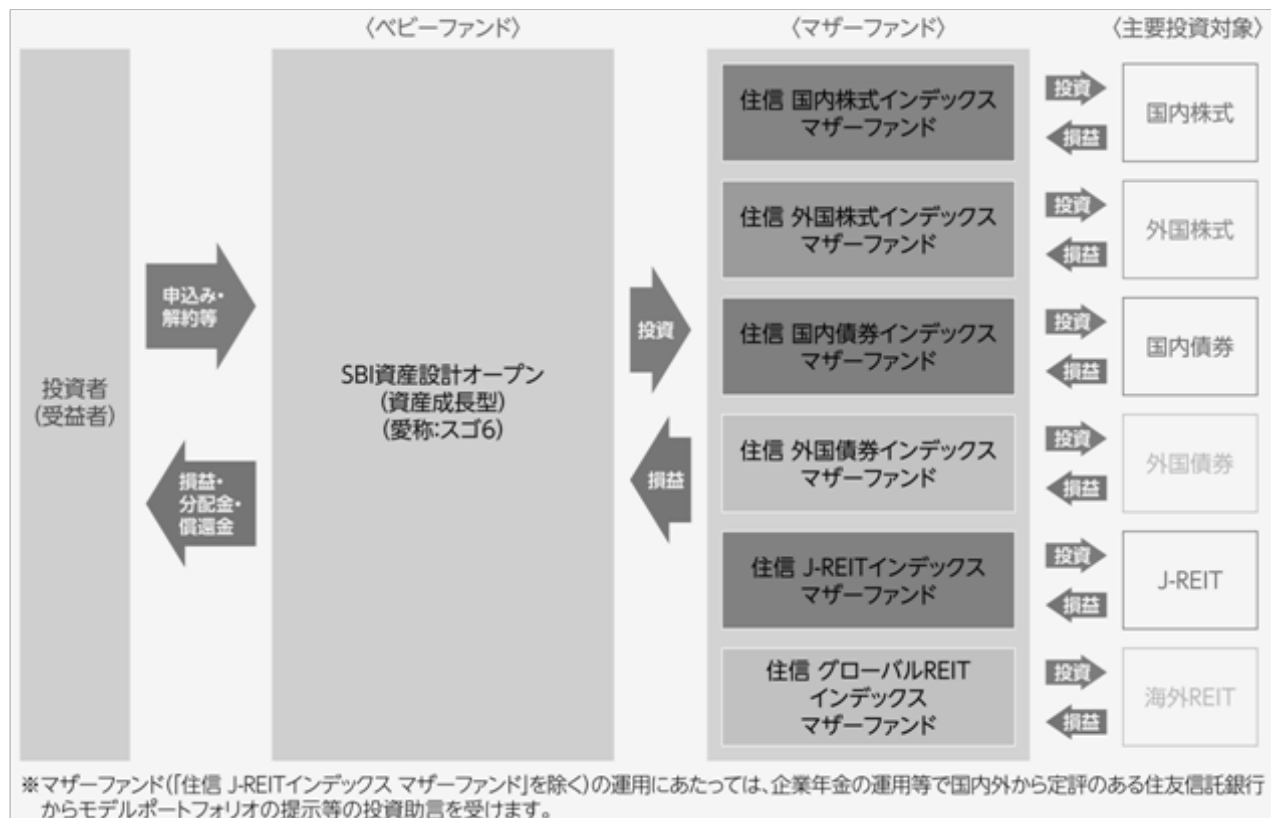
国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」ということがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

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

ファンドの特色

1. 国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券の6資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファンドのしくみ



? ファミリーファンド方式とは

ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を、ベビーファンドごとにまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行うしくみです。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX)※1
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)※2
国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合)※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
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)※5
海外 R E I T	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)※6

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

3「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合)」とは、野村證券株式会社(野村證券(株))が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発

した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。

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

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

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

5「東証REIT指数（配当込み）」とは、東京証券取引所に上場しているJ-REIT（不動産投資信託証券）全銘柄を投資対象として算出した指数（市場における価格の変動と配当金の受取りを合わせた投資成果を表す指数）です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数（配当込み）の商標は、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といたします。）の知的財産であり、指数値の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利および東証REIT指数（配当込み）の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

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

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

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

本ファンドが主要投資対象とする「住信 J-REITインデックス マザーファンド」は、東証REIT指数（配当込み）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東証REIT指数（配当込み）の指数値が著しく乖離することがあります。

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

(株)東京証券取引所は、「住信 J-REIT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 J-REITインデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

(株)東京証券取引所は、委託者または「住信 J-REIT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、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

前記の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンドおよび「住信 J-REIT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。

6「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、スタンダード&プアーズが発表している、日本を除く世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）および同様の制度にもとづく銘柄の浮動株修正時価総額にもとづいて算出される指数です。「円換算ベース」とは、ドルベースのインデックスをもとに住信アセットマネジメント株式会社（STAM）が独自に円換算したものです。

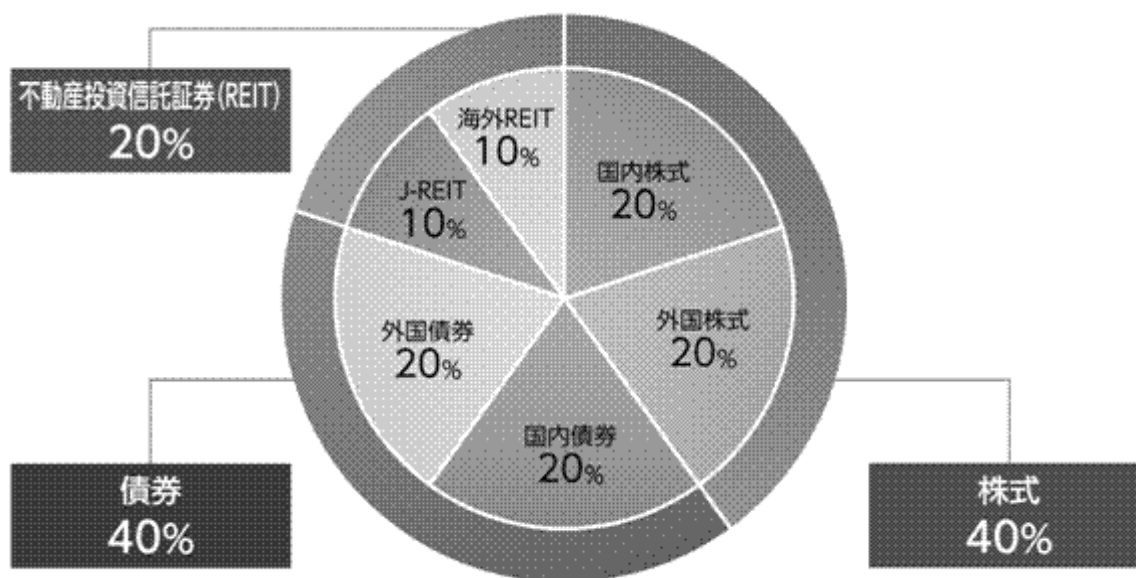
なお、本商品は、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（S&P）によって支持、保証、販売又は販売促進されるものではありません。S&P は、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対し

て、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）が市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&P のSTAMに対する唯一の関係は、S&P 及びS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）に関する決定、作成及び計算において、STAM又は本商品の所有者の要求等を考慮に入れずに行います。S&P は本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&P は、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。

S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）に含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負いません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）又はそれらに含まれるデータの使用により、STAM、本商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）又はそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行っていません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害（利益の損失を含む）について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&P が責任を負うことはありません。

3 . 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券（REIT）20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率
（2010年11月30日現在）



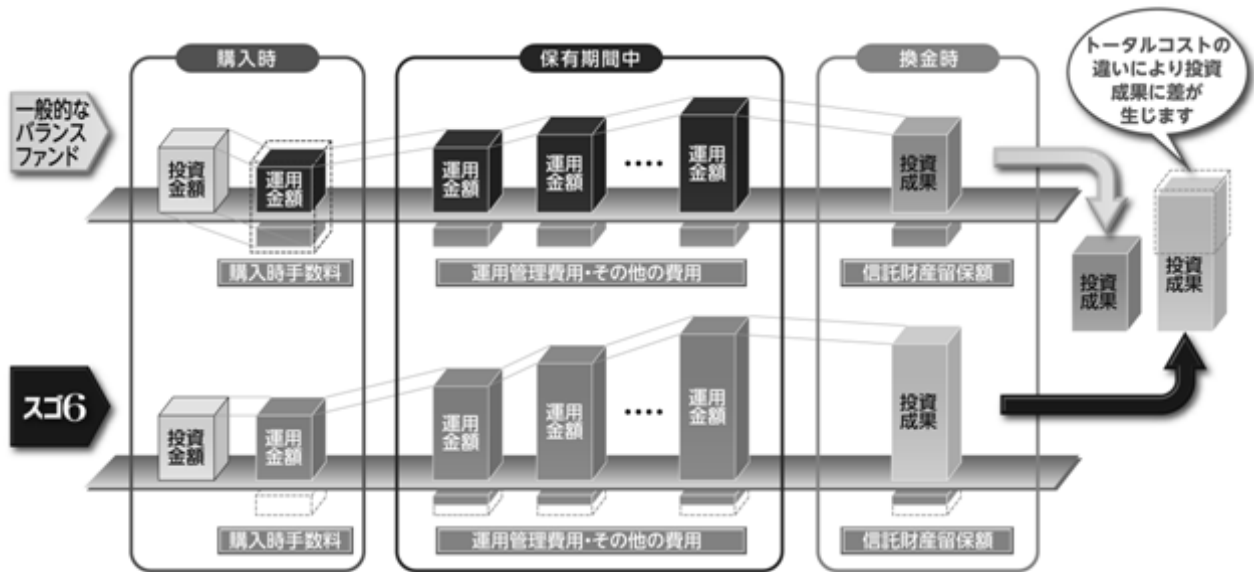
- ・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ・基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

4 . 魅力的な低コストファンドです。

- ・購入時手数料が無料のノーロードファンドです。また、運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対し

て年率0.714%（税込）と1%を下回る水準となっています。

コストが収益に与える影響 （イメージ図）



※上記はコストがファンドの収益に与える影響を分かりやすく説明するために一定の仮定にもとづいて作成したイメージ図であり、将来の運用成果を示唆したり、予想や保証するものではありません。

5. 毎決算時に分配を行います。

分配方針

- ・ 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の全額とします。
- ・ 原則として、毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。
- ・ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。市況動向の影響を受けて変動するため、あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。
- ・ 分配対象額が少額の場合、分配を行わないことがあります。

！ 主な投資制限

- ・ 株式への直接投資は行いません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

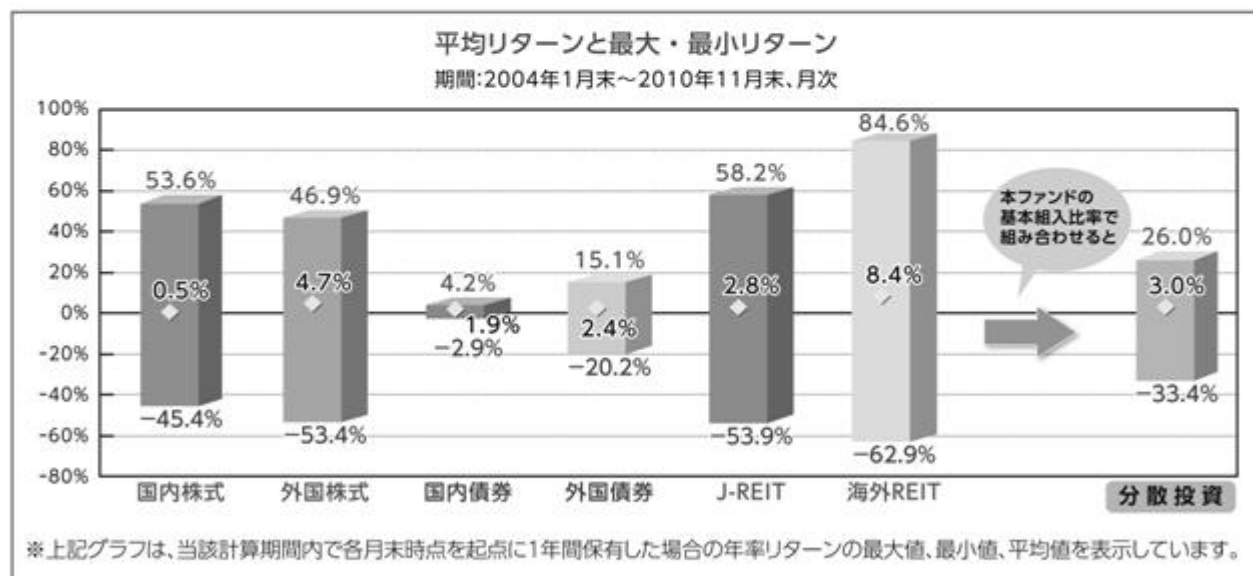
+ i ご参考情報

分散投資の魅力について

資産ごとに値動きは異なり、経済環境等により変動するため、常に収益率の高い資産を予想し運用することは困難ですが、分散投資を心がけることでリスクを分散し、相対的に安定した投資成果が期待できます。

	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年
1位	海外REIT 40.9%	外国株式 6.6%	国内債券 3.4%	海外REIT 39.6%	J-REIT 21.4%
2位	J-REIT 28.8%	外国債券 4.5%	外国債券 -15.5%	外国株式 35.6%	海外REIT 4.7%
3位	外国株式 23.7%	国内債券 2.7%	分散投資 -31.7%	分散投資 15.0%	国内債券 1.8%
4位	分散投資 14.4%	分散投資 -1.5%	国内株式 -40.6%	国内株式 7.6%	分散投資 -0.7%
5位	外国債券 10.0%	J-REIT -3.1%	J-REIT -48.6%	外国債券 7.4%	国内株式 -3.4%
6位	国内株式 3.0%	国内株式 -11.1%	外国株式 -53.4%	J-REIT 6.2%	外国株式 -4.6%
7位	国内債券 0.2%	海外REIT -17.8%	海外REIT -56.1%	国内債券 1.4%	外国債券 -10.5%

※2010年は11月末までの収益率を表示しています。



(出所) Bloombergデータをもとに住信アセットマネジメント作成

※使用したインデックスは以下のとおりです。「国内株式」東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、「外国株式」MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)、「国内債券」NOMURA-BPI 総合、「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)、「J-REIT」東証REIT指数(配当込み)、「海外REIT」S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)。「分散投資」については、本ファンドの基本組入比率にもとづいて、上記インデックスの月次リターンをもとに住信アセットマネジメントが独自に算出したものであり、本ファンドのポートフォリオの内容とは異なります。円換算は当該日の三菱東京UFJ銀行の為替データをもとに住信アセットマネジメントが算出しています。

※上記は分散投資の有効性について説明するため過去のデータをもとに作成したものであり、将来の運用成果を示唆したり、予想や保証するものではありません。

[ファンドの商品分類]

本ファンドは、社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。
本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)

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

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	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	ファミリーファンド	あり ()
	年6回 (隔月)	欧州		
	年6回 (隔月)	アジア		
	年6回 (隔月)	オセアニア		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)、(資産配分固定型)))	日々	アフリカ		
	日々	中近東 (中東)		
	その他 ()	エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変異型				

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

[区分における定義]

区分項目	該当区分	定義
------	------	----

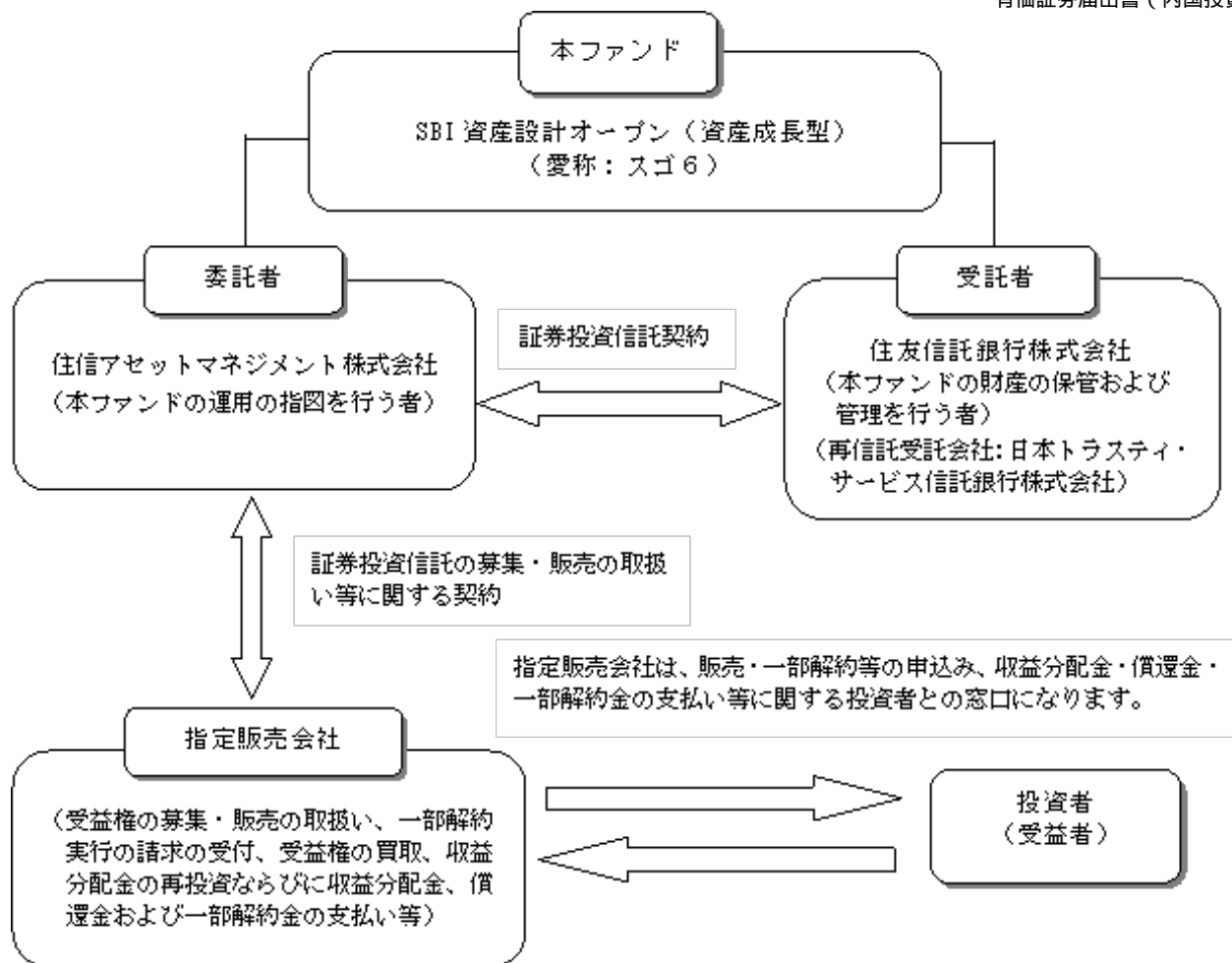
投資対象資産	その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）、（資産配分固定型）））	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり（投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。）、実質的に複数資産（本ファンドにおいては、株式、債券、不動産投信）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（日本を含みます。）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

(2) 【ファンドの沿革】

- 平成12年5月30日 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス 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 外国債券インデックス 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」の投資信託契約締結、設定、運用開始
- 平成20年1月9日 本ファンドおよび本ファンドの主要投資対象である「住信 J-REITインデックス マザーファンド」および「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

(イ) 本ファンドの関係法人図



（ロ）委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

受託者との投資信託契約

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

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約

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

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

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

（ハ）委託会社等の概況

資本金

平成22年11月30日現在 3億円

会社の沿革

昭和61年11月 1日	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年 2月20日	投資顧問業の登録
昭和62年 9月 9日	投資一任契約に係る業務の認可

平成 2年10月 1日	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年 2月15日	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年 3月25日	証券投資信託委託業の認可
平成19年 9月30日	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録 (登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

大株主の状況（平成22年11月30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、主として、「住信 国内債券インデックス 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 外国債券インデックス 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 J-REITインデックス マザーファンド」および「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

(ロ)運用方法

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

投資態度

1)主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

2)各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

マザーファンド受益証券	基本組入比率
住信 国内債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
住信 国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
住信 外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
住信 外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
住信 J-REITインデックス マザーファンド受益証券	10%

住信 グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	10%
--------------------------------	-----

- 3)前記2)に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 4)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。
- 5)実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- 6)株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みません。)への投資は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。
- 7)ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに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。

(参考)「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

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

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに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。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

(参考)「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(参考)「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（参考）「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(参考)「住信 J-REIT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、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）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. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）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。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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、ならびに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の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指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該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。

(参考)「住信 グローバルREIT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、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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。

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への実質投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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（本邦通貨表示のものに限ります。）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．金銭債権

ハ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を主として次に掲げる第1号から第6号までの住信アセットマネジメント株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第7号から第11号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 住信 国内債券インデックス マザーファンド

2. 住信 国内株式インデックス マザーファンド

3. 住信 外国債券インデックス マザーファンド

4. 住信 外国株式インデックス マザーファンド
5. 住信 J-REITインデックス マザーファンド
6. 住信 グローバルREITインデックス マザーファンド
7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号の証券の性質を有するもの
9. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
11. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第9号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

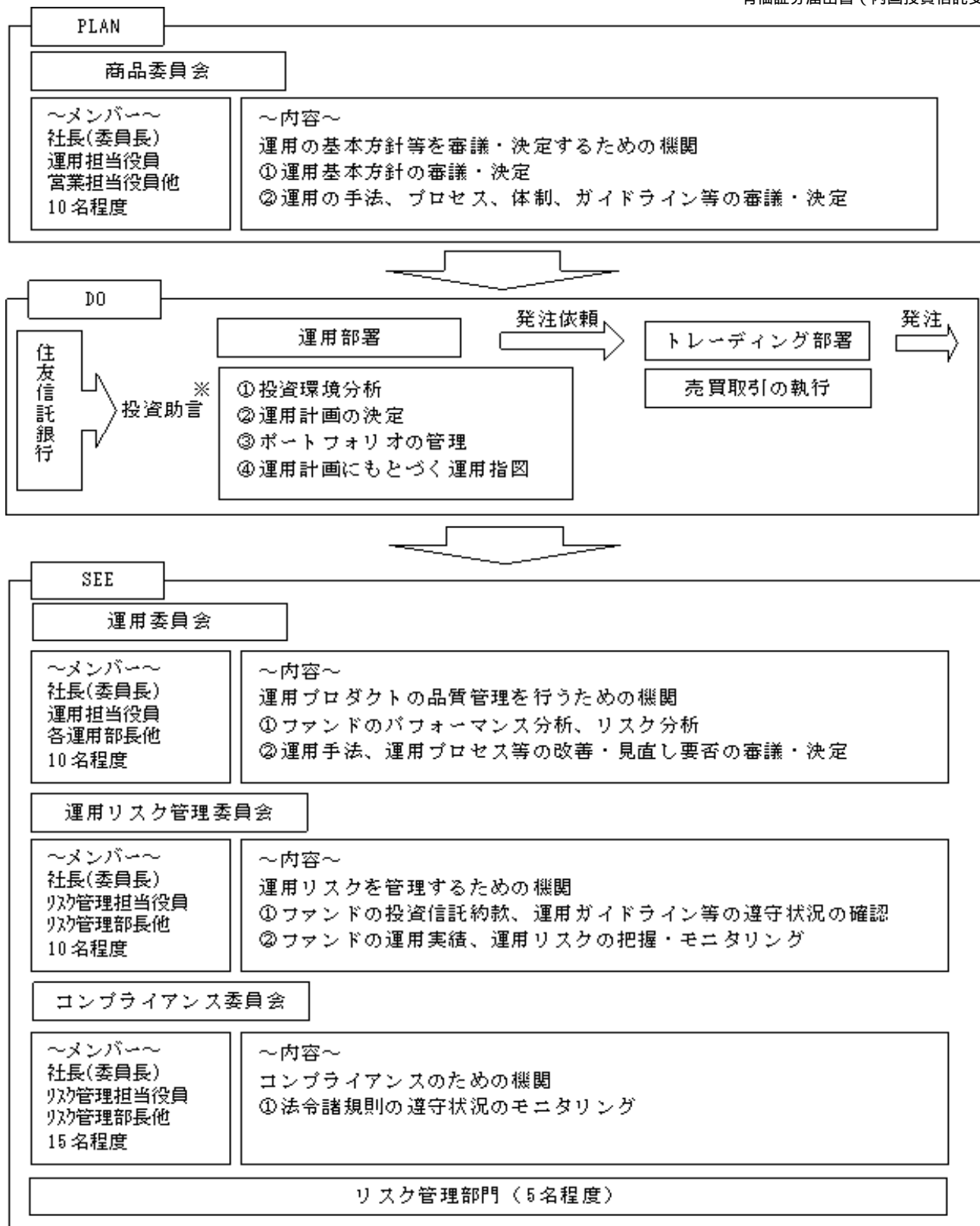
(八) 委託者は、信託金を、前記（ロ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(二) 前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（八）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。



※「住信 J-REIT インデックス マザーファンド」を除きます。

(4)【分配方針】

(イ) 分配方針

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）

および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

留保益の運用方針

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

(ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とみなし配当等収益との合計額から諸経費、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て得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（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。

前記におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(5) 【投資制限】

(イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブへの直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財

産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第26条）

前記における「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マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（ロ）法律等で規制される取引等

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

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

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

< デリバティブ取引に係る投資制限 >（金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

3【投資リスク】

（イ）本ファンドのもつ主なリスク

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

本ファンドは値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。本ファンドの運用による損益は、すべて本ファンドの受益者に帰属します。

基準価額の変動要因

1) 株価変動リスク

株式の価格は、発行者の業績、経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動し、基準価額の変動要因となります。

2) 債券価格変動リスク

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

3) リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リートおよびリートの運用会社の業績、

財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

4) 為替変動リスク

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

5) 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、基準価額の変動要因となります。

6) インデックスと乖離するリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 1) 本ファンドは、ファミリーファンド方式で運用するため、マザーファンドに対し、同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドによる追加設定および一部解約等があり、マザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与える場合があります。
- 2) 本ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(ロ) リスクの管理体制

委託者におけるリスクマネジメント体制

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額	信託報酬総額 (純資産総額に対して)	配分（純資産総額に対して）		
		委託者	指定販売会社	受託者
100億円以下の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.399% (税抜 0.38%)	年率0.273% (税抜 0.26%)	年率0.042% (税抜 0.04%)
100億円超300億円以下の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.336% (税抜 0.32%)	年率0.336% (税抜 0.32%)	年率0.042% (税抜 0.04%)
300億円超の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.273% (税抜 0.26%)	年率0.399% (税抜 0.38%)	年率0.042% (税抜 0.04%)

「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。

マザーファンドを通じて実質的に組み入れるJ-REITおよび海外リートは上場投資信託で市場の需給により価格形成されるため、組入J-REITおよび組入海外リートでの費用負担を加えた実質的な負担の水準は表示しておりません。

(4) 【その他の手数料等】

(イ) ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として当該基準価額から控除します。

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

(ロ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用(消費税等を含みます。)ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担(運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。)となります。(マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。)

(ハ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料(消費税等を含みます。)または税金、先物・オプション取引に要する費用(消費税等を含みます。)、組入資産の保管に要する費用(消費税等を含みます。)等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担(運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。)となります。(マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。)

(ニ) 投資信託財産に係る会計監査費用(消費税等を含みます。)は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

本ファンドは、課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

受益者に対する課税については、以下の取扱いとなります。以下は、平成22年11月30日現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。また、税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。また、買取請求によるご換金については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.sumishinam.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-417434

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時とします。)

(イ) 個人の受益者に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、平成23年12月31日までは10%(所得税7%および地方税3%)、平成24年1月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率により源泉徴収が行われます。原則として確定申告不要ですが、確定申告により総合課税(原則として、配当控除の適用が可能です。)または申告分離課税のいずれかを選択することも可能です。ご解約による換金時および償還時の差益(解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益)が譲渡所得等として課税対象となり、平成23年12月31日までは10%(所得税7%および地方税3%)、平成24年1月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座

（源泉徴収選択口座）の利用による申告不要の特例があります。詳しくは指定販売会社にお問い合わせ
 わせください。

ご解約による換金時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等を行うことにより、上
 場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得と通算することができ、また、控除しきれない損失金
 額については、翌年以降3年間の繰越控除の対象とすることができます。

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

（ハ）確定拠出年金制度にもとづくお申込みの場合は、同制度にもとづく課税上の取扱いが適用されます。

個別元本について

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

収益分配金の課税について

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

（平成22年11月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
住信 国内債券インデックス マザーファンド	日本	397,496,226	15.76
住信 国内株式インデックス マザーファンド	日本	477,132,726	18.92
住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	447,339,465	17.74
住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	543,096,457	21.54
住信 J-REITインデックス マザーファンド	日本	309,833,084	12.29
住信 グローバルREITインデックス マザーファンド	日本	297,181,653	11.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		49,783,957	1.97

合計(純資産総額)	2,521,863,568	100.00
-----------	---------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	119,627,019,700	74.74
	ポーランド	100,003,000	0.06
	小計	119,727,022,700	74.81
地方債証券	日本	10,204,776,863	6.38
特殊債券	日本	16,348,827,838	10.21
社債券	日本	12,231,596,190	7.64
	アメリカ	809,798,000	0.51
	オーストラリア	305,039,000	0.19
	オランダ	103,152,000	0.06
	イギリス	100,739,000	0.06
	小計	13,550,324,190	8.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		219,519,572	0.14
合計(純資産総額)		160,050,471,163	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	128,917,599,150	97.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,519,526,791	2.66
合計(純資産総額)		132,437,125,941	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	99,036,289,022	41.00
	イタリア	23,253,830,648	9.63
	ドイツ	22,602,007,140	9.36

	フランス	22,048,016,635	9.13
	イギリス	18,604,273,705	7.70
	スペイン	9,537,575,799	3.95
	カナダ	6,730,577,972	2.79
	ベルギー	6,200,409,428	2.57
	オランダ	5,928,209,955	2.45
	オーストリア	4,170,637,786	1.73
	メキシコ	2,266,198,956	0.94
	デンマーク	2,149,688,278	0.89
	ポルトガル	2,096,291,080	0.87
	ポーランド	2,073,151,690	0.86
	アイルランド	1,841,143,702	0.76
	スウェーデン	1,557,912,916	0.64
	フィンランド	1,371,419,944	0.57
	マレーシア	1,269,139,294	0.53
	スイス	1,216,803,315	0.50
	シンガポール	914,079,947	0.38
	ノルウェー	627,231,194	0.26
	オーストラリア	549,577,214	0.23
	小計	236,044,465,620	97.72
特殊債券	オーストラリア	1,900,238,057	0.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,610,800,768	1.49
合計(純資産総額)		241,555,504,445	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	61,717,307,786	50.70
	イギリス	11,348,355,783	9.32
	カナダ	6,789,866,182	5.58
	フランス	5,283,726,926	4.34
	スイス	5,229,510,559	4.30
	ドイツ	4,860,128,342	3.99
	オーストラリア	4,778,806,750	3.93
	オランダ	2,655,119,029	2.18
	スペイン	1,892,495,075	1.55

	スウェーデン	1,819,104,442	1.49
	イタリア	1,511,266,550	1.24
	香港	1,470,036,862	1.21
	シンガポール	952,322,397	0.78
	アイルランド	664,561,550	0.55
	バミューダ	654,921,259	0.54
	フィンランド	641,240,737	0.53
	アンティル	608,045,044	0.50
	デンマーク	589,544,059	0.48
	ベルギー	540,786,928	0.44
	イスラエル	480,927,992	0.40
	ノルウェー	411,541,133	0.34
	ルクセンブルグ	293,541,362	0.24
	オーストリア	190,479,454	0.16
	ポルトガル	155,856,530	0.13
	ギリシャ	143,729,098	0.12
	ジャージー	125,790,134	0.10
	ケイマン島	77,512,138	0.06
	ニュージーランド	63,892,599	0.05
	マン島	54,332,016	0.04
	リベリア	33,025,733	0.03
	ガーンジー	28,698,119	0.02
	モーリシャス	21,695,605	0.02
	キプロス	13,697,295	0.01
	小計	116,101,865,468	95.37
投資信託受益証券	カナダ	162,634,357	0.13
	パナマ	110,277,597	0.09
	小計	272,911,954	0.22
投資証券	アメリカ	1,081,200,536	0.89
	オーストラリア	337,463,210	0.28
	フランス	150,242,465	0.12
	イギリス	142,932,227	0.12
	香港	39,893,822	0.03
	シンガポール	32,525,959	0.03
	オランダ	20,292,216	0.02
	カナダ	15,061,350	0.01
	小計	1,819,611,785	1.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,547,493,874	2.91

合計(純資産総額)	121,741,883,081	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 J-REITインデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	3,559,614,120	99.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		35,454,354	0.99
合計(純資産総額)		3,595,068,474	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

住信 グローバルREITインデックス マザーファンドの投資状況

(平成22年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	3,431,089,674	61.42
	オーストラリア	747,849,707	13.39
	イギリス	362,289,156	6.49
	フランス	352,326,739	6.31
	シンガポール	185,952,373	3.33
	カナダ	152,183,167	2.72
	オランダ	126,235,578	2.26
	香港	110,397,718	1.98
	ベルギー	40,209,116	0.72
	ニュージーランド	18,661,374	0.33
	ドイツ	4,105,156	0.07
	イタリア	2,883,780	0.05
	ガーンジー	2,636,004	0.05
	イスラエル	1,591,023	0.03
	ギリシャ	1,425,488	0.03
小計		5,539,836,053	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		46,308,988	0.83
合計(純資産総額)		5,586,145,041	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 【投資資産】（平成22年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

a．投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	住信 外国株式インデックス マザーファンド	613,183,310	0.8988	551,160,907	0.8857	543,096,457	21.54
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	723,366,778	0.6536	472,815,186	0.6596	477,132,726	18.92
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	256,531,406	1.7603	451,594,580	1.7438	447,339,465	17.74
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	331,772,161	1.2079	400,769,926	1.1981	397,496,226	15.76
日本	親投資信託 受益証券	住信 J-REITインデックス マザーファンド	441,672,252	0.6761	298,645,843	0.7015	309,833,084	12.29
日本	親投資信託 受益証券	住信 グローバルREITインデックス マザーファンド	426,739,882	0.7011	299,200,591	0.6964	297,181,653	11.78

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.03
合計	98.03

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第288回利付国債 (10年)	1,970,000,000	106.50	2,098,050,000	106.55	2,099,172,900	1.7	2017/09/20	1.31
日本	国債 証券	第89回利付国債 (5年)	1,900,000,000	100.51	1,909,813,000	99.91	1,898,290,000	0.4	2015/06/20	1.19

日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,820,000,000	100.93	1,836,961,400	101.81	1,852,996,600	1.3	2019/12/20	1.16
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	1,840,000,000	100.46	1,848,629,600	100.47	1,848,795,200	0.5	2014/12/20	1.16
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	1,730,000,000	104.24	1,803,518,000	104.71	1,811,552,200	1.5	2018/09/20	1.13
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	1,700,000,000	100.42	1,707,250,000	100.40	1,706,800,000	0.5	2015/03/20	1.07
日本	国債証券	第84回利付国債(5年)	1,610,000,000	101.55	1,635,050,000	101.33	1,631,445,200	0.7	2014/06/20	1.02
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,580,000,000	101.26	1,599,908,000	102.39	1,617,904,200	1.4	2020/03/20	1.01
日本	国債証券	第63回利付国債(5年)	1,590,000,000	101.87	1,619,733,000	101.32	1,611,131,100	1.2	2012/03/20	1.01
日本	国債証券	第85回利付国債(5年)	1,570,000,000	101.48	1,593,236,000	101.31	1,590,582,700	0.7	2014/09/20	0.99
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1,500,000,000	104.87	1,573,050,000	105.12	1,576,875,000	1.5	2017/12/20	0.99
日本	国債証券	第61回利付国債(5年)	1,530,000,000	101.63	1,554,939,000	101.09	1,546,692,300	1.2	2011/12/20	0.97
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	1,440,000,000	106.66	1,535,904,000	106.57	1,534,651,200	1.7	2016/12/20	0.96
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,430,000,000	106.80	1,527,317,400	106.60	1,524,451,500	1.7	2017/03/20	0.95
日本	国債証券	第235回利付国債(10年)	1,490,000,000	101.93	1,518,876,200	101.29	1,509,295,500	1.4	2011/12/20	0.94
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	1,410,000,000	101.80	1,435,380,000	101.44	1,430,402,700	0.9	2012/12/20	0.89
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	1,400,000,000	100.99	1,413,910,000	99.52	1,393,378,000	1.1	2020/06/20	0.87
日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	1,280,000,000	105.53	1,350,900,000	105.02	1,344,371,200	1.5	2015/09/20	0.84
日本	国債証券	第300回利付国債(10年)	1,250,000,000	104.04	1,300,521,500	104.26	1,303,350,000	1.5	2019/03/20	0.81
日本	国債証券	第269回利付国債(10年)	1,250,000,000	104.13	1,301,625,000	103.79	1,297,475,000	1.3	2015/03/20	0.81
日本	国債証券	第256回利付国債(10年)	1,240,000,000	104.00	1,289,686,800	103.44	1,282,718,000	1.4	2013/12/20	0.80
日本	国債証券	第70回利付国債(5年)	1,200,000,000	101.65	1,219,878,000	101.35	1,216,296,000	0.8	2013/03/20	0.76
日本	国債証券	第237回利付国債(10年)	1,190,000,000	102.41	1,218,679,000	101.71	1,210,420,400	1.5	2012/03/20	0.76
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	1,190,000,000	101.95	1,213,205,000	101.64	1,209,599,300	0.8	2014/03/20	0.76
日本	国債証券	第240回利付国債(10年)	1,170,000,000	102.30	1,196,985,500	101.72	1,190,182,500	1.3	2012/06/20	0.74
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1,140,000,000	102.01	1,162,914,000	102.98	1,174,017,600	1.4	2019/09/20	0.73
日本	国債証券	第286回利付国債(10年)	1,090,000,000	107.46	1,171,404,200	107.25	1,169,057,700	1.8	2017/06/20	0.73
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1,060,000,000	104.91	1,112,141,000	104.32	1,105,887,400	1.5	2014/09/20	0.69

日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,060,000,000	102.20	1,083,320,000	102.92	1,090,994,400	1.3	2018/12/20	0.68
日本	国債証券	第66回利付国債 (5年)	1,070,000,000	102.11	1,092,577,000	101.63	1,087,537,300	1.1	2012/09/20	0.68

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	74.81
地方債証券	6.38
特殊債券	10.21
社債券	8.47
合計	99.86

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,439,200	3,270.95	4,707,551,240	3,220.00	4,634,224,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,367,600	439.39	3,676,639,764	396.00	3,313,569,600	2.50
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	945,100	2,767.98	2,616,017,898	3,010.00	2,844,751,000	2.15
日本	株式	キヤノン	電気機器	695,900	3,737.95	2,601,239,405	3,945.00	2,745,325,500	2.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	836,200	2,695.61	2,254,069,082	2,569.00	2,148,197,800	1.62
日本	株式	三菱商事	卸売業	885,400	2,045.26	1,810,873,204	2,116.00	1,873,506,400	1.41
日本	株式	ソニー	電気機器	629,000	2,798.98	1,760,558,420	2,971.00	1,868,759,000	1.41
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,490,200	153.79	2,074,657,858	133.00	1,794,196,600	1.35
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	472,000	3,681.72	1,737,771,840	3,790.00	1,788,880,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	439,500	3,796.25	1,668,451,875	3,890.00	1,709,655,000	1.29
日本	株式	東京電力	電気・ガス業	824,600	2,195.93	1,810,763,878	1,950.00	1,607,970,000	1.21

日本	株式	任天堂	その他製品	64,100	26,696.78	1,711,263,598	22,730.00	1,456,993,000	1.10
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	489,600	2,197.17	1,075,734,432	2,900.00	1,419,840,000	1.07
日本	株式	ファナック	電気機器	116,600	9,667.67	1,127,250,322	11,990.00	1,398,034,000	1.06
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,109,200	1,160.48	1,287,204,416	1,204.00	1,335,476,800	1.01
日本	株式	小松製作所	機械	555,800	1,725.25	958,893,950	2,318.00	1,288,344,400	0.97
日本	株式	三井物産	卸売業	954,400	1,287.73	1,229,009,512	1,307.00	1,247,400,800	0.94
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,139	135,303.73	1,236,540,788	135,800.00	1,241,076,200	0.94
日本	株式	野村ホールディングス	証券、 商品先物取引業	2,329,400	555.20	1,293,282,880	482.00	1,122,770,800	0.85
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,415,200	667.18	944,193,136	785.00	1,110,932,000	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	774,000	1,388.05	1,074,350,700	1,412.00	1,092,888,000	0.83
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,515,000	370.77	932,486,550	396.00	995,940,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	419,800	2,542.35	1,067,278,530	2,367.00	993,666,600	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	194,800	5,873.84	1,144,224,032	5,000.00	974,000,000	0.74
日本	株式	東芝	電気機器	2,211,000	465.88	1,030,060,680	436.00	963,996,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	462,500	2,092.96	967,994,000	2,045.00	945,812,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,120,000	744.45	833,784,000	829.00	928,480,000	0.70
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	457,100	2,084.74	952,934,654	2,013.00	920,142,300	0.69
日本	株式	新日本製鐵	鉄鋼	3,078,000	317.88	978,434,640	277.00	852,606,000	0.64
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,716	412,225.13	707,378,323	478,500.00	821,106,000	0.62

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	97.34
合計	97.34

(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	0.09
		鉱業	0.48
		建設業	1.93
		食料品	2.94
		繊維製品	0.85
		パルプ・紙	0.36
		化学	5.64
		医薬品	4.12
		石油・石炭製品	0.83
		ゴム製品	0.60

ガラス・土石製品	1.23
鉄鋼	2.31
非鉄金属	1.29
金属製品	0.63
機械	4.80
電気機器	14.85
輸送用機器	9.80
精密機器	1.41
その他製品	2.10
電気・ガス業	4.79
陸運業	3.49
海運業	0.63
空運業	0.34
倉庫・運輸関連業	0.23
情報・通信業	5.61
卸売業	5.13
小売業	3.49
銀行業	8.79
証券、商品先物取引業	1.50
保険業	2.44
その他金融業	0.69
不動産業	2.32
サービス業	1.63
合計	97.34

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	234	1,912,923,920	2,007,720,000	2,007,720,000	1.52

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

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	T 1.75% 07/31/15	27,000,000	8,606.55	2,323,769,581	8,565.25	2,312,618,976	1.750	2015/07/31	0.96
アメリカ	国債 証券	T 0.625% 06/30/12	26,000,000	8,427.84	2,191,239,102	8,452.01	2,197,524,590	0.625	2012/06/30	0.91
アメリカ	国債 証券	T 3.125% 05/15/19	24,600,000	8,355.89	2,055,550,708	8,820.69	2,169,891,930	3.125	2019/05/15	0.90
アメリカ	国債 証券	T 1.375% 01/15/13	23,000,000	8,482.30	1,950,929,503	8,574.47	1,972,128,675	1.375	2013/01/15	0.82
アメリカ	国債 証券	T 1.75% 08/15/12	22,000,000	8,594.22	1,890,729,121	8,611.34	1,894,494,937	1.750	2012/08/15	0.78
アメリカ	国債 証券	T 3.375% 11/15/19	18,300,000	8,486.25	1,552,984,178	8,933.93	1,634,910,419	3.375	2019/11/15	0.68
アメリカ	国債 証券	T 0.875% 01/31/12	18,000,000	8,454.65	1,521,837,196	8,478.35	1,526,103,365	0.875	2012/01/31	0.63
アメリカ	国債 証券	T 2.25% 05/31/14	17,000,000	8,589.61	1,460,234,517	8,808.84	1,497,504,234	2.250	2014/05/31	0.62
アメリカ	国債 証券	T 2.625% 08/15/20	17,000,000	8,497.27	1,444,537,305	8,313.76	1,413,339,571	2.625	2020/08/15	0.59
アメリカ	国債 証券	T 2.75% 05/31/17	16,000,000	8,610.55	1,377,688,647	8,800.94	1,408,151,700	2.750	2017/05/31	0.58
アメリカ	国債 証券	T 2.875% 01/31/13	15,800,000	8,825.96	1,394,502,593	8,858.88	1,399,703,632	2.875	2013/01/31	0.58
アメリカ	国債 証券	T 1.125% 12/15/12	16,200,000	8,437.53	1,366,880,467	8,527.07	1,381,385,441	1.125	2012/12/15	0.57
アメリカ	国債 証券	T 1.875% 06/30/15	15,900,000	8,553.78	1,360,051,717	8,623.19	1,371,087,383	1.875	2015/06/30	0.57
アメリカ	国債 証券	T 1% 12/31/11	16,100,000	8,473.08	1,364,166,709	8,487.56	1,366,498,619	1.000	2011/12/31	0.57
アメリカ	国債 証券	T 0.5% 10/15/13	16,200,000	8,428.56	1,365,427,061	8,374.33	1,356,641,662	0.500	2013/10/15	0.56
アメリカ	国債 証券	T 3.375% 06/30/13	15,000,000	8,962.90	1,344,435,679	9,020.84	1,353,126,023	3.375	2013/06/30	0.56
アメリカ	国債 証券	T 2.375% 02/28/15	14,500,000	8,565.25	1,241,962,042	8,825.96	1,279,765,037	2.375	2015/02/28	0.53
アメリカ	国債 証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,458.60	1,184,204,175	8,857.56	1,240,059,384	2.750	2016/11/30	0.51
アメリカ	国債 証券	T 3.25% 07/31/16	13,500,000	8,760.12	1,182,617,528	9,124.86	1,231,856,226	3.250	2016/07/31	0.51
アメリカ	国債 証券	T 2.25% 01/31/15	14,000,000	8,519.17	1,192,683,843	8,789.09	1,230,473,671	2.250	2015/01/31	0.51
アメリカ	国債 証券	T 2.75% 02/15/19	14,100,000	8,157.07	1,150,147,244	8,610.02	1,214,013,370	2.750	2019/02/15	0.50
アメリカ	国債 証券	T 3.5% 05/15/20	13,350,000	8,738.88	1,166,641,513	8,977.38	1,198,481,355	3.500	2020/05/15	0.50
アメリカ	国債 証券	T 4.0% 02/15/15	12,700,000	9,180.16	1,165,880,716	9,392.15	1,192,803,664	4.000	2015/02/15	0.49
アメリカ	国債 証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	9,287.39	1,160,924,587	9,535.67	1,191,959,648	4.250	2015/08/15	0.49
イタリア	国債 証券	BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000	11,755.52	1,210,818,813	11,500.89	1,184,592,061	4.750	2013/02/01	0.49

アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/13	12,600,000	9,195.96	1,158,691,432	9,238.09	1,164,000,442	4.250	2013/08/15	0.48
イギリス	国債証券	UKT 5% 03/07/12	8,400,000	14,066.32	1,181,571,131	13,833.72	1,162,032,742	5.000	2012/03/07	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 03/15/12	13,500,000	8,537.60	1,152,576,590	8,540.23	1,152,932,104	1.375	2012/03/15	0.48
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000	12,370.57	1,131,907,222	12,165.96	1,113,185,376	4.250	2014/07/04	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,607.33	1,075,917,225	8,837.81	1,104,727,031	2.375	2014/08/31	0.46

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.72
特殊債券	0.79
合計	98.51

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,521	5,084.00	1,776,967,944	5,852.55	2,045,589,652	1.68
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	62,403	21,622.83	1,349,330,040	26,702.63	1,666,324,525	1.37
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	540,918	2,165.73	1,171,487,208	2,132.87	1,153,709,776	0.95
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	237,799	4,422.05	1,051,561,327	4,700.28	1,117,722,478	0.92
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	87,943	10,549.76	927,777,658	12,041.34	1,058,951,590	0.87
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	197,502	5,142.15	1,015,585,975	5,235.69	1,034,060,253	0.85

イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,202,138	822.56	988,832,196	854.57	1,027,313,065	0.84
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	189,147	4,912.09	929,108,657	5,217.15	986,809,349	0.81
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	732,190	1,368.54	1,002,034,817	1,345.79	985,375,371	0.81
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	406,818	2,051.97	834,780,162	2,334.27	949,626,714	0.78
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	137,752	6,209.85	855,420,125	6,884.01	948,287,013	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	273,513	3,321.08	908,358,745	3,194.67	873,785,334	0.72
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,843	40,692.29	685,380,368	49,054.40	826,223,422	0.68
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	230,158	3,165.99	728,679,859	3,521.03	810,393,959	0.67
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	340,261	2,397.48	815,769,452	2,292.14	779,927,209	0.64
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	553,171	1,281.74	709,025,103	1,395.51	771,956,326	0.63
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	142,395	4,336.53	617,500,787	5,341.87	760,656,333	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,612,111	181.04	653,944,522	208.98	754,879,437	0.62
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,288,520	640.20	824,919,781	561.82	723,917,820	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	381,576	1,791.58	683,624,006	1,797.47	685,874,885	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	144,709	4,433.01	641,497,862	4,556.95	659,432,473	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	689,710	1,316.29	907,863,479	953.09	657,358,255	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	391,668	1,942.42	760,785,127	1,638.20	641,633,964	0.53
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	139,923	4,255.63	595,461,216	4,537.93	634,962,108	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	275,365	1,899.44	523,040,892	2,293.82	631,640,332	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	213,848	2,844.95	608,387,979	2,923.32	625,147,482	0.51
オランダ	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	243,160	2,382.41	579,306,912	2,552.30	620,617,620	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	127,001	3,727.26	473,366,013	4,872.49	618,811,280	0.51
アンティル	株式	SCHLUMBERGER	エネルギー	93,707	4,702.26	440,635,240	6,488.78	608,045,044	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	110,599	5,297.21	585,866,372	5,394.12	596,584,576	0.49

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
----	----------

株式	95.37
投資信託受益証券	0.22
投資証券	1.49
合計	97.09

(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	11.17
		素材	7.72
		資本財	7.32
		商業・専門サービス	0.77
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	1.47
		メディア	2.53
		小売	2.65
		食品・生活必需品小売り	2.41
		食品・飲料・タバコ	6.20
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	2.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.95
		銀行	7.96
		各種金融	5.37
		保険	3.97
		不動産	0.70
		ソフトウェア・サービス	5.32
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.51		
電気通信サービス	4.16		
公益事業	3.77		
半導体・半導体製造装置	1.66		
合計			95.37

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	-------	-----	---------	----	----	----------------	----------------	-------------	-------------

株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	73	21,173,909	21,653,625	1,824,750,978	1.50
	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	48	2,711,670	2,673,120	350,686,612	0.29
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	16	2,319,852	2,363,200	195,649,328	0.16
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	23	2,660,084	2,655,925	216,271,972	0.18
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	193	5,325,391.5	5,162,750	571,309,915	0.47
	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	23	1,466,764	1,471,080	124,026,754	0.10

(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 J-REITインデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	573	829,807.12	475,479,480	817,000.00	468,141,000	13.02
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	517	839,270.88	433,903,050	807,000.00	417,219,000	11.61
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	1,783	129,247.78	230,448,805	134,700.00	240,170,100	6.68
日本	投資証券	森トラスト総合リ・ト投資法人	256	755,690.63	193,456,802	749,000.00	191,744,000	5.33
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	322	513,896.50	165,474,675	532,000.00	171,304,000	4.76
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	755	203,552.72	153,682,311	212,200.00	160,211,000	4.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,035	140,652.59	145,575,436	150,100.00	155,353,500	4.32
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	205	688,453.18	141,132,903	710,000.00	145,550,000	4.05
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	266	433,917.51	115,422,058	466,000.00	123,956,000	3.45
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,281	92,667.21	118,706,699	96,700.00	123,872,700	3.45
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	156	687,804.57	107,297,514	712,000.00	111,072,000	3.09
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	418	229,152.37	95,785,692	261,300.00	109,223,400	3.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	165	509,800.58	84,117,096	535,000.00	88,275,000	2.46
日本	投資証券	東急リアル・エステ - ト投資法人	179	471,817.09	84,455,260	488,000.00	87,352,000	2.43
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	247	308,801.10	76,273,872	336,000.00	82,992,000	2.31
日本	投資証券	トップリート投資法人	164	482,291.87	79,095,868	498,000.00	81,672,000	2.27
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	163	474,017.80	77,264,902	497,000.00	81,011,000	2.25
日本	投資証券	グロ - バル・ワン不動産投資法人	102	619,050.59	63,143,161	710,000.00	72,420,000	2.01
日本	投資証券	ビ・ライフ投資法人	125	470,565.62	58,820,703	536,000.00	67,000,000	1.86
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	245	260,075.42	63,718,479	267,200.00	65,464,000	1.82
日本	投資証券	福岡リート投資法人	113	528,728.15	59,746,281	551,000.00	62,263,000	1.73
日本	投資証券	プレミアム投資法人	148	362,405.01	53,635,942	406,500.00	60,162,000	1.67
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	133	404,500.66	53,798,588	401,500.00	53,399,500	1.49
日本	投資証券	M I D リート投資法人	194	196,372.23	38,096,213	220,500.00	42,777,000	1.19
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,406	26,568.54	37,355,369	30,350.00	42,672,100	1.19
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	122	278,516.77	33,979,046	329,500.00	40,199,000	1.12

日本	投資証券	平和不動産リート投資法人	735	44,493.36	32,702,625	51,100.00	37,558,500	1.04
日本	投資証券	阪急リート投資法人	90	409,059.71	36,815,374	398,000.00	35,820,000	1.00
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	83	344,811.89	28,619,387	374,000.00	31,042,000	0.86
日本	投資証券	日本コマース投資法人	267	91,366.85	24,394,949	94,400.00	25,204,800	0.70

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.01
合計	99.01

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

c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 グローバルREITインデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	40,478	8,525.10	345,079,096	8,319.97	336,776,033	6.03
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	292,705	981.38	287,257,486	1,001.58	293,170,108	5.25
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,622	16,580.19	209,275,241	14,922.50	188,351,807	3.37
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	39,184	4,081.83	159,942,628	4,213.50	165,101,784	2.96
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	19,283	8,529.00	164,464,886	8,212.95	158,370,395	2.84
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	22,427	7,117.07	159,614,703	6,898.34	154,709,120	2.77
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	19,263	7,193.55	138,569,486	7,094.69	136,665,038	2.45
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	91,009	1,350.32	122,891,644	1,387.08	126,237,145	2.26
アメリカ	投資証券	HCP INC	42,862	2,871.72	123,088,019	2,769.95	118,725,806	2.13
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,773	8,940.37	105,254,987	9,279.81	109,251,231	1.96
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	329,422	303.71	100,049,309	302.10	99,520,132	1.78
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	21,714	4,511.44	97,961,514	4,359.28	94,657,560	1.69
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	105,597	913.09	96,420,242	831.74	87,829,734	1.57
アメリカ	投資証券	PROLOGIS	76,969	1,186.67	91,337,163	1,112.36	85,617,544	1.53
香港	投資証券	LINK REIT	306,500	270.62	82,948,039	264.19	80,976,533	1.45
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	56,101	1,473.23	82,650,082	1,414.05	79,329,652	1.42

イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	121,553	670.07	81,449,075	629.84	76,559,328	1.37
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	18,334	4,048.49	74,225,100	3,905.07	71,595,586	1.28
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	17,985	3,899.16	70,126,434	3,950.57	71,051,138	1.27
オランダ	投資証券	CORIO NV	12,580	5,417.33	68,150,039	4,996.85	62,860,401	1.13
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	10,812	5,513.52	59,612,272	5,535.69	59,851,948	1.07
アメリカ	投資証券	AMB PROPERTY CORP	23,263	2,466.17	57,370,696	2,484.27	57,791,796	1.03
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,490	6,706.69	56,939,839	6,623.62	56,234,550	1.01
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	236,544	227.19	53,740,633	228.00	53,932,978	0.97
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,069	4,483.88	54,116,061	4,459.56	53,822,531	0.96
アメリカ	投資証券	NATIONWIDE HEALTH PPTYS	17,108	3,294.60	56,364,075	3,069.11	52,506,392	0.94
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	97,813	563.33	55,101,450	517.80	50,648,249	0.91
オーストラリア	投資証券	MIRVAC GROUP	472,121	104.62	49,397,895	105.04	49,593,808	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	24,798	1,892.61	46,933,182	1,892.70	46,935,278	0.84
オーストラリア	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	316,510	146.15	46,261,092	146.57	46,392,136	0.83

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.17
合計	99.17

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1期計算期間末 (平成20年11月10日)	(分配付)	994,679,991	(分配付)	0.7198
	(分配落)	994,679,991	(分配落)	0.7198
第2期計算期間末 (平成21年11月10日)	(分配付)	1,764,446,119	(分配付)	0.7679
	(分配落)	1,764,446,119	(分配落)	0.7679
第3期計算期間末 (平成22年11月10日)	(分配付)	2,508,787,040	(分配付)	0.7788
	(分配落)	2,508,787,040	(分配落)	0.7788
平成21年11月末日		1,723,158,323		0.7406
12月末日		1,858,660,387		0.7851

平成22年 1月末日	1,861,671,821	0.7612
2月末日	1,917,083,093	0.7593
3月末日	2,094,478,095	0.8137
4月末日	2,202,119,952	0.8319
5月末日	2,103,811,177	0.7615
6月末日	2,118,386,154	0.7350
7月末日	2,275,320,598	0.7582
8月末日	2,266,026,270	0.7347
9月末日	2,405,532,920	0.7659
10月末日	2,433,602,289	0.7611
11月末日	2,521,863,568	0.7777

【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20年 1月 9日～平成20年11月10日）	0.0000
第2期計算期間（平成20年11月11日～平成21年11月10日）	0.0000
第3期計算期間（平成21年11月11日～平成22年11月10日）	0.0000

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間（平成20年 1月 9日～平成20年11月10日）	28.0
第2期計算期間（平成20年11月11日～平成21年11月10日）	6.7
第3期計算期間（平成21年11月11日～平成22年11月10日）	1.4

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

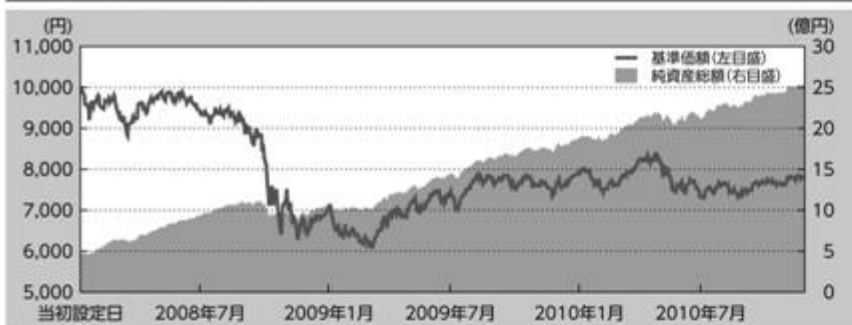
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（参考情報）

当初設定日：2008年1月 9日

作成基準日：2010年11月30日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	7,777円
純資産総額	25億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	2.18%
3ヶ月	5.85%
6ヶ月	2.13%
1年	5.01%
3年	—
5年	—
設定来	-22.23%

※上記は作成基準日からの期間です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

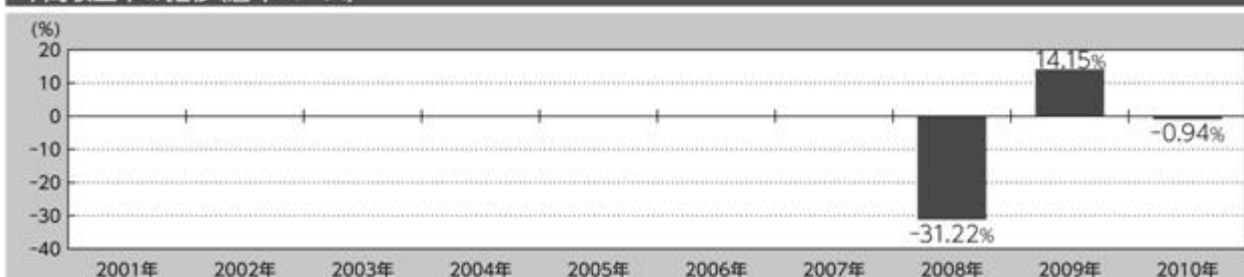
決算期	2008年11月	2009年11月	2010年11月	—	—
分配金	0円	0円	0円	—	—

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
住信 外国株式 インデックス マザーファンド	21.5%	EXXON MOBIL	米国	株式	エネルギー	—	—	0.4%
		APPLE INC	米国	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	—	—	0.3%
住信 国内株式 インデックス マザーファンド	18.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	0.7%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.5%
住信 外国債券 インデックス マザーファンド	17.7%	T 1.75% 07/31/15	米国	国債証券	—	1.750%	2015/7/31	0.2%
		T 0.625% 06/30/12	米国	国債証券	—	0.625%	2012/6/30	0.2%
住信 国内債券 インデックス マザーファンド	15.8%	第288回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.7%	2017/9/20	0.2%
		第89回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.4%	2015/6/20	0.2%
住信 J-REIT インデックス マザーファンド	12.3%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	—	—	—	1.6%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	—	—	—	1.4%
住信 グローバル REIT インデックス マザーファンド	11.8%	SIMON PROPERTY GROUP	米国	投資証券	—	—	—	0.7%
		WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	—	—	—	0.6%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2010年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

最新の運用の内容等は、委託者のホームページでご確認いただけます。

(4) 【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	受益権総口数(口)
第1期計算期間 (平成20年 1月 9日～平成20年11月10日)	1,620,495,479	238,628,571	1,381,866,908
第2期計算期間 (平成20年11月11日～平成21年11月10日)	1,146,528,947	230,541,088	2,297,854,767

第3期計算期間 (平成21年11月11日～平成22年11月10日)	1,325,647,358	402,047,721	3,221,454,404
--------------------------------------	---------------	-------------	---------------

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

(イ) 申込手続

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

取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、取得の申込みを受け付けないものとし、ニューヨーク、ロンドンの銀行および取引所の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

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

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

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

申込みには、「一般コース」と「自動けいぞく投資（再投資）コース」があり、「自動けいぞく投資（再投資）コース」を選択した場合には、取得申込者は指定販売会社との間で「自動けいぞく投資（再投資）契約」を別途締結します。なお、指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、指定販売会社によって取扱いコースが異なる場合があります。取扱いコースの詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

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

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

(ロ) 申込単位

一般コース

1万口以上1万口単位

自動けいぞく投資（再投資）コース

1万円以上1円単位

積立買付サービスの場合、買付単位は1千円以上1円単位となりますのでご注意ください。

分配金の再投資および確定拠出年金制度にもとづくお申込みの場合、1円以上1円単位です。

(八) 申込手数料

ありません。

2【換金（解約）手続等】

(イ) 受益権の買取請求

本ファンドのご換金の方法は、ご解約の請求のほか受益権の買取の方法によることができます。ただし、受益権の買取は、指定販売会社によっては行わない場合がありますので、詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

(ロ) 受益権のご解約の請求

ご解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者にご解約の請求をすることができます。

ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、ご解約の請求を受け付けられないものとします。ニューヨーク、ロンドンの銀行および取引所の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。なお、解約単位は、以下のとおりです。

1) 一般コース：1万口単位

2) 自動けいぞく投資（再投資）コース：1円単位

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

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

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として控除した価額（解約価額）とします。

解約価額 = 解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保金

= 解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - (解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.15%)

ご解約の受取金額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた額（解約代金）となります。

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

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

前記により、ご解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日のご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受

益権のご解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご解約の請求を受け付けられたものとして、前記の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等につきましては、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

(ハ) 換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

(イ) 基準価額の算出方法

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

[主要な投資対象の評価方法]

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1) 株式および不動産投資信託証券

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

2) 公社債

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

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。）

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

(ロ) 基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

(ハ) 基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等につきましては、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」に記載されている先と同じです。

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成20年1月9日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

(4) 【計算期間】

原則として、毎年11月11日から翌年11月10日（第1計算期間は平成20年1月9日から平成20年11月10日）までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

(イ) 信託の終了

- (a) 委託者は、信託期間中において、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (d) 前記(c)の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (e) 前記(c)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- (f) 前記(c)から(e)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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)から(e)までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- 委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ) 投資信託約款の変更等 (b)」の書面決議で否決された場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。
- 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ロ) 投資信託約款の変更等

- (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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、この投資信託約款は本規定に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- (b) 委託者は、前記(a)の事項(前記(a)の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (c) 前記(b)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 前記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 前記(b)から(e)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 前記(a)から(f)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかるとはならない他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- 委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。
- (ハ) 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。
- (ニ) 運用報告書
委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知っている受益者に対して交付します。
- (ホ) 信託事務処理の再信託
受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。
- (ヘ) 公告
委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。
- (ト) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限
受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。
- 他の受益者の氏名または名称および住所
他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

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

（イ）収益分配金請求権

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

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

前記にかかわらず、「自動けいぞく投資（再投資）コース」を選択した受益者については、収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。この場合、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われ、指定販売会社は、受益者に対して遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は委託者に帰属するものとします。

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として、取得申込者とします。）

に、原則として、決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。「自動けいぞく投資（再投資）コース」をお申込みの場合は、分配金は、税金を差し引いた後、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

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

（ハ）換金（解約）請求権

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

（ニ）反対者の買取請求権

投資信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

（ホ）帳簿閲覧・謄写請求権

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

なお、受益者には、受益者集会の権利はありません。

第3【ファンドの経理状況】

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

財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により改正されておりますが、第2期計算期間（平成20年11月11日から平成21年11月10日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第3期計算期間（平成21年11月11日から平成22年11月10日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

投資信託財産計算規則は、平成21年6月24日付内閣府令第35号附則第16条第2項により改正されておりますが、第2期計算期間（平成20年11月11日から平成21年11月10日まで）については、改正前の投資信託財産計算規則に基づき、第3期計算期間（平成21年11月11日から平成22年11月10日まで）については、改正後の投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成20年11月11日から平成21年11月10日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第3期計算期間（平成21年11月11日から平成22年11月10日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

1【財務諸表】

SBI資産設計オープン（資産成長型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成21年11月10日現在)	第3期 (平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,360,675	55,013,219
親投資信託受益証券	1,724,877,728	2,464,729,946
未収利息	102	95
流動資産合計	1,770,238,505	2,519,743,260
資産合計		
	1,770,238,505	2,519,743,260
負債の部		
流動負債		
未払解約金	165,788	2,659,026
未払受託者報酬	326,957	481,571
未払委託者報酬	5,231,255	7,705,081
その他未払費用	68,386	110,542
流動負債合計	5,792,386	10,956,220
負債合計		
	5,792,386	10,956,220
純資産の部		
元本等		
元本	2,297,854,767	3,221,454,404
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	533,408,648	712,667,364
（分配準備積立金）	-	95,692,058
元本等合計	1,764,446,119	2,508,787,040
純資産合計		
	1,764,446,119	2,508,787,040
負債純資産合計		
	1,770,238,505	2,519,743,260

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日)	第3期 (自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
営業収益		
受取利息	34,403	35,022
有価証券売買等損益	128,373,138	50,572,218
営業収益合計	128,407,541	50,607,240
営業費用		
受託者報酬	548,102	885,272
委託者報酬	8,769,555	14,164,221
その他費用	68,386	110,542
営業費用合計	9,386,043	15,160,035
営業利益又は営業損失（ ）	119,021,498	35,447,205
経常利益又は経常損失（ ）	119,021,498	35,447,205
当期純利益又は当期純損失（ ）	119,021,498	35,447,205
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,056,368	3,249,767
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	387,186,917	533,408,648
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,982,820	93,218,553
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	66,982,820	93,218,553
剰余金減少額又は欠損金増加額	329,169,681	304,674,707
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	329,169,681	304,674,707
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	533,408,648	712,667,364

(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20年11月11日 至平成21年11月10日)	第3期 (自平成21年11月11日 至平成22年11月10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21年11月10日現在)	第3期 (平成22年11月10日現在)
1. 期首元本	1,381,866,908円	2,297,854,767円
期中追加設定元本額	1,146,528,947円	1,325,647,358円
期中一部解約元本額	230,541,088円	402,047,721円
期末元本額	2,297,854,767円	<u>3,221,454,404円</u>
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を533,408,648円下回っております。	純資産額は、元本を712,667,364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	2,297,854,767口	3,221,454,404口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第2期 (自平成20年11月11日 至平成21年11月10日)	第3期 (自平成21年11月11日 至平成22年11月10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(40,497,837円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(17,296,588円)及び分配準備積立金(15,660,633円)により、分配対象収益は73,455,058円(1万口当たり319円66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(47,103,573円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(56,094,017円)及び分配準備積立金(48,588,485円)により、分配対象収益は151,786,075円(1万口当たり471円17銭)であります。分配は見送りとさせていただきます。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 (自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、主として、「住信 国内債券インデックス 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 外国債券インデックス 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J-REITインデックス マザーファンド」および「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	第3期 (平成22年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	a. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

第2期(平成21年11月10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	1,724,877,728	129,536,180
合 計	1,724,877,728	129,536,180

（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22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	52,517,701
合 計	52,517,701

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

第2期 （自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）
該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

第2期 （平成21年11月10日現在）
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期 （平成22年11月10日現在）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 （自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	第3期 （自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10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21年11月10日現在）	第3期 （平成22年11月10日現在）

1口当たり純資産額 = 0.7679円	1口当たり純資産額 = 0.7788円
---------------------	---------------------

(4) 【附属明細表】（平成22年11月10日現在）

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数（口）	評価額（円）
親投資信託 受益証券	住信 J-REITインデックス マザーファンド	440,229,615	297,683,265
	住信 グローバルREITインデックス マザーファンド	425,272,546	298,243,636
	住信 外国株式インデックス マザーファンド	610,877,782	549,179,126
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	255,369,049	449,577,210
	住信 国内株式インデックス マザーファンド	720,280,434	470,919,347
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	330,348,752	399,127,362
合計		2,782,378,178	2,464,729,946

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）

「SBI資産設計オープン（資産成長型）」は、「住信 国内債券インデックス 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 外国債券インデックス 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 J-REITインデックス マザーファンド」、「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」を投資対象にしており、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 国内債券インデックス マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	461,758,314	509,080,780
国債証券	110,351,809,500	119,350,717,400
地方債証券	9,421,513,114	10,191,558,483
特殊債券	16,807,374,565	16,632,727,104
社債券	12,035,935,100	13,534,814,540
未収入金	99,313,000	100,695,000
未収利息	533,799,420	552,828,919
前払費用	31,634,470	17,761,251
流動資産合計	149,743,137,483	160,890,183,477
資産合計	149,743,137,483	160,890,183,477
負債の部		
流動負債		
未払金	402,653,100	100,000,000
未払解約金	10,665,479	93,398,108
流動負債合計	413,318,579	193,398,108
負債合計	413,318,579	193,398,108
純資産の部		
元本等		
元本	128,418,752,745	133,007,073,320
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,911,066,159	27,689,712,049
元本等合計	149,329,818,904	160,696,785,369
純資産合計	149,329,818,904	160,696,785,369
負債純資産合計	149,743,137,483	160,890,183,477

（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、「SBI資産設計オープン（資産成長型）」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年11月10日及び平成22年11月10日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）
資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

	（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
1. 期首元本額	105,564,762,433円	128,418,752,745円
期中追加設定元本額	37,260,273,126円	25,696,599,139円
期中一部解約元本額	14,406,282,814円	21,108,278,564円
期末元本額	128,418,752,745円	133,007,073,320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）	228,986,199円	330,348,752円
SBI 資産設計オープン（分配型）	20,556,209円	17,512,567円
STAM 国内債券インデックス・オープン	887,729,585円	1,417,506,500円
世界経済インデックスファンド	12,327,798円	28,055,069円
住信 国内バランス30	613,022,187円	496,123,003円
住信 国内バランス60	119,458,352円	88,157,699円
すみしん マイセクション25	326,920,732円	262,470,505円
すみしん マイセクション50	251,077,045円	219,900,273円
すみしん マイセクション75	58,585,631円	52,760,517円
すみしん DC マイセクション25	5,978,904,901円	6,243,921,182円
すみしん DC マイセクション50	8,342,447,588円	8,639,136,026円
すみしん DC マイセクション75	2,207,158,059円	2,341,078,155円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	309,135,568円	329,545,821円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	22,191,070,871円	26,736,620,207円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	5,677,514,396円	7,001,393,681円
すみしん DC マイセクションS25	275,669,748円	559,774,695円
すみしん DC マイセクションS50	600,773,883円	1,026,485,046円
すみしん DC マイセクションS75	144,119,512円	210,405,626円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	35,027,336円	33,953,829円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	28,086,759円	111,094,439円

すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	11,738,329円	49,956,809円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,664,881円	9,671,720円
STAM 日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	3,555,394,520円	3,427,204,806円
住信 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	100,793,422円	86,189,049円
すみしん マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	678,611,429円	617,595,311円
すみしん マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	86,077,065円	79,715,834円
住信 国内バランス 30VA2(適格機関投資家専用)	15,465,393円	15,015,202円
住信 国内バランス 60VA2(適格機関投資家専用)	15,762,896円	15,565,573円
すみしん マイセクション50VA2 (適格機関投資家専用)	5,249,792円	3,436,291円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	2,419,864,847円	2,168,856,824円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,828,068,673円	3,277,667,468円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11,911,864,247円	10,303,631,652円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,000,683,344円	886,811,564円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	18,902,536,353円	16,887,000,398円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,087,592,685円	1,828,352,411円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	7,319,261,893円	6,544,749,388円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,158,987,864円	3,917,487,814円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,919,815,481円	5,487,580,905円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	3,289,344,278円	2,910,505,287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)	2,399,244,466円	2,197,113,190円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,919,998,461円	3,427,510,425円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)		2,729,310,885円
すみしん 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)		331,825,682円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,929,487,711円	2,078,565,908円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	7,541,731,436円	7,568,568,412円
2.計算期間末日における受益権の総数	128,418,752,745口	133,007,073,320口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
----	----------------------------------

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

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	a. 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

(平成21年11月10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	110,351,809,500	220,712,880
地方債証券	9,421,513,114	76,691,732
特殊債券	16,807,374,565	111,715,874
社債券	12,035,935,100	181,487,840
合計	148,616,632,279	590,608,326

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

（平成22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,120,067,500
地方債証券	77,713,322
特殊債券	130,886,836
社債券	94,922,200
合計	1,423,589,858

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

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）
該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

（平成21年11月10日現在）
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成22年11月10日現在）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
1口当たり純資産額 = 1.1628円	1口当たり純資産額 = 1.2082円

（3）附属明細表（平成22年11月10日現在）

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	300,000,000	321,381,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	176,180,800	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	154,001,400	
	第103回利付国債（20年）	280,000,000	303,780,400	
	第104回利付国債（20年）	270,000,000	284,817,600	
	第105回利付国債（20年）	450,000,000	473,994,000	
	第106回利付国債（20年）	300,000,000	320,538,000	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	199,688,100	
	第108回利付国債（20年）	490,000,000	500,098,900	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	203,740,000	
	第10回利付国債（30年）	120,000,000	102,766,800	
	第110回利付国債（20年）	520,000,000	545,646,400	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	212,626,000	
	第112回利付国債（20年）	430,000,000	450,480,900	
	第113回利付国債（20年）	860,000,000	899,465,400	
	第114回利付国債（20年）	380,000,000	397,046,800	
	第115回利付国債（20年）	550,000,000	583,335,500	
	第116回利付国債（20年）	180,000,000	190,602,000	
	第117回利付国債（20年）	600,000,000	625,824,000	
	第118回利付国債（20年）	800,000,000	820,200,000	
	第119回利付国債（20年）	180,000,000	178,704,000	
	第11回利付国債（30年）	40,000,000	38,491,600	
	第121回利付国債（20年）	400,000,000	403,488,000	
	第122回利付国債（20年）	140,000,000	138,882,800	
	第12回利付国債（30年）	120,000,000	123,921,600	
	第13回利付国債（30年）	90,000,000	91,224,900	
	第14回利付国債（30年）	240,000,000	260,668,800	
	第15回利付国債（30年）	170,000,000	187,839,800	
	第16回利付国債（30年）	170,000,000	187,972,400	
	第17回利付国債（30年）	120,000,000	130,347,600	
	第18回利付国債（20年）	80,000,000	86,620,000	
	第18回利付国債（30年）	140,000,000	149,319,800	
	第19回利付国債（30年）	240,000,000	256,089,600	
	第1回利付国債（30年）	40,000,000	46,346,400	
	第1回利付国債（40年）	150,000,000	163,876,500	
	第20回利付国債（20年）	110,000,000	121,050,600	
	第20回利付国債（30年）	190,000,000	209,950,000	
	第21回利付国債（30年）	130,000,000	138,600,800	
	第22回利付国債（20年）	120,000,000	134,440,800	
	第22回利付国債（30年）	220,000,000	243,203,400	

第235回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,510,949,400	
第236回利付国債（10年）	440,000,000	446,666,000	
第237回利付国債（10年）	1,190,000,000	1,212,003,100	
第238回利付国債（10年）	410,000,000	417,031,500	
第239回利付国債（10年）	550,000,000	561,154,000	
第23回利付国債（20年）	40,000,000	46,046,000	
第23回利付国債（30年）	120,000,000	132,626,400	
第240回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,191,867,300	
第241回利付国債（10年）	630,000,000	643,576,500	
第242回利付国債（10年）	360,000,000	367,095,600	
第243回利付国債（10年）	580,000,000	590,358,800	
第244回利付国債（10年）	320,000,000	325,782,400	
第245回利付国債（10年）	470,000,000	477,510,600	
第246回利付国債（10年）	350,000,000	354,861,500	
第247回利付国債（10年）	400,000,000	406,116,000	
第248回利付国債（10年）	190,000,000	192,460,500	
第249回利付国債（10年）	300,000,000	303,186,000	
第24回利付国債（20年）	20,000,000	22,995,800	
第24回利付国債（30年）	150,000,000	165,888,000	
第250回利付国債（10年）	490,000,000	494,365,900	
第251回利付国債（10年）	560,000,000	570,780,000	
第252回利付国債（10年）	440,000,000	449,605,200	
第253回利付国債（10年）	480,000,000	499,440,000	
第254回利付国債（10年）	550,000,000	569,162,000	
第255回利付国債（10年）	240,000,000	249,040,800	
第256回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,286,574,400	
第257回利付国債（10年）	460,000,000	475,860,800	
第258回利付国債（10年）	310,000,000	321,268,500	
第259回利付国債（10年）	640,000,000	667,513,600	
第25回利付国債（20年）	60,000,000	67,803,000	
第25回利付国債（30年）	210,000,000	223,872,600	
第260回利付国債（10年）	490,000,000	513,838,500	
第261回利付国債（10年）	410,000,000	432,869,800	
第262回利付国債（10年）	480,000,000	508,483,200	
第263回利付国債（10年）	710,000,000	746,231,300	
第264回利付国債（10年）	1,060,000,000	1,110,053,200	
第265回利付国債（10年）	550,000,000	577,054,500	
第266回利付国債（10年）	840,000,000	877,917,600	
第267回利付国債（10年）	370,000,000	385,203,300	
第268回利付国債（10年）	520,000,000	546,629,200	
第269回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,303,300,000	
第26回利付国債（20年）	20,000,000	23,238,400	
第26回利付国債（30年）	430,000,000	466,924,100	
第270回利付国債（10年）	940,000,000	981,266,000	
第271回利付国債（10年）	230,000,000	239,055,100	

第272回利付国債(10年)	130,000,000	136,537,700	
第273回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,350,464,000	
第274回利付国債(10年)	430,000,000	454,527,200	
第275回利付国債(10年)	230,000,000	241,969,200	
第276回利付国債(10年)	330,000,000	350,476,500	
第277回利付国債(10年)	370,000,000	393,635,600	
第278回利付国債(10年)	430,000,000	461,970,500	
第279回利付国債(10年)	340,000,000	368,838,800	
第27回利付国債(20年)	50,000,000	59,061,000	
第27回利付国債(30年)	400,000,000	443,060,000	
第280回利付国債(10年)	730,000,000	790,130,100	
第281回利付国債(10年)	390,000,000	424,261,500	
第282回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,073,040,000	
第283回利付国債(10年)	450,000,000	485,433,000	
第284回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,547,251,200	
第285回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,538,322,500	
第286回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,180,829,700	
第287回利付国債(10年)	500,000,000	544,685,000	
第288回利付国債(10年)	1,970,000,000	2,122,261,300	
第288回利付国債(2年)	560,000,000	560,487,200	
第289回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,596,225,000	
第289回利付国債(2年)	960,000,000	960,892,800	
第28回利付国債(20年)	20,000,000	24,055,200	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	332,388,000	
第290回利付国債(10年)	710,000,000	750,470,000	
第290回利付国債(2年)	250,000,000	250,247,500	
第291回利付国債(10年)	270,000,000	283,489,200	
第291回利付国債(2年)	600,000,000	600,630,000	
第292回利付国債(10年)	420,000,000	453,285,000	
第292回利付国債(2年)	800,000,000	800,888,000	
第293回利付国債(10年)	410,000,000	445,247,700	
第293回利付国債(2年)	300,000,000	300,354,000	
第294回利付国債(10年)	500,000,000	539,360,000	
第294回利付国債(2年)	700,000,000	700,812,000	
第295回利付国債(10年)	500,000,000	531,910,000	
第295回利付国債(2年)	600,000,000	600,732,000	
第296回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,838,401,800	
第296回利付国債(2年)	200,000,000	199,890,000	
第297回利付国債(10年)	640,000,000	674,060,800	
第297回利付国債(2年)	300,000,000	299,799,000	
第298回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,108,293,600	
第299回利付国債(10年)	420,000,000	438,307,800	
第29回利付国債(20年)	60,000,000	71,133,600	
第29回利付国債(30年)	470,000,000	510,932,300	
第2回利付国債(30年)	60,000,000	65,571,600	

第2回利付国債(40年)	300,000,000	312,681,000	
第300回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,324,637,500	
第301回利付国債(10年)	870,000,000	920,451,300	
第302回利付国債(10年)	370,000,000	388,474,100	
第303回利付国債(10年)	1,140,000,000	1,194,526,200	
第304回利付国債(10年)	390,000,000	405,272,400	
第305回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,886,757,600	
第306回利付国債(10年)	1,580,000,000	1,647,371,200	
第308回利付国債(10年)	600,000,000	618,732,000	
第309回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,418,452,000	
第30回利付国債(20年)	80,000,000	92,912,000	
第30回利付国債(30年)	310,000,000	330,407,300	
第310回利付国債(10年)	400,000,000	400,356,000	
第311回利付国債(10年)	560,000,000	550,205,600	
第31回利付国債(20年)	80,000,000	93,222,400	
第31回利付国債(30年)	430,000,000	449,014,600	
第32回利付国債(20年)	50,000,000	58,788,500	
第32回利付国債(30年)	450,000,000	480,289,500	
第33回利付国債(20年)	140,000,000	167,288,800	
第33回利付国債(30年)	250,000,000	250,232,500	
第34回利付国債(20年)	50,000,000	59,477,000	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	11,779,200	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	81,530,400	
第37回利付国債(20年)	70,000,000	81,993,800	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	22,994,000	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	571,125,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	129,222,000	
第3回利付国債(40年)	220,000,000	228,679,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	112,276,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	349,430,400	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	91,800,000	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	164,288,600	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	193,941,100	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	328,193,000	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	189,361,300	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	100,177,200	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	148,499,000	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	154,513,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	129,324,800	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	238,565,800	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	109,319,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	121,308,000	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	88,084,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	222,304,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	152,553,800	

第56回利付国債(20年)	150,000,000	163,210,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	258,544,800	
第58回利付国債(20年)	200,000,000	215,190,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	210,340,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	52,956,000	
第60回利付国債(20年)	270,000,000	274,976,100	
第61回利付国債(20年)	220,000,000	213,318,600	
第61回利付国債(5年)	1,530,000,000	1,548,161,100	
第62回利付国債(20年)	220,000,000	207,086,000	
第62回利付国債(5年)	320,000,000	324,147,200	
第63回利付国債(20年)	80,000,000	84,557,600	
第63回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,613,007,300	
第64回利付国債(20年)	370,000,000	394,434,800	
第64回利付国債(5年)	900,000,000	919,692,000	
第65回利付国債(20年)	250,000,000	266,040,000	
第65回利付国債(5年)	280,000,000	285,678,400	
第66回利付国債(20年)	130,000,000	136,814,600	
第66回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,089,110,200	
第67回利付国債(20年)	150,000,000	159,327,000	
第67回利付国債(5年)	470,000,000	480,128,500	
第68回利付国債(20年)	140,000,000	153,801,200	
第68回利付国債(5年)	260,000,000	265,241,600	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	130,395,600	
第69回利付国債(5年)	1,410,000,000	1,432,531,800	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	76,344,800	
第70回利付国債(20年)	230,000,000	257,887,500	
第70回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,218,348,000	
第71回利付国債(20年)	290,000,000	318,130,000	
第71回利付国債(5年)	820,000,000	842,107,200	
第72回利付国債(20年)	490,000,000	530,395,600	
第72回利付国債(5年)	430,000,000	444,942,500	
第73回利付国債(20年)	220,000,000	235,122,800	
第73回利付国債(5年)	470,000,000	483,902,600	
第74回利付国債(20年)	150,000,000	162,169,500	
第74回利付国債(5年)	380,000,000	388,295,400	
第75回利付国債(20年)	140,000,000	151,163,600	
第75回利付国債(5年)	440,000,000	451,589,600	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	252,820,800	
第76回利付国債(5年)	620,000,000	638,085,400	
第77回利付国債(20年)	120,000,000	127,987,200	
第77回利付国債(5年)	470,000,000	481,049,700	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	178,675,100	
第78回利付国債(5年)	390,000,000	398,642,400	
第79回利付国債(20年)	180,000,000	191,577,600	
第79回利付国債(5年)	170,000,000	172,720,000	

第7回利付国債(30年)	90,000,000	96,677,100	
第80回利付国債(20年)	190,000,000	204,751,600	
第80回利付国債(5年)	380,000,000	387,250,400	
第81回利付国債(20年)	70,000,000	74,340,000	
第81回利付国債(5年)	1,290,000,000	1,315,477,500	
第82回利付国債(20年)	540,000,000	580,748,400	
第82回利付国債(5年)	390,000,000	398,997,300	
第83回利付国債(20年)	220,000,000	236,247,000	
第83回利付国債(5年)	220,000,000	225,214,000	
第84回利付国債(20年)	380,000,000	402,887,400	
第84回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,636,677,700	
第85回利付国債(20年)	120,000,000	128,498,400	
第85回利付国債(5年)	1,570,000,000	1,596,297,500	
第86回利付国債(20年)	170,000,000	186,728,000	
第86回利付国債(5年)	80,000,000	81,020,000	
第87回利付国債(20年)	230,000,000	249,612,100	
第87回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,855,640,000	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	460,425,000	
第88回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,713,838,000	
第89回利付国債(20年)	280,000,000	303,046,800	
第89回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,905,586,000	
第8回利付国債(30年)	150,000,000	147,786,000	
第90回利付国債(20年)	480,000,000	518,371,200	
第91回利付国債(20年)	290,000,000	317,265,800	
第91回利付国債(5年)	400,000,000	400,952,000	
第92回利付国債(20年)	710,000,000	755,432,900	
第92回利付国債(5年)	240,000,000	239,426,400	
第93回利付国債(20年)	250,000,000	261,935,000	
第94回利付国債(20年)	440,000,000	467,288,800	
第95回利付国債(20年)	430,000,000	468,545,200	
第96回利付国債(20年)	220,000,000	233,351,800	
第97回利付国債(20年)	510,000,000	547,694,100	
第98回利付国債(20年)	230,000,000	243,643,600	
第99回利付国債(20年)	640,000,000	677,043,200	
第9回ポーランド共和国円貨債券(2009)	100,000,000	99,353,000	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	63,807,800	
小計	114,290,000,000	119,350,717,400	

地方債証券	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	106,710,000	
	第116回神奈川県公募公債	14,000,000	14,255,360	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,453,000	
	第124回神奈川県公募公債	10,000,000	10,359,300	
	第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	106,466,000	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	107,727,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	104,375,334	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	106,998,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,607,000	
	第167回神奈川県公募公債	140,000,000	147,131,600	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,317,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,867,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,581,000	
	第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,137,000	
	第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,183,000	
	第248回大阪府公募公債(10年)	16,550,000	16,828,702	
	第252回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,097,000	
	第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,310,000	
	第271回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,511,000	
	第284回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,284,000	
	第28回1号宮城県公募公債	116,000,000	117,453,480	
	第291回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,830,000	
	第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,601,000	
	第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,499,000	
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,811,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,916,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,253,000	
	第3回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,134,400	
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,306,000	
	第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	130,791,600	
	第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,500,000	
	第47回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	102,751,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	109,129,000	
	第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,456,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	171,384,048	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,340,000	
	第587回東京都公募公債	10,000,000	10,186,800	
	第588回東京都公募公債	117,000,000	119,290,860	
	第591回東京都公募公債	108,000,000	109,955,880	
	第593回東京都公募公債	143,000,000	144,846,130	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	107,058,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	106,457,000		
第602回東京都公募公債	20,000,000	20,677,800		
第608回東京都公募公債	100,000,000	104,339,000		
第611回東京都公募公債	40,000,000	42,179,600		

第618回東京都公募公債	100,000,000	104,433,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	104,003,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	139,242,600	
第639回東京都公募公債	50,000,000	53,817,500	
第674回東京都公募公債	100,000,000	103,986,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	174,936,118	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,280,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,606,000	
第75回川崎市公募公債	22,000,000	22,440,220	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	115,876,200	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,991,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	105,790,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,007,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	150,167,736	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	104,426,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	102,836,000	
平成13年度第2回京都府公募公債	10,000,000	10,133,600	
平成13年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,133,600	
平成14年度第1回愛知県公募公債	20,000,000	20,347,200	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,157,900	
平成14年度第1回仙台市公募公債	20,000,000	20,400,200	
平成14年度第1回千葉市公募公債	100,100,000	102,095,994	
平成14年度第2回愛知県公募公債	120,000,000	122,511,600	
平成14年度第2回埼玉県公募公債	20,040,000	20,410,940	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,306,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,552,436	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	103,368,000	
平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	75,280,701	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,520,500	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	128,666,944	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,356,100	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,886,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	104,466,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,426,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	157,300,500	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	208,620,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,886,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,757,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	105,637,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	212,200,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	103,920,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	105,639,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,091,000	
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	105,249,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	107,870,000	

	平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	106,485,000	
	平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	108,273,000	
	平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	107,634,000	
	平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	108,634,000	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	107,185,000	
	平成19年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	102,126,000	
	平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	107,643,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,367,000	
	平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,132,000	
	平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,003,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	211,704,000	
	平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	105,725,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,275,000	
	小計	9,705,770,000	10,191,558,483	
特殊債券	い第682号農林債	100,000,000	101,487,000	
	い第685号農林債	210,000,000	214,475,100	
	い第689号農林債	100,000,000	102,406,000	
	い第690号農林債	100,000,000	102,105,000	
	い第694号農林債	100,000,000	102,004,000	
	い第695号農林債	100,000,000	102,064,000	
	い第704号商工債	100,000,000	103,343,000	
	い第705号商工債	100,000,000	103,559,000	
	い第707号農林債	200,000,000	206,712,000	
	い第710号農林債	100,000,000	102,212,000	
	い第715号農林債	100,000,000	101,053,000	
	い第718号商工債	100,000,000	101,009,000	
	い第722号商工債	100,000,000	100,276,000	
	第108号商工債（3年）	100,000,000	101,113,000	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	79,618,000	83,191,255	
	第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,586,000	
	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,823,000	
	第119号商工債（3年）	100,000,000	100,421,000	
	第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,885,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,578,000	
	第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	185,814,530	
	第12回都市再生債券	100,000,000	101,349,000	
	第134回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,761,000	
	第135回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,692,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	115,205,040	
	第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,165,000	
	第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	104,546,000	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,685,000	
	第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	82,034,000	85,301,414	
	第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	82,489,000	85,593,885	
	第171回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,204,480	

第176回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,782,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	105,364,000	
第182回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,453,100	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,791,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	108,718,480	
第1回公営企業債券(5年)	200,000,000	203,796,000	
第1回政府保証新東京国際空港債券	11,000,000	11,207,020	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,394,620	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,457,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	105,903,000	
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	105,468,000	
第1回政府保証農林漁業金融公庫債券	12,000,000	12,263,760	
第1回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	62,848,000	65,614,568	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,186,000	81,108,592	
第1回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,996,000	
第1回日本鉄道建設債券	100,000,000	101,438,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,303,000	
第205回信金中金債(5年)	100,000,000	101,430,000	
第212回信金中金債(5年)	100,000,000	102,418,000	
第214回信金中金債(5年)	100,000,000	102,096,000	
第21回道路債券	100,000,000	110,133,000	
第222回信金中金債(5年)	200,000,000	205,614,000	
第224回信金中金債(5年)	100,000,000	103,120,000	
第226回信金中金債(5年)	100,000,000	102,996,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,662,000	
第233回信金中金債(5年)	100,000,000	103,426,000	
第237回信金中金債(5年)	100,000,000	102,301,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,172,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,717,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,353,000	93,792,010	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,322,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	108,320,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,812,000	95,502,842	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	155,924,370	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,567,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	64,237,000	67,767,465	
第30回公営企業債券	100,000,000	109,097,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,284,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,502,000	96,277,931	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,796,400	
第313回政府保証道路債券	100,000,000	102,096,000	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	227,754,000	
第316回政府保証道路債券	120,000,000	121,208,400	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,568,500	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,417,000	97,591,299	

第3 2 2 回東京交通債券	10,000,000	11,457,800	
第3 2 3 回政府保証道路債券	100,000,000	103,922,000	
第3 2 7 回政府保証道路債券	100,000,000	104,241,000	
第3 2 8 回政府保証道路債券	114,000,000	118,913,400	
第3 3 1 回政府保証道路債券	102,000,000	107,750,760	
第3 3 3 回政府保証道路債券	48,000,000	50,411,040	
第3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	103,162,000	
第3 4 6 回政府保証道路債券	143,000,000	149,829,680	
第3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	19,291,600	
第3 4 7 回政府保証道路債券	181,000,000	188,821,010	
第3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,807,000	98,978,211	
第3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,235,000	
第3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	233,616,850	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,316,000	74,837,658	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,340,000	100,436,385	
第3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,747,000	
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,528,000	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,956,000	74,941,862	
第3 回公営企業債券	40,000,000	40,792,800	
第3 回公営企業債券（20年）	10,000,000	9,595,000	
第3 回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	110,465,440	
第4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,630,000	77,200,605	
第4 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,440,000	
第4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,837,000	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,003,000	74,910,295	
第4 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,074,000	
第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,957,000	
第4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,426,000	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	75,772,000	79,921,274	
第4 回国際協力銀行債券	120,000,000	122,074,800	
第4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,020,000	
第4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,677,000	71,442,622	
第4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,215,000	81,969,899	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,001,000	80,313,583	
第5 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,614,000	
第5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,948,490	
第5 回公営企業債券	100,000,000	101,220,000	
第5 回新東京国際空港債券	100,000,000	104,271,000	
第5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,278,400	
第5 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,043,000	
第5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,083,000	
第5 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,592,000	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	52,023,000	53,442,707	
第5 回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,592,000	
第5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,499,000	

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	108,247,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	194,544,230	
第6回公営企業債券	10,000,000	10,091,500	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,741,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	104,423,000	
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	107,896,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	112,152,000	118,783,547	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,887,000	73,341,107	
第6回都市基盤整備債券	100,000,000	101,494,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,333,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	103,928,000	
第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,817,000	
第810回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,501,000	
第814回政府保証公営企業債券	122,000,000	124,189,900	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,886,000	
第818回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,020,000	
第821回政府保証公営企業債券	110,000,000	112,060,300	
第827回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,005,000	
第836回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,344,900	
第839回政府保証公営企業債券	28,000,000	29,205,120	
第840回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,611,390	
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	106,398,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	146,035,400	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	138,244,300	
第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,562,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,686,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,621,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,766,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,313,000	
第875回政府保証公営企業債券	112,000,000	120,217,440	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	132,563,980	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,806,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	43,557,200	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	106,135,000	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,054,000	60,939,283	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	74,905,000	78,274,226	
第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	105,619,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,462,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,417,000	
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	107,899,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,571,000	61,602,049	
第9回都市再生債券	100,000,000	101,369,000	
小計	15,917,805,000	16,632,727,104	
社債券			
第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,280,000	
第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,908,000	

第11回シティグループ・インク円貨社債（2003）	200,000,000	198,134,000	
第11回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	100,600,000	
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	102,385,000	
第133回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,506,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,828,000	
第13回積水ハウス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,888,000	
第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,127,000	
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	101,416,000	
第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	100,351,000	
第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,586,000	
第15回シ・エイ・エフ・イー・ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,279,000	
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	104,988,000	
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	205,896,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,832,000	
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	108,508,000	
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	216,804,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	111,198,000	
第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	103,807,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,539,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,480,000	
第1回A号日本生命2009基金特定目的会社特定社債（一般担保付）	100,000,000	102,687,000	
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	105,628,000	
第1回ラボバンク円貨社債	100,000,000	103,236,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,367,000	
第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,888,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	204,316,000	
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	108,546,000	
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	102,139,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,231,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,280,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,347,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,340,000	
第248回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	118,652,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,588,000	
第24回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,024,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,351,000	
第24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	102,974,000	
第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,135,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	99,442,000	
第261回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	31,000,000	35,421,220	
第26回日本郵船株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,180,000	
第26回富士通株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,874,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,971,000	
第285回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,441,000	
第286回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,472,000	

第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,412,000	
第2回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2008)	100,000,000	103,765,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,162,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,107,000	
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	105,478,000	
第362回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,349,000	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	115,966,000	
第380回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	117,649,000	
第382回東北電力株式会社社債(一般担保付)	20,000,000	23,166,200	
第387回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,276,000	
第38回三菱電機株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,838,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,359,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,452,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,906,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	107,915,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,226,000	
第405回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	58,165,500	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,304,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	58,110,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債間同順位特約付	100,000,000	100,889,000	
第425回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	117,059,000	
第431回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,891,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,504,000	
第455回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	131,715,600	
第459回東京電力株式会社社債(一般担保付)	10,000,000	11,466,200	
第462回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,507,000	
第463回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,356,000	
第464回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,163,000	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,106,000	
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	101,870,000	
第473回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,349,000	
第474回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,374,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,918,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,564,000	
第498回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,776,000	
第4回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	104,265,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2010)	100,000,000	100,504,000	
第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	100,000,000	100,444,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,205,000	
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	101,440,000	
第4回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,097,000	
第501回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	30,446,400	
第505回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	30,373,800	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,480,000	
第518回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,235,000	

第5 1 回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,213,000	
第5 1 回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,712,000	
第5 2 1 回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,012,000	
第5 2 8 回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,230,000	
第5 2 回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,859,000	
第5 3 6 回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,822,000	
第5 3 回伊藤忠商事株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,575,000	
第5 3 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	104,848,000	
第5 4 2 回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,314,000	
第5 4 4 回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	109,038,000	
第5 5 回新日本製鐵株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,122,000	
第5 回アフラック・インコーポレーテッド円貨社債(2007)	100,000,000	100,903,000	
第5 回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,582,000	
第6 9 回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,500,000	
第6 回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,260,000	
第6 回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,261,000	
第7 0 回住友不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,409,000	
第7 5 回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,115,000	
第7 回KDDI株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,446,000	
第7 回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,190,000	
第7 回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	105,967,000	
第7 回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,077,000	
第7 回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,785,000	
第7 回トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同等特約付)	200,000,000	206,094,000	
第7 回パナソニック株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,393,000	
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	100,931,000	
第7 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,942,400	
第8 回旭化成株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,351,000	
第8 回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,546,000	
第8 回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	102,517,000	
第8 回三菱UFJリース無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,818,000	
第8 回昭和シェル石油株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,975,000	
第9 回株式会社日興コーディアルグループ無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第9 回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,369,000	
第9 回三菱UFJリース株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,721,000	
第9 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	19,000,000	21,021,220	
第9 回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	115,482,000	
小計	12,980,000,000	13,534,814,540	
合計	152,893,575,000	159,709,817,527	

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,116,064,819	2,092,906,339
株式	123,220,164,240	128,947,760,855
新株予約権証券	2,002,000	
派生商品評価勘定	375,720	99,404,080
未収入金		1,780,050
未収配当金	847,039,788	1,052,478,181
未収利息	11,587	3,644
前払金	404,264,000	
差入委託証拠金	201,210,000	86,190,000
流動資産合計	129,791,132,154	132,280,523,149
資産合計	129,791,132,154	132,280,523,149
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	387,134,200	
前受金		63,396,000
未払解約金	46,979,966	389,435,036
流動負債合計	434,114,166	452,831,036
負債合計	434,114,166	452,831,036
純資産の部		
元本等		
元本	197,842,493,564	201,643,731,909
剰余金		
剰余金又は欠損金()	68,485,475,576	69,816,039,796
元本等合計	129,357,017,988	131,827,692,113
純資産合計	129,357,017,988	131,827,692,113
負債純資産合計	129,791,132,154	132,280,523,149

(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、「SBI資産設計オープン(資産成長型)」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年11月10日及び平成22年11月10日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自平成20年11月11日 至平成21年11月10日)	(自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)

1.資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p>	<p>(1) 株式 同左</p> <p>(2) 先物取引 同左</p>
2.収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	<p>受取配当金 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1.期首元本額	175,457,875,064円	197,842,493,564円
期中追加設定元本額	50,953,107,393円	32,471,823,914円
期中一部解約元本額	28,568,488,893円	28,670,585,569円
期末元本額	197,842,493,564円	201,643,731,909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）	12,227,100,329円	6,776,729,065円
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	506,983,107円	720,280,434円
SBI 資産設計オープン（分配型）	46,315,279円	40,205,900円
STAM TOPIXインデックス・オープン	3,426,642,791円	4,513,258,119円
世界経済インデックスファンド	26,177,957円	60,905,923円
住信 国内バランス30	746,376,071円	620,093,119円
住信 国内バランス60	630,558,383円	493,753,346円
すみしん マイセクション25	186,472,158円	157,766,780円
すみしん マイセクション50	376,256,372円	358,249,010円
すみしん マイセクション75	297,303,879円	293,566,220円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	20,667,103,525円	18,689,133,492円
すみしん DC マイセクション25	3,414,178,127円	3,982,392,481円
すみしん DC マイセクション50	12,441,366,438円	14,383,018,119円

すみしん DC マイセレクション75	10,961,519,676円	12,691,927,051円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	2,397,972,981円	2,832,300,006円
すみしん DC マイセレクションS25	160,636,878円	351,854,072円
すみしん DC マイセレクションS50	911,656,541円	1,630,953,406円
すみしん DC マイセレクションS75	734,702,714円	1,225,185,836円
すみしん DC日本株式インデックス・オープンS	371,535,390円	496,505,464円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	19,219,270円	22,279,763円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	23,744,737円	103,193,534円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	19,540,695円	90,841,251円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	6,455,191円	37,530,680円
STAM 日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,171,610,913円	4,197,536,460円
住信 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	532,976,847円	469,417,569円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,002,025,177円	981,615,573円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	442,049,719円	449,972,845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)	4,026,102,132円	3,755,781,692円
住信 国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	20,295,697円	20,372,794円
住信 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	85,487,231円	83,304,696円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	8,221,210円	5,484,542円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	2,129,727,830円	2,085,506,815円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	7,882,846,739円	7,754,776,157円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	21,860,645,350円	20,848,439,045円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	6,293,587,173円	6,148,024,375円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	12,605,176,493円	12,566,463,464円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,636,821,467円	2,599,854,749円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	15,074,090,182円	14,100,828,232円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	6,106,367,323円	6,343,097,930円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,739,362,709円	4,845,363,926円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	3,671,298,188円	3,422,685,864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)	6,009,171,840円	5,775,314,183円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,618,539,300円	2,101,275,914円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)		1,644,210,622円
すみしん 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)		219,896,376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)	24,791,801,098円	26,464,267,169円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,657,447,193円	3,313,547,632円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	877,023,264円	874,770,214円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 68,485,475,576円下回っており ます。	純資産額は、元本を 69,816,039,796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	197,842,493,564口	201,643,731,909口
---------------------	------------------	------------------

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 価格変動リスク
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております(運用を再委託しているファンドも含まれます。) モニタリング結果は、原則月1回(必要に応じ随時)開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	<p>a. 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>b. 先物取引 1.原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。</p> <p>c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------	--

(有価証券に関する注記)

(平成21年11月10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	123,220,164,240	3,349,143,686
新株予約権証券	2,002,000	2,002,000
合 計	123,222,166,240	3,347,141,686

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

(平成22年11月10日現在)

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株 式	3,466,630,834
合 計	3,466,630,834

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

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

(自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日)
<p>1. 取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。</p>

2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制

デリバティブ取引には、市場リスクがあります。当ファンドが利用するデリバティブ取引は、約款に基づき、金融商品取引所取引のみであり、信用リスクはないものと考えられます。なお、デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従って行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。

3.取引の時価等に関する事項についての補足説明

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

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	(平成21年11月10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	6,542,934,000		6,156,320,000	386,614,000
合計		6,542,934,000		6,156,320,000	386,614,000

(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。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種類	(平成22年11月10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	2,753,089,000		2,852,525,000	99,436,000
合計		2,753,089,000		2,852,525,000	99,436,000

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成20年11月11日 至平成21年11月10日)	(自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)
--------------------------------	--------------------------------

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

(1口当たり情報)

(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 0.6538円	1口当たり純資産額 = 0.6538円

(3) 附属明細表 (平成22年11月10日現在)

1) 有価証券明細表

株式

銘柄	株数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	50,000	163.00	8,150,000	
日本水産	145,900	244.00	35,599,600	
マルハニチロホールディングス	250,000	135.00	33,750,000	
ハウスイ	15,000	101.00	1,515,000	
サカタのタネ	17,000	1,053.00	17,901,000	
ホクト	12,900	1,871.00	24,135,900	
ショーボンドホールディングス	11,300	1,717.00	19,402,100	
ミライト・ホールディングス	33,100	595.00	19,694,500	
住石ホールディングス	35,100	70.00	2,457,000	
日鉄鉱業	32,000	300.00	9,600,000	
三井松島産業	73,000	151.00	11,023,000	
国際石油開発帝石	1,283	433,000.00	555,539,000	
日本海洋掘削	3,200	2,476.00	7,923,200	
関東天然瓦斯開発	13,000	424.00	5,512,000	
石油資源開発	20,100	2,875.00	57,787,500	
ダイセキ環境ソリューション	26	65,800.00	1,710,800	
間組	49,100	62.00	3,044,200	
東急建設	44,960	255.00	11,464,800	
コムシスホールディングス	61,600	776.00	47,801,600	
ミサワホーム	15,000	329.00	4,935,000	
高松コンストラクショングループ	9,600	1,061.00	10,185,600	
東建コーポレーション	5,250	2,553.00	13,403,250	
ヤマウラ	15,500	187.00	2,898,500	
大成建設	614,000	179.00	109,906,000	
大林組	389,000	334.00	129,926,000	
清水建設	362,000	332.00	120,184,000	
長谷工コーポレーション	791,500	70.00	55,405,000	

松井建設	20,000	304.00	6,080,000
鹿島建設	573,000	202.00	115,746,000
鉄建建設	77,000	73.00	5,621,000
安藤建設	42,000	100.00	4,200,000
太平工業	25,000	364.00	9,100,000
三井住友建設	69,400	58.00	4,025,200
前田建設工業	97,000	248.00	24,056,000
奥村組	122,000	301.00	36,722,000
東鉄工業	17,000	491.00	8,347,000
戸田建設	138,000	295.00	40,710,000
熊谷組	96,000	56.00	5,376,000
青木あすなろ建設	8,500	368.00	3,128,000
三井ホーム	21,000	368.00	7,728,000
矢作建設工業	16,000	488.00	7,808,000
大東建託	49,600	5,280.00	261,888,000
新日本建設	37,400	194.00	7,255,600
N I P P O	29,000	533.00	15,457,000
東亜道路工業	33,000	118.00	3,894,000
前田道路	36,000	587.00	21,132,000
日本道路	43,000	170.00	7,310,000
東亜建設工業	103,000	85.00	8,755,000
五洋建設	147,000	125.00	18,375,000
大林道路	22,000	137.00	3,014,000
住友林業	88,200	662.00	58,388,400
日本基礎技術	20,700	172.00	3,560,400
巴コーポレーション	17,200	267.00	4,592,400
バナホーム	43,000	500.00	21,500,000
大和ハウス工業	319,000	940.00	299,860,000
ライト工業	29,700	176.00	5,227,200
積水ハウス	381,000	791.00	301,371,000
北陸電気工事	10,000	217.00	2,170,000
ユアテック	23,000	287.00	6,601,000
西部電気工業	13,000	295.00	3,835,000
四電工	12,000	319.00	3,828,000
中電工	18,400	892.00	16,412,800
関電工	58,000	466.00	27,028,000
きんでん	84,000	702.00	58,968,000
東京エネシス	15,000	488.00	7,320,000
トーエネック	18,000	429.00	7,722,000
住友電設	11,000	304.00	3,344,000
日本電設工業	23,000	734.00	16,882,000
協和エクシオ	45,600	722.00	32,923,200
新日本空調	12,800	459.00	5,875,200
日本工営	42,000	216.00	9,072,000
日本電話施設	20,000	249.00	4,980,000

九電工	24,000	467.00	11,208,000
三機工業	30,000	484.00	14,520,000
日揮	128,000	1,652.00	211,456,000
中外炉工業	50,000	259.00	12,950,000
ヤマト	21,000	300.00	6,300,000
太平電業	17,000	590.00	10,030,000
高砂熱学工業	37,100	608.00	22,556,800
三晃金属工業	14,000	160.00	2,240,000
N E C ネットズエスアイ	10,500	903.00	9,481,500
朝日工業社	20,000	338.00	6,760,000
アタカ大機	11,000	218.00	2,398,000
大気社	19,900	1,217.00	24,218,300
ダイダン	22,000	371.00	8,162,000
日比谷総合設備	16,800	646.00	10,852,800
東芝プラントシステム	23,000	1,072.00	24,656,000
日本製粉	73,000	382.00	27,886,000
日清製粉グループ本社	115,000	1,038.00	119,370,000
日東富士製粉	11,000	306.00	3,366,000
昭和産業	52,000	214.00	11,128,000
鳥越製粉	11,000	730.00	8,030,000
協同飼料	44,000	94.00	4,136,000
中部飼料	11,900	500.00	5,950,000
日本配合飼料	39,000	94.00	3,666,000
東洋精糖	24,000	92.00	2,208,000
日本甜菜製糖	70,000	191.00	13,370,000
三井製糖	50,000	290.00	14,500,000
ネクスト	39	78,900.00	3,077,100
日本M & A センター	29	306,500.00	8,888,500
アコーディア・ゴルフ	348	71,700.00	24,951,600
パソナグループ	112	60,100.00	6,731,200
リンクアンドモチベーション	25	43,950.00	1,098,750
テンプホールディングス	16,600	742.00	12,317,200
森永製菓	124,000	188.00	23,312,000
中村屋	29,000	394.00	11,426,000
江崎グリコ	46,000	982.00	45,172,000
名糖産業	5,600	1,099.00	6,154,400
不二家	72,000	146.00	10,512,000
山崎製パン	93,000	941.00	87,513,000
モロゾフ	19,000	270.00	5,130,000
森永乳業	108,000	337.00	36,396,000
ヤクルト本社	67,900	2,475.00	168,052,500
明治ホールディングス	37,500	3,740.00	140,250,000
雪印メグミルク	24,900	1,400.00	34,860,000
プリマハム	75,000	87.00	6,525,000
日本ハム	88,000	971.00	85,448,000

伊藤ハム	70,000	256.00	17,920,000
丸大食品	56,000	231.00	12,936,000
米久	11,000	613.00	6,743,000
S Foods	8,000	643.00	5,144,000
学情	4,400	272.00	1,196,800
スタジオアリス	4,900	702.00	3,439,800
シミック	240	22,670.00	5,440,800
システナ	117	65,100.00	7,616,700
NECフィールドینگ	10,200	895.00	9,129,000
新日鉄ソリューションズ	9,500	1,507.00	14,316,500
総合警備保障	43,100	902.00	38,876,200
日本駐車場開発	1,552	3,425.00	5,315,600
コア	4,500	639.00	2,875,500
カカクコム	83	383,500.00	31,830,500
ルネサンス	8,100	297.00	2,405,700
新日本科学	7,200	363.00	2,613,600
エムスリー	46	370,500.00	17,043,000
ディー・エヌ・エー	46,400	2,451.00	113,726,400
博報堂DYホールディングス	16,380	4,285.00	70,188,300
ぐるなび	68	111,700.00	7,595,600
一休	115	37,700.00	4,335,500
ジャパンベストレスキューシステム	32	72,000.00	2,304,000
ジェイコムホールディングス	16	91,000.00	1,456,000
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	274	52,400.00	14,357,600
サッポロホールディングス	181,000	337.00	60,997,000
アサヒビール	237,600	1,618.00	384,436,800
キリンホールディングス	518,000	1,145.00	593,110,000
宝ホールディングス	107,000	480.00	51,360,000
オエノンホールディングス	36,000	183.00	6,588,000
メルシャン	40,000	160.00	6,400,000
養命酒製造	10,000	747.00	7,470,000
三国コカ・コーラボトリング	15,100	706.00	10,660,600
コカ・コーラウエスト	39,000	1,364.00	53,196,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	14,200	1,071.00	15,208,200
ダイドードリンコ	5,200	2,751.00	14,305,200
伊藤園	32,000	1,320.00	42,240,000
キーコーヒー	11,100	1,387.00	15,395,700
ジャパンフーズ	2,100	785.00	1,648,500
日清オイリオグループ	55,000	351.00	19,305,000
不二製油	30,800	1,065.00	32,802,000
J - オイルミルズ	49,000	215.00	10,535,000
ローソン	38,700	3,640.00	140,868,000
インターニックス	5,800	351.00	2,035,800
サンエー	3,800	3,210.00	12,198,000
キリン堂	4,900	385.00	1,886,500

ダイユーエイト	1,700	489.00	831,300
カワチ薬品	7,800	1,543.00	12,035,400
エービーシー・マート	13,200	2,850.00	37,620,000
ハードオフコーポレーション	5,500	379.00	2,084,500
高千穂交易	5,000	859.00	4,295,000
アスクル	8,100	1,631.00	13,211,100
ゲオ	186	86,700.00	16,126,200
ポイント	9,440	3,330.00	31,435,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	8,000	101.00	808,000
伊藤忠食品	2,700	2,689.00	7,260,300
くらコーポレーション	5,900	1,304.00	7,693,600
キャンドウ	45	77,700.00	3,496,500
エレマテック	9,100	1,017.00	9,254,700
バル	3,250	2,870.00	9,327,500
JALUX	3,500	635.00	2,222,500
エディオン	40,900	633.00	25,889,700
サーラコーポレーション	11,000	445.00	4,895,000
トーマンデバイス	1,600	1,647.00	2,635,200
バルス	52	87,300.00	4,539,600
あみやき亭	19	225,900.00	4,292,100
ひらまつ	22	86,500.00	1,903,000
双日	746,700	149.00	111,258,300
アルフレッサ ホールディングス	29,200	3,590.00	104,828,000
ハニーズ	9,840	1,170.00	11,512,800
キッコーマン	103,000	880.00	90,640,000
味の素	344,000	785.00	270,040,000
キュービー	65,500	1,027.00	67,268,500
ハウス食品	46,700	1,336.00	62,391,200
カゴメ	45,500	1,512.00	68,796,000
焼津水産化学工業	6,000	825.00	4,950,000
アリアケジャパン	10,400	1,304.00	13,561,600
ニチレイ	142,000	373.00	52,966,000
横浜冷凍	23,900	523.00	12,499,700
東洋水産	54,000	1,713.00	92,502,000
日清食品ホールディングス	45,400	2,942.00	133,566,800
永谷園	11,000	804.00	8,844,000
フジッコ	14,000	968.00	13,552,000
ロック・フィールド	6,100	1,213.00	7,399,300
日本たばこ産業	2,632	277,800.00	731,169,600
わらべや日洋	7,200	941.00	6,775,200
なとり	6,000	794.00	4,764,000
片倉工業	14,700	782.00	11,495,400
ゲンゼ	81,000	282.00	22,842,000
昭栄	20,300	643.00	13,052,900
神栄	14,000	128.00	1,792,000

山下医科器械	1,200	1,110.00	1,332,000
ラサ商事	6,100	298.00	1,817,800
アルペン	8,600	1,316.00	11,317,600
ビックカメラ	274	32,300.00	8,850,200
D C Mホールディングス	56,100	421.00	23,618,100
M o n o t a R O	2,200	727.00	1,599,400
あい ホールディングス	24,500	279.00	6,835,500
ユニバース	1,700	1,130.00	1,921,000
J . フロント リテイリング	264,000	442.00	116,688,000
ドトール・日レスホールディングス	19,600	1,079.00	21,148,400
マツモトキヨシホールディングス	20,700	1,566.00	32,416,200
ココカラファイン	10,800	1,721.00	18,586,800
三越伊勢丹ホールディングス	221,700	943.00	209,063,100
東洋紡績	429,000	140.00	60,060,000
ユニチカ	267,000	70.00	18,690,000
富士紡ホールディングス	53,000	122.00	6,466,000
日清紡ホールディングス	76,000	867.00	65,892,000
倉敷紡績	119,000	137.00	16,303,000
ダイワボウホールディングス	103,000	207.00	21,321,000
シキボウ	72,000	109.00	7,848,000
日東紡績	96,000	200.00	19,200,000
トヨタ紡織	39,500	1,424.00	56,248,000
クリエイトS Dホールディングス	3,900	1,819.00	7,094,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,700	611.00	13,258,700
U K Cホールディングス	7,100	834.00	5,921,400
日本毛織	41,000	647.00	26,527,000
ダイドーリミテッド	15,500	665.00	10,307,500
野村不動産ホールディングス	47,800	1,320.00	63,096,000
ヒューリック	32,500	626.00	20,345,000
帝国繊維	14,000	484.00	6,776,000
ブックオフコーポレーション	6,900	655.00	4,519,500
日本コークス工業	95,500	134.00	12,797,000
ミタチ産業	3,800	418.00	1,588,400
J F E 商事ホールディングス	75,000	322.00	24,150,000
あさひ	4,700	1,113.00	5,231,100
サークルKサンクス	24,200	1,149.00	27,805,800
日本調剤	1,430	2,705.00	3,868,150
コスモス薬品	4,900	2,683.00	13,146,700
シップヘルスケアホールディングス	14,500	870.00	12,615,000
セブン&アイ・ホールディングス	466,600	2,000.00	933,200,000
ツルハホールディングス	8,300	3,545.00	29,423,500
サンマルクホールディングス	3,600	3,030.00	10,908,000
フェリシモ	3,200	1,011.00	3,235,200
トリドール	42	107,500.00	4,515,000
帝人	450,000	316.00	142,200,000

東レ	916,000	474.00	434,184,000
クラレ	174,700	1,172.00	204,748,400
旭化成	689,000	507.00	349,323,000
稲葉製作所	5,700	685.00	3,904,500
三協・立山ホールディングス	137,000	97.00	13,289,000
トーカロ	7,900	1,362.00	10,759,800
アルファＣｏ	6,300	795.00	5,008,500
SUMCO	73,700	1,301.00	95,883,700
住江織物	30,000	147.00	4,410,000
日本フェルト	7,200	385.00	2,772,000
日本バイリーン	15,000	402.00	6,030,000
芦森工業	46,000	112.00	5,152,000
アツギ	104,000	105.00	10,920,000
ダイニック	22,000	137.00	3,014,000
共和レザー	6,900	295.00	2,035,500
セーレン	30,900	563.00	17,396,700
小松精練	20,000	315.00	6,300,000
ワコールホールディングス	71,000	1,118.00	79,378,000
ホギメディカル	6,400	3,745.00	23,968,000
サンエー・インターナショナル	7,000	981.00	6,867,000
レナウン	22,700	217.00	4,925,900
クラウドディア	2,900	1,240.00	3,596,000
ITホールディングス	37,400	997.00	37,287,800
グリー	18,100	930.00	16,833,000
コーエーテクモホールディングス	22,300	491.00	10,949,300
三菱総合研究所	4,500	1,682.00	7,569,000
特種東海製紙	76,000	197.00	14,972,000
ドワンゴ	57	169,400.00	9,655,800
ベリサーブ	11	122,700.00	1,349,700
マクロミル	56	126,800.00	7,100,800
ティーガイア	92	122,300.00	11,251,600
GMOペイメントゲートウェイ	28	160,900.00	4,505,200
ザッパラス	65	118,000.00	7,670,000
インターネットイニシアティブ	68	189,300.00	12,872,400
ソネットエンタテインメント	64	218,500.00	13,984,000
SRAホールディングス	6,200	781.00	4,842,200
JBSホールディングス	13,600	296.00	4,025,600
朝日ネット	10,000	285.00	2,850,000
王子製紙	524,000	375.00	196,500,000
三菱製紙	168,000	87.00	14,616,000
北越紀州製紙	74,000	415.00	30,710,000
中越バルブ工業	50,000	133.00	6,650,000
大王製紙	51,000	525.00	26,775,000
日本製紙グループ本社	57,400	2,017.00	115,775,800
レンゴー	95,000	498.00	47,310,000

トーモク	42,000	202.00	8,484,000
ザ・バック	8,400	1,466.00	12,314,400
コープケミカル	18,000	98.00	1,764,000
昭和電工	790,000	156.00	123,240,000
住友化学	813,000	348.00	282,924,000
日本化成	22,000	189.00	4,158,000
住友精化	25,000	323.00	8,075,000
日産化学工業	85,500	1,022.00	87,381,000
クレハ	77,000	447.00	34,419,000
テイカ	20,000	272.00	5,440,000
石原産業	198,000	62.00	12,276,000
片倉チッカリン	8,000	234.00	1,872,000
日本曹達	72,000	349.00	25,128,000
東ソー	297,000	228.00	67,716,000
トクヤマ	184,000	465.00	85,560,000
セントラル硝子	113,000	340.00	38,420,000
東亜合成	121,000	371.00	44,891,000
ダイソー	47,000	225.00	10,575,000
関東電化工業	28,000	634.00	17,752,000
電気化学工業	249,000	380.00	94,620,000
イビデン	68,900	2,192.00	151,028,800
信越化学工業	197,200	4,125.00	813,450,000
堺化学工業	37,000	336.00	12,432,000
エア・ウォーター	95,000	966.00	91,770,000
太陽日酸	156,000	694.00	108,264,000
日本化学工業	46,000	192.00	8,832,000
日本パーカライジング	28,000	1,098.00	30,744,000
高圧ガス工業	18,000	460.00	8,280,000
四国化成工業	17,000	449.00	7,633,000
戸田工業	18,000	694.00	12,492,000
ステラ ケミファ	5,300	3,500.00	18,550,000
保土谷化学工業	29,000	258.00	7,482,000
日本触媒	97,000	804.00	77,988,000
大日精化工業	43,000	355.00	15,265,000
カネカ	147,000	502.00	73,794,000
協和発酵キリン	142,000	825.00	117,150,000
三菱瓦斯化学	187,000	499.00	93,313,000
三井化学	540,000	244.00	131,760,000
J S R	98,800	1,456.00	143,852,800
東京応化工業	21,300	1,493.00	31,800,900
三菱ケミカルホールディングス	687,000	456.00	313,272,000
日本合成化学工業	29,000	430.00	12,470,000
ダイセル化学工業	154,000	565.00	87,010,000
住友ベークライト	111,000	435.00	48,285,000
積水化学工業	246,000	575.00	141,450,000

日本ゼオン	111,000	674.00	74,814,000
アイカ工業	34,300	969.00	33,236,700
宇部興産	496,000	200.00	99,200,000
積水樹脂	17,000	812.00	13,804,000
タキロン	28,000	259.00	7,252,000
旭有機材工業	42,000	193.00	8,106,000
日立化成工業	51,200	1,526.00	78,131,200
ニチバン	12,000	287.00	3,444,000
リケンテクノス	21,000	223.00	4,683,000
大倉工業	30,000	208.00	6,240,000
積水化成成品工業	27,000	309.00	8,343,000
群栄化学工業	32,000	214.00	6,848,000
タイガースポリマー	5,800	327.00	1,896,600
日本カーリット	10,500	401.00	4,210,500
日本化薬	83,000	814.00	67,562,000
イーピーエス	64	183,600.00	11,750,400
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,400	2,261.00	5,426,400
アミューズ	3,300	909.00	2,999,700
野村総合研究所	63,300	1,696.00	107,356,800
ドリームインキュベータ	54	57,700.00	3,115,800
サイバネットシステム	117	21,940.00	2,566,980
T A C	6,700	337.00	2,257,900
電通	107,500	2,184.00	234,780,000
インテージ	3,400	1,598.00	5,433,200
シンプレクス・ホールディングス	203	38,500.00	7,815,500
イオンファンタジー	4,400	826.00	3,634,400
メディカルシステムネットワーク	1,600	628.00	1,004,800
日本精化	9,900	487.00	4,821,300
A D E K A	47,300	853.00	40,346,900
日油	104,000	362.00	37,648,000
ミヨシ油脂	42,000	125.00	5,250,000
ハリマ化成	10,000	466.00	4,660,000
花王	322,300	2,120.00	683,276,000
第一工業製薬	20,000	218.00	4,360,000
三洋化成工業	33,000	618.00	20,394,000
武田薬品工業	443,400	3,980.00	1,764,732,000
アステラス製薬	262,800	3,060.00	804,168,000
大日本住友製薬	83,800	756.00	63,352,800
塩野義製薬	172,500	1,419.00	244,777,500
田辺三菱製薬	99,000	1,316.00	130,284,000
わかもと製薬	12,000	232.00	2,784,000
あすか製薬	14,000	513.00	7,182,000
日本新薬	27,000	1,144.00	30,888,000
中外製薬	117,900	1,448.00	170,719,200
科研製薬	50,000	929.00	46,450,000

エーザイ	145,700	2,840.00	413,788,000
ロート製薬	54,000	921.00	49,734,000
小野薬品工業	59,400	3,710.00	220,374,000
久光製薬	33,400	3,325.00	111,055,000
有機合成薬品工業	8,000	202.00	1,616,000
持田製薬	47,000	848.00	39,856,000
大正製薬	95,000	1,708.00	162,260,000
参天製薬	36,700	2,816.00	103,347,200
扶桑薬品工業	40,000	231.00	9,240,000
日本ケミファ	18,000	255.00	4,590,000
ツムラ	32,300	2,451.00	79,167,300
テルモ	88,800	4,345.00	385,836,000
みらかホールディングス	28,700	2,936.00	84,263,200
キッセイ薬品工業	24,000	1,538.00	36,912,000
生化学工業	22,600	874.00	19,752,400
栄研化学	9,200	834.00	7,672,800
日水製薬	4,700	662.00	3,111,400
鳥居薬品	8,100	1,592.00	12,895,200
東和薬品	6,000	4,620.00	27,720,000
沢井製薬	7,800	7,040.00	54,912,000
ゼリア新薬工業	17,000	996.00	16,932,000
第一三共	398,100	1,795.00	714,589,500
キョーリン製薬ホールディングス	32,000	1,324.00	42,368,000
大幸薬品	4,000	1,199.00	4,796,000
大日本塗料	75,000	87.00	6,525,000
日本ペイント	103,000	619.00	63,757,000
関西ペイント	134,000	740.00	99,160,000
中国塗料	32,000	603.00	19,296,000
日本特殊塗料	10,600	339.00	3,593,400
藤倉化成	15,700	528.00	8,289,600
太陽ホールディングス	8,700	2,314.00	20,131,800
D I C	457,000	162.00	74,034,000
サカタインクス	24,000	361.00	8,664,000
東洋インキ製造	106,000	357.00	37,842,000
アルプス技研	5,300	654.00	3,466,200
ダイオーズ	2,200	457.00	1,005,400
日本空調サービス	3,000	706.00	2,118,000
オリエンタルランド	31,900	7,710.00	245,949,000
ダスキン	33,200	1,485.00	49,302,000
パーク24	52,900	778.00	41,156,200
明光ネットワークジャパン	10,500	700.00	7,350,000
ファルコSDホールディングス	7,000	608.00	4,256,000
クレスコ	3,600	399.00	1,436,400
フジ・メディア・ホールディングス	1,162	113,400.00	131,770,800
秀英予備校	4,700	340.00	1,598,000

田谷	2,000	655.00	1,310,000
ラウンドワン	35,000	318.00	11,130,000
リゾートトラスト	19,000	1,283.00	24,377,000
オービック	3,850	15,810.00	60,868,500
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,600	698.00	1,814,800
ヤフー	8,159	28,800.00	234,979,200
ビー・エム・エル	7,000	2,109.00	14,763,000
ワタベウェディング	4,000	776.00	3,104,000
トレンドマイクロ	49,400	2,448.00	120,931,200
もしもしホットライン	7,500	1,968.00	14,760,000
東急コミュニティー	3,200	2,256.00	7,219,200
リソー教育	1,327	3,805.00	5,049,235
日本オラクル	17,800	3,775.00	67,195,000
アルファシステムズ	3,200	1,452.00	4,646,400
フューチャーアーキテクト	138	32,600.00	4,498,800
ウェアハウス	6,500	246.00	1,599,000
シーエーシー	7,200	535.00	3,852,000
ソフトバンク・テクノロジー	2,900	659.00	1,911,100
トーセ	3,000	488.00	1,464,000
ユー・エス・エス	15,400	6,310.00	97,174,000
オービックビジネスコンサルタント	2,850	4,105.00	11,699,250
日立ビジネスソリューション	3,900	720.00	2,808,000
伊藤忠テクノソリューションズ	15,800	2,934.00	46,357,200
アイティフォー	14,200	242.00	3,436,400
東京個別指導学院	10,900	245.00	2,670,500
東計電算	2,000	1,136.00	2,272,000
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	63,000	409.00	25,767,000
エクスネット	11	130,200.00	1,432,200
テー・オー・ダブリュー	3,000	466.00	1,398,000
大塚商会	8,900	5,350.00	47,615,000
総合メディカル	2,500	2,126.00	5,315,000
サイボウズ	178	20,180.00	3,592,040
ソフトブレイン	255	5,170.00	1,318,350
アグレックス	2,700	762.00	2,057,400
セントラルスポーツ	4,600	866.00	3,983,600
電通国際情報サービス	7,300	517.00	3,774,100
ウェザーニューズ	3,000	1,246.00	3,738,000
C I J	10,800	262.00	2,829,600
富士フィルムホールディングス	252,900	2,840.00	718,236,000
コニカミノルタホールディングス	298,500	878.00	262,083,000
資生堂	196,500	1,719.00	337,783,500
ライオン	136,000	440.00	59,840,000
高砂香料工業	39,000	424.00	16,536,000
マンダム	11,900	2,282.00	27,155,800
ミルボン	5,700	2,307.00	13,149,900

ファンケル	22,900	1,165.00	26,678,500
コーセー	21,300	1,923.00	40,959,900
ドクターシーラボ	79	300,000.00	23,700,000
エステー	7,200	927.00	6,674,400
コニシ	9,300	984.00	9,151,200
長谷川香料	15,000	1,346.00	20,190,000
小林製薬	16,400	3,830.00	62,812,000
荒川化学工業	9,200	844.00	7,764,800
メック	7,900	343.00	2,709,700
日本高純度化学	33	241,200.00	7,959,600
荏原ユーザライト	1,700	1,585.00	2,694,500
アース製薬	8,500	2,796.00	23,766,000
イハラケミカル工業	22,000	240.00	5,280,000
北興化学工業	14,000	237.00	3,318,000
大成ラミック	3,300	2,101.00	6,933,300
クミアイ化学工業	26,000	286.00	7,436,000
日本農薬	25,000	452.00	11,300,000
昭和シェル石油	105,800	699.00	73,954,200
コスモ石油	327,000	228.00	74,556,000
富士興産	43,000	62.00	2,666,000
ニチレキ	14,000	302.00	4,228,000
東燃ゼネラル石油	179,000	741.00	132,639,000
ユシロ化学工業	5,900	1,141.00	6,731,900
ビービー・カストロール	4,800	314.00	1,507,200
AOCホールディングス	30,200	376.00	11,355,200
出光興産	14,000	7,350.00	102,900,000
JXホールディングス	1,313,700	529.00	694,947,300
横浜ゴム	132,000	419.00	55,308,000
東洋ゴム工業	98,000	166.00	16,268,000
ブリヂストン	371,000	1,473.00	546,483,000
住友ゴム工業	83,100	840.00	69,804,000
藤倉ゴム工業	7,400	327.00	2,419,800
オカモト	45,000	357.00	16,065,000
アキレス	96,000	115.00	11,040,000
フコク	4,900	691.00	3,385,900
ニッタ	10,600	1,316.00	13,949,600
クリエートメディック	3,500	822.00	2,877,000
東海ゴム工業	18,300	955.00	17,476,500
三ツ星ベルト	31,000	390.00	12,090,000
バンドー化学	42,000	289.00	12,138,000
鬼怒川ゴム工業	28,000	350.00	9,800,000
旭硝子	583,000	886.00	516,538,000
日本板硝子	512,000	180.00	92,160,000
有沢製作所	19,700	415.00	8,175,500
日本山村硝子	54,000	210.00	11,340,000

日本電気硝子	245,000	1,187.00	290,815,000
オハラ	4,500	1,036.00	4,662,000
住友大阪セメント	228,000	156.00	35,568,000
太平洋セメント	508,000	91.00	46,228,000
デイ・シイ	21,000	124.00	2,604,000
リゾートソリューション	17,000	151.00	2,567,000
日本ヒューム	13,000	243.00	3,159,000
東海カーボン	111,000	477.00	52,947,000
日本カーボン	58,000	250.00	14,500,000
東洋炭素	5,800	4,850.00	28,130,000
ノリタケカンパニーリミテド	61,000	270.00	16,470,000
TOTO	170,000	563.00	95,710,000
日本碍子	142,000	1,235.00	175,370,000
日本特殊陶業	105,000	1,196.00	125,580,000
MARUWA	2,900	1,998.00	5,794,200
品川リフラクトリーズ	30,000	191.00	5,730,000
黒崎播磨	26,000	299.00	7,774,000
東京窯業	17,000	194.00	3,298,000
ニッカトー	5,900	385.00	2,271,500
フジインコーポレーテッド	10,800	1,131.00	12,214,800
ニチアス	58,000	395.00	22,910,000
新日本製鐵	3,106,000	276.00	857,256,000
住友金属工業	2,193,000	204.00	447,372,000
神戸製鋼所	1,640,000	191.00	313,240,000
日新製鋼	459,000	157.00	72,063,000
中山製鋼所	70,000	102.00	7,140,000
合同製鐵	67,000	151.00	10,117,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	280,300	2,692.00	754,567,600
東京製鐵	65,400	845.00	55,263,000
共英製鋼	12,700	966.00	12,268,200
大和工業	27,100	2,247.00	60,893,700
東京製鋼	28,000	169.00	4,732,000
大阪製鐵	7,500	1,248.00	9,360,000
淀川製鋼所	91,000	320.00	29,120,000
東洋鋼板	28,000	436.00	12,208,000
住友鋼管	8,100	498.00	4,033,800
丸一鋼管	39,600	1,675.00	66,330,000
モリ工業	20,000	294.00	5,880,000
大同特殊鋼	198,000	448.00	88,704,000
日本高周波鋼業	49,000	87.00	4,263,000
日本金属工業	87,000	100.00	8,700,000
日本冶金工業	64,000	219.00	14,016,000
山陽特殊製鋼	59,000	436.00	25,724,000
愛知製鋼	63,000	469.00	29,547,000
日立金属	77,000	996.00	76,692,000

日本金属	31,000	141.00	4,371,000
大平洋金属	83,000	708.00	58,764,000
日本電工	47,000	619.00	29,093,000
日本鋳鉄管	20,000	115.00	2,300,000
日本製鋼所	183,000	878.00	160,674,000
三菱製鋼	74,000	209.00	15,466,000
日亜鋼業	17,000	182.00	3,094,000
日本精線	11,000	427.00	4,697,000
日本軽金属	268,000	149.00	39,932,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	255.00	4,590,000
三井金属鉱業	342,000	258.00	88,236,000
東邦亜鉛	67,000	365.00	24,455,000
三菱マテリアル	739,000	272.00	201,008,000
住友金属鉱山	327,000	1,400.00	457,800,000
DOWAホールディングス	142,000	532.00	75,544,000
古河機械金属	199,000	89.00	17,711,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,900	3,885.00	50,116,500
東邦チタニウム	19,200	2,165.00	41,568,000
住友軽金属工業	197,000	92.00	18,124,000
古河スカイ	48,000	217.00	10,416,000
古河電気工業	372,000	341.00	126,852,000
住友電気工業	418,000	1,067.00	446,006,000
フジクラ	177,000	353.00	62,481,000
昭和電線ホールディングス	141,000	68.00	9,588,000
タツタ電線	23,000	186.00	4,278,000
日立電線	92,000	211.00	19,412,000
沖電線	12,000	129.00	1,548,000
カナレ電気	1,400	1,152.00	1,612,800
平河ヒューテック	2,500	640.00	1,600,000
リョービ	66,000	311.00	20,526,000
アサヒホールディングス	16,500	1,872.00	30,888,000
東洋製罐	83,600	1,518.00	126,904,800
ホッカンホールディングス	35,000	216.00	7,560,000
コロナ	5,400	780.00	4,212,000
横河ブリッジホールディングス	21,000	466.00	9,786,000
三和ホールディングス	118,000	245.00	28,910,000
文化シャッター	38,000	186.00	7,068,000
住生活グループ	142,800	1,645.00	234,906,000
日本フィルコン	13,200	410.00	5,412,000
ノーリツ	21,400	1,379.00	29,510,600
長府製作所	11,400	1,731.00	19,733,400
リンナイ	19,000	5,040.00	95,760,000
ユニプレス	14,400	1,365.00	19,656,000
ダイニチ工業	8,500	522.00	4,437,000
日東精工	22,000	241.00	5,302,000

三洋工業	15,000	102.00	1,530,000
岡部	25,200	333.00	8,391,600
日立ツール	6,800	902.00	6,133,600
東プレ	22,800	620.00	14,136,000
高周波熱錬	15,700	631.00	9,906,700
東京製綱	88,000	230.00	20,240,000
パイオラックス	5,100	1,644.00	8,384,400
日本発條	86,000	839.00	72,154,000
中央発條	17,000	289.00	4,913,000
三浦工業	19,100	1,959.00	37,416,900
タクマ	43,000	215.00	9,245,000
ツガミ	35,000	557.00	19,495,000
オークマ	79,000	519.00	41,001,000
東芝機械	72,000	357.00	25,704,000
アマダ	167,000	579.00	96,693,000
アイダエンジニアリング	33,000	305.00	10,065,000
牧野フライス製作所	56,000	602.00	33,712,000
オーエスジー	52,400	894.00	46,845,600
旭ダイヤモンド工業	26,000	1,466.00	38,116,000
森精機製作所	62,400	854.00	53,289,600
ディスコ	12,000	5,060.00	60,720,000
日東工器	6,900	2,095.00	14,455,500
豊田自動織機	102,900	2,375.00	244,387,500
オーエム製作所	12,000	268.00	3,216,000
津田駒工業	29,000	128.00	3,712,000
島精機製作所	15,400	1,729.00	26,626,600
日阪製作所	15,000	957.00	14,355,000
やまびこ	4,600	662.00	3,045,200
ベガサスミシン製造	20,000	191.00	3,820,000
ナブテスコ	44,700	1,555.00	69,508,500
三井海洋開発	10,700	1,212.00	12,968,400
レオン自動機	15,000	186.00	2,790,000
S M C	35,300	13,960.00	492,788,000
新川	9,400	779.00	7,322,600
ホソカワミクロン	23,000	303.00	6,969,000
ユニオンツール	7,400	2,185.00	16,169,000
オイレス工業	11,900	1,363.00	16,219,700
サトー	11,300	944.00	10,667,200
日本エアーテック	5,600	393.00	2,200,800
日精樹脂工業	13,700	242.00	3,315,400
ワイエイシイ	7,500	535.00	4,012,500
小松製作所	560,800	2,252.00	1,262,921,600
住友重機械工業	303,000	517.00	156,651,000
日立建機	52,900	1,836.00	97,124,400
日工	19,000	227.00	4,313,000

巴工業	4,600	1,092.00	5,023,200
井関農機	124,000	205.00	25,420,000
丸山製作所	26,000	160.00	4,160,000
北川鉄工所	62,000	128.00	7,936,000
シンニッタン	14,000	263.00	3,682,000
クボタ	496,000	789.00	391,344,000
荏原実業	2,800	1,186.00	3,320,800
東洋エンジニアリング	88,000	270.00	23,760,000
三菱化工機	36,000	163.00	5,868,000
月島機械	19,000	536.00	10,184,000
帝国電機製作所	4,100	1,546.00	6,338,600
東京機械製作所	35,000	68.00	2,380,000
新東工業	23,900	623.00	14,889,700
澁谷工業	6,700	813.00	5,447,100
アイチ コーポレーション	22,000	317.00	6,974,000
小森コーポレーション	31,700	860.00	27,262,000
鶴見製作所	9,000	492.00	4,428,000
住友精密工業	23,000	305.00	7,015,000
酒井重工業	22,000	123.00	2,706,000
荏原製作所	210,000	327.00	68,670,000
西島製作所	13,700	1,448.00	19,837,600
千代田化工建設	86,000	696.00	59,856,000
ダイキン工業	123,500	2,900.00	358,150,000
オルガノ	20,000	562.00	11,240,000
トーヨーカネツ	64,000	126.00	8,064,000
栗田工業	65,300	2,363.00	154,303,900
椿本チエイン	63,000	386.00	24,318,000
大同工業	32,000	147.00	4,704,000
日機装	40,000	605.00	24,200,000
木村化工機	10,800	542.00	5,853,600
新興ブランテック	25,400	712.00	18,084,800
アネスト岩田	24,000	264.00	6,336,000
ダイフク	50,000	439.00	21,950,000
加藤製作所	34,000	159.00	5,406,000
油研工業	21,000	152.00	3,192,000
タダノ	51,000	383.00	19,533,000
フジテック	33,000	372.00	12,276,000
シーケーディ	33,200	651.00	21,613,200
キトー	43	75,000.00	3,225,000
平和	24,500	1,078.00	26,411,000
理想科学工業	9,600	1,246.00	11,961,600
SANKYO	34,300	4,330.00	148,519,000
日本金銭機械	11,000	608.00	6,688,000
マースエンジニアリング	5,600	1,257.00	7,039,200
福島工業	3,800	771.00	2,929,800

オーイズミ	7,800	219.00	1,708,200
ダイコク電機	5,200	924.00	4,804,800
アマノ	31,400	723.00	22,702,200
サンデン	64,000	282.00	18,048,000
ブラザー工業	146,200	1,198.00	175,147,600
マックス	20,000	922.00	18,440,000
モリタホールディングス	20,000	453.00	9,060,000
グローリー	31,300	1,884.00	58,969,200
大和冷機工業	17,000	379.00	6,443,000
セガサミーホールディングス	119,300	1,327.00	158,311,100
日本ピストンリング	44,000	177.00	7,788,000
リケン	46,000	300.00	13,800,000
帝国ピストンリング	15,900	698.00	11,098,200
ホシザキ電機	22,800	1,538.00	35,066,400
大豊工業	10,000	645.00	6,450,000
日本精工	253,000	692.00	175,076,000
N T N	263,000	387.00	101,781,000
ジェイテクト	121,000	915.00	110,715,000
不二越	118,000	261.00	30,798,000
ミネベア	168,000	485.00	81,480,000
日本トムソン	41,000	588.00	24,108,000
T H K	75,500	1,764.00	133,182,000
ユーシン精機	6,200	1,585.00	9,827,000
前澤給装工業	4,200	946.00	3,973,200
イーグル工業	16,000	681.00	10,896,000
日本ビラー工業	15,000	545.00	8,175,000
キッツ	49,000	334.00	16,366,000
日立製作所	2,537,000	394.00	999,578,000
東芝	2,231,000	422.00	941,482,000
三菱電機	1,130,000	814.00	919,820,000
富士電機ホールディングス	341,000	203.00	69,223,000
東洋電機製造	20,000	359.00	7,180,000
安川電機	124,000	719.00	89,156,000
シンフォニアテクノロジー	68,000	171.00	11,628,000
明電舎	114,000	341.00	38,874,000
オリジン電気	17,000	321.00	5,457,000
デンヨー	11,300	520.00	5,876,000
日立工機	30,300	695.00	21,058,500
三櫻工業	13,100	612.00	8,017,200
マキタ	73,700	3,015.00	222,205,500
東芝テック	71,000	332.00	23,572,000
芝浦メカトロニクス	23,000	264.00	6,072,000
マブチモーター	16,200	4,165.00	67,473,000
日本電産	56,000	8,170.00	457,520,000
高岳製作所	45,000	330.00	14,850,000

ダイヘン	62,000	365.00	22,630,000
日新電機	20,000	417.00	8,340,000
大崎電気工業	17,000	681.00	11,577,000
オムロン	125,900	2,010.00	253,059,000
日東工業	17,300	900.00	15,570,000
I D E C	14,000	704.00	9,856,000
エルピーダメモリ	100,800	857.00	86,385,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	218,000	560.00	122,080,000
サクサホールディングス	31,000	116.00	3,596,000
メルコホールディングス	6,300	2,746.00	17,299,800
テクノメディカ	9	295,000.00	2,655,000
日本電気	1,463,000	228.00	333,564,000
富士通	1,090,000	557.00	607,130,000
沖電気工業	411,000	67.00	27,537,000
岩崎通信機	50,000	62.00	3,100,000
電気興業	35,000	346.00	12,110,000
サンケン電気	67,000	315.00	21,105,000
ナカヨ通信機	11,000	180.00	1,980,000
アイホン	7,300	1,259.00	9,190,700
ルネサスエレクトロニクス	30,300	688.00	20,846,400
セイコーエプソン	77,200	1,467.00	113,252,400
ワコム	225	100,800.00	22,680,000
アルバック	20,800	1,796.00	37,356,800
アクセル	4,400	1,795.00	7,898,000
ナナオ	9,600	1,667.00	16,003,200
日本信号	26,400	570.00	15,048,000
京三製作所	25,000	346.00	8,650,000
能美防災	15,000	452.00	6,780,000
ホーチキ	10,000	383.00	3,830,000
マスプロ電工	7,900	766.00	6,051,400
日本無線	45,000	265.00	11,925,000
パナソニック	1,119,200	1,193.00	1,335,205,600
シャープ	507,000	807.00	409,149,000
アンリツ	50,000	573.00	28,650,000
富士通ゼネラル	28,000	393.00	11,004,000
日立国際電気	26,000	740.00	19,240,000
ソニー	634,600	2,749.00	1,744,515,400
T D K	63,700	5,210.00	331,877,000
帝国通信工業	27,000	185.00	4,995,000
三洋電機	865,000	133.00	115,045,000
ミツミ電機	40,000	1,466.00	58,640,000
タムラ製作所	36,000	218.00	7,848,000
アルプス電気	89,900	750.00	67,425,000
パイオニア	160,200	293.00	46,938,600
日本電波工業	9,300	1,353.00	12,582,900

日本トリム	1,350	1,799.00	2,428,650
ローランド ディー . ジー .	5,100	1,190.00	6,069,000
フォスター電機	11,000	2,014.00	22,154,000
クラリオン	60,000	134.00	8,040,000
S M K	35,000	368.00	12,880,000
ヨコオ	9,700	458.00	4,442,600
東光	48,000	113.00	5,424,000
ホシデン	28,100	794.00	22,311,400
ヒロセ電機	18,300	8,210.00	150,243,000
日本航空電子工業	27,000	592.00	15,984,000
T O A	14,000	401.00	5,614,000
アルパイン	22,200	1,096.00	24,331,200
スミダコーポレーション	8,400	815.00	6,846,000
アイコム	6,300	2,080.00	13,104,000
船井電機	10,300	2,415.00	24,874,500
横河電機	113,200	548.00	62,033,600
新電元工業	40,000	325.00	13,000,000
山武	31,700	1,875.00	59,437,500
日本光電工業	20,900	1,616.00	33,774,400
チノー	23,000	195.00	4,485,000
共和電業	12,000	249.00	2,988,000
日本電子材料	5,900	515.00	3,038,500
堀場製作所	19,400	2,304.00	44,697,600
アドバンテスト	77,100	1,629.00	125,595,900
小野測器	15,000	225.00	3,375,000
エスベック	13,000	549.00	7,137,000
パナソニック電工 S U N X	10,000	450.00	4,500,000
キーエンス	25,200	21,760.00	548,352,000
日置電機	5,500	1,650.00	9,075,000
シスメックス	19,900	5,550.00	110,445,000
メガチップス	10,300	1,509.00	15,542,700
O B A R A	8,300	810.00	6,723,000
日本電産コバル電子	11,800	628.00	7,410,400
ミヤチテクノス	7,300	566.00	4,131,800
東京電波	3,400	444.00	1,509,600
澤藤電機	12,000	178.00	2,136,000
デンソー	248,200	2,649.00	657,481,800
コーセル	15,100	1,123.00	16,957,300
日立メディコ	8,000	590.00	4,720,000
新日本無線	8,000	221.00	1,768,000
オブテックス	7,800	1,007.00	7,854,600
千代田インテグレ	4,500	1,056.00	4,752,000
東光電気	8,000	432.00	3,456,000
スタンレー電気	76,400	1,409.00	107,647,600
岩崎電気	48,000	142.00	6,816,000

ウシオ電機	68,600	1,452.00	99,607,200
岡谷電機産業	6,200	321.00	1,990,200
ヘリオス テクノ ホールディング	14,500	217.00	3,146,500
日本セラミック	7,400	1,334.00	9,871,600
新神戸電機	9,000	889.00	8,001,000
日本デジタル研究所	9,600	852.00	8,179,200
古河電池	8,000	504.00	4,032,000
双信電機	5,600	357.00	1,999,200
図研	7,900	597.00	4,716,300
日本電子	44,000	246.00	10,824,000
カシオ計算機	107,800	618.00	66,620,400
ファナック	117,700	12,320.00	1,450,064,000
日本シイエムケイ	24,200	334.00	8,082,800
エンブラス	5,700	1,086.00	6,190,200
ローム	56,700	4,960.00	281,232,000
浜松ホトニクス	44,100	2,687.00	118,496,700
三井ハイテック	14,800	433.00	6,408,400
新光電気工業	28,500	886.00	25,251,000
京セラ	94,000	8,680.00	815,920,000
協栄産業	17,000	160.00	2,720,000
太陽誘電	51,000	1,141.00	58,191,000
村田製作所	118,600	4,835.00	573,431,000
ユーシン	14,700	662.00	9,731,400
双葉電子工業	19,400	1,447.00	28,071,800
日東電工	97,600	3,290.00	321,104,000
北陸電気工業	45,000	160.00	7,200,000
パナソニック電工	105,000	1,072.00	112,560,000
東海理化電機製作所	26,500	1,430.00	37,895,000
ニチコン	35,700	909.00	32,451,300
日本ケミコン	72,000	322.00	23,184,000
K O A	14,300	851.00	12,169,300
三井造船	437,000	190.00	83,030,000
日立造船	475,000	117.00	55,575,000
佐世保重工業	74,000	150.00	11,100,000
三菱重工業	1,895,000	292.00	553,340,000
川崎重工業	879,000	236.00	207,444,000
I H I	778,000	163.00	126,814,000
日本車輛製造	41,000	362.00	14,842,000
日本輸送機	13,000	190.00	2,470,000
近畿車輛	17,000	350.00	5,950,000
日産自動車	1,427,900	790.00	1,128,041,000
いすゞ自動車	655,000	343.00	224,665,000
トヨタ自動車	1,452,100	3,055.00	4,436,165,500
日野自動車	141,000	379.00	53,439,000
三菱自動車工業	2,332,000	105.00	244,860,000

エフテック	4,200	1,415.00	5,943,000
武蔵精密工業	11,000	2,095.00	23,045,000
トヨタ車体	20,500	1,349.00	27,654,500
日産車体	44,000	652.00	28,688,000
関東自動車工業	17,200	585.00	10,062,000
新明和工業	50,000	299.00	14,950,000
極東開発工業	21,000	285.00	5,985,000
日信工業	23,000	1,459.00	33,557,000
トピー工業	93,000	173.00	16,089,000
ティラド	37,000	279.00	10,323,000
曙ブレーキ工業	53,200	501.00	26,653,200
タチエス	14,800	1,269.00	18,781,200
N O K	54,700	1,460.00	79,862,000
フタバ産業	32,000	461.00	14,752,000
カヤバ工業	71,000	539.00	38,269,000
シロキ工業	26,000	226.00	5,876,000
市光工業	34,000	174.00	5,916,000
大同メタル工業	17,000	432.00	7,344,000
プレス工業	53,000	336.00	17,808,000
カルソニックカンセイ	58,000	273.00	15,834,000
太平洋工業	23,000	393.00	9,039,000
ケーヒン	23,400	1,699.00	39,756,600
河西工業	15,000	388.00	5,820,000
アイシン精機	93,100	2,664.00	248,018,400
マツダ	875,000	213.00	186,375,000
ダイハツ工業	120,000	1,123.00	134,760,000
愛知機械工業	25,000	280.00	7,000,000
今仙電機製作所	7,700	1,141.00	8,785,700
本田技研工業	953,600	3,030.00	2,889,408,000
スズキ	236,300	2,067.00	488,432,100
富士重工業	357,000	610.00	217,770,000
ヤマハ発動機	171,800	1,242.00	213,375,600
ショーワ	24,000	540.00	12,960,000
小糸製作所	56,000	1,161.00	65,016,000
T B K	13,000	335.00	4,355,000
エクセディ	13,700	2,682.00	36,743,400
ミツバ	22,000	582.00	12,804,000
豊田合成	31,900	1,732.00	55,250,800
愛三工業	13,700	637.00	8,726,900
ヨロズ	6,800	1,388.00	9,438,400
エフ・シー・シー	16,600	1,912.00	31,739,200
新家工業	26,000	123.00	3,198,000
シマノ	46,600	4,255.00	198,283,000
タカタ	17,500	2,198.00	38,465,000
テイ・エス テック	21,500	1,541.00	33,131,500

小野建	10,000	670.00	6,700,000
はるやま商事	5,400	333.00	1,798,200
佐鳥電機	8,600	582.00	5,005,200
カッパ・クリエイト	8,200	1,815.00	14,883,000
エコートレーディング	3,200	812.00	2,598,400
伯東	7,100	702.00	4,984,200
中山福	6,800	557.00	3,787,600
ライトオン	8,500	385.00	3,272,500
ナガイレーベン	6,000	1,914.00	11,484,000
ジーンズメイト	3,600	158.00	568,800
菱食	10,900	1,824.00	19,881,600
良品計画	12,800	2,896.00	37,068,800
三城ホールディングス	13,900	694.00	9,646,600
松田産業	8,200	1,384.00	11,348,800
メディバルホールディングス	103,000	926.00	95,378,000
アドヴァン	7,200	599.00	4,312,800
S P K	2,800	1,099.00	3,077,200
アズワン	7,300	1,434.00	10,468,200
スズデン	4,400	493.00	2,169,200
尾家産業	4,100	750.00	3,075,000
シモジマ	7,800	1,123.00	8,759,400
ドウシシャ	5,200	1,955.00	10,166,000
コナカ	13,500	193.00	2,605,500
高速	7,000	725.00	5,075,000
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,207.00	1,448,400
G - 7ホールディングス	2,900	449.00	1,302,100
イオン北海道	8,200	277.00	2,271,400
コジマ	13,700	455.00	6,233,500
コーナン商事	10,900	928.00	10,115,200
黒田電気	15,100	1,010.00	15,251,000
ネットワンシステムズ	273	115,800.00	31,613,400
エコス	4,000	340.00	1,360,000
ワタミ	13,200	1,462.00	19,298,400
マルシェ	3,000	685.00	2,055,000
ドン・キホーテ	17,800	2,262.00	40,263,600
丸文	8,900	376.00	3,346,400
メガネトップ	11,800	926.00	10,926,800
西松屋チェーン	24,500	798.00	19,551,000
ゼンショー	42,600	732.00	31,183,200
ハビネット	3,200	940.00	3,008,000
幸楽苑	6,900	1,178.00	8,128,200
トーメンエレクトロニクス	4,800	1,025.00	4,920,000
ハークスレイ	3,200	519.00	1,660,800
サイゼリヤ	14,700	1,522.00	22,373,400
エクセル	5,800	891.00	5,167,800

マルカキカイ	4,000	603.00	2,412,000
アルゴグラフィックス	4,200	946.00	3,973,200
ガリバーインターナショナル	3,110	3,915.00	12,175,650
ボブラ	4,000	470.00	1,880,000
ユナイテッドアローズ	10,600	1,102.00	11,681,200
進和	6,400	939.00	6,009,600
エスケイジャパン	5,000	239.00	1,195,000
ダイトエレクトロン	5,800	537.00	3,114,600
ハイデイ日高	4,900	1,290.00	6,321,000
シークス	7,700	804.00	6,190,800
京都きもの友禅	7,200	901.00	6,487,200
コロナ	37,000	428.00	15,836,000
田中商事	5,600	308.00	1,724,800
オーハシテクニカ	6,900	571.00	3,939,900
壱番屋	3,900	2,265.00	8,833,500
マクニカ	5,400	1,731.00	9,347,400
白銅	3,900	815.00	3,178,500
トップカルチャー	4,200	342.00	1,436,400
スギホールディングス	17,800	1,833.00	32,627,400
島津製作所	135,000	672.00	90,720,000
JMS	17,000	268.00	4,556,000
アロカ	7,100	670.00	4,757,000
長野計器	7,400	668.00	4,943,200
スター精密	21,600	790.00	17,064,000
東京計器	44,000	111.00	4,884,000
愛知時計電機	15,000	214.00	3,210,000
日本電産トーソク	6,800	873.00	5,936,400
東京精密	22,300	1,144.00	25,511,200
ニコン	197,000	1,664.00	327,808,000
トプコン	26,000	391.00	10,166,000
オリンパス	133,400	2,181.00	290,945,400
理研計器	9,800	574.00	5,625,200
大日本スクリーン製造	126,000	518.00	65,268,000
キヤノン電子	10,400	2,207.00	22,952,800
タムロン	11,400	1,606.00	18,308,400
H O Y A	259,600	1,958.00	508,296,800
ノーリツ鋼機	11,700	512.00	5,990,400
キヤノン	702,100	3,995.00	2,804,889,500
リコー	340,000	1,229.00	417,860,000
日本電産コバル	8,900	1,248.00	11,107,200
日本電産サンキョー	27,000	599.00	16,173,000
シチズンホールディングス	123,300	501.00	61,773,300
リズム時計工業	59,000	131.00	7,729,000
S R I スポーツ	71	89,000.00	6,319,000
バンダイナムコホールディングス	131,600	774.00	101,858,400

共立印刷	18,700	118.00	2,206,600
フランスベッドホールディングス	76,000	105.00	7,980,000
パイロットコーポレーション	109	136,100.00	14,834,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	21,600	1,215.00	26,244,000
トッパン・フォームズ	24,200	726.00	17,569,200
フジシールインターナショナル	11,600	1,647.00	19,105,200
タカラトミー	33,800	642.00	21,699,600
レック	3,100	1,244.00	3,856,400
アロン化成	9,000	341.00	3,069,000
タカノ	6,400	418.00	2,675,200
プロネクサス	12,500	396.00	4,950,000
ウッドワン	19,000	240.00	4,560,000
大建工業	49,000	184.00	9,016,000
きもと	10,600	651.00	6,900,600
凸版印刷	319,000	682.00	217,558,000
大日本印刷	344,000	1,058.00	363,952,000
図書印刷	21,000	122.00	2,562,000
共同印刷	37,000	176.00	6,512,000
日本写真印刷	20,900	1,767.00	36,930,300
光村印刷	12,000	243.00	2,916,000
藤森工業	8,500	1,073.00	9,120,500
宝印刷	4,600	663.00	3,049,800
前澤化成工業	8,300	659.00	5,469,700
コンビ	5,500	779.00	4,284,500
アシックス	105,000	877.00	92,085,000
ツツミ	4,900	1,983.00	9,716,700
J S P	7,700	993.00	7,646,100
ニチハ	11,800	591.00	6,973,800
ローランド	11,700	834.00	9,757,800
エフピコ	5,800	4,500.00	26,100,000
小松ウオール工業	4,200	734.00	3,082,800
ヤマハ	90,000	989.00	89,010,000
河合楽器製作所	42,000	147.00	6,174,000
クリナップ	12,800	536.00	6,860,800
ビジョン	7,900	2,640.00	20,856,000
天馬	10,500	799.00	8,389,500
パラマウントベッド	8,900	2,240.00	19,936,000
キングジム	8,600	583.00	5,013,800
リンテック	24,200	1,925.00	46,585,000
信越ポリマー	23,300	454.00	10,578,200
東リ	30,000	130.00	3,900,000
イトーキ	27,700	194.00	5,373,800
任天堂	64,600	20,820.00	1,344,972,000
三菱鉛筆	9,600	1,428.00	13,708,800
タカラスタンダード	52,000	530.00	27,560,000

コクヨ	58,800	625.00	36,750,000
ナカバヤシ	27,000	161.00	4,347,000
ニフコ	22,600	2,173.00	49,109,800
グロープライド	51,000	89.00	4,539,000
岡村製作所	44,000	437.00	19,228,000
日本バルカー工業	49,000	238.00	11,662,000
MUTOHホールディングス	17,000	178.00	3,026,000
伊藤忠商事	778,700	788.00	613,615,600
丸紅	976,000	543.00	529,968,000
スクロール	15,800	322.00	5,087,600
高島	24,000	122.00	2,928,000
F & A アクアホールディングス	9,100	728.00	6,624,800
三陽商会	58,000	324.00	18,792,000
長瀬産業	63,000	942.00	59,346,000
蝶理	78,000	94.00	7,332,000
豊田通商	124,300	1,345.00	167,183,500
オンワードホールディングス	79,000	627.00	49,533,000
三共生興	20,500	255.00	5,227,500
兼松	252,000	71.00	17,892,000
美津濃	56,000	361.00	20,216,000
ファミリーマート	37,700	2,912.00	109,782,400
三井物産	962,900	1,351.00	1,300,877,900
日本紙パルプ商事	64,000	279.00	17,856,000
東京エレクトロン	88,800	5,110.00	453,768,000
日立ハイテクノロジーズ	33,900	1,763.00	59,765,700
カメイ	15,000	352.00	5,280,000
東都水産	24,000	112.00	2,688,000
スターゼン	39,000	222.00	8,658,000
セイコーホールディングス	59,000	292.00	17,228,000
山善	43,000	350.00	15,050,000
椿本興業	13,000	200.00	2,600,000
住友商事	614,500	1,141.00	701,144,500
日本ユニシス	31,500	539.00	16,978,500
内田洋行	26,000	286.00	7,436,000
三菱商事	893,300	2,125.00	1,898,262,500
第一実業	24,000	257.00	6,168,000
キヤノンマーケティングジャパン	37,100	1,137.00	42,182,700
西華産業	44,000	201.00	8,844,000
佐藤商事	11,300	455.00	5,141,500
菱洋エレクトロ	14,900	768.00	11,443,200
東京産業	12,000	243.00	2,916,000
ユアサ商事	114,000	78.00	8,892,000
神鋼商事	28,000	170.00	4,760,000
阪和興業	105,000	294.00	30,870,000
カナデン	11,000	459.00	5,049,000

菱電商事	18,000	455.00	8,190,000
ニプロ	22,400	1,687.00	37,788,800
フルサト工業	7,200	454.00	3,268,800
岩谷産業	125,000	238.00	29,750,000
すてきなイスグループ	49,000	172.00	8,428,000
昭光通商	41,000	114.00	4,674,000
ニチモウ	16,000	140.00	2,240,000
極東貿易	16,000	131.00	2,096,000
イワキ	15,000	185.00	2,775,000
兼松エレクトロニクス	7,000	793.00	5,551,000
三愛石油	29,000	367.00	10,643,000
稲畑産業	30,000	424.00	12,720,000
明和産業	8,800	222.00	1,953,600
ゴールドウイン	27,000	190.00	5,130,000
東京スタイル	43,000	619.00	26,617,000
ユニ・チャーム	65,400	3,375.00	220,725,000
デサント	30,000	431.00	12,930,000
ヤマトインターナショナル	13,000	350.00	4,550,000
東邦ホールディングス	34,100	1,046.00	35,668,600
サンゲツ	19,700	1,769.00	34,849,300
ミツウロコ	18,500	499.00	9,231,500
シナネン	25,000	325.00	8,125,000
伊藤忠エネクス	25,300	392.00	9,917,600
サンリオ	31,500	2,019.00	63,598,500
リョーサン	18,200	2,063.00	37,546,600
新光商事	10,900	608.00	6,627,200
トーヨー	24,000	294.00	7,056,000
三信電気	14,000	641.00	8,974,000
東陽テクニカ	15,300	785.00	12,010,500
モスフードサービス	14,600	1,494.00	21,812,400
加賀電子	11,200	928.00	10,393,600
三益半導体工業	8,700	806.00	7,012,200
ソーダニッカ	12,000	319.00	3,828,000
立花エレテック	7,200	599.00	4,312,800
木曽路	12,800	1,649.00	21,107,200
千趣会	20,200	471.00	9,514,200
タカキュー	9,000	136.00	1,224,000
ケーヨー	20,900	402.00	8,401,800
ユニ 헤어	12,700	989.00	12,560,300
上新電機	24,000	803.00	19,272,000
日本瓦斯	10,700	1,150.00	12,305,000
ベスト電器	35,000	234.00	8,190,000
マルエツ	23,000	289.00	6,647,000
ロイヤルホールディングス	17,300	847.00	14,653,100
いなげや	12,000	863.00	10,356,000

島忠	21,700	1,661.00	36,043,700
チヨダ	14,700	972.00	14,288,400
ライフコーポレーション	7,000	1,266.00	8,862,000
カスミ	22,800	422.00	9,621,600
リンガーハット	8,600	955.00	8,213,000
MrMax	11,300	258.00	2,915,400
テナアライド	7,700	280.00	2,156,000
AOKIホールディングス	10,400	1,254.00	13,041,600
オークワ	16,000	814.00	13,024,000
コメリ	15,300	1,723.00	26,361,900
青山商事	28,400	1,329.00	37,743,600
しまむら	11,700	7,900.00	92,430,000
CFSコーポレーション	11,500	402.00	4,623,000
高島屋	151,000	668.00	100,868,000
松屋	23,200	475.00	11,020,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,000	568.00	36,920,000
ニッセンホールディングス	22,400	373.00	8,355,200
バルコ	29,000	657.00	19,053,000
丸井グループ	146,000	696.00	101,616,000
クレディセゾン	85,200	1,327.00	113,060,400
原信ナルスホールディングス	6,700	1,055.00	7,068,500
セディナ	116,100	123.00	14,280,300
ダイエー	51,650	308.00	15,908,200
イズミヤ	42,000	298.00	12,516,000
イオン	393,300	991.00	389,760,300
ユニー	91,600	707.00	64,761,200
イズミ	31,200	1,125.00	35,100,000
東武ストア	15,000	238.00	3,570,000
平和堂	22,600	1,038.00	23,458,800
フジ	12,700	1,617.00	20,535,900
ヤオコー	4,900	2,216.00	10,858,400
ゼビオ	13,500	1,567.00	21,154,500
ケーズホールディングス	25,700	2,114.00	54,329,800
Paltac	6,900	1,327.00	9,156,300
Olympic	7,500	614.00	4,605,000
新生銀行	578,000	70.00	40,460,000
あおぞら銀行	405,000	130.00	52,650,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,442,600	393.00	3,317,941,800
りそなホールディングス	341,100	469.00	159,975,900
中央三井トラスト・ホールディングス	640,000	307.00	196,480,000
三井住友フィナンシャルグループ	843,700	2,512.00	2,119,374,400
第四銀行	146,000	257.00	37,522,000
北越銀行	125,000	152.00	19,000,000
西日本シティ銀行	391,000	229.00	89,539,000
札幌北洋ホールディングス	168,200	344.00	57,860,800

千葉銀行	440,000	507.00	223,080,000
横浜銀行	764,000	416.00	317,824,000
常陽銀行	433,000	374.00	161,942,000
群馬銀行	261,000	410.00	107,010,000
武蔵野銀行	18,100	2,431.00	44,001,100
千葉興業銀行	21,400	457.00	9,779,800
筑波銀行	48,900	259.00	12,665,100
東京都民銀行	21,500	810.00	17,415,000
七十七銀行	188,000	404.00	75,952,000
青森銀行	89,000	206.00	18,334,000
秋田銀行	77,000	241.00	18,557,000
山形銀行	68,000	369.00	25,092,000
岩手銀行	7,600	3,580.00	27,208,000
東邦銀行	94,000	234.00	21,996,000
東北銀行	63,000	139.00	8,757,000
みちのく銀行	58,000	173.00	10,034,000
ふくおかフィナンシャルグループ	453,000	331.00	149,943,000
静岡銀行	346,000	725.00	250,850,000
十六銀行	135,000	255.00	34,425,000
スルガ銀行	118,000	730.00	86,140,000
八十二銀行	210,000	429.00	90,090,000
山梨中央銀行	68,000	337.00	22,916,000
大垣共立銀行	149,000	233.00	34,717,000
福井銀行	96,000	261.00	25,056,000
北國銀行	128,000	342.00	43,776,000
清水銀行	3,800	3,500.00	13,300,000
滋賀銀行	105,000	433.00	45,465,000
南都銀行	104,000	432.00	44,928,000
百五銀行	101,000	347.00	35,047,000
京都銀行	200,000	752.00	150,400,000
三重銀行	51,000	220.00	11,220,000
ほくほくフィナンシャルグループ	781,000	162.00	126,522,000
広島銀行	329,000	350.00	115,150,000
山陰合同銀行	67,000	575.00	38,525,000
中国銀行	92,000	1,011.00	93,012,000
鳥取銀行	38,000	176.00	6,688,000
伊予銀行	119,000	619.00	73,661,000
百十四銀行	131,000	304.00	39,824,000
四国銀行	81,000	247.00	20,007,000
阿波銀行	93,000	569.00	52,917,000
鹿児島銀行	72,000	505.00	36,360,000
大分銀行	72,000	272.00	19,584,000
宮崎銀行	76,000	211.00	16,036,000
肥後銀行	88,000	383.00	33,704,000
佐賀銀行	69,000	222.00	15,318,000

十八銀行	74,000	225.00	16,650,000
沖縄銀行	8,600	3,195.00	27,477,000
琉球銀行	23,500	982.00	23,077,000
住友信託銀行	999,000	462.00	461,538,000
みずほ信託銀行	1,059,000	75.00	79,425,000
八千代銀行	6,100	1,905.00	11,620,500
みずほフィナンシャルグループ	13,606,900	127.00	1,728,076,300
紀陽ホールディングス	442,000	116.00	51,272,000
山口フィナンシャルグループ	111,000	757.00	84,027,000
芙蓉総合リース	11,000	2,510.00	27,610,000
興銀リース	15,600	1,876.00	29,265,600
東京センチュリーリース	26,400	1,223.00	32,287,200
SBIホールディングス	13,344	10,290.00	137,309,760
日本証券金融	47,600	505.00	24,038,000
大阪証券金融	18,500	156.00	2,886,000
ポケットカード	10,600	202.00	2,141,200
長野銀行	42,000	154.00	6,468,000
名古屋銀行	103,000	252.00	25,956,000
愛知銀行	3,800	4,860.00	18,468,000
第三銀行	68,000	217.00	14,756,000
中京銀行	46,000	250.00	11,500,000
東日本銀行	60,000	152.00	9,120,000
愛媛銀行	70,000	225.00	15,750,000
トマト銀行	43,000	149.00	6,407,000
みなと銀行	115,000	125.00	14,375,000
京葉銀行	92,000	404.00	37,168,000
関西アーバン銀行	157,000	129.00	20,253,000
栃木銀行	57,000	356.00	20,292,000
北日本銀行	3,700	1,921.00	7,107,700
福島銀行	137,000	47.00	6,439,000
大東銀行	71,000	57.00	4,047,000
リコーリース	7,800	2,103.00	16,403,400
イオンクレジットサービス	50,100	985.00	49,348,500
アコム	23,540	810.00	19,067,400
プロミス	56,800	433.00	24,594,400
ジャックス	79,000	158.00	12,482,000
日立キャピタル	26,400	1,177.00	31,072,800
オリックス	58,100	7,620.00	442,722,000
三菱UFJリース	28,300	2,895.00	81,928,500
ジャフコ	15,800	1,768.00	27,934,400
トモニホールディングス	88,300	310.00	27,373,000
大和証券グループ本社	1,105,000	362.00	400,010,000
野村ホールディングス	2,350,900	447.00	1,050,852,300
みずほ証券	288,000	182.00	52,416,000
みずほインベスターズ証券	260,000	78.00	20,280,000

岡三証券グループ	95,000	269.00	25,555,000
丸三証券	36,100	452.00	16,317,200
東洋証券	47,000	126.00	5,922,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	128,000	301.00	38,528,000
水戸証券	37,000	131.00	4,847,000
いちよし証券	25,000	525.00	13,125,000
松井証券	66,200	474.00	31,378,800
N K S Jホールディングス	933,000	582.00	543,006,000
だいこう証券ビジネス	7,600	262.00	1,991,200
マネックスグループ	689	20,650.00	14,227,850
カブドットコム証券	50,400	293.00	14,767,200
極東証券	15,200	606.00	9,211,200
岩井コスモホールディングス	10,600	502.00	5,321,200
フィデアホールディングス	67,500	183.00	12,352,500
池田泉州ホールディングス	320,300	111.00	35,553,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	333,400	2,041.00	680,469,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	534	288,300.00	153,952,200
第一生命保険	4,475	109,900.00	491,802,500
富士火災海上保険	98,000	107.00	10,486,000
東京海上ホールディングス	423,500	2,374.00	1,005,389,000
N E Cキャピタルソリューション	3,400	1,046.00	3,556,400
T & Dホールディングス	203,300	1,777.00	361,264,100
三井不動産	526,000	1,555.00	817,930,000
三菱地所	781,000	1,476.00	1,152,756,000
平和不動産	94,000	222.00	20,868,000
東京建物	235,000	332.00	78,020,000
ダイビル	34,600	641.00	22,178,600
サンケイビル	26,500	466.00	12,349,000
東急不動産	226,000	398.00	89,948,000
京阪神不動産	18,100	366.00	6,624,600
住友不動産	268,000	1,891.00	506,788,000
東宝不動産	14,200	517.00	7,341,400
大京	209,000	132.00	27,588,000
テーオーシー	46,700	342.00	15,971,400
東京楽天地	20,000	295.00	5,900,000
フジ住宅	15,600	336.00	5,241,600
空港施設	17,300	322.00	5,570,600
住友不動産販売	4,210	3,560.00	14,987,600
ゴールドクレスト	10,690	1,863.00	19,915,470
東栄住宅	10,000	947.00	9,470,000
東急リバブル	12,500	913.00	11,412,500
飯田産業	10,400	636.00	6,614,400
アーネストワン	21,600	943.00	20,368,800
サンヨーハウジング名古屋	57	72,300.00	4,121,100
イオンモール	51,100	1,916.00	97,907,600

タクトホーム	78	65,600.00	5,116,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	830	74,000.00	61,420,000
東武鉄道	482,000	456.00	219,792,000
相鉄ホールディングス	178,000	253.00	45,034,000
東京急行電鉄	621,000	371.00	230,391,000
京浜急行電鉄	290,000	756.00	219,240,000
小田急電鉄	362,000	771.00	279,102,000
京王電鉄	293,000	569.00	166,717,000
京成電鉄	182,000	570.00	103,740,000
富士急行	31,000	425.00	13,175,000
新京成電鉄	15,000	350.00	5,250,000
東日本旅客鉄道	196,500	4,995.00	981,517,500
西日本旅客鉄道	1,053	302,000.00	318,006,000
東海旅客鉄道	981	628,000.00	616,068,000
アートコーポレーション	2,300	1,265.00	2,909,500
西日本鉄道	146,000	347.00	50,662,000
ハマキョウレックス	3,200	1,918.00	6,137,600
サカイ引越センター	2,100	1,720.00	3,612,000
近畿日本鉄道	1,021,000	251.00	256,271,000
阪急阪神ホールディングス	759,000	394.00	299,046,000
南海電気鉄道	236,000	347.00	81,892,000
京阪電気鉄道	253,000	356.00	90,068,000
名糖運輸	4,200	602.00	2,528,400
名古屋鉄道	394,000	222.00	87,468,000
日本通運	447,000	332.00	148,404,000
ヤマトホールディングス	230,000	1,095.00	251,850,000
山九	137,000	330.00	45,210,000
日新	43,000	185.00	7,955,000
丸運	6,100	205.00	1,250,500
丸全昭和運輸	38,000	259.00	9,842,000
センコー	45,000	238.00	10,710,000
トナミホールディングス	23,000	135.00	3,105,000
日本梱包運輸倉庫	34,000	881.00	29,954,000
日本石油輸送	13,000	183.00	2,379,000
福山通運	78,000	421.00	32,838,000
セイノーホールディングス	87,000	513.00	44,631,000
神奈川中央交通	13,000	420.00	5,460,000
日立物流	19,600	1,239.00	24,284,400
日本郵船	955,000	355.00	339,025,000
商船三井	551,000	555.00	305,805,000
川崎汽船	351,000	343.00	120,393,000
N S ユナイテッド海運	40,000	193.00	7,720,000
乾汽船	13,700	446.00	6,110,200
飯野海運	61,700	354.00	21,841,800
第一中央汽船	78,000	198.00	15,444,000

全日本空輸	1,507,000	300.00	452,100,000
パスコ	17,000	196.00	3,332,000
三菱倉庫	80,000	1,037.00	82,960,000
三井倉庫	52,000	311.00	16,172,000
住友倉庫	83,000	428.00	35,524,000
滋澤倉庫	29,000	285.00	8,265,000
ヤマタネ	56,000	99.00	5,544,000
東陽倉庫	18,000	175.00	3,150,000
日本トランスシティ	24,000	252.00	6,048,000
ケイヒン	21,000	84.00	1,764,000
安田倉庫	9,600	472.00	4,531,200
東洋埠頭	33,000	132.00	4,356,000
宇徳	8,200	211.00	1,730,200
上組	125,000	658.00	82,250,000
サンリツ	3,000	575.00	1,725,000
キムラユニティー	2,500	677.00	1,692,500
キューソー流通システム	3,600	900.00	3,240,000
郵船ロジスティクス	8,900	1,076.00	9,576,400
近鉄エクスプレス	10,100	1,971.00	19,907,100
東海運	6,100	173.00	1,055,300
バンテック	52	118,600.00	6,167,200
東京放送ホールディングス	60,500	1,048.00	63,404,000
日本テレビ放送網	9,790	11,020.00	107,885,800
テレビ朝日	282	116,500.00	32,853,000
スカパーJ S A Tホールディングス	861	27,420.00	23,608,620
テレビ東京ホールディングス	5,100	1,206.00	6,150,600
アイ・ティー・シーネットワーク	9,400	396.00	3,722,400
イー・アクセス	626	64,400.00	40,314,400
NECモバイリング	4,100	2,141.00	8,778,100
日本電信電話	476,200	3,900.00	1,857,180,000
K D D I	1,731	464,500.00	804,049,500
光通信	14,400	1,585.00	22,824,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,221	139,800.00	1,289,095,800
GMOインターネット	33,700	321.00	10,817,700
学研ホールディングス	48,000	142.00	6,816,000
ゼンリン	16,400	846.00	13,874,400
昭文社	7,000	600.00	4,200,000
角川グループホールディングス	10,600	1,984.00	21,030,400
インプレスホールディングス	9,200	125.00	1,150,000
東京電力	832,000	1,918.00	1,595,776,000
中部電力	348,100	2,022.00	703,858,200
関西電力	461,200	2,050.00	945,460,000
中国電力	156,300	1,669.00	260,864,700
北陸電力	116,000	2,028.00	235,248,000
東北電力	282,400	1,842.00	520,180,800

四国電力	114,500	2,459.00	281,555,500
九州電力	249,600	1,922.00	479,731,200
北海道電力	105,800	1,690.00	178,802,000
沖縄電力	6,800	3,860.00	26,248,000
電源開発	70,100	2,509.00	175,880,900
東京瓦斯	1,413,000	380.00	536,940,000
大阪瓦斯	1,136,000	314.00	356,704,000
東邦瓦斯	291,000	413.00	120,183,000
北海道瓦斯	22,000	243.00	5,346,000
西部瓦斯	127,000	238.00	30,226,000
静岡瓦斯	29,500	487.00	14,366,500
アイネット	6,800	426.00	2,896,800
松竹	69,000	513.00	35,397,000
東宝	73,000	1,284.00	93,732,000
エイチ・アイ・エス	12,400	1,749.00	21,687,600
東映	48,000	345.00	16,560,000
葵プロモーション	5,500	430.00	2,365,000
エヌ・ティ・ティ・データ	789	271,300.00	214,055,700
共立メンテナンス	6,600	1,114.00	7,352,400
イチネンホールディングス	15,900	372.00	5,914,800
建設技術研究所	7,400	438.00	3,241,200
アインファーマシーズ	3,700	2,833.00	10,482,100
燦ホールディングス	2,400	1,270.00	3,048,000
スバル興業	9,000	226.00	2,034,000
東京テアトル	45,000	106.00	4,770,000
ホリプロ	4,100	646.00	2,648,600
よみうりランド	30,000	284.00	8,520,000
東京都競馬	81,000	120.00	9,720,000
常磐興産	36,000	115.00	4,140,000
カナモト	17,000	399.00	6,783,000
東京ドーム	94,000	205.00	19,270,000
D T S	10,900	845.00	9,210,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,500	1,581.00	57,706,500
シーイーシー	9,000	370.00	3,330,000
カプコン	24,000	1,161.00	27,864,000
日本空港ビルデング	36,000	1,310.00	47,160,000
トランス・コスモス	16,800	675.00	11,340,000
乃村工藝社	27,000	242.00	6,534,000
ジャステック	6,700	497.00	3,329,900
住商情報システム	11,500	1,239.00	14,248,500
藤田観光	30,000	379.00	11,370,000
日本管財	4,400	1,328.00	5,843,200
白洋舎	16,000	234.00	3,744,000
セコム	122,800	3,770.00	462,956,000
日本システムウエア	6,000	310.00	1,860,000

セントラル警備保障	5,400	813.00	4,390,200
アイネス	15,700	501.00	7,865,700
丹青社	17,000	172.00	2,924,000
メイテック	17,700	1,724.00	30,514,800
T K C	8,400	1,602.00	13,456,800
アサツー ディ・ケイ	19,100	1,979.00	37,798,900
富士ソフト	15,300	1,150.00	17,595,000
応用地質	11,900	674.00	8,020,600
船井総合研究所	12,700	514.00	6,527,800
N S D	21,700	867.00	18,813,900
進学会	6,500	267.00	1,735,500
コナミ	50,500	1,508.00	76,154,000
ベネッセホールディングス	37,300	3,700.00	138,010,000
イオンディライト	13,600	1,489.00	20,250,400
ナック	2,700	942.00	2,543,400
福井コンピュータ	4,000	426.00	1,704,000
ニチイ学館	21,600	685.00	14,796,000
ダイセキ	17,500	1,424.00	24,920,000
日鐵商事	27,000	236.00	6,372,000
元気寿司	3,500	738.00	2,583,000
トラスコ中山	13,900	1,221.00	16,971,900
ヤマダ電機	50,890	5,170.00	263,101,300
オートバックスセブン	14,500	2,970.00	43,065,000
アークランドサカモト	6,600	920.00	6,072,000
ニトリホールディングス	22,100	7,220.00	159,562,000
グルメ杵屋	8,000	382.00	3,056,000
愛眼	9,000	439.00	3,951,000
吉野家ホールディングス	303	102,600.00	31,087,800
加藤産業	16,100	1,162.00	18,708,200
富士エレクトロニクス	6,600	1,054.00	6,956,400
松屋フーズ	5,400	1,267.00	6,841,800
J B C Cホールディングス	9,900	496.00	4,910,400
J Kホールディングス	12,500	354.00	4,425,000
サガミチェーン	13,000	507.00	6,591,000
日伝	4,700	2,442.00	11,477,400
杉本商事	6,400	670.00	4,288,000
因幡電機産業	13,100	2,113.00	27,680,300
住金物産	53,000	167.00	8,851,000
ブレナス	14,100	1,183.00	16,680,300
ミニストップ	8,200	1,251.00	10,258,200
アークス	14,400	1,073.00	15,451,200
パロー	22,300	621.00	13,848,300
ミスミグループ本社	37,700	1,816.00	68,463,200
江守商事	2,700	767.00	2,070,900
アルテック	4,800	225.00	1,080,000

ベルク	5,600	862.00	4,827,200	
大庄	6,000	921.00	5,526,000	
タキヒヨー	18,000	404.00	7,272,000	
ファーストリテイリング	26,100	12,360.00	322,596,000	
ソフトバンク	494,000	2,860.00	1,412,840,000	
スズケン	46,200	2,366.00	109,309,200	
サンドラッグ	21,200	2,241.00	47,509,200	
ジェコス	9,000	296.00	2,664,000	
ヤマザワ	2,900	1,173.00	3,401,700	
やまや	1,800	729.00	1,312,200	
ペルーナ	14,050	389.00	5,465,450	
合計	168,869,564		128,947,760,855	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[次へ](#)

「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,120,402,952	91,895,141
コール・ローン	440,413,181	807,791,355
国債証券	290,463,687,869	240,145,408,628
特殊債券	2,116,961,366	1,926,524,353
未収利息	3,981,098,962	2,956,457,437
前払費用	225,174,604	179,249,297
流動資産合計	298,347,738,934	246,107,326,211
資産合計	298,347,738,934	246,107,326,211
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,653,221	222,287,550
流動負債合計	37,653,221	222,287,550
負債合計	37,653,221	222,287,550
純資産の部		
元本等		
元本	155,026,739,583	139,664,878,320
剰余金		
剰余金又は欠損金()	143,283,346,130	106,220,160,341
元本等合計	298,310,085,713	245,885,038,661
純資産合計	298,310,085,713	245,885,038,661
負債純資産合計	298,347,738,934	246,107,326,211

(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、「SBI資産設計オープン(資産成長型)」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年11月10日及び平成22年11月10日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自平成20年11月11日 至平成21年11月10日)	(自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)

1.資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 国債証券、特殊債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(2) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p>	<p>国債証券、特殊債券 同左</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。</p>	<p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1.期首元本額	161,895,632,556円	155,026,739,583円
期中追加設定元本額	19,216,364,477円	15,124,859,347円
期中一部解約元本額	26,085,257,450円	30,486,720,610円
期末元本額	155,026,739,583円	139,664,878,320円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン（毎月決算型）	22,802,244,383円	16,764,307,872円
住信 外国債券オープン（3ヶ月決算型）	760,673,469円	578,548,627円
住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	9,738,893,836円	5,731,989,023円
住信 財産四分法ファンド（毎月決算型）	6,395,469,582円	4,587,936,361円
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	177,175,336円	255,369,049円
SBI 資産設計オープン（分配型）	16,114,888円	13,860,400円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	1,295,537,434円	1,943,970,190円
世界経済インデックスファンド	60,718,912円	135,887,207円
すみしん マイセクション25	34,376,625円	29,232,953円
すみしん マイセクション50	18,659,447円	18,009,939円
すみしん マイセクション75	10,105,039円	10,157,502円
すみしん DC マイセクション25	598,193,513円	714,977,313円
すみしん DC マイセクション50	618,150,751円	730,429,327円
すみしん DC マイセクション75	394,931,247円	426,378,053円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	756,993,070円	918,476,829円
すみしん DC マイセクションS25	28,086,706円	63,991,379円
すみしん DC マイセクションS50	45,059,112円	85,599,760円

すみしん DC マイセレクションS75	25,628,065円	42,896,681円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,852,147円	1,974,523円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,623,947円	7,253,742円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	956,627円	4,546,718円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	223,126円	1,465,518円
すみしん DCマルチアセット ファンド	69,914円	177,850円
STAM 外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	417,575,863円	2,861,925,548円
STAM 外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)		2,157,005,854円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	50,973,510円	51,585,543円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	15,321,352円	15,839,419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)	747,109,767円	651,016,612円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	408,111円	284,680円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,669,655,445円	1,701,214,938円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,758,054,908円	2,711,320,274円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	36,316,202,190円	35,577,493,970円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,485,500,167円	3,497,019,825円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	10,868,191,826円	10,943,516,158円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,553,134,197円	1,540,316,874円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	5,274,267,188円	5,109,749,697円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,284,043,021円	5,637,744,032円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,742,438,021円	6,029,403,688円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	1,926,854,658円	1,876,422,091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)	3,708,139,132円	3,735,681,360円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	581,350,628円	771,218,255円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)		610,810,550円
住信 FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	21,841,294,008円	16,500,578,797円
住信グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	3,131,933,014円	3,101,863,124円
住信グローバル債券ファンド・シリーズ2 (適格機関投資家専用)	4,171,184,881円	
住信グローバル・バランスファンド・シリーズ1	313,548,841円	388,585,136円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	1,387,821,679円	1,126,845,079円
2. 計算期間末日における受益権の総数	155,026,739,583口	139,664,878,320口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・価格変動リスク ・為替変動リスク
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年11月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	a. 国債証券、特殊債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

(平成21年11月10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	290,463,687,869	4,583,289,452
特殊債券	2,116,961,366	20,556,385

合 計	292,580,649,235	4,562,733,067
-----	-----------------	---------------

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

（平成22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	2,284,591,063	
特殊債券	788,942	
合 計	2,285,380,005	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10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。

取引の時価等に関する事項

（平成21年11月10日現在）	
該当事項はありません。	

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成22年11月10日現在）	
該当事項はありません。	

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）

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

(1口当たり情報)

(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 1.9242円	1口当たり純資産額 = 1.7605円

(3) 附属明細表（平成22年11月10日現在）

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 10/15/13	16,200,000.00	16,144,312.50	
		T 0.625% 06/30/12	26,000,000.00	26,089,375.00	
		T 0.875% 01/31/12	18,000,000.00	18,120,937.50	
		T 1% 03/31/12	6,000,000.00	6,052,500.00	
		T 1% 12/31/11	16,100,000.00	16,228,296.87	
		T 1.125% 01/15/12	12,000,000.00	12,116,250.00	
		T 1.125% 12/15/11	5,000,000.00	5,045,312.50	
		T 1.125% 12/15/12	16,200,000.00	16,420,218.75	
		T 1.375% 01/15/13	23,000,000.00	23,427,656.25	
		T 1.375% 02/15/12	1,500,000.00	1,519,453.12	
		T 1.375% 03/15/12	13,500,000.00	13,685,625.00	
		T 1.375% 04/15/12	8,200,000.00	8,317,875.00	
		T 1.375% 05/15/13	5,000,000.00	5,103,125.00	
		T 1.375% 09/15/12	8,000,000.00	8,137,500.00	
		T 1.375% 10/15/12	800,000.00	814,250.00	
		T 1.375% 11/15/12	10,200,000.00	10,386,468.75	
		T 1.5% 12/31/13	12,500,000.00	12,822,265.62	
		T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	6,299,203.12	
		T 1.75% 07/31/15	27,000,000.00	27,700,312.50	
		T 1.75% 08/15/12	22,000,000.00	22,512,187.50	
		T 1.75% 11/15/11	8,400,000.00	8,526,000.00	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	8,092,500.00	
		T 1.875% 06/15/12	9,200,000.00	9,415,625.00	
		T 1.875% 06/30/15	15,900,000.00	16,416,750.00	
T 1.875% 08/31/17	4,000,000.00	4,009,375.00			

T 1.875% 09/30/17	9,000,000.00	9,004,218.75	
T 2.25% 01/31/15	14,000,000.00	14,713,125.00	
T 2.25% 05/31/14	17,000,000.00	17,868,593.75	
T 2.375% 02/28/15	14,500,000.00	15,306,562.50	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	13,199,218.75	
T 2.375% 09/30/14	6,000,000.00	6,339,375.00	
T 2.375% 10/31/14	10,050,000.00	10,619,238.33	
T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,366,031.25	
T 2.5% 03/31/15	10,400,000.00	11,040,250.00	
T 2.625% 02/29/16	10,000,000.00	10,653,125.00	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,681,546.87	
T 2.625% 08/15/20	17,000,000.00	16,952,187.50	
T 2.625% 12/31/14	8,000,000.00	8,533,750.00	
T 2.75% 02/15/19	14,100,000.00	14,628,750.00	
T 2.75% 02/28/13	6,000,000.00	6,312,187.50	
T 2.75% 05/31/17	16,000,000.00	16,982,500.00	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,593,984.37	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	14,938,437.50	
T 2.875% 01/31/13	15,800,000.00	16,649,250.00	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,252,578.12	
T 3% 08/31/16	10,500,000.00	11,372,812.50	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,056,562.50	
T 3.125% 05/15/19	24,600,000.00	26,129,812.50	
T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,748,828.12	
T 3.125% 10/31/16	12,000,000.00	13,068,750.00	
T 3.25% 06/30/16	2,600,000.00	2,855,937.50	
T 3.25% 07/31/16	13,500,000.00	14,820,468.75	
T 3.25% 12/31/16	7,000,000.00	7,666,093.75	
T 3.375% 06/30/13	15,000,000.00	16,115,625.00	
T 3.375% 07/31/13	10,800,000.00	11,630,250.00	
T 3.375% 11/15/19	18,300,000.00	19,658,203.12	
T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,894,062.50	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,294,937.50	
T 3.5% 02/15/39	7,900,000.00	6,927,312.50	
T 3.5% 05/15/20	13,350,000.00	14,374,195.31	
T 3.5% 05/31/13	2,400,000.00	2,583,375.00	
T 3.625% 02/15/20	11,300,000.00	12,339,953.12	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,363,945.31	
T 3.625% 08/15/19	6,900,000.00	7,574,906.25	
T 3.625% 12/31/12	5,100,000.00	5,448,234.37	
T 3.75% 11/15/18	3,650,000.00	4,077,734.37	
T 3.875% 02/15/13	6,400,000.00	6,892,000.00	
T 3.875% 05/15/18	5,000,000.00	5,647,656.25	
T 3.875% 08/15/40	8,500,000.00	7,967,421.87	
T 3.875% 10/31/12	3,700,000.00	3,952,640.62	

T 4% 02/15/14	5,450,000.00	6,033,320.31	
T 4.0% 02/15/15	12,700,000.00	14,281,546.87	
T 4.0% 08/15/18	10,500,000.00	11,942,109.37	
T 4.0% 11/15/12	1,700,000.00	1,822,718.75	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,601,359.37	
T 4.125% 08/31/12	5,600,000.00	5,975,375.00	
T 4.25% 05/15/39	6,500,000.00	6,518,281.25	
T 4.25% 08/15/13	12,600,000.00	13,875,750.00	
T 4.25% 08/15/14	11,700,000.00	13,173,468.75	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	14,298,828.12	
T 4.25% 09/30/12	6,400,000.00	6,864,000.00	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,654,625.00	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,714,234.37	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,315,875.00	
T 4.375% 02/15/38	5,900,000.00	6,082,531.25	
T 4.375% 05/15/40	6,700,000.00	6,848,656.25	
T 4.375% 08/15/12	4,200,000.00	4,494,656.25	
T 4.375% 11/15/39	10,500,000.00	10,741,171.87	
T 4.5% 02/15/16	7,700,000.00	8,942,828.12	
T 4.5% 02/15/36	7,900,000.00	8,362,890.62	
T 4.5% 03/31/12	4,000,000.00	4,230,000.00	
T 4.5% 04/30/12	8,200,000.00	8,698,406.25	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,866,156.25	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,103,125.00	
T 4.5% 08/15/39	9,400,000.00	9,827,406.25	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,597,937.50	
T 4.5% 11/30/11	6,000,000.00	6,268,125.00	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,892,968.75	
T 4.625% 02/15/40	8,900,000.00	9,493,796.87	
T 4.625% 02/29/12	1,000,000.00	1,055,781.25	
T 4.625% 10/31/11	5,000,000.00	5,212,500.00	
T 4.625% 12/31/11	7,700,000.00	8,080,187.50	
T 4.75% 01/31/12	8,000,000.00	8,435,000.00	
T 4.75% 02/15/37	5,900,000.00	6,475,250.00	
T 4.75% 05/15/14	8,400,000.00	9,569,437.50	
T 4.75% 05/31/12	5,800,000.00	6,192,406.25	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,543,546.87	
T 4.875% 02/15/12	8,000,000.00	8,456,250.00	
T 4.875% 06/30/12	3,700,000.00	3,972,296.87	
T 4.875% 08/15/16	2,700,000.00	3,211,312.50	
T 5.0% 05/15/37	3,600,000.00	4,102,312.50	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,950,031.25	
T 5.25% 02/15/29	2,050,000.00	2,456,796.87	
T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,278,515.62	
T 5.375% 02/15/31	2,610,000.00	3,165,440.62	

T 5.5% 08/15/28	3,700,000.00	4,561,984.37	
T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	2,856,562.50	
T 6.125% 08/15/29	3,000,000.00	3,959,531.25	
T 6.125% 11/15/27	3,220,000.00	4,240,840.62	
T 6.25% 05/15/30	2,880,000.00	3,856,950.00	
T 6.25% 08/15/23	3,490,000.00	4,620,978.12	
T 6.375% 08/15/27	1,200,000.00	1,620,375.00	
T 6.5% 11/15/26	2,110,000.00	2,877,842.18	
T 6.625% 02/15/27	1,150,000.00	1,588,078.12	
T 6.75% 08/15/26	2,000,000.00	2,790,000.00	
T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,403,593.75	
T 7.25% 05/15/16	7,650,000.00	10,031,062.50	
T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,709,468.75	
T 7.5% 11/15/16	6,100,000.00	8,191,156.25	
T 7.5% 11/15/24	600,000.00	883,125.00	
T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	5,061,750.00	
T 7.875% 02/15/21	900,000.00	1,322,437.50	
T 8.0% 11/15/21	6,010,000.00	8,958,656.25	
T 8.125% 05/15/21	2,600,000.00	3,888,218.75	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,069,281.25	
T 8.125% 08/15/21	2,000,000.00	2,998,750.00	
T 8.5% 02/15/20	3,400,000.00	5,109,562.50	
T 8.75% 05/15/17	4,800,000.00	6,901,500.00	
T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,304,125.00	
T 8.875% 02/15/19	6,700,000.00	10,108,625.00	
小計	1,096,920,000.00	1,186,093,672.53 (96,998,740,539)	
カナダドル			
CAN 1.25% 12/01/11	2,400,000.00	2,397,384.00	
CAN 1.5% 03/01/12	2,000,000.00	2,001,640.00	
CAN 1.75% 03/01/13	1,550,000.00	1,553,503.00	
CAN 2% 09/01/12	3,000,000.00	3,023,550.00	
CAN 2% 12/01/14	3,000,000.00	3,000,180.00	
CAN 2.5% 06/01/15	2,000,000.00	2,035,280.00	
CAN 2.5% 09/01/13	1,950,000.00	1,990,501.50	
CAN 3.0% 06/01/14	3,800,000.00	3,941,664.00	
CAN 3.5% 06/01/13	3,500,000.00	3,658,620.00	
CAN 3.5% 06/01/20	2,900,000.00	3,026,121.00	
CAN 3.75% 06/01/12	2,600,000.00	2,689,622.00	
CAN 3.75% 06/01/19	3,800,000.00	4,056,082.00	
CAN 4% 06/01/16	4,200,000.00	4,570,314.00	
CAN 4% 06/01/17	2,150,000.00	2,347,950.50	
CAN 4.0% 06/01/41	2,300,000.00	2,501,181.00	
CAN 4.25% 06/01/18	3,250,000.00	3,600,512.50	
CAN 4.5% 06/01/15	4,200,000.00	4,640,034.00	
CAN 5% 06/01/14	3,150,000.00	3,483,742.50	
CAN 5% 06/01/37	4,200,000.00	5,223,288.00	

	CAN 5.25% 06/01/12	3,270,000.00	3,457,926.90	
	CAN 5.25% 06/01/13	4,420,000.00	4,813,777.80	
	CAN 5.75% 06/01/29	3,610,000.00	4,726,825.70	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,660,000.00	3,564,001.00	
	CAN 8.0% 06/01/23	1,700,000.00	2,530,654.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	2,050,000.00	3,237,196.00	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	575,634.50	
小計		74,010,000.00	82,647,185.90 (6,714,257,382)	
オーストラリアドル	ACGB 4.5% 04/15/20	300,000.00	282,597.00	
	ACGB 4.75% 11/15/12	200,000.00	198,810.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	1,200,000.00	1,197,708.00	
	ACGB 5.75% 04/15/12	400,000.00	404,000.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	700,000.00	724,346.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	800,000.00	827,576.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	800,000.00	834,632.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	600,000.00	621,948.00	
	ACGB 6.5% 05/15/13	1,650,000.00	1,705,390.50	
小計		6,650,000.00	6,797,007.50 (558,646,046)	
イギリスポンド	UKT 2.25% 03/07/14	3,550,000.00	3,668,445.75	
	UKT 2.75% 01/22/15	4,450,000.00	4,655,977.15	
	UKT 3.25% 12/07/11	4,250,000.00	4,368,774.75	
	UKT 3.75% 09/07/19	2,500,000.00	2,654,085.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	1,200,000.00	1,260,758.40	
	UKT 4% 01/22/60	1,350,000.00	1,304,568.45	
	UKT 4% 03/07/22	3,300,000.00	3,502,052.40	
	UKT 4% 09/07/16	5,950,000.00	6,576,112.55	
	UKT 4.25% 03/07/36	5,450,000.00	5,555,375.75	
	UKT 4.25% 06/07/32	4,810,000.00	4,942,250.95	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,000,000.00	1,015,722.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	3,850,000.00	4,030,164.60	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,224,686.20	
	UKT 4.25% 12/07/46	4,400,000.00	4,467,764.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	3,100,000.00	3,150,564.10	
	UKT 4.25% 12/07/55	4,600,000.00	4,693,071.80	
	UKT 4.5% 03/07/13	5,300,000.00	5,738,034.40	
	UKT 4.5% 03/07/19	7,100,000.00	7,976,274.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	800,000.00	846,037.60	
	UKT 4.5% 12/07/42	5,150,000.00	5,452,382.25	
	UKT 4.75% 03/07/20	6,300,000.00	7,174,729.80	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,600,000.00	6,367,200.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,100,000.00	4,512,095.10	
	UKT 4.75% 12/07/38	5,100,000.00	5,614,533.90	
UKT 5% 03/07/12	8,400,000.00	8,875,582.80		
UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	2,096,827.20		

	UKT 5% 03/07/25	3,620,000.00	4,168,455.34	
	UKT 5.0% 09/07/14	4,210,000.00	4,769,723.71	
	UKT 5.25% 06/07/12	5,700,000.00	6,101,200.20	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,760,000.00	3,526,846.68	
	UKT 8% 06/07/21	3,040,000.00	4,377,587.84	
	UKT 8% 09/27/13	2,400,000.00	2,876,755.20	
	UKT 8% 12/07/15	2,145,000.00	2,787,867.22	
	UKT 8.75% 08/25/17	2,850,000.00	4,007,972.10	
小計		132,335,000.00	145,340,480.49 (19,041,056,348)	
スイスフラン	SWISS 2.75% 06/10/12	4,300,000.00	4,459,014.00	
	SWISS 4% 02/11/23	4,000,000.00	5,079,680.00	
	SWISS 4.25% 06/05/17	4,700,000.00	5,645,875.00	
小計		13,000,000.00	15,184,569.00 (1,281,881,314)	
シンガポールドル	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	823,184.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,050,000.00	1,099,182.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	350,000.00	371,045.50	
	SIGB 2.5% 10/01/12	600,000.00	624,162.00	
	SIGB 2.625% 04/01/12	950,000.00	979,659.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,100,000.00	1,202,773.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	348,407.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,212,431.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	800,000.00	895,400.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,500,000.00	1,652,880.00	
	SIGB 3.5% 07/01/12	1,700,000.00	1,787,295.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	800,000.00	886,832.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,200,000.00	1,374,588.00	
	SIGB 4% 09/01/18	1,100,000.00	1,299,287.00	
小計		13,400,000.00	14,557,126.00 (923,504,073)	
マレーシアリングgit	MGS 2.509% 08/27/12	1,600,000.00	1,584,072.00	
	MGS 3.21% 05/31/13	1,400,000.00	1,400,751.80	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,926,719.70	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,223,750.00	
	MGS 3.702% 02/25/13	2,500,000.00	2,528,970.00	
	MGS 3.718% 06/15/12	10,900,000.00	11,013,360.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	2,013,224.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	412,133.20	
	MGS 4.262% 09/15/16	10,100,000.00	10,429,179.20	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,912,700.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,685,816.00	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,200,000.00	3,388,035.20	
	MGS 5.248% 09/15/28	2,600,000.00	2,973,744.80	
小計		46,400,000.00	47,492,455.90 (1,253,800,835)	

スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	13,700,000.00	14,161,416.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	10,400,000.00	10,767,016.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	16,244,429.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	16,000,000.00	17,891,520.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	4,900,000.00	5,413,618.00	
	SGB 5% 12/01/20	18,300,000.00	21,880,029.00	
	SGB 5.5% 10/08/12	15,800,000.00	17,017,864.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	23,900,000.00	27,801,197.00	
小計		118,100,000.00	131,177,089.00 (1,585,931,006)	
ノルウェークローネ	NGB 4.25% 05/19/17	9,000,000.00	9,789,480.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	6,400,000.00	7,115,392.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,600,000.00	11,747,768.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	15,900,000.00	17,552,487.00	
小計		41,900,000.00	46,205,127.00 (645,023,572)	
デンマーククローネ	DGB 4% 11/15/12	3,200,000.00	3,379,424.00	
	DGB 4% 11/15/15	18,700,000.00	20,673,972.00	
	DGB 4% 11/15/17	19,600,000.00	21,938,868.00	
	DGB 4% 11/15/19	13,100,000.00	14,639,119.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	24,800,000.00	32,334,984.00	
	DGB 5% 11/15/13	22,190,000.00	24,558,560.60	
	DGB 6% 11/15/11	21,300,000.00	22,383,744.00	
	DGB 7% 11/10/24	6,140,000.00	9,082,349.40	
小計		129,030,000.00	148,991,021.00 (2,249,764,417)	
メキシコペソ	MBONO 6% 06/18/15	100,000,000.00	102,801,000.00	
	MBONO 8% 06/11/20	50,000,000.00	56,847,000.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	40,100,000.00	46,564,521.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,000,000.00	29,760,640.00	
	MBONO 9% 12/20/12	103,800,000.00	113,011,212.00	
小計		319,900,000.00	348,984,373.00 (2,320,746,080)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/12	3,100,000.00	2,940,474.00	
	POLGB 4.75% 04/25/12	13,000,000.00	13,027,950.00	
	POLGB 5% 10/24/13	9,600,000.00	9,604,896.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	11,200,000.00	11,296,432.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	7,450,000.00	7,361,196.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	1,500,000.00	1,513,770.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,100,000.00	6,051,383.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	7,500,000.00	7,649,475.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,700,000.00	1,697,620.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,800,000.00	7,834,554.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,700,000.00	9,055,743.00	
小計		77,650,000.00	78,033,493.00 (2,246,584,263)	

ユーロ	BGB 2% 03/28/12	1,400,000.00	1,414,560.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,050,000.00	3,147,203.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,051,700.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,248,760.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,600,000.00	2,690,558.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,454,767.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,500,000.00	2,675,300.00	
	BGB 4% 03/28/22	2,900,000.00	3,056,368.00	
	BGB 4.0% 03/28/13	2,800,000.00	2,957,304.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,400,000.00	2,571,264.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,300,000.00	2,446,303.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	800,000.00	870,792.00	
	BGB 4.25% 09/28/13	4,200,000.00	4,494,210.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	4,600,000.00	4,970,254.00	
	BGB 5% 03/28/35	3,800,000.00	4,595,378.00	
	BGB 5% 09/28/12	4,800,000.00	5,116,560.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,800,000.00	4,703,678.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	2,350,000.00	2,736,528.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	2,000,000.00	2,477,000.00	
	BKO 0.75% 09/14/12	5,600,000.00	5,582,136.00	
	BKO 1% 03/16/12	1,800,000.00	1,802,592.00	
	BKO 1.25% 12/16/11	5,500,000.00	5,521,780.00	
	BTNS 2.5% 01/12/14	2,450,000.00	2,536,656.50	
	BTNS 2.5% 01/15/15	2,400,000.00	2,482,032.00	
	BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,424,032.00	
	BTNS 3.75% 01/12/12	3,650,000.00	3,768,844.00	
	BTNS 3.75% 01/12/13	6,400,000.00	6,758,400.00	
	BTNS 4.5% 07/12/12	5,300,000.00	5,599,874.00	
	BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,085,540.00	
	BTPS 2% 06/01/13	300,000.00	296,967.00	
	BTPS 2% 12/15/12	2,800,000.00	2,787,540.00	
	BTPS 2.5% 07/01/12	2,600,000.00	2,616,120.00	
	BTPS 3% 03/01/12	1,500,000.00	1,519,020.00	
	BTPS 3% 04/15/15	4,000,000.00	4,011,720.00	
	BTPS 3.5% 06/01/14	4,000,000.00	4,108,000.00	
	BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	7,759,500.00	
	BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000.00	9,899,328.00	
	BTPS 3.75% 08/01/21	7,500,000.00	7,387,950.00	
	BTPS 3.75% 12/15/13	3,700,000.00	3,829,944.00	
	BTPS 4% 02/01/17	6,300,000.00	6,552,630.00	
	BTPS 4% 02/01/37	6,300,000.00	5,608,764.00	
BTPS 4% 04/15/12	7,900,000.00	8,113,221.00		
BTPS 4% 09/01/20	4,600,000.00	4,620,240.00		
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,647,823.00		
BTPS 4.25% 02/01/19	7,400,000.00	7,677,130.00		

BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,031,774.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,800,000.00	1,878,876.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	5,800,000.00	6,077,878.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	8,953,220.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	5,500,000.00	5,673,305.00	
BTPS 4.25% 10/15/12	4,000,000.00	4,152,400.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,900,000.00	4,146,714.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,400,000.00	7,761,712.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	5,250,000.00	5,528,775.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	5,100,000.00	5,400,033.00	
BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000.00	10,845,694.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	6,200,000.00	6,488,734.00	
BTPS 5% 02/01/12	8,870,000.00	9,192,601.90	
BTPS 5% 03/01/25	2,800,000.00	2,959,768.00	
BTPS 5% 08/01/34	5,700,000.00	5,867,181.00	
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,637,648.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	5,100,000.00	5,237,649.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,040,000.00	4,484,642.40	
BTPS 5.25% 11/01/29	7,150,000.00	7,631,481.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	5,000,000.00	5,636,000.00	
BTPS 6% 05/01/31	6,330,000.00	7,303,997.10	
BTPS 6.5% 11/01/27	7,200,000.00	8,717,256.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	3,100,000.00	4,013,880.00	
BTPS 9% 11/01/23	2,050,000.00	2,986,399.00	
DBR 2.25% 09/04/20	5,400,000.00	5,327,316.00	
DBR 3% 07/04/20	2,700,000.00	2,838,240.00	
DBR 3.25% 01/04/20	4,100,000.00	4,397,578.00	
DBR 3.25% 07/04/15	4,400,000.00	4,743,728.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,733,200.00	
DBR 3.5% 07/04/19	8,500,000.00	9,284,295.00	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,784,350.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,429,831.00	
DBR 3.75% 01/04/19	5,000,000.00	5,558,100.00	
DBR 3.75% 07/04/13	5,000,000.00	5,350,750.00	
DBR 4% 07/04/16	3,500,000.00	3,919,580.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,073,210.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,800,000.00	4,472,562.00	
DBR 4.25% 01/04/14	2,200,000.00	2,408,692.00	
DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000.00	10,108,737.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,800,000.00	4,339,296.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,800,000.00	5,501,232.00	
DBR 4.25% 07/04/39	4,000,000.00	4,991,400.00	
DBR 4.5% 01/04/13	8,200,000.00	8,812,786.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,200,000.00	3,964,352.00	
DBR 4.75% 07/04/34	5,300,000.00	6,821,736.00	

DBR 4.75% 07/04/40	5,200,000.00	7,023,536.00	
DBR 5.0% 01/04/12	9,280,000.00	9,723,305.60	
DBR 5.0% 07/04/12	3,200,000.00	3,411,488.00	
DBR 5.5% 01/04/31	3,700,000.00	5,054,644.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,670,000.00	2,254,834.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	685,322.40	
DBR 6.25% 01/04/24	3,350,000.00	4,647,957.50	
DBR 6.25% 01/04/30	3,700,000.00	5,441,812.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,400,000.00	2,048,774.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	2,000,000.00	1,938,280.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,800,000.00	6,111,228.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	8,300,000.00	8,838,753.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,495,976.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	4,400,000.00	4,659,512.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	1,500,000.00	1,553,100.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,600,000.00	5,020,762.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	9,200,000.00	9,915,852.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,000,000.00	6,497,280.00	
FRTR 4% 04/25/14	6,500,000.00	7,061,795.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,800,000.00	7,527,124.00	
FRTR 4% 04/25/55	3,650,000.00	4,208,048.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,200,000.00	1,393,992.00	
FRTR 4% 10/25/13	5,300,000.00	5,712,711.00	
FRTR 4% 10/25/14	4,500,000.00	4,914,810.00	
FRTR 4% 10/25/38	6,200,000.00	6,972,892.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	6,550,000.00	6,992,911.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	8,150,000.00	9,158,236.50	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,400,000.00	4,940,980.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,300,000.00	3,711,939.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,061,625.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	1,900,000.00	2,322,522.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	4,750,000.00	5,867,960.00	
FRTR 4.75% 10/25/12	7,900,000.00	8,451,420.00	
FRTR 5% 04/25/12	5,900,000.00	6,237,716.00	
FRTR 5% 10/25/16	7,410,000.00	8,602,269.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,230,000.00	6,825,150.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,900,000.00	6,750,730.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,758,692.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,574,030.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,642,961.60	
FRTR 8.5% 12/26/12	1,500,000.00	1,730,670.00	
IRISH 3.9% 03/05/12	1,300,000.00	1,278,498.00	
IRISH 4% 01/15/14	1,200,000.00	1,106,196.00	
IRISH 4% 11/11/11	800,000.00	795,736.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,300,000.00	1,836,021.00	

IRISH 4.5% 04/18/20	4,200,000.00	3,281,670.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,600,000.00	1,316,960.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,600,000.00	2,313,792.00	
IRISH 5% 04/18/13	3,100,000.00	3,009,077.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	2,800,000.00	2,194,360.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	600,000.00	530,094.00	
NETHER 2.5% 01/15/12	1,250,000.00	1,272,400.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,257,492.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	1,500,000.00	1,606,530.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,600,000.00	2,787,200.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,407,130.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,400,000.00	1,596,140.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	5,300,000.00	5,751,083.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,800,000.00	3,265,416.00	
NETHER 4% 07/15/16	4,300,000.00	4,776,870.00	
NETHER 4% 07/15/19	3,100,000.00	3,456,872.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	3,100,000.00	3,453,462.00	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,700,000.00	5,085,259.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,200,000.00	4,804,632.00	
NETHER 5.0% 07/15/12	7,200,000.00	7,675,488.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,900,000.00	3,842,935.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,050,000.00	1,557,202.50	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,618,685.00	
OBL 2.25% 04/11/14	4,500,000.00	4,663,305.00	
OBL 2.5% 02/27/15	4,600,000.00	4,802,170.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,970,050.00	
OBL 3.5% 04/12/13	5,350,000.00	5,671,802.50	
OBL 4% 04/13/12	5,400,000.00	5,633,982.00	
OBL 4% 10/11/13	600,000.00	650,046.00	
OBL 4.25% 10/12/12	5,900,000.00	6,268,868.00	
PGB 3.35% 10/15/15	3,400,000.00	3,064,522.00	
PGB 3.85% 04/15/21	1,550,000.00	1,225,569.50	
PGB 4.1% 04/15/37	1,750,000.00	1,222,340.00	
PGB 4.2% 10/15/16	1,300,000.00	1,186,289.00	
PGB 4.35% 10/16/17	1,400,000.00	1,258,642.00	
PGB 4.375% 06/16/14	1,300,000.00	1,261,520.00	
PGB 4.45% 06/15/18	2,300,000.00	2,041,434.00	
PGB 4.75% 06/14/19	1,900,000.00	1,675,648.00	
PGB 4.8% 06/15/20	800,000.00	692,448.00	
PGB 4.95% 10/25/23	1,600,000.00	1,346,688.00	
PGB 5% 06/15/12	1,900,000.00	1,925,232.00	
PGB 5.45% 09/23/13	2,350,000.00	2,378,952.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	300,000.00	315,750.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	638,820.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,700,000.00	3,963,514.00	

RAGB 3.5% 09/15/21	3,400,000.00	3,561,330.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	4,250,000.00	4,546,862.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	3,150,009.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,400,000.00	3,738,606.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,100,000.00	2,373,336.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,500,000.00	2,739,125.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	900,000.00	1,005,885.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,600,000.00	1,795,040.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	4,500,000.00	5,133,015.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,100,000.00	1,307,702.00	
RAGB 5.0% 07/15/12	1,850,000.00	1,967,512.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,000,000.00	2,756,000.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,600,000.00	1,702,976.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	900,000.00	953,388.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,750,000.00	1,936,305.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,200,000.00	1,336,212.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,671,420.00	
RFGB 4.25% 09/15/12	1,100,000.00	1,164,735.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,827,664.00	
RFGB 5.375% 07/04/13	1,800,000.00	1,996,902.00	
SPGB 2.3% 04/30/13	800,000.00	790,584.00	
SPGB 2.75% 04/30/12	2,900,000.00	2,916,298.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,793,670.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,100,000.00	4,090,447.00	
SPGB 3.9% 10/31/12	3,500,000.00	3,582,950.00	
SPGB 4% 04/30/20	3,300,000.00	3,221,460.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	4,100,000.00	4,095,367.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	4,050,000.00	3,453,232.50	
SPGB 4.2% 07/30/13	5,000,000.00	5,170,550.00	
SPGB 4.25% 01/31/14	1,400,000.00	1,453,060.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,200,000.00	2,206,094.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	6,100,000.00	6,366,143.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	4,400,000.00	4,515,720.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,100,000.00	1,064,954.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,200,000.00	1,094,880.00	
SPGB 4.75% 07/30/14	7,900,000.00	8,362,150.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	3,900,000.00	3,921,294.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	2,300,000.00	2,383,444.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	3,142,293.00	
SPGB 5.0% 07/30/12	4,000,000.00	4,166,440.00	
SPGB 5.35% 10/31/11	3,700,000.00	3,815,070.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	3,500,000.00	3,821,510.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	3,050,000.00	3,266,641.50	
SPGB 6.0% 01/31/29	5,200,000.00	5,714,852.00	
SPGB 6.15% 01/31/13	4,100,000.00	4,393,929.00	

	小計		860,210,000.00	927,090,311.50 (104,325,472,753)	
国債証券計				(240,145,408,628)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	3,200,000.00	3,192,544.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,315,516.00	
		NSWTC 6% 05/01/12	2,850,000.00	2,879,618.00	
		QTC 6% 06/14/21	1,200,000.00	1,228,716.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,800,000.00	2,851,744.00	
		QTC 6% 09/14/17	6,450,000.00	6,598,192.50	
		QTC 6% 10/14/15	3,300,000.00	3,373,557.00	
	小計		23,100,000.00	23,439,887.50 (1,926,524,353)	
特殊債券計				(1,926,524,353)	
合計				(242,071,932,981)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券 140銘柄	100.0%	40.0%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.8%
ユーロ	国債証券 225銘柄	100.0%	43.1%
イギリスポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	7.9%
スイスフラン	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	国債証券 9銘柄	22.5%	1.0%
	特殊債券 7銘柄	77.5%	
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	1.0%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,424,992,129	2,527,327,674
コール・ローン	92,817,401	74,977,261
株式	114,717,077,865	117,807,480,912
新株予約権証券	418,117	
投資信託受益証券	219,038,997	272,581,092
投資証券	1,480,289,547	1,837,843,219
派生商品評価勘定	115,103,728	147,496,669
未収入金		794,446
未収配当金	148,089,362	138,364,268
未収利息	210	130
差入委託証拠金	1,273,802,092	854,263,224
流動資産合計	121,471,629,448	123,661,128,895
資産合計	121,471,629,448	123,661,128,895
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,258,054	11,959
未払解約金	22,794,911	54,231,137
流動負債合計	26,052,965	54,243,096
負債合計	26,052,965	54,243,096
純資産の部		
元本等		
元本	136,011,705,064	137,499,750,763
剰余金		
剰余金又は欠損金()	14,566,128,581	13,892,864,964
元本等合計	121,445,576,483	123,606,885,799
純資産合計	121,445,576,483	123,606,885,799
負債純資産合計	121,471,629,448	123,661,128,895

(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、「SBI資産設計オープン(資産成長型)」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年11月10日及び平成22年11月10日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）
1.資産の評価基準及び評価方法	<p>（1）株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>（2）新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>（3）投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>（4）投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>（5）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>（6）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p>	<p>（1）株式 同左</p> <p>（2）投資信託受益証券 同左</p> <p>（3）投資証券 同左</p> <p>（4）先物取引 同左</p> <p>（5）外国為替予約 同左</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1. 期首元本額	117,075,877,087円	136,011,705,064円
期中追加設定元本額	56,470,833,550円	24,447,846,054円
期中一部解約元本額	37,535,005,573円	22,959,800,355円
期末元本額	136,011,705,064円	137,499,750,763円
元本額の内訳		
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	446,951,899円	610,877,782円
SBI 資産設計オープン（分配型）	37,009,288円	32,382,279円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	9,333,829,181円	12,361,531,587円
世界経済インデックスファンド	142,437,894円	284,805,324円
すみしん マイセクション25	42,261,424円	33,186,238円
すみしん マイセクション50	130,286,804円	120,117,512円
すみしん マイセクション75	120,240,143円	115,146,923円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,352,853,285円	1,377,566,858円
すみしん DC マイセクション25	742,128,190円	788,888,359円
すみしん DC マイセクション50	4,443,913,355円	4,752,198,104円
すみしん DC マイセクション75	4,298,014,917円	4,783,566,934円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	3,264,339,923円	4,083,164,105円
すみしん DC マイセクションS25	34,356,201円	69,225,909円
すみしん DC マイセクションS50	329,511,019円	557,960,060円
すみしん DC マイセクションS75	275,411,262円	463,458,617円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2015	8,087,556円	8,545,966円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2025	10,029,271円	39,417,319円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2035	8,202,919円	34,727,029円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2045	2,703,167円	14,248,650円
すみしん DCマルチアセット ファンド	157,212円	386,285円
STAM 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,545,024,605円	5,905,620,508円

すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	350,084,208円	337,690,473円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	172,738,329円	163,489,062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)	702,812,297円	625,233,056円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	2,759,825円	1,865,163円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,755,828,787円	1,569,285,926円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	5,878,803,872円	5,858,680,809円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,930,714,232円	14,964,802,145円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	4,875,399,600円	4,414,171,920円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	7,032,075,192円	6,811,301,768円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,915,898,041円	1,776,860,573円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	11,241,761,227円	10,754,476,654円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	23,655,396,243円	22,936,196,675円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	11,015,491,428円	10,513,717,311円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	2,052,629,366円	1,965,763,388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)	1,879,595,316円	1,645,797,479円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	563,554,411円	727,775,862円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,452,569,167円	1,574,890,506円
住信 グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	383,586,083円	
住信 FOFs用外国株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	7,841,937,790円	8,007,072,608円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	8,740,320,135円	6,413,657,037円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 14,566,128,581円下回っており ます。	純資産額は、元本を 13,892,864,964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	136,011,705,064口	137,499,750,763口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

2. 時価の算定方法

- a. 株式、投資信託受益証券、投資証券
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
- b. 先物取引
1. 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等および時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。
- c. 外国為替予約
1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち該当日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
 2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

（平成21年11月10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	114,717,077,865	18,348,778,496
新株予約権証券	418,117	214,549
投資信託受益証券	219,038,997	37,918,303
投資証券	1,480,289,547	305,204,062
合 計	116,416,824,526	18,692,115,410

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

（平成22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	12,225,345,857
投資信託受益証券	36,002,182
投資証券	184,559,433
合 計	12,445,907,472

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

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10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委託者が適当と認める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、為替先渡取引、外国為替予約取引であります。
2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制	当ファンドのデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクがあります。デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。
3.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	（平成21年11月10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	2,554,318,894		2,627,975,714	73,656,820
	S&P/TSE 60	373,796,676		382,670,062	8,873,386
	SPI 200 FUTU	336,909,239		343,044,450	6,135,211
	FTSE 100	577,083,995		589,994,592	12,910,597
	SWISS MKT IX	254,963,151		256,317,075	1,353,924
	DJ EURO STOXX	805,014,404		813,921,848	8,907,444
合 計	4,902,086,359		5,013,923,741	111,837,382	

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

通貨関連

区分	種類	（平成21年11月10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 ユーロ	16,178,508		16,186,800	8,292
	合計	16,178,508		16,186,800	8,292

（注）時価の算定方法

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

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

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

 - ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2.計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しています。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種類	（平成22年11月10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	1,869,723,876		1,955,791,187	86,067,311
	S&P/TSE 60	199,622,927		204,123,624	4,500,697
	SPI 200 FUTU	257,371,820		263,632,644	6,260,824
	FTSE 100	383,847,507		399,486,170	15,638,663
	SWISS MKT IX	134,119,740		138,976,425	4,856,685
	DJ EURO STOXX	641,634,803		671,790,593	30,155,790

合計	3,486,320,673		3,633,800,643	147,479,970
----	---------------	--	---------------	-------------

(注)時価の算定方法

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

通貨関連

区分	種類	（平成22年11月10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 売建				
	アメリカドル	32,710,800		32,708,000	2,800
	カナダドル	2,437,050		2,436,900	150
	オーストラリアドル	2,464,950		2,464,800	150
	イギリスポンド	7,860,360		7,860,000	360
	スイスフラン	2,532,570		2,532,300	270
	香港ドル	1,476,860		1,477,000	140
	イスラエルシェケル	1,121,400		1,121,000	400
	ユーロ	16,878,750		16,878,000	750
合計	67,482,740		67,478,000	4,740	

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
1口当たり純資産額 = 0.8929円	1口当たり純資産額 = 0.8990円

(3) 附属明細表（平成22年11月10日現在）

1) 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカドル	3 M COMPANY	46,457	85.30	3,962,782.10
	ABBOTT LABORATORIES	105,857	50.05	5,298,142.85
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,217	46.44	288,717.48
	ACCENTURE PLC-CL A	43,686	45.30	1,978,975.80
	ACE LTD	23,281	60.24	1,402,447.44
	ACTIVISION BLIZZARD INC	38,388	11.77	451,826.76
	ADOBE SYSTEMS INC	36,102	29.49	1,064,647.98
	ADVANCE AUTO PARTS	5,995	66.01	395,729.95
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,457	7.91	312,104.87
	AES CORP	46,365	11.68	541,543.20
	AETNA INC	29,139	31.45	916,421.55
	AFLAC	32,280	56.49	1,823,497.20
	AGCO CORP	6,558	45.21	296,487.18
	AGILENT TECHNOLOGIES	23,876	35.48	847,120.48
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,563	85.58	1,246,301.54
	AIRGAS INC	5,438	68.01	369,838.38
	AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,804	51.56	608,614.24
	ALCOA	70,021	13.75	962,788.75
	ALLEGHENY ENERGY INC	11,711	23.56	275,911.16
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	6,082	51.66	314,196.12
	ALLERGAN INC	21,089	68.98	1,454,719.22
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,761	62.07	233,445.27
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,597	37.11	281,924.67
	ALLSTATE CORP	35,129	30.28	1,063,706.12
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,303	47.47	394,143.41
	ALTERA CORPORATION	20,687	33.50	693,014.50
	ALTRIA GROUP INC	142,821	25.58	3,653,361.18
	AMAZON.COM	24,451	170.27	4,163,271.77
	AMEREN CORPORATION	16,342	29.54	482,742.68
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	14,019	16.00	224,304.00
	AMERICAN ELECTRIC POWER	32,841	36.90	1,211,832.90
	AMERICAN EXPRESS	74,322	43.36	3,222,601.92
	AMERICAN TOWER-A	27,775	52.19	1,449,577.25
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,981	24.44	292,815.64
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,703	53.48	946,756.44
	AMERISOURCEBERGEN CORP	19,375	30.83	597,331.25
	AMETEK INC	7,294	56.26	410,360.44
	AMGEN	65,695	54.93	3,608,626.35
	AMPHENOL CORPORATION	11,902	52.17	620,927.34
	ANADARKO PETROLEUM CORP	33,929	63.34	2,149,062.86
	ANALOG DEVICES	20,435	35.07	716,655.45
AON CORP	20,375	41.44	844,340.00	
APACHE CORP	24,744	109.97	2,721,097.68	
APOLLO GROUP INC-CLA	9,327	36.84	343,606.68	
APPLE INC	62,403	316.08	19,724,340.24	

APPLIED MATERIALS	92,121	12.82	1,180,991.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,662	88.80	325,185.60
ARCH COAL INC	11,219	28.49	319,629.31
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,100	30.85	1,360,485.00
ARROW ELECTRONICS INC	8,559	30.36	259,851.24
ASSURANT INC	8,008	40.14	321,441.12
AT&T INC	406,818	29.18	11,870,949.24
AUTODESK INC	15,732	35.30	555,339.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,495	45.31	1,562,968.45
AUTONATION INC	4,577	26.28	120,283.56
AUTOZONE INC	1,961	243.00	476,523.00
AVERY DENNISON CORP	6,965	37.01	257,774.65
AVNET INC	10,554	30.86	325,696.44
AVON PRODUCTS INC	29,380	28.85	847,613.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,277	35.22	291,515.94
BAKER HUGHES	29,424	49.51	1,456,782.24
BALL CORP	6,015	65.48	393,862.20
BANK NEW YORK CO	83,383	27.75	2,313,878.25
BANK OF AMERICA CORP	689,710	12.27	8,462,741.70
BARD C R INC	6,522	85.93	560,435.46
BAXTER INTERNATIONAL	41,108	51.67	2,124,050.36
BB&T CORP	47,578	24.85	1,182,313.30
BECKMAN COULTER INC	4,825	54.87	264,747.75
BECTON DICKINSON & CO	16,002	77.78	1,244,635.56
BED BATH & BEYOND INC	18,105	44.25	801,146.25
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,607	80.85	4,576,675.95
BEST BUY COMPANY INC	24,597	44.15	1,085,957.55
BIOGEN IDEC INC	18,311	63.39	1,160,734.29
BLACKROCK INC	2,432	164.51	400,088.32
BLOCK H & R INC	22,579	12.25	276,592.75
BMC SOFTWARE	12,449	46.01	572,778.49
BOEING CO	46,849	69.25	3,244,293.25
BORGWARNER INC	8,073	57.71	465,892.83
BOSTON SCIENTIFIC CORP	103,989	6.69	695,686.41
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	117,934	26.25	3,095,767.50
BROADCOM CORP-CL A	30,223	42.06	1,271,179.38
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,572	62.61	348,862.92
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	5,273	70.74	373,012.02
BUNGE LIMITED	9,392	61.32	575,917.44
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,937	71.19	849,795.03
CA INC	28,235	23.61	666,628.35
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	17,240	29.33	505,649.20
CABOT OIL & GAS CORP	7,170	33.84	242,632.80
CALPINE CORP	24,372	12.68	309,036.96
CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,747	45.49	761,821.03

CAMPBELL SOUP CO (US)	14,001	36.05	504,736.05	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31,384	38.73	1,215,502.32	
CARDINAL HEALTH	24,831	35.62	884,480.22	
CAREFUSION CORP	13,320	23.18	308,757.60	
CARMAX INC	15,338	32.37	496,491.06	
CATERPILLAR	43,081	81.91	3,528,764.71	
CBS CORP-CL B	43,109	16.36	705,263.24	
CELANESE CORP-SERIES A	10,738	36.96	396,876.48	
CELGENE CORP	31,606	60.69	1,918,168.14	
CENTERPOINT ENERGY INC	27,193	16.60	451,403.80	
CENTURYLINK INC	20,682	42.28	874,434.96	
CEPHALON INC	5,157	65.23	336,391.11	
CERNER CORP	4,792	87.82	420,833.44	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,873	125.18	610,002.14	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,666	31.61	147,492.26	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,639	23.06	1,029,375.34	
CHEVRON CORP	137,752	83.56	11,510,557.12	
CHUBB CORPORATION	22,464	58.70	1,318,636.80	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,861	65.18	316,839.98	
CIGNA CORP	18,974	36.56	693,689.44	
CIMAREX ENERGY CO	5,753	81.79	470,537.87	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,640	29.98	318,987.20	
CINTAS CORP	9,502	27.62	262,445.24	
CISCO SYSTEMS	391,668	24.35	9,537,115.80	
CIT GROUP INC	13,033	43.70	569,542.10	
CITIGROUP	1,693,376	4.30	7,281,516.80	
CITRIX SYSTEMS INC	12,739	64.62	823,194.18	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	9,288	68.83	639,293.04	
CLOROX COMPANY	9,659	62.76	606,198.84	
CME GROUP INC	4,516	293.19	1,324,046.04	
COACH INC	20,924	52.25	1,093,279.00	
COCA-COLA CO	142,395	62.64	8,919,622.80	
COCA-COLA ENTERPRISES	21,165	24.83	525,526.95	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,534	63.45	1,302,882.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,635	76.99	2,589,558.65	
COMCAST CORP-CL A	141,706	20.77	2,943,233.62	
COMCAST CORP-SPECIAL A	52,467	19.58	1,027,303.86	
COMERICA INC	12,121	37.98	460,355.58	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,578	48.79	516,100.62	
CONAGRA	30,556	22.10	675,287.60	
CONOCOPHILLIPS	96,965	62.03	6,014,738.95	
CONSOL ENERGY INC	15,479	41.45	641,604.55	
CONSOLIDATED EDISON INC	19,337	50.61	978,645.57	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,988	19.90	258,461.20	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	13,140	29.95	393,543.00	

COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	11,489	53.34	612,823.26	
CORNING	107,036	18.97	2,030,472.92	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,210	64.22	1,940,086.20	
COVANCE INC	4,422	46.34	204,915.48	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,428	25.67	267,686.76	
COVIDIEN PLC	34,376	43.50	1,495,356.00	
CREE INC	7,003	54.46	381,383.38	
CROWN CASTLE INTL CORP	19,996	41.68	833,433.28	
CROWN HOLDINGS INC	11,110	32.33	359,186.30	
CSX CORP	26,693	61.17	1,632,810.81	
CUMMINS INC	13,068	93.30	1,219,244.40	
CVS CAREMARK CORPORATION	93,329	31.03	2,895,998.87	
DANAHER CORP	37,849	43.40	1,642,646.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,160	47.37	433,909.20	
DAVITA INC	7,125	72.10	513,712.50	
DEAN FOODS CO	12,795	8.50	108,757.50	
DEERE&CO	29,135	77.87	2,268,742.45	
DELL INC	120,858	14.41	1,741,563.78	
DELTA AIR LINES INC	13,919	13.86	192,917.34	
DENBURY RESOURCES INC	26,011	18.56	482,764.16	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,656	31.64	305,515.84	
DEVON ENERGY CORPORATION	29,116	70.83	2,062,286.28	
DEVRY INC	4,423	46.90	207,438.70	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,767	73.06	348,277.02	
DIRECTV	60,829	42.50	2,585,232.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	37,385	18.47	690,500.95	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,324	40.53	377,901.72	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,719	35.36	343,663.84	
DISH NETWORK CORPORATION-A	14,361	19.91	285,927.51	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,706	67.11	248,709.66	
DOLLAR GENERAL CORP	6,006	28.58	171,651.48	
DOLLAR TREE INC	9,079	52.77	479,098.83	
DOMINION RESOURCES	40,877	43.07	1,760,572.39	
DONNELLEY (RR) & SONS	14,191	17.54	248,910.14	
DOVER CORP	12,808	54.38	696,499.04	
DOW CHEMICAL CO	79,202	31.81	2,519,415.62	
DR HORTON INC	20,187	11.75	237,197.25	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,849	36.09	608,080.41	
DTE ENERGY COMPANY	11,549	46.29	534,603.21	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	62,136	47.61	2,958,294.96	
DUKE ENERGY CORP	90,054	18.05	1,625,474.70	
DUN & BRADSTREET CORP	3,522	75.73	266,721.06	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,962	78.79	390,955.98	
EATON CORP	10,919	93.15	1,017,104.85	
EATON VANCE CORP	8,339	30.91	257,758.49	

EBAY	80,668	30.53	2,462,794.04
ECOLAB INC	16,005	48.82	781,364.10
EDISON INTL	21,227	37.56	797,286.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,758	66.46	515,596.68
EL PASO CORP	48,262	13.72	662,154.64
ELECTRONIC ARTS INC	22,609	16.34	369,431.06
EMC CORP	140,973	22.02	3,104,225.46
EMERSON ELECTRIC CO	51,652	56.18	2,901,809.36
ENERGEN CORP	4,814	46.15	222,166.10
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,563	69.39	316,626.57
ENTERGY CORP	12,982	73.84	958,590.88
EOG RESOURCES INC	17,361	91.99	1,597,038.39
EQT CORPORATION	9,373	40.51	379,700.23
EQUIFAX INC	8,683	34.36	298,347.88
ESTEE LAUDER CO-CL A	7,907	71.02	561,555.14
EVEREST RE GROUP LTD	4,051	87.69	355,232.19
EXELON CORP	45,302	41.55	1,882,298.10
EXPEDIA INC	14,179	27.35	387,795.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,600	50.45	736,570.00
EXPRESS SCRIPTS INC	35,818	52.59	1,883,668.62
EXXON MOBIL	349,521	70.63	24,686,668.23
F5 NETWORKS INC	5,496	120.42	661,828.32
FAMILY DOLLAR STORES	8,800	47.99	422,312.00
FASTENAL CO	9,100	53.00	482,300.00
FEDEX CORP	20,404	88.12	1,798,000.48
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,151	13.63	206,508.13
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,075	27.65	472,123.75
FIFTH THIRD BANCORP	54,639	12.87	703,203.93
FIRST SOLAR INC	3,802	138.62	527,033.24
FIRSTENERGY CORP	20,905	36.13	755,297.65
FISERV INC	10,466	55.62	582,118.92
FLEXTRONICS INTL LTD	55,866	7.11	397,207.26
FLIR SYSTEMS INC	10,516	28.35	298,128.60
FLOWSERVE CORP	3,845	105.52	405,724.40
FLUOR CORP	12,258	54.87	672,596.46
FMC CORP	4,736	76.16	360,693.76
FMC TECHNOLOGIES INC	8,339	77.25	644,187.75
FORD MOTOR COMPANY	203,521	16.07	3,270,582.47
FOREST LABORATORIES INC	20,738	32.98	683,939.24
FORTUNE BRANDS INC	10,446	54.16	565,755.36
FOSTER WHEELER AG	8,989	27.85	250,343.65
FRANKLIN RESOURCES INC	10,940	121.50	1,329,210.00
FREEPORT-MCMOR-B	29,671	102.65	3,045,728.15
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	67,200	9.15	614,880.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	9,958	20.19	201,052.02

GAP	32,040	20.19	646,887.60	
GARMIN LTD	8,302	30.01	249,143.02	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,485	69.20	1,555,962.00	
GENERAL ELECTRIC CO	732,190	16.62	12,168,997.80	
GENERAL MILLS INC	45,506	36.17	1,645,952.02	
GENUINE PARTS CO	10,890	47.47	516,948.30	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	33,541	11.80	395,783.80	
GENZYME CORP	18,302	70.65	1,293,036.30	
GILEAD SCIENCES INC	61,030	38.51	2,350,265.30	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,619	166.55	5,599,244.45	
GOODRICH CORP	8,585	85.48	733,845.80	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	16,220	10.30	167,066.00	
GOOGLE INC-CL A	16,843	624.82	10,523,843.26	
GRAINGER (WW) INC	4,249	125.82	534,609.18	
HALLIBURTON CO	62,569	33.22	2,078,542.18	
HANSEN NATURAL CORPORATION	5,319	50.05	266,215.95	
HARLEY-DAVIDSON	16,147	31.75	512,667.25	
HARRIS CORP	9,034	46.22	417,551.48	
HARSCO CORP	5,675	24.01	136,256.75	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,923	25.42	735,222.66	
HASBRO INC	8,978	46.67	419,003.26	
HEINZ (H.J) CO	21,687	48.56	1,053,120.72	
HELMERICH & PAYNE	7,251	43.99	318,971.49	
HENRY SCHEIN INC	6,267	57.72	361,731.24	
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,849	48.16	522,487.84	
HESS CORP	20,266	69.66	1,411,729.56	
HEWLETT-PACKARD CO	160,825	44.12	7,095,599.00	
HOLOGIC INC	17,768	16.73	297,258.64	
HOME DEPOT	116,129	31.47	3,654,579.63	
HONEYWELL INTL INC	49,917	49.02	2,446,931.34	
HORMEL FOODS CORP	5,076	45.74	232,176.24	
HOSPIRA INC	11,376	59.27	674,255.52	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,580	11.63	378,905.40	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	12,848	24.15	310,279.20	
HUMANA INC	11,672	59.12	690,048.64	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,593	36.36	239,721.48	
IHS INC-CLASS A	2,928	73.65	215,647.20	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,291	48.13	1,409,775.83	
ILLUMINA INC	8,353	56.75	474,032.75	
INGERSOLL-RAND PLC	22,076	40.67	897,830.92	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,282	52.09	275,139.38	
INTEL CORP	381,576	21.16	8,074,148.16	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,321	115.13	497,476.73	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,557	10.39	348,657.23	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	87,943	146.14	12,851,990.02	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,606	52.88	296,445.28
INT'L GAME TECHNOLOGY	20,444	16.32	333,646.08
INT'L PAPER CO	28,435	25.74	731,916.90
INTUIT INC	20,465	48.52	992,961.80
INTUITIVE SURGICAL INC	2,686	277.96	746,600.56
INVESCO PLC	29,992	23.20	695,814.40
IRON MOUNTAIN INC	12,656	22.94	290,328.64
ITT CORPORATION	11,955	47.68	570,014.40
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	2,379	61.00	145,119.00
J.C. PENNEY CO INC	14,585	32.19	469,491.15
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,574	42.61	365,338.14
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	7,885	25.23	198,938.55
JM SMUCKER CO	8,169	63.48	518,568.12
JOHNSON & JOHNSON	189,147	64.31	12,164,043.57
JOHNSON CONTROLS INC	46,134	36.85	1,700,037.90
JOY GLOBAL INC	7,059	74.17	523,566.03
JPMORGAN CHASE & CO	273,513	39.90	10,913,168.70
JUNIPER NETWORKS INC	36,082	34.20	1,234,004.40
KBR INC	11,013	27.17	299,223.21
KELLOGG CO	18,274	48.94	894,329.56
KEY CORP	60,437	8.24	498,000.88
KIMBERLY-CLARK CORP	28,390	62.16	1,764,722.40
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,573	64.30	358,343.90
KLA-TENCOR CORP	11,658	37.42	436,242.36
KOHL'S CORP	20,000	52.29	1,045,800.00
KRAFT FOODS INC-A	119,567	30.62	3,661,141.54
KROGER CO	42,012	22.72	954,512.64
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,937	73.13	580,432.81
LABORATORY CRP OF AMER	7,157	82.89	593,243.73
LAM RESEARCH CORP	8,853	46.98	415,913.94
LAS VEGAS SANDS CORP	22,643	52.11	1,179,926.73
LEGG MASON INC	11,242	33.85	380,541.70
LEGGETT & PLATT INC	10,465	20.25	211,916.25
LENDER PROCESSING SERV-W/I	6,684	30.58	204,396.72
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,349	26.56	354,549.44
LIBERTY GLOBAL INC-A	8,982	38.33	344,280.06
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	7,917	36.19	286,516.23
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	38,952	15.34	597,523.68
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,523	51.05	639,299.15
LILLY (ELI) & CO	71,174	35.77	2,545,893.98
LIMITED	18,853	31.37	591,418.61
LINCOLN NATIONAL CORP	20,794	24.43	507,997.42
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,371	32.83	504,629.93
LOCKHEED MARTIN CORP	21,788	72.55	1,580,719.40
LOEWS CORP	23,015	39.27	903,799.05

LORILLARD INC	10,483	88.60	928,793.80	
LOWES COMPANIES	98,960	21.65	2,142,484.00	
LSI CORP	46,074	5.60	258,014.40	
LUBRIZOL CORP	4,678	107.68	503,727.04	
M & T BANK CORP	5,720	80.32	459,430.40	
MACY'S INC	28,947	25.22	730,043.34	
MANPOWER INC	5,615	56.75	318,651.25	
MARATHON OIL CORP	48,657	33.61	1,635,361.77	
MARRIOTT INTL A	19,824	38.55	764,215.20	
MARSH & MCLENNAN COS	37,178	25.15	935,026.70	
MARSHALL & ILSLEY CORP	34,471	5.59	192,692.89	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,130	89.16	279,070.80	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,569	20.45	768,286.05	
MASCO CORP	24,856	11.48	285,346.88	
MASTERCARD INC-CLASS A	6,841	251.52	1,720,648.32	
MATTEL INC	25,014	23.64	591,330.96	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,049	22.66	476,970.34	
MCAFEE INC	10,700	47.30	506,110.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,236	44.42	365,843.12	
MCDONALD'S CORP	73,778	79.10	5,835,839.80	
MCGRAW-HILL COS	21,637	37.97	821,556.89	
MCKESSON CORP	18,612	64.99	1,209,593.88	
MDU RESOURCES GROUP INC	12,326	20.62	254,162.12	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,026	59.58	835,669.08	
MEADWESTVACO CORP	11,829	26.06	308,263.74	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	31,331	59.24	1,856,048.44	
MEDTRONIC	75,543	35.52	2,683,287.36	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	16,031	12.69	203,433.39	
MERCK & CO	213,848	35.05	7,495,372.40	
METLIFE INC	61,554	40.53	2,494,783.62	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	17,510	11.98	209,769.80	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,663	13.00	242,619.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,635	33.83	427,442.05	
MICRON TECHNOLOGY	61,340	7.90	484,586.00	
MICROSOFT CORP	540,918	26.95	14,577,740.10	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,109	54.20	222,707.80	
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,108	49.61	551,067.88	
MONSANTO CO	37,414	62.77	2,348,476.78	
MOODY'S CORP	13,849	27.81	385,140.69	
MORGAN STANLEY	86,483	26.32	2,276,232.56	
MOSAIC CO/THE	10,691	72.20	771,890.20	
MOTOROLA	151,415	8.21	1,243,117.15	
MURPHY OIL CORP	12,475	66.90	834,577.50	
MYLAN INC	21,180	19.48	412,586.40	
NABORS INDUSTRIES LTD	19,560	21.56	421,713.60	

NASDAQ OMX GROUP	9,563	21.72	207,708.36
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,736	58.33	1,676,170.88
NATIONAL SEMICONDUCTOR CO	16,414	13.68	224,543.52
NETAPP INC	23,635	56.63	1,338,450.05
NETFLIX INC	3,046	170.46	519,221.16
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,438	16.93	481,455.34
NEWELL RUBBERMAID	19,079	17.37	331,402.23
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,148	64.42	589,314.16
NEWMONT MINING CORP	33,693	60.51	2,038,763.43
NEWS CORP -CLASS A	124,964	14.28	1,784,485.92
NEWS CORP -CLASS B	30,119	16.08	484,313.52
NEXTERA ENERGY INC	27,016	54.43	1,470,480.88
NII HOLDINGS INC	11,517	41.86	482,101.62
NIKE B	25,781	83.20	2,144,979.20
NISOURCE INC	19,005	17.48	332,207.40
NOBLE CORP	17,545	37.26	653,726.70
NOBLE ENERGY INC	11,976	85.22	1,020,594.72
NORDSTROM INC	11,961	41.90	501,165.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,378	61.68	1,565,315.04
NORTHEAST UTILITIES	12,070	31.26	377,308.20
NORTHERN TRUST CORP	14,963	50.53	756,080.39
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,726	65.28	1,287,713.28
NRG ENERGY INC	17,509	20.21	353,856.89
NSTAR	7,325	41.82	306,331.50
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,423	16.69	274,099.87
NUCOR CORP	21,611	39.92	862,711.12
NVIDIA CORP	39,241	12.59	494,044.19
NYSE EURONEXT	17,942	29.38	527,135.96
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,698	84.01	4,679,188.98
OLD REPUBLIC INTL CORP	16,178	12.75	206,269.50
OMNICARE INC	8,264	25.70	212,384.80
OMNICOM GROUP	21,051	46.30	974,661.30
ONEOK INC	6,925	50.71	351,166.75
ORACLE CORP	275,365	28.74	7,913,990.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,472	58.29	552,122.88
OWENS-ILLINOIS INC	11,313	28.80	325,814.40
PACCAR INC	22,522	53.57	1,206,503.54
PACTIV CORPORATION	9,113	33.16	302,187.08
PALL CORP	8,105	43.73	354,431.65
PARKER HANNIFIN CORP	11,044	79.83	881,642.52
PARTNERRE LTD	5,110	80.09	409,259.90
PATTERSON COMPANIES INC	6,490	28.22	183,147.80
PAYCHEX INC	22,307	27.77	619,465.39
PEABODY ENERGY CORP	18,434	57.80	1,065,485.20
PENTAIR INC	6,813	32.94	224,420.22

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	25,762	12.56	323,570.72	
PEPCO HOLDINGS INC	15,308	18.93	289,780.44	
PEPSICO INC	110,599	65.30	7,222,114.70	
PERRIGO CO	5,640	59.74	336,933.60	
PETROHAWK ENERGY CORP	20,721	18.40	381,266.40	
PETSMART INC	8,474	38.53	326,503.22	
PFIZER	553,171	16.99	9,398,375.29	
PG&E CORP	25,535	47.56	1,214,444.60	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	7,934	25.79	204,617.86	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	127,001	59.56	7,564,179.56	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,437	41.55	309,007.35	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,950	76.95	611,752.50	
PITNEY BOWES INC	14,232	23.35	332,317.20	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,876	28.41	280,577.16	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,163	56.25	2,034,168.75	
POLO RALPH LAUREN CORP	4,361	100.92	440,112.12	
PPG INDUSTRIES INC	11,407	78.26	892,711.82	
PPL CORPORATION	32,136	26.90	864,458.40	
PRAXAIR INC	20,982	92.02	1,930,763.64	
PRECISION CASTPARTS CORP	9,752	140.06	1,365,865.12	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,843	57.86	1,032,395.98	
PRICELINE.COM INC	3,126	420.65	1,314,951.90	
PRIDE INTERNATIONAL INC	12,044	32.55	392,032.20	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,980	28.92	635,661.60	
PROCTER & GAMBLE CO	197,502	64.81	12,800,104.62	
PROGRESS ENERGY INC	19,694	44.74	881,109.56	
PROGRESSIVE CORP	43,784	21.46	939,604.64	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,897	54.89	1,750,826.33	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,698	32.46	1,126,297.08	
PULTE GROUP INC	24,272	7.75	188,108.00	
QEP RESOURCES INC	11,977	33.51	401,349.27	
QUALCOMM	112,496	47.92	5,390,808.32	
QUANTA SERVICES INC	14,435	17.56	253,478.60	
QUEST DIAGNOSTICS	10,489	51.94	544,798.66	
QWEST COMMUNI. INT'L	107,581	6.79	730,474.99	
RALCORP HOLDINGS INC	3,870	61.16	236,689.20	
RANGE RESOURCES CORP	10,933	42.59	465,636.47	
RAYTHEON COMPANY	26,133	48.02	1,254,906.66	
RED HAT INC	12,937	42.94	555,514.78	
REGIONS FINL CORP	81,976	6.20	508,251.20	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,157	60.89	253,119.73	
REPUBLIC SERVICES INC	26,186	28.59	748,657.74	
REYNOLDS AMERICAN INC	11,993	66.06	792,257.58	
ROBERT HALF INTL INC	10,047	27.62	277,498.14	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,779	65.01	635,732.79	

ROCKWELL COLLIN	10,794	59.76	645,049.44
ROPER INDUSTRIES INC	6,444	71.38	459,972.72
ROSS STORES INC	8,392	62.89	527,772.88
ROWAN COMPANIES INC	8,066	31.36	252,949.76
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,582	42.29	405,222.78
SAFEWAY INC	26,650	22.88	609,752.00
SAIC INC	26,518	15.77	418,188.86
SALESFORCE.COM INC	7,944	114.77	911,732.88
SANDISK CORP	15,772	39.88	628,987.36
SARA LEE CORP	43,082	15.21	655,277.22
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,653	37.79	289,206.87
SCANA CORP	8,081	41.21	333,018.01
SCHLUMBERGER	93,707	73.92	6,926,821.44
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,740	15.53	1,083,062.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,239	51.93	323,991.27
SEAGATE TECHNOLOGY	33,428	14.64	489,385.92
SEALED AIR CORP	10,978	23.26	255,348.28
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,239	71.62	231,977.18
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,390	22.97	215,688.30
SEMPRA ENERGY	16,127	51.59	831,991.93
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,397	73.15	467,940.55
SIGMA-ALDRICH	8,325	64.55	537,378.75
SLM CORP	33,313	12.34	411,082.42
SOUTHERN CO	56,546	38.25	2,162,884.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,119	13.93	182,747.67
SOUTHWESTERN ENERGY CO	23,742	37.81	897,685.02
SPECTRA ENERGY CORP	44,439	24.42	1,085,200.38
SPRINT NEXTEL CORPORATION	202,826	4.03	817,388.78
SPX CORP	3,517	66.68	234,513.56
ST JUDE MEDICAL INC	22,923	39.19	898,352.37
STANLEY BLACK&DECKER	10,450	61.86	646,437.00
STAPLES INC	50,057	20.45	1,023,665.65
STARBUCKS CORP	51,099	30.17	1,541,656.83
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,996	56.99	740,642.04
STATE STREET CORP	34,490	43.97	1,516,525.30
STERICYCLE INC	5,514	71.61	394,857.54
STRYKER CORP	20,404	52.17	1,064,476.68
SUNOCO INC	8,268	38.21	315,920.28
SUNTRUST BANKS	34,364	26.04	894,838.56
SUPERVALU INC	14,962	10.49	156,951.38
SYMANTEC CORP	54,787	17.56	962,059.72
SYNOPSIS INC	10,560	25.56	269,913.60
SYSCO CORP	40,571	28.79	1,168,039.09
TARGET (DAYTON HUDSON)	47,981	54.46	2,613,045.26
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,323	17.35	283,204.05

TELEPHONE AND DATA SYSTEMS, INC	3,364	35.81	120,464.84
TERADATA CORP	11,446	40.76	466,538.96
TEXAS INSTRUMENTS	83,820	31.34	2,626,918.80
TEXTRON	18,744	22.44	420,615.36
TFS FINANCIAL CORP	6,221	8.57	53,313.97
THE WALT DISNEY CO	127,601	36.86	4,703,372.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,145	51.40	1,446,653.00
TIFFANY & CO	8,720	56.84	495,644.80
TIME WARNER CABLE-A	24,311	61.91	1,505,094.01
TIME WARNER INC	78,161	31.82	2,487,083.02
TJX COMPANIES INC	27,979	45.48	1,272,484.92
TOLL BROTHERS INC	9,905	19.22	190,374.10
TORCHMARK CORP	5,734	58.65	336,299.10
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,828	15.69	185,581.32
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	4,451	52.92	235,546.92
TRANSOCEAN LTD	21,941	67.82	1,488,038.62
TRAVELERS COS INC/THE	34,052	56.58	1,926,662.16
TYCO ELECTRONICS LTD	31,105	32.88	1,022,732.40
TYCO INTERNATIONAL LTD	35,281	39.29	1,386,190.49
TYSON FOODS INC	19,998	15.03	300,569.94
ULTRA PETROLEUM CORP	10,437	47.07	491,269.59
UNION PACIFIC CORP	34,695	90.35	3,134,693.25
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,564	28.05	156,070.20
UNITED HEALTHCARE CORP	77,953	36.98	2,882,701.94
UNITED PARCEL SERVICE B	49,400	68.99	3,408,106.00
UNITED STATES STEEL CORP	9,833	47.20	464,117.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,791	76.69	4,662,061.79
UNUM GROUP	22,880	21.74	497,411.20
URBAN OUTFITTERS INC	9,293	33.27	309,178.11
URS CORP	5,796	41.03	237,809.88
US BANCORP	131,776	25.21	3,322,072.96
VALERO ENERGY CORP	38,780	19.14	742,249.20
VALIDUS HOLDINGS LTD	5,128	29.58	151,686.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,472	64.80	548,985.60
VERISIGN INC	12,581	35.08	441,341.48
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	6,951	29.99	208,460.49
VERIZON COMMUNICATIONS	194,613	33.01	6,424,175.13
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,755	34.27	471,383.85
VF CORP	6,041	83.03	501,584.23
VIACOM INC-CLASS B	38,063	38.03	1,447,535.89
VIRGIN MEDIA INC	21,549	26.00	560,274.00
VISA INC-CLASS A SHARES	33,946	78.32	2,658,650.72
VMWARE INC-CLASS A	4,827	80.80	390,021.60
VULCAN MATERIALS CO	8,757	42.12	368,844.84
WALGREEN CO	67,100	35.24	2,364,604.00

WAL-MART STORES	139,923	55.05	7,702,761.15	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	7,999	20.89	167,099.11	
WASHINGTON POST -CL B	413	390.57	161,305.41	
WASTE MANAGEMENT INC	31,469	35.15	1,106,135.35	
WATERS CORP	6,374	77.01	490,861.74	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	7,688	51.95	399,391.60	
WEATHERFORD INTL LTD	50,768	19.07	968,145.76	
WELLPOINT INC	30,445	57.74	1,757,894.30	
WELLS FARGO & CO	340,261	28.13	9,571,541.93	
WESTERN DIGITAL CORP	15,717	34.57	543,336.69	
WESTERN UNION CO	46,095	18.50	852,757.50	
WEYERHAEUSER CO	36,828	17.33	638,229.24	
WHIRLPOOL CORP	5,151	76.45	393,793.95	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	555	313.19	173,820.45	
WHOLE FOODS MKT INC	9,994	46.49	464,621.06	
WILLIAMS COS	40,069	22.95	919,583.55	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,653	32.55	379,305.15	
WINDSTREAM CORP	33,273	13.02	433,214.46	
WISCONSIN ENERGY CORP	8,017	58.96	472,682.32	
WR BERKLEY CORP	9,725	27.63	268,701.75	
WYNN RESORTS LTD	5,497	113.87	625,943.39	
XCEL ENERGY INC	31,517	24.12	760,190.04	
XEROX CORP	94,574	11.77	1,113,135.98	
XILINX INC	18,781	27.37	514,035.97	
XL GROUP PLC	23,516	20.94	492,425.04	
YAHOO	90,238	16.97	1,531,338.86	
YUM BRANDS INC	32,057	50.66	1,624,007.62	
ZIMMER HOLDINGS INC	13,908	52.07	724,189.56	
小計	22,208,954		773,467,014.84 (63,254,132,473)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES	11,464	80.63	924,342.32	
AGRIUM INC	10,794	84.92	916,626.48	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,803	23.87	210,127.61	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	13,415	11.47	153,870.05	
BANK MONTREAL	38,505	59.37	2,286,041.85	
BANK NOVA SCOTIA	70,495	54.60	3,849,027.00	
BARRICK GOLD CORP	67,551	51.25	3,461,988.75	
BCE INC	17,335	33.12	574,135.20	
BOMBARDIER B	98,535	4.95	487,748.25	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	35,511	31.13	1,105,457.43	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	20,687	18.12	374,848.44	
CAE INC	17,706	11.33	200,608.98	
CAMECO CORP	26,950	37.13	1,000,653.50	
CANADIAN IMPERIAL BANK	26,704	77.62	2,072,764.48	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,273	64.45	2,079,994.85	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	74,662	39.68	2,962,588.16
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,361	59.29	317,853.69
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,886	49.78	293,005.08
CENOVUS ENERGY INC	51,551	29.97	1,544,983.47
CGI GROUP INC - CL A	17,688	17.07	301,934.16
CI FINANCIAL CORP	11,123	21.82	242,703.86
CP RAILWAY LIMITED	11,561	65.48	757,014.28
CRESCENT POINT ENERGY CORP	15,278	40.60	620,286.80
ELDORADO GOLD CORP	36,920	18.00	664,560.00
EMPIRE CO LTD 'A'	2,049	56.62	116,014.38
ENBRIDGE	24,655	56.37	1,389,802.35
ENCANA CORP	50,707	30.10	1,526,280.70
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	9,181	12.50	114,762.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,370	408.67	559,877.90
FINNING INTERNATIONAL INC	11,725	24.35	285,503.75
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	5,527	95.25	526,446.75
FORTIS INC	11,808	32.63	385,295.04
FRANCO-NEVADA CORP	7,820	32.40	253,368.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,116	27.91	226,517.56
GOLDCORP INC	50,332	46.63	2,346,981.16
GREAT-WEST LIFECO INC	19,541	27.06	528,779.46
HUSKY ENERGY INC	17,485	26.07	455,833.95
IAMGOLD CORP	24,170	18.00	435,060.00
IGM FINANCIAL INC	8,118	43.00	349,074.00
IMPERIAL OIL	20,345	38.83	789,996.35
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	5,899	31.34	184,874.66
INMET MINING CORPORATION	3,559	63.20	224,928.80
INTACT FINANCIAL CORP	7,937	46.99	372,959.63
IVANHOE MINES LTD	18,166	26.13	474,677.58
KINROSS GOLD CORP	76,795	18.63	1,430,690.85
LOBLAW COMPANIES LTD	7,607	40.77	310,137.39
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,299	99.95	729,535.05
MANULIFE FINANCIAL CORP	121,070	15.24	1,845,106.80
METRO INC -A	7,316	46.49	340,120.84
NATIONAL BANK OF CANADA	11,145	66.57	741,922.65
NEXEN INC	35,939	21.81	783,829.59
NIKO RESOURCES LTD	3,141	99.02	311,021.82
ONEX CORP	6,657	29.27	194,850.39
OPEN TEXT CORP	4,002	44.30	177,288.60
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,128	32.30	553,234.40
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,014	35.64	249,978.96
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	5,318	21.93	116,623.74
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	6,893	43.56	300,259.08
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,319	142.43	2,894,035.17
POWER CORP OF CANADA	23,903	28.33	677,171.99

POWER FINANCIAL CORP	16,987	31.18	529,654.66	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	12,781	12.15	155,289.15	
RESEARCH IN MOTION	34,084	55.46	1,890,298.64	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,693	20.66	138,277.38	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,808	36.27	1,117,406.16	
ROYAL BANK OF CANADA	97,716	54.40	5,315,750.40	
SAPUTO INC	9,960	36.75	366,030.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,899	21.56	515,262.44	
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	20,731	8.60	178,286.60	
SHOPPERS DRUG MART CORP	14,911	38.35	571,836.85	
SILVER WHEATON CORP	22,324	32.53	726,199.72	
SINO-FOREST CORPORATION	16,632	21.24	353,263.68	
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,355	54.55	564,865.25	
SUN LIFE FINANCIAL INC	38,967	29.14	1,135,498.38	
SUNCOR ENERGY	107,060	35.96	3,849,877.60	
TALTSMAN ENERGY INC	69,864	19.94	1,393,088.16	
TECK RESOURCES LTD-CL B	33,816	48.44	1,638,047.04	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	14,077	43.14	607,281.78	
THOMSON REUTERS CORP	25,649	37.88	971,584.12	
TIM HORTONS INC	12,000	39.08	468,960.00	
TMX GROUP INC	5,251	35.22	184,940.22	
TORONTO-DOMINION BANK	59,753	73.65	4,400,808.45	
TRANSALTA CORP	15,003	20.60	309,061.80	
TRANSCANADA CORP	47,122	37.29	1,757,179.38	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,881	26.11	492,982.91	
VERMILION ENERGY INC	5,924	40.39	239,270.36	
VITERRA INC	25,664	9.84	252,533.76	
WESTON (GEORGE) LTD	3,541	77.07	272,904.87	
YAMANA GOLD INC	50,787	11.69	593,700.03	
YELLOW MEDIA INC	35,179	6.36	223,738.44	
小計	2,283,233		81,819,884.76 (6,647,047,437)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	30,866	15.90	490,769.40	
ALUMINA LIMITED	172,011	2.14	368,103.54	
AMCOR	83,758	6.79	568,716.82	
AMP LTD	142,092	5.23	743,141.16	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,844	3.64	97,712.16	
ASCIANO GROUP	206,263	1.61	332,083.43	
ASX LTD	11,904	37.50	446,400.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP	173,747	23.75	4,126,491.25	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	70,880	5.52	391,257.60	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,473	9.43	240,210.39	
BHP BILLITON LTD	230,158	44.64	10,274,253.12	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	13,575	8.51	115,523.25	
BLUESCOPE STEEL LTD	128,527	1.91	246,129.20	

BORAL LIMITED	50,355	4.44	223,576.20
BRAMBLES LTD	97,530	6.60	643,698.00
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,059	13.18	119,397.62
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,798	12.25	475,275.50
COCHLEAR LIMITED	3,986	73.32	292,253.52
COMMONWEALTH BANK OF AUST	106,211	48.25	5,124,680.75
COMPUTERSHARE LIMITED	31,335	10.39	325,570.65
CROWN LTD	31,871	8.80	280,464.80
CSL LIMITED	39,459	34.74	1,370,805.66
CSR LIMITED	106,788	1.79	191,150.52
ENERGY RESOURCES OF AUST	4,480	12.22	54,745.60
FAIRFAX MEDIA LTD	146,190	1.44	210,513.60
FORTESCUE METALS GROUP LTD	85,228	6.76	576,141.28
FOSTERS GROUP LTD	132,388	5.85	774,469.80
GOODMAN FIELDER LTD	97,304	1.56	151,794.24
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,442	3.07	114,946.94
INCITEC PIVOT LTD	111,437	3.82	425,689.34
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	142,576	3.94	561,749.44
INTOLL GROUP	159,431	1.51	240,740.81
JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	30,008	5.67	170,145.36
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,538	33.09	315,612.42
MACARTHUR COAL LTD	8,534	12.35	105,394.90
MACQUARIE GROUP LIMITED	23,630	36.20	855,406.00
METCASH LTD	52,876	4.47	236,355.72
NATIONAL AUSTRALIA BANK	145,462	25.85	3,760,192.70
NEWCREST MINING LIMITED	52,428	43.41	2,275,899.48
ONESTEEL LIMITED	93,864	2.57	241,230.48
ORICA LTD	24,766	26.19	648,621.54
ORIGIN ENERGY LIMITED	60,396	16.34	986,870.64
OZ MINERALS LTD	219,000	1.76	385,440.00
PALADIN ENERGY LIMITED	48,024	4.68	224,752.32
QANTAS AIRWAYS LIMITED	76,654	2.75	210,798.50
QBE INSURANCE GROUP	70,984	16.71	1,186,142.64
RIO TINTO LTD	29,884	87.04	2,601,103.36
SANTOS	57,151	13.04	745,249.04
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	11,243	16.87	189,669.41
SONIC HEALTHCARE LTD	26,012	10.97	285,351.64
SP AUSNET	90,764	0.91	83,049.06
SUNCORP-METWAY LIMITED	87,877	9.51	835,710.27
TABCORP HOLDINGS	43,184	7.38	318,697.92
TATTS GROUP LTD	90,365	2.50	225,912.50
TELSTRA CORP	298,669	2.65	791,472.85
TOLL HOLDINGS LIMITED	47,068	6.25	294,175.00
TRANSURBAN GROUP	87,314	5.36	468,003.04
WESFARMERS LIMITED	68,933	33.56	2,313,391.48

	WESFARMERS LTD-PPS	10,419	34.00	354,246.00	
	WESTPAC BANKING	204,178	22.15	4,522,542.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	37,312	42.99	1,604,042.88	
	WOOLWORTHS LTD	85,085	28.70	2,441,939.50	
	WORLEYPARSONS LTD	13,502	25.72	347,271.44	
小計		4,953,090		60,623,146.38 (4,982,616,400)	
イギリス債券	3I GROUP PLC	66,626	3.26	217,200.76	
	ADMIRAL GROUP PLC	13,815	16.71	230,848.65	
	AGGREKO PLC	17,857	15.96	284,997.72	
	AMEC PLC	22,922	11.14	255,351.08	
	ANGLO AMERICAN PLC	90,439	29.59	2,676,090.01	
	ANTOFAGASTA PLC	27,044	14.61	395,112.84	
	ARM HOLDINGS PLC	90,149	3.56	320,930.44	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,432	11.07	270,462.24	
	ASTRAZENECA	98,887	30.93	3,058,574.91	
	AUTONOMY CORP PLC	14,914	14.37	214,314.18	
	AVIVA PIC	192,606	4.23	814,915.98	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	24,842	5.96	148,058.32	
	BAE SYSTEMS PLC	236,362	3.48	823,721.57	
	BALFOUR BEATTY PLC	48,327	2.84	137,490.31	
	BARCLAYS	785,549	2.97	2,333,080.53	
	BG GROUP	231,893	12.82	2,972,868.26	
	BHP BILLITTON PLC	151,355	24.69	3,736,954.95	
	BP PLC	1,288,520	4.54	5,855,679.14	
	BRITISH AIRWAYS	38,708	2.78	107,724.36	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	136,936	24.33	3,332,337.56	
	BRITISH SKY BROADCASTING	78,360	7.28	570,460.80	
	BT GROUP PLC	531,760	1.59	846,561.92	
	BUNZL PLC	22,683	7.33	166,379.80	
	BURBERRY GROUP PLC	29,916	10.27	307,237.32	
	CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	179,320	0.71	127,317.20	
	CAIRN ENERGY PLC	95,930	3.86	370,577.59	
	CAPITA GROUP PLC	42,432	7.40	314,208.96	
	CARNIVAL PLC	11,919	27.50	327,772.50	
	CENTRICA PLC	352,857	3.34	1,179,600.95	
	COBHAM PLC	79,300	2.09	165,895.60	
	COMPASS GROUP PLC	129,381	5.42	701,891.92	
	DIAGEO	171,812	11.55	1,984,428.60	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	17,663	10.09	178,219.67	
	EXPERIAN PLC	70,274	7.35	516,865.27	
	FIRSTGROUP PLC	33,912	4.03	136,767.09	
	FRESNILLO PLC	12,296	14.48	178,046.08	
	G4S PLC	96,738	2.53	245,327.56	
	GLAXOSMITHKLINE	356,102	12.35	4,399,640.21	
	HOME RETAIL GROUP	58,904	2.12	125,229.90	

HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,202,138	6.94	8,347,646.27
ICAP PLC	38,502	4.88	188,043.76
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	69,828	20.30	1,417,508.40
INMARSAT PLC	30,151	7.05	212,564.55
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,838	11.40	226,153.20
INTERNATIONAL POWER PLC	104,458	4.34	453,556.63
INTERTEK GROUP PLC	10,932	19.45	212,627.40
INVENSYS PLC	55,379	3.22	178,431.13
INVESTEC PLC	33,192	5.21	172,930.32
ITV PLC	254,106	0.71	181,558.73
JOHNSON MATTHEY PLC	14,826	19.70	292,072.20
KAZAKHMYS PLC	14,683	15.53	228,026.99
KINGFISHER PLC	162,435	2.37	385,620.69
LEGAL & GENERAL GROUP	402,666	1.02	412,732.65
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,804,200	0.68	1,920,316.16
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,152	7.50	76,190.76
LONMIN PLC	11,093	18.94	210,101.42
MAN GROUP PLC	117,562	2.99	352,333.31
MARKS & SPENCER GROUP PLC	108,859	4.06	441,967.54
MORRISON SUPERMARKETS	145,500	2.72	396,487.50
NATIONAL GRID PLC	237,434	5.75	1,366,432.67
NEXT PLC	12,975	21.40	277,665.00
OLD MUTUAL PLC	372,671	1.32	493,416.40
PEARSON	55,818	9.72	542,830.05
PETROFAC LTD	17,903	15.40	275,706.20
PRUDENTIAL	174,318	6.30	1,099,074.99
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,195	62.65	388,116.75
RECKITT BENCKISER PLC	42,256	35.59	1,503,891.04
REED ELSEVIER PLC	83,473	5.38	449,084.74
RESOLUTION LTD	99,614	2.49	248,038.86
REXAM	60,557	3.17	192,268.47
RIO TINTO PLC REG	99,413	44.54	4,427,855.02
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	127,156	6.06	771,201.14
ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C SHRS	8,137,984	0.001	8,137.98
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,192,620	0.43	521,771.25
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	243,160	20.63	5,016,390.80
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	184,877	20.22	3,739,137.32
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	236,552	1.30	307,990.70
SABMILLER PLC	65,137	20.23	1,317,721.51
SAGE GROUP PLC	90,754	2.70	245,761.83
SAINSBURY (J) PLC	83,074	3.77	313,355.12
SCHRODERS PLC	7,886	16.67	131,459.62
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	63,307	11.18	707,772.26
SERCO GROUP PLC	33,911	5.75	194,988.25
SEVERN TRENT PLC	16,339	14.29	233,484.31

	SHIRE PLC	38,550	14.86	572,853.00	
	SMITH & NEPHEW PLC	60,950	5.94	362,043.00	
	SMITHS GROUP PLC	26,792	12.02	322,039.84	
	STANDARD CHARTERED PLC	158,199	19.13	3,027,137.86	
	STANDARD LIFE PLC	155,150	2.32	361,034.05	
	TESCO	550,109	4.13	2,273,600.49	
	THOMAS COOK GROUP PLC	60,665	1.84	111,926.92	
	TUI TRAVEL PLC	37,617	2.06	77,603.87	
	TULLOW OIL PLC	60,829	12.31	748,804.99	
	UNILEVER PLC	88,019	18.97	1,669,720.43	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	46,739	6.20	289,781.80	
	VEDANTA RESOURCES PLC	8,178	24.11	197,171.58	
	VODAFONE GROUP PLC	3,612,111	1.74	6,285,073.14	
	WHITBREAD PLC	12,182	17.97	218,910.54	
	WOLSELEY PLC	19,503	18.17	354,369.51	
	WPP PLC	86,377	7.49	647,395.61	
	XSTRATA PLC	141,089	14.07	1,985,827.67	
小計		28,492,685		101,614,858.94 (13,312,562,669)	
スイスフラン	ABB LTD	151,757	20.71	3,142,887.47	
	ACTELION LTD-REG	6,993	49.85	348,601.05	
	ADECCO	8,437	60.75	512,547.75	
	ARYZTA AG	5,794	42.00	243,348.00	
	BALOISE HOLDING AG	3,433	93.20	319,955.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	35,901	52.35	1,879,417.35	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	77,337	42.50	3,286,822.50	
	GAM HOLDING LTD	14,288	15.90	227,179.20	
	GEBERIT AG-REG	2,670	202.00	539,340.00	
	GIVAUDAN-REG	570	1,015.00	578,550.00	
	HOLCIM LTD	16,824	66.75	1,123,002.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,186	40.29	571,553.94	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,703	126.50	468,429.50	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	60	2,714.00	162,840.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	28,975.00	231,800.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,571	20.15	253,305.65	
	LONZA GROUP AG-REG	3,114	86.50	269,361.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	237,799	55.40	13,174,064.60	
	NOBEL BIO CARE HLDGS AG-REG	8,726	16.13	140,750.38	
	NOVARTIS	144,709	55.35	8,009,643.15	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,907	82.50	157,327.50	
	ROCHE HOLDING GENUSS	48,181	142.50	6,865,792.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,518	112.30	170,471.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,334	112.30	374,408.20	
	SGS SA	376	1,636.00	615,136.00	
	SIKA AG-BR	140	1,945.00	272,300.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,145	119.90	377,085.50	

	STRAUMANN HOLDING AG-REG	551	205.60	113,285.60	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,121	405.30	859,641.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,069	73.20	224,650.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,105	129.40	272,387.00	
	SWISS RE-REG	24,178	51.25	1,239,122.50	
	SWISSCOM	1,599	419.70	671,100.30	
	SYNGENTA AG	6,488	286.40	1,858,163.20	
	SYNTHESE INC	4,071	122.70	499,511.70	
	UBS AG-REG	249,856	17.38	4,342,497.28	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,171	233.30	2,372,894.30	
小計		1,111,690		56,769,174.22 (4,792,453,687)	
香港ドル	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,900	72.00	1,000,800.00	
	BANK EAST ASIA	104,560	34.65	3,623,004.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	254,000	28.55	7,251,700.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	22.10	1,812,200.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	95,000	127.90	12,150,500.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	34.00	1,088,000.00	
	CLP HOLDINGS	132,000	63.75	8,415,000.00	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	79,474	43.40	3,449,171.60	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	151,000	5.81	877,310.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	55,000	52.25	2,873,750.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	143,000	37.50	5,362,500.00	
	HANG SENG BANK	52,400	122.30	6,408,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	74,000	58.90	4,358,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	295,729	19.08	5,642,509.32	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	70,200	194.20	13,632,840.00	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	95,000	50.80	4,826,000.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	38,500	25.75	991,375.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	146,000	83.45	12,183,700.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	44,000	33.85	1,489,400.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	49,000	45.80	2,244,200.00	
	LI & FUNG	156,400	42.40	6,631,360.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	39,500	19.42	767,090.00	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	205,000	3.06	627,300.00	
	MTR CORP	98,000	30.70	3,008,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	175,000	17.18	3,006,500.00	
	NWS HOLDINGS LTD	60,000	19.02	1,141,200.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	15,500	76.25	1,181,875.00	
	PCCW LTD	250,000	3.11	777,500.00	
	SANDS CHINA LTD	165,600	17.44	2,888,064.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	92,000	20.55	1,890,600.00	
	SINO LAND CO	118,000	17.24	2,034,320.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	97,000	143.10	13,880,700.00	
	SWIRE PACIFIC A	53,000	122.70	6,503,100.00	
	TELEVISION BROADCASTS LTD	20,000	40.50	810,000.00	

	WHARF HOLDINGS	94,000	56.70	5,329,800.00	
	WHEELOCK & CO LTD	63,000	30.85	1,943,550.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	99.95	1,249,375.00	
	WYNN MACAU LTD	107,600	17.28	1,859,328.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	52,500	28.65	1,504,125.00	
小計		3,881,363		156,715,466.92 (1,653,348,176)	
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	175,500	3.94	691,470.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	94,000	2.18	204,920.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	13.30	492,100.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	132,000	1.49	196,680.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	2.16	146,880.00	
	DBS GROUP	117,000	14.12	1,652,040.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	68,000	6.80	462,400.00	
	GENTING INTERNATIONAL PLC	418,000	2.35	982,300.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	108,000	2.24	241,920.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	461,000	0.77	354,970.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	7,000	38.80	271,600.00	
	KEPPEL CORP LTD	88,000	10.78	948,640.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	4.92	246,000.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	2.27	138,470.00	
	NOBLE GROUP LTD	205,363	2.13	437,423.19	
	OCBC BANK	167,000	9.89	1,651,630.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	84,000	3.38	283,920.00	
	SEBMCORP INDUSTRIES LTD	68,000	4.91	333,880.00	
	SEBMCORP MARINE LTD	59,000	5.13	302,670.00	
	SINGAPORE AIRLINES	36,533	16.32	596,218.56	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	59,000	9.18	541,620.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	104,000	4.21	437,840.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	115,000	3.47	399,050.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	546,243	3.32	1,813,526.76	
	STARHUB LTD	40,000	2.80	112,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	84,000	18.56	1,559,040.00	
	UOL GROUP LIMITED	33,300	4.74	157,842.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	132,000	6.88	908,160.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	103,000	2.02	208,060.00	
小計		3,720,939		16,773,270.51 (1,064,096,281)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,659	2.14	138,370.26	
	CONTACT ENERGY LTD	20,388	5.95	121,308.60	
	FLETCHER BUILDING LTD	42,784	8.15	348,689.60	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	38,593	3.22	124,269.46	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	135,121	2.12	286,456.52	
小計		301,545		1,019,094.44 (64,620,778)	

スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	23,155	126.40	2,926,792.00	
	ASSA ABLOY B	21,401	184.70	3,952,764.70	
	ATLAS COPCO A	46,052	147.90	6,811,090.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	26,761	134.40	3,596,678.40	
	BOLIDEN AB	18,890	126.00	2,380,140.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	16,498	171.00	2,821,158.00	
	ERICSSON (LM) B	206,534	72.00	14,870,448.00	
	GETINGE AB-B SHS	13,726	148.50	2,038,311.00	
	HENNES & MAURITZ B	70,322	232.30	16,335,800.60	
	HEXAGON AB-B SHS	13,049	152.30	1,987,362.70	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,544	214.00	758,416.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	28,208	48.26	1,361,318.08	
	INVESTOR AB-B SHS	31,272	139.20	4,353,062.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,903	139.40	2,077,478.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,216	625.00	3,260,000.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,488	521.00	1,817,248.00	
	NORDEA BANK AB	222,035	72.35	16,064,232.25	
	RATOS AB-B SHS	7,025	239.40	1,681,785.00	
	SANDVIK AB	69,152	113.60	7,855,667.20	
	SCA SV CELLULOSA B	39,296	103.30	4,059,276.80	
	SCANIA AB-B SHS	21,945	149.10	3,271,999.50	
	SECURITAS B	21,625	73.95	1,599,168.75	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	96,840	53.15	5,147,046.00	
	SKANSKA B	27,385	128.30	3,513,495.50	
	SKF AB-B	26,724	180.10	4,812,992.40	
	SSAB AB-A SHS	12,471	98.90	1,233,381.90	
SSAB AB-B SHS	5,581	87.15	486,384.15		
SVENSKA HANDELSBK A	33,598	218.90	7,354,602.20		
SWEDBANK AB-A	49,036	93.90	4,604,480.40		
SWEDISH MATCH AB	15,842	189.90	3,008,395.80		
TELE2 AB-B SHS	21,601	146.40	3,162,386.40		
TELIASONERA AB	153,977	56.45	8,692,001.65		
VOLVO B	74,622	97.70	7,290,569.40		
小計		1,441,774		155,185,934.18 (1,876,197,944)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	11,589	96.55	1,118,917.95	
	DNB NOR ASA	67,096	79.15	5,310,648.40	
	NORSK HYDRO	61,011	38.49	2,348,313.39	
	ORKLA	52,923	56.70	3,000,734.10	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	33,457	19.97	668,136.29	
	SEADRILL LTD	19,161	196.00	3,755,556.00	
	STATOIL ASA	76,537	123.30	9,437,012.10	
	TELENOR ASA	56,849	96.55	5,488,770.95	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,997	319.30	4,149,942.10	
小計		391,620		35,278,031.28 (492,481,316)	

デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	38	47,870.00	1,819,060.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	90	49,290.00	4,436,100.00	
	CARLSBERG AS-B	7,336	565.00	4,144,840.00	
	COLOPLAST-B	1,573	762.00	1,198,626.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	152.00	4,740,120.00	
	DSV A/S	14,343	114.80	1,646,576.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	29,876	562.00	16,790,312.00	
	NOVOZYMES A/S	3,162	729.50	2,306,679.00	
	TRYG A/S	1,805	273.00	492,765.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	13,970	177.70	2,482,469.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,662	405.30	673,608.60	
小計		105,040		40,731,156.00 (615,040,455)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	68,065	17.31	1,178,205.15	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	80,934	17.48	1,414,726.32	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	119,263	9.57	1,141,346.91	
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,486	121.00	421,806.00	
	DELEK GROUP LTD	265	930.00	246,450.00	
	DISCOUNT INVESTMENT CORP-REG	1,700	82.06	139,502.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,653	189.30	312,912.90	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	30,398	56.20	1,708,367.60	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	163	4,096.00	667,648.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	36,100	7.72	278,692.00	
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES	16,000	17.80	284,800.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	36.40	298,480.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,403	119.90	527,919.70	
	ORMAT INDUSTRIES LTD	4,000	28.59	114,360.00	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	6,005	73.70	442,568.50	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	63,944	186.10	11,899,978.40		
小計		444,579		21,077,763.48 (472,774,234)	
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS	20,273	13.86	281,085.14	
	ACCIONA SA	1,792	60.00	107,520.00	
	ACCOR	10,169	31.92	324,594.48	
	ACERINOX SA	7,029	12.08	84,910.32	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,711	37.00	359,307.00	
	ADIDAS AG	14,389	48.51	698,082.33	
	ADP	2,093	62.29	130,372.97	
	AEGON	107,271	4.69	503,315.53	
	AEM SPA	77,294	1.13	87,805.98	
	AGEAS	153,212	2.21	339,364.58	
	AHOLD (KON.)	81,739	9.65	788,781.35	
	AIR FRANCE-KLM	9,523	13.57	129,227.11	
	AIR LIQUIDE	19,397	95.24	1,847,370.28	
	AKZO NOBEL	15,887	44.32	704,111.84	
	ALCATEL-LUCENT	158,971	2.28	362,771.82	

ALLIANZ SE-REG	31,163	92.46	2,881,330.98
ALPHA BANK	35,778	4.66	166,725.48
ALSTOM RGPT	14,106	33.90	478,193.40
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	45,054	0.00	0.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV	49,514	44.00	2,178,616.00
ARCELORMITTAL	58,876	26.23	1,544,317.48
ASML HOLDING NV	29,577	24.61	727,889.97
ASSICURAZIONI GENERALI	80,166	16.31	1,307,507.46
ATLANTIA SPA	16,467	16.46	271,046.82
ATOS ORIGIN	3,195	32.00	102,255.97
AUTOGRILL SPA	7,704	9.75	75,114.00
AXA	117,916	13.76	1,623,113.74
BANCA CARIGE SPA	37,954	1.67	63,534.99
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	152,990	0.94	143,887.09
BANCA POPOLARE DI MILANO	27,830	3.24	90,377.92
BANCO BILBAO VIZCAYA	244,454	8.37	2,046,813.34
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG-RTS	244,454	0.32	78,714.18
BANCO DE SABADELL SA	65,910	3.25	214,734.78
BANCO DE VALENCIA SA	14,702	3.60	52,927.20
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	36,302	3.36	122,265.13
BANCO POPOLARE SPA	43,973	3.70	163,029.89
BANCO POPULAR ESPANOL	59,494	4.27	254,455.83
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	565,100	8.65	4,888,115.00
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	45,340	3.24	146,901.60
BANK OF IRELAND	234,664	0.42	98,558.88
BANKINTER SA	20,050	4.54	91,147.30
BASF SE	62,989	57.41	3,616,198.49
BAYER	56,712	55.97	3,174,170.64
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,772	54.91	1,250,410.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,689	37.54	138,503.50
BCP BANCO COMERCIAL NOM	194,771	0.62	122,510.95
BEIERSDORF AG	6,913	45.00	311,085.00
BELGACOM	10,432	27.94	291,470.08
BIOMERIEUX	794	70.79	56,207.26
BNP PARIBAS	65,068	54.81	3,566,377.08
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,769	30.30	144,524.54
BOUYGUES ORD	15,825	33.11	524,044.87
BRISA	12,079	5.19	62,690.01
BUREAU VERITAS SA	3,461	58.30	201,776.30
CAP GEMINI SA	10,091	34.84	351,620.89
CARREFOUR	41,091	38.00	1,561,458.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,784	68.55	259,393.20
CELESIO AG	5,396	19.06	102,874.74
CHRISTIAN DIOR	4,374	110.15	481,796.10
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	9,917	20.05	198,835.85

CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	13,528	5.21	70,480.88
CNP ASSURANCES	10,272	15.00	154,080.00
CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE	1,845	39.52	72,923.62
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	12,889	19.52	251,593.28
COLRUYT SA	5,170	39.91	206,334.70
COMMERZBANK AG	48,664	6.29	306,291.21
CONTINENTAL AG	3,463	60.00	207,780.00
CREDIT AGRICOLE SA	63,701	12.22	778,744.72
CRH	48,537	14.46	702,087.70
CRITERIA CAIXACORP SA	57,720	4.05	233,881.44
DAIMLER AG	62,037	50.04	3,104,331.48
DANONE (GROUPE)	39,991	47.15	1,885,775.60
DASSAULT SYSTEMES SA	4,059	55.00	223,245.00
DELHAIZE GROUP	6,935	50.89	352,922.15
DELTA LLOYD NV	5,001	14.44	72,239.44
DEUTSCHE BANK NAMEN	63,938	41.91	2,679,641.58
DEUTSCHE BOERSE	13,388	49.85	667,391.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,703	16.04	251,954.63
DEUTSCHE POST AG-REG	58,040	13.79	800,661.80
DEUTSCHE TELEKOM	194,413	10.22	1,986,900.86
DEXIA	39,097	3.30	129,020.10
E.ON AG	123,505	22.18	2,739,340.90
EDENRED	10,330	16.84	174,008.85
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	4.01	58,740.87
EFG EUROBANK ERGASIAS	22,780	4.51	102,737.80
EIFFAGE	2,855	36.40	103,922.00
ELAN CORPORATION PLC	34,324	3.93	134,893.32
ELECTRICITE DE FRANCE	17,751	31.77	563,949.27
ELISA A	9,189	15.70	144,267.30
ENAGAS	12,366	15.26	188,766.99
ENEL	451,414	4.09	1,849,668.86
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	119,895	2.54	305,252.67
ENI	178,546	16.64	2,971,005.44
ERAMET	354	271.70	96,181.80
ERSTE GROUP BANK AG	12,973	32.87	426,422.51
ESSILOR INTERNATIONAL	13,780	47.97	661,095.50
EURAZEO	2,045	58.08	118,773.60
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	27,984	18.55	519,243.12
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,812	27.16	185,047.98
EXOR SPA	4,302	20.67	88,922.34
FERROVIAL SA	30,182	8.13	245,379.66
FIAT ORD	52,584	13.22	695,160.48
FINMECCANICA SPA	27,754	9.66	268,103.64
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,563	19.20	49,222.41
FORTUM OYJ	30,462	20.30	618,378.60

FRANCE TELECOM	127,151	17.23	2,190,811.73
FRAPORT AG	2,590	46.80	121,212.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,183	43.74	576,624.42
FRESENIUS SE	1,990	64.35	128,056.50
FRESENIUS SE-PFD	5,527	65.22	360,470.94
FUGRO NV-CVA	4,592	53.55	245,901.60
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	15,866	14.42	228,787.72
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	13,061	5.36	70,006.96
GAS NATURAL SDG SA	15,954	10.71	170,867.34
GDF SUEZ	85,291	28.87	2,462,351.17
GEA GROUP AG	11,345	19.50	221,227.50
GESTEVISION TELECINCO SA	6,639	9.67	64,225.68
GRIFOLS SA	9,762	10.21	99,670.02
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,539	65.05	360,311.95
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	32,717	7.37	241,287.87
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,169	36.70	153,023.14
HEIDELBERGCEMENT AG	9,644	42.68	411,605.92
HEINEKEN HOLDING NV	7,901	31.10	245,721.10
HEINEKEN NV	17,776	35.99	639,758.24
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,926	6.16	104,264.16
HENKEL AG & CO KGAA	8,908	35.40	315,343.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,218	42.06	513,950.17
HERMES INTERNATIONAL	3,630	166.05	602,761.50
HOCHTIEF AG	3,142	62.53	196,469.26
IBERDROLA RENOVABLES	59,082	2.43	143,628.34
IBERDROLA SA	276,814	5.93	1,643,167.90
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	33,592	3.25	109,241.18
ILIAD SA	1,146	80.05	91,737.30
IMERYS SA	2,659	47.80	127,100.20
IMMOFINANZ AG	68,031	2.97	202,188.13
INDITEX	15,005	57.00	855,285.00
INDRA SISTEMAS SA	6,363	13.75	87,491.25
INFINEON TECHNOLOGIES	74,528	6.24	465,650.94
ING GROEP	262,994	7.96	2,095,010.20
INTESA SANPAOLO	528,791	2.49	1,316,689.59
INTESA SANPAOLO-RNC	65,817	2.03	133,608.51
IPSEN	1,975	24.33	48,051.75
JC DECAUX SA	4,694	20.40	95,781.07
JERONIMO MARTINS	15,526	11.15	173,114.90
K+S AG	9,845	52.60	517,847.00
KBC GROEP NV	11,058	31.11	344,014.38
KERRY GROUP PLC-A	9,614	27.00	259,578.00
KESKO OYJ-B SHS	4,713	36.65	172,731.45
KONE OYJ-B	10,678	40.12	428,401.36
KONINKLIJKE DSM NV	10,576	38.82	410,560.32

KPN (KON.)	110,971	11.95	1,326,103.45
LAFARGE (FRANCE)	13,751	46.14	634,471.14
LAGADERE S.C.A	8,117	31.10	252,479.28
LEGRAND SA	9,022	28.94	261,096.68
LINDE AG	11,584	105.80	1,225,587.20
LOREAL	16,438	86.21	1,417,119.98
LUXOTTICA GROUP SPA	8,044	20.95	168,521.80
LVMH	16,839	117.70	1,981,950.30
M6-METROPOLE TELEVISION	4,339	18.44	80,011.16
MAN SE	7,251	83.56	605,893.56
MAPFRE SA	52,154	2.31	120,527.89
MEDIASET	48,744	5.40	263,461.32
MEDIOBANCA	32,516	7.65	248,909.98
MEDIOLANUM SPA	14,724	3.53	52,012.53
MERCK KGAA	4,432	58.17	257,809.44
METRO STAMM	8,891	53.25	473,445.75
METSO OYJ	8,764	37.60	329,526.40
MICHELIN	11,989	57.46	688,887.94
MOBISTAR SA	1,904	47.29	90,049.68
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,939	113.30	1,465,988.70
NATIONAL BANK OF GREECE	65,568	7.78	510,119.04
NATIXIS	59,898	4.47	268,283.14
NEOPOST SA	2,155	61.78	133,135.90
NESTE OIL OYJ	9,037	12.00	108,444.00
NOKIA CORP	256,827	7.78	1,998,114.06
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,435	26.22	194,945.70
OKO BANK-A	9,750	9.56	93,210.00
OMV AG	10,287	27.77	285,669.99
OPAP SA	15,463	13.25	204,884.75
ORION OYJ-CLASS B	6,550	15.83	103,686.50
OUTOKUMPU OYJ	9,028	13.66	123,322.48
PAGESJAUNES GROUPE	8,509	7.54	64,208.91
PARMALAT SPA	118,527	1.96	232,312.92
PERNOD-RICARD	13,573	63.30	859,170.90
PEUGEOT SA	10,463	30.30	317,028.90
PHILIPS ELECTRS (KON.)	67,625	22.80	1,542,188.12
PIRELLI & CO	16,813	6.11	102,727.43
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,018	43.54	262,023.72
PORTUGAL TELECOM	39,964	9.89	395,483.74
PPR	5,223	115.55	603,517.65
PRYSMIAN SPA	12,831	13.65	175,143.15
PUBLIC POWER CORP	8,177	12.47	101,967.19
PUBLICIS GROUPE	8,498	35.92	305,248.16
PUMA AG	363	250.85	91,058.55
QIAGEN N.V.	15,937	13.44	214,193.28

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,821	41.73	159,450.33	
RANDSTAD HOLDING NV	7,558	36.76	277,832.08	
RAUTARUUKKI OYJ	5,933	15.28	90,656.24	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,421	35.70	264,929.70	
REED ELSEVIER NV	47,285	9.42	445,424.70	
RENAULT SA	13,220	43.12	570,112.50	
REPSOL YPF	50,236	20.11	1,010,245.96	
RWE AG-NON VTG PFD	2,693	47.35	127,513.55	
RWE STAMM	28,716	50.44	1,448,435.04	
SAFRAN SA	11,440	22.70	259,688.00	
SAINT-GOBAIN	26,382	37.12	979,299.84	
SAIPEM	18,157	33.25	603,720.25	
SALZGITTER AG	2,905	55.94	162,505.70	
SAMPO OYJ-A SHS	28,844	20.35	586,975.40	
SANOFI-AVENTIS SA	71,912	51.19	3,681,175.28	
SANOMA OYJ	5,688	16.69	94,932.72	
SAP AG	58,857	37.39	2,200,663.23	
SBM OFFSHORE NV	11,816	15.40	181,966.40	
SCHNEIDER ELECTRIC	16,486	105.00	1,731,030.00	
SCOR SE	11,436	18.51	211,737.54	
SES	20,611	18.20	375,120.20	
SIEMENS	56,426	84.98	4,795,081.48	
SNAM RETE GAS	97,953	3.87	379,567.87	
SOCIETE BIC SA	1,882	64.01	120,466.82	
SOCIETE GENERALE	43,173	44.19	1,907,814.87	
SODEXO	6,484	48.09	311,847.98	
SOLVAY SA	4,066	77.06	313,325.96	
STMICROELECTRONICS	43,700	6.67	291,566.40	
STORA ENSO OYJ R	39,897	7.49	299,028.01	
SUEDZUCKER AG	4,447	16.87	75,043.12	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	18,471	13.87	256,192.77	
TECHNIP S.A.	6,749	63.70	429,911.30	
TELECOM ITALIA ORD	642,359	1.04	668,053.36	
TELECOM ITALIA RNC	413,268	0.84	350,244.63	
TELEFONICA	281,697	18.54	5,224,070.86	
TELEKOM AUSTRIA AG	22,786	11.33	258,279.31	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,296	12.48	103,575.56	
TENARIS SA	32,384	16.60	537,574.40	
TERNA SPA	89,322	3.36	300,121.92	
THALES SA	6,185	29.36	181,622.52	
THYSSEN KRUPP	22,934	28.37	650,752.25	
TNT NV	25,641	18.39	471,537.99	
TOTAL SA	144,948	41.12	5,960,986.50	
UCB (GROUPE)	6,965	27.97	194,845.87	
UMICORE	7,818	37.41	292,471.38	

UNICREDIT SPA	926,258	1.82	1,686,715.81	
UNILEVER NV-CVA	111,715	22.55	2,519,173.25	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	41,687	7.50	312,652.50	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,459	13.05	110,389.95	
UPM KYMMENE CORP	35,659	12.51	446,094.09	
VALLOUREC	7,464	80.45	600,478.80	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,696	20.87	494,535.52	
VERBUND AG	5,243	27.80	145,755.40	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,710	38.27	103,711.70	
VINCI S.A.	29,896	39.79	1,189,561.84	
VIVENDI	84,550	20.76	1,755,258.00	
VOESTALPINE AG	7,589	30.88	234,348.32	
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,702	111.45	1,304,187.90	
VOLKSWAGEN STAMM	2,043	100.05	204,402.15	
VOPAK	4,856	36.95	179,453.48	
WACKER CHEMIE AG	1,081	142.05	153,556.05	
WARTSILA OYJ	5,411	53.35	288,676.85	
WOLTERS KLUWER	20,541	15.95	327,628.95	
ZARDOYA OTIS SA	9,585	12.11	116,074.35	
小計	12,400,552		165,112,495.00 (18,580,109,062)	
合計	81,737,064		(117,807,480,912)	

(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 568銘柄	100.0%	53.7%
カナダドル	株式 90銘柄	100.0%	5.6%
ユーロ	株式 259銘柄	100.0%	15.8%
イギリスポンド	株式 101銘柄	100.0%	11.3%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%	4.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%	1.6%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	株式 63銘柄	100.0%	4.2%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式 29銘柄	100.0%	0.9%
イスラエルシェケル	株式 16銘柄	100.0%	0.4%

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
----	----	----	-------	-----	----

投資信託受益証券	アメリカドル	CARNIVAL CORP	31,809.00	1,379,556.33	
	小計		31,809.00	1,379,556.33	(112,820,116)
	カナダドル	ARC ENERGY TRUST-UNITS	9,654.00	227,351.70	
		BONAVISTA ENERGY TRUST	4,682.00	126,086.26	
		CANADIAN OIL SANDS TRUST	16,279.00	434,974.88	
		ENERPLUS RESOURCES FUND	12,172.00	353,718.32	
		PENN WEST ENERGY TRUST	29,214.00	676,888.38	
		PROVIDENT ENERGY TRUST-UTS	18,696.00	147,511.44	
小計		90,697.00	1,966,530.98	(159,760,976)	
投資信託受益証券計					(272,581,092)
投資証券	アメリカドル	AMB PROPERTY CORP	11,561.00	338,274.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	42,606.00	757,960.74	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,705.00	605,015.25	
		BOSTON PROPERTIES	9,557.00	815,881.09	
		DUKE REALTY CORP	17,165.00	211,472.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,451.00	941,817.42	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,218.00	335,710.62	
		HCP INC	20,208.00	688,890.72	
		HEALTH CARE REIT INC	8,769.00	421,438.14	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,387.00	695,059.74	
		KIMCO REALTY CORP	27,884.00	487,691.16	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,001.00	265,953.24	
		MACERICH CO/THE	8,897.00	411,664.19	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,203.00	431,203.47	
		PROLOGIS	38,199.00	538,223.91	
		PUBLIC STORAGE	9,924.00	1,004,705.76	
		RAYONIER INC	5,512.00	294,506.16	
		REGENCY CENTERS CORP	5,779.00	246,127.61	
		SIMON PROPERTY GROUP	20,123.00	2,036,045.14	
		VENTAS INC	10,783.00	577,429.65	
	VORNADO REALTY TRUST	11,255.00	950,822.40		
	小計		340,187.00	13,055,894.07	(1,067,711,017)
	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,399.00	191,245.23	
	小計		8,399.00	191,245.23	(15,536,762)
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	121,379.00	217,875.30	
		DEXUS PROPERTY GROUP	339,823.00	275,256.63	
		GOODMAN GROUP	449,008.00	287,365.12	
		GPT GROUP	120,889.00	337,280.31	
		LEND LEASE GROUP	37,106.00	263,081.54	
MIRVAC GROUP		230,244.00	295,863.54		
STOCKLAND		163,427.00	609,582.71		
WESTFIELD GROUP		150,353.00	1,811,753.65		

小計		1,612,229.00	4,098,058.80 (336,819,452)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	59,978.00	306,487.58	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	32,917.00	128,540.88	
	HAMMERSON PLC	48,597.00	208,821.30	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	52,327.00	364,457.55	
	SEGRO PLC	52,338.00	158,584.14	
小計		246,157.00	1,166,891.45 (152,874,448)	
香港ドル	LINK REIT	151,000.00	3,767,450.00	
小計		151,000.00	3,767,450.00 (39,746,597)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	106,000.00	227,900.00	
	CAPITAMALL TRUST	154,000.00	308,000.00	
小計		260,000.00	535,900.00 (33,997,496)	
ユーロ	CORIO NV	4,061.00	198,928.08	
	FONCIERE DES REGIONS	1,715.00	137,680.20	
	GECINA SA	1,325.00	114,745.00	
	ICADE	1,641.00	129,540.54	
	KLEPIERRE	6,510.00	178,243.80	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,266.00	939,586.70	
小計		21,518.00	1,698,724.32 (191,157,447)	
投資証券計			(1,837,843,219)	
合計			(2,110,424,311)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益 証券時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	9.6%	-	55.9%
	投資証券21銘柄	-	90.4%	
カナダドル	投資信託受益証券6銘柄	91.1%	-	8.3%
	投資証券1銘柄	-	8.9%	
ユーロ	投資証券6銘柄	-	100.0%	9.1%
イギリスポンド	投資証券5銘柄	-	100.0%	7.2%
オーストラリアドル	投資証券8銘柄	-	100.0%	16.0%
香港ドル	投資証券1銘柄	-	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券2銘柄	-	100.0%	1.6%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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 J-REITインデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,640,191	13,149,551
投資証券	1,433,442,900	3,291,249,760
未収配当金	22,430,026	40,075,888
未収利息	33	22
流動資産合計	1,470,513,150	3,344,475,221
資産合計	1,470,513,150	3,344,475,221
負債の部		
流動負債		
未払金	9,074,855	11,250,131
未払解約金	1,263,569	1,403,595
流動負債合計	10,338,424	12,653,726
負債合計	10,338,424	12,653,726
純資産の部		
元本等		
元本	2,479,283,257	4,927,249,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,019,108,531	1,595,427,906
元本等合計	1,460,174,726	3,331,821,495
純資産合計	1,460,174,726	3,331,821,495
負債純資産合計	1,470,513,150	3,344,475,221

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自平成20年11月11日 至平成21年11月10日)	(自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	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。	投資証券 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、当該投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。	受取配当金 同左
----------------	--	-------------

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1. 期首元本額	1,360,827,289円	2,479,283,257円
期中追加設定元本額	1,827,704,925円	2,917,774,258円
期中一部解約元本額	709,248,957円	469,808,114円
期末元本額	2,479,283,257円	4,927,249,401円
元本額の内訳		
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	323,415,837円	440,229,615円
SBI 資産設計オープン（分配型）	29,756,461円	26,280,747円
STAM J - REITインデックス・オープン	1,561,863,136円	1,868,171,050円
STAM Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	564,247,823円	2,592,567,989円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を1,019,108,531円下回っております。	純資産額は、元本を1,595,427,906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	2,479,283,257口	4,927,249,401口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	(自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）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。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・価格変動リスク

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成22年11月10日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>a. 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

（平成21年11月10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）
投資証券	1,433,442,900	52,459,207
合 計	1,433,442,900	52,459,207

（平成22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	235,452,007
合 計	235,452,007

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）
該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

（平成21年11月10日現在）
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成22年11月10日現在）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日）	（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
1口当たり純資産額 = 0.5890円	1口当たり純資産額 = 0.6762円

（3）附属明細表（平成22年11月10日現在）

1）有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数（口）	評価額（円）	備考
国内投資証券	F C レジデンシャル投資法人	33	7,722,000	
	M I D リート投資法人	186	36,381,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	991	139,136,400	
	インヴィンシブル投資法人	644	8,365,560	
	オリックス不動産投資法人	254	109,982,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	98	60,564,000	
	ケネディクス不動産投資法人	236	72,688,000	
	ジャパン・オフィス投資法人	207	16,394,400	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	107	21,400,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	156	73,788,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	495	415,800,000	
	スターツプロシード投資法人	109	11,499,500	
	トップリート投資法人	157	75,674,000	

ビ・ライフ投資法人	120	56,280,000	
プレミア投資法人	142	51,262,000	
フロンティア不動産投資法人	196	134,848,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	204	113,220,000	
阪急リート投資法人	86	35,174,000	
産業ファンド投資法人	80	27,560,000	
森トラスト総合リート投資法人	245	185,220,000	
森ヒルズリート投資法人	234	60,840,000	
積水ハウス・S I 投資法人	116	32,132,000	
大和証券オフィス投資法人	400	91,280,000	
東急リアル・エステート投資法人	171	80,541,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	158	80,422,000	
日本コマース投資法人	260	23,738,000	
日本ビルファンド投資法人	548	454,840,000	
日本プライムリアルティ投資法人	723	146,913,600	
日本ホテルファンド投資法人	43	10,866,100	
日本リテールファンド投資法人	1,708	220,502,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	150	103,050,000	
日本賃貸住宅投資法人	1,345	35,615,600	
福岡リート投資法人	108	57,024,000	
平和不動産リート投資法人	703	31,213,200	
野村不動産オフィスファンド投資法人	308	158,004,000	
野村不動産レジデンシャル投資法人	127	51,308,000	
合計	11,848	3,291,249,760	

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。

「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,404,270	38,932,553
コール・ローン	25,876,492	27,241,904
投資証券	2,284,363,521	5,526,185,356

派生商品評価勘定		17,315
未収入金	10,003	84,314
未収配当金	6,892,690	12,420,688
未収利息	58	47
流動資産合計	2,330,547,034	5,604,882,177
資産合計	2,330,547,034	5,604,882,177
負債の部		
流動負債		
未払金		21,722,873
未払解約金	5,414	211,024
流動負債合計	5,414	21,933,897
負債合計	5,414	21,933,897
純資産の部		
元本等		
元本	3,760,454,998	7,960,298,789
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,429,913,378	2,377,350,509
元本等合計	2,330,541,620	5,582,948,280
純資産合計	2,330,541,620	5,582,948,280
負債純資産合計	2,330,547,034	5,604,882,177

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成20年11月11日 至 平成21年11月10日)	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p>	<p>(1) 投資証券 同左</p> <p>(2) 外国為替予約 同左</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年11月10日現在)	(平成22年11月10日現在)
1. 期首元本額	2,260,529,061円	3,760,454,998円
期中追加設定元本額	2,983,323,577円	6,041,142,925円
期中一部解約元本額	1,483,397,640円	1,841,299,134円
期末元本額	3,760,454,998円	7,960,298,789円
元本額の内訳		
住信 ワールド・ファイブインカム・ファンド （毎月決算型）		2,772,025,123円
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	317,332,522円	425,272,546円
SBI 資産設計オープン（分配型）	24,776,862円	21,626,290円
STAM グローバルREITインデックス・オープン	2,977,767,847円	3,665,991,902円
すみしん DC グローバルREIT インデックス・オープン	967,042円	
すみしん DCマルチアセット ファンド	150,536円	347,668円
STAM グローバルリートインデックス・オープン （SMA専用）	439,460,189円	1,075,035,260円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 1,429,913,378円下回っております。	純資産額は、元本を 2,377,350,509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	3,760,454,998口	7,960,298,789口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含みます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年11月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

2. 時価の算定方法

a. 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

b. 外国為替予約

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

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

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

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

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（有価証券に関する注記）

（平成21年11月10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）
投資証券	2,284,363,521	291,187,772
合 計	2,284,363,521	291,187,772

（平成22年11月10日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	841,590,626
合 計	841,590,626

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年11月11日
至 平成21年11月10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、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。

取引の時価等に関する事項

（平成21年11月10日現在）

該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

区分	種類	（平成22年11月10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	8,160,900		8,177,000	16,100
	売建 ニュージーランドドル	5,705,415		5,704,200	1,215
	合計	13,866,315		13,881,200	17,315

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

（自平成20年11月11日 至平成21年11月10日）	（自平成21年11月11日 至平成22年11月10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いません。また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っていません。	同左

(1口当たり情報)

（平成21年11月10日現在）	（平成22年11月10日現在）
1口当たり純資産額 = 0.6197円	1口当たり純資産額 = 0.7013円

(3) 附属明細表（平成22年11月10日現在）

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	5,495.00	107,372.30	
		AGREE REALTY CORP	1,265.00	33,105.05	
		ALEXANDER'S INC	280.00	114,405.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,458.00	533,694.48	
		AMB PROPERTY CORP	23,031.00	673,887.06	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	9,096.00	295,074.24	
		APARTMENT INVEST & MGMT	16,018.00	396,285.32	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,661.00	55,534.41	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	5,498.00	78,181.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,655.00	1,236,012.75	
		BIOMED REALTY TRUST INC	17,539.00	317,280.51	
		BOSTON PROPERTIES	19,071.00	1,628,091.27	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	18,066.00	208,842.96	
		BRE PROPERTIES-CL A	8,763.00	380,401.83	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	9,167.00	460,733.42	
		CAPLEASE INC	8,353.00	52,206.25	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	18,832.00	323,345.44	
		CEDAR SHOPPING CENTERS INC	6,799.00	43,989.53	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,356.00	44,198.56	
		COGDELL SPENCER INC	7,202.00	45,444.62	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	9,718.00	175,604.26	
		COMMONWEALTH REIT	9,867.00	252,101.85	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	9,004.00	314,599.76	
		COUSINS PROPERTIES INC	14,048.00	106,624.32	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	28,837.00	141,301.30	
		DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY	26,262.00	346,395.78	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	21,155.00	215,992.55	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,948.00	635,872.56	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	16,728.00	290,063.52	
		DUKE REALTY CORP	34,430.00	424,177.60	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	8,110.00	187,503.20	
		EASTGROUP PROPERTIES, INC	3,679.00	148,999.50	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	8,284.00	63,455.44	
		ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	6,342.00	304,796.52	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,185.00	242,981.10	
		EQUITY ONE INC	5,696.00	102,414.08	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	38,794.00	1,878,405.48	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,151.00	456,734.53	
		EXCEL TRUST INC	2,282.00	27,361.18	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,968.00	198,429.44	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,406.00	669,033.54			
FELCOR LODGING TRUST INC	12,442.00	76,518.30			
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9,218.00	70,148.98			

FIRST POTOMAC REALTY TRUST	5,193.00	82,412.91	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	9,456.00	119,618.40	
GETTY REALTY CORP	3,114.00	90,804.24	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,225.00	22,650.25	
GLIMCHER REALTY TRUST	11,351.00	90,013.43	
HCP INC	42,436.00	1,446,643.24	
HEALTH CARE REIT INC	18,151.00	872,337.06	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,710.00	204,162.40	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	20,098.00	120,186.04	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,769.00	317,590.19	
HOME PROPERTIES INC	5,114.00	272,167.08	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	16,887.00	374,553.66	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	90,103.00	1,443,450.06	
INLAND REAL ESTATE CORP	10,191.00	89,680.80	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10,630.00	94,607.00	
KILROY REALTY CORPORATION	7,141.00	239,366.32	
KIMCO REALTY CORP	55,542.00	971,429.58	
KITE REALTY GROUP TRUST	9,317.00	48,075.72	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	9,520.00	221,340.00	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	15,758.00	132,209.62	
LIBERTY PROPERTY TRUST	15,568.00	517,480.32	
LTC PROPERTIES INC	3,531.00	98,161.80	
MACERICH CO/THE	17,806.00	823,883.62	
MACK-CALI REALTY CORP	10,830.00	356,631.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	15,178.00	168,627.58	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,474.00	272,063.94	
MISSION WEST PROPERTIES	2,744.00	18,220.16	
MONMOUTH REIT -CL A	4,683.00	39,103.05	
MPG OFFICE TRUST INC	4,896.00	14,051.52	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,373.00	304,227.75	
NATIONWIDE HEALTH PPTYS	16,938.00	662,614.56	
NATL HEALTH INVESTORS INC	3,774.00	176,057.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,928.00	292,431.36	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,168.00	19,435.52	
PARKWAY PROPERTIES INC	3,151.00	51,298.28	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,460.00	104,559.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	7,571.00	111,520.83	
POST PROPERTIES	6,664.00	208,316.64	
PROLOGIS	76,203.00	1,073,700.27	
PS BUSINESS PARKS INC	2,551.00	144,003.95	
PUBLIC STORAGE	19,091.00	1,932,772.84	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	5,539.00	64,861.69	
REALTY INCOME CORP	15,039.00	514,183.41	
REGENCY CENTERS CORP	11,203.00	477,135.77	
SAUL CENTERS INC	1,647.00	70,804.53	

	SENIOR HOUSING PROP TRUST	17,438.00	420,604.56	
	SIMON PROPERTY GROUP	40,075.00	4,054,788.50	
	SL GREEN REALTY CORP	10,705.00	700,428.15	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	3,764.00	150,334.16	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	20,704.00	98,136.96	
	SUN COMMUNITIES INC	2,458.00	83,473.68	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	13,439.00	135,733.90	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	5,521.00	269,811.27	
	TAUBMAN CENTERS INC	7,459.00	356,465.61	
	TERRENO REALTY CORP	999.00	18,161.82	
	U STORE IT TR COM	10,941.00	98,140.77	
	UDR INC	24,551.00	551,415.46	
	UMH PROPERTIES INC	1,554.00	16,612.26	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,782.00	67,003.20	
	URSTADT BIDDLE - CL A	3,162.00	62,765.70	
	VENTAS INC	21,498.00	1,151,217.90	
	VORNADO REALTY TRUST	22,204.00	1,875,793.92	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	8,286.00	260,263.26	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	16,476.00	408,440.04	
	WINTHROP REALTY TRUST	3,006.00	39,288.42	
小計		1,382,897.00	40,945,926.48 (3,348,557,867)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,811.00	62,460.42	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,332.00	69,742.56	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,514.00	154,651.14	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	6,530.00	161,291.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,611.00	77,787.57	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	4,447.00	144,349.62	
	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	9,550.00	88,337.50	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4,145.00	89,076.05	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,508.00	31,249.68	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	2,810.00	87,953.00	
	EXTENDICARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,678.00	56,723.22	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,675.00	198,821.25	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	6,186.00	43,920.60	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,105.00	58,126.80	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	1,836.00	49,516.92	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,693.00	19,554.15	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	4,585.00	88,398.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,866.00	384,038.82	
	WHITEROCK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,184.00	22,496.00	
小計		98,066.00	1,888,495.10 (153,421,341)	

オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	178,289.00	76,664.27	
	ALE PROPERTY GROUP	19,614.00	39,816.42	
	ARDENT LEISURE GROUP	44,805.00	48,389.40	
	ASPEN GROUP	80,418.00	39,002.73	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	74,879.00	26,207.65	
	BUNNINGS WAREHOUSE PROPERTY	44,894.00	83,727.31	
	CENTRO RETAIL GROUP	66,129.00	13,556.44	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	313,359.00	562,479.40	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	69,484.00	35,784.26	
	CHARTER HALL GROUP	123,815.00	66,860.10	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	56,072.00	159,244.48	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	36,188.00	107,840.24	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	268,385.00	242,888.42	
	CROMWELL GROUP	96,450.00	69,926.25	
	DEXUS PROPERTY GROUP	643,358.00	521,119.98	
	EDT RETAIL TRUST	357,312.00	26,083.77	
	GOODMAN GROUP	871,766.00	557,930.24	
	GPT GROUP	234,189.00	653,387.31	
	ING INDUSTRIAL FUND	342,618.00	179,874.45	
	ING OFFICE FUND	386,284.00	235,633.24	
MIRVAC GROUP	467,421.00	600,635.98		
STOCKLAND	326,143.00	1,216,513.39		
VALAD PROPERTY GROUP	16,215.00	20,268.75		
WESTFIELD GROUP	288,825.00	3,480,341.25		
小計		5,406,912.00	9,064,175.73 (744,984,603)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	15,823.00	52,690.59	
	BRITISH LAND CO PLC	120,343.00	614,952.73	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	63,488.00	247,920.64	
	DERWENT LONDON PLC	11,110.00	167,205.50	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	42,650.00	148,166.10	
	HAMMERSON PLC	96,839.00	416,117.18	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	51,853.00	20,741.20	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	104,545.00	728,155.92	
	METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	27,680.00	28,233.60	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	9,131.00	29,538.78	
	SEGRO PLC	101,486.00	307,502.58	
	SHAFTESBURY PLC	31,079.00	136,126.02	
	WORKSPACE GROUP PLC	124,509.00	29,570.88	
小計		800,536.00	2,926,921.72 (383,456,014)	

香港ドル	CHAMPION REIT	319,000.00	1,486,540.00	
	FORTUNE REAL ESTATE INVESTME	135,000.00	549,450.00	
	GZI REAL ESTATE INVMNT TRUST	99,000.00	405,900.00	
	LINK REIT	303,500.00	7,572,325.00	
	PROSPERITY REIT	151,000.00	261,230.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	123,000.00	255,840.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	157,000.00	339,120.00	
小計		1,287,500.00	10,870,405.00 (114,682,772)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	238,000.00	53,550.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	206,266.00	443,471.90	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	52,000.00	65,000.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	128,000.00	70,400.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	258,000.00	392,160.00	
	CAPITAMALL TRUST	318,500.00	637,000.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	54,000.00	70,200.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	82,000.00	177,120.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	59,000.00	88,500.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	338,000.00	57,460.00	
	K-REIT ASIA	47,000.00	66,740.00	
	LIPPO-MAPLETREE INDONESIA RETAIL TRUST	81,000.00	44,550.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	149,920.00	139,425.60	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	51,000.00	86,700.00	
	SAIZEN REIT	138,800.00	21,514.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	189,000.00	118,125.00	
SUNTEC REIT	250,000.00	385,000.00		
小計		2,640,486.00	2,916,916.50 (185,049,182)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY TRUST	76,999.00	60,829.21	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	104,195.00	102,111.10	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	133,108.00	137,101.24	
小計		314,302.00	300,041.55 (19,025,634)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	9,532.00	71,404.21	
小計		9,532.00	71,404.21 (1,601,596)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	3,719.00	36,632.15	
	BEFIMMO S.C.A.	1,860.00	121,365.00	
	COFINIMMO	1,848.00	184,800.00	
	CORIO NV	12,455.00	610,108.17	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE	2,202.00	13,234.02	
	EUROCOMMERCIAL	4,890.00	157,311.30	
	FONCIERE DES REGIONS	4,400.00	353,232.00	
	GECINA SA	3,575.00	309,595.00	
	ICADE	3,102.00	244,871.88	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	19,893.00	28,844.85	
	INTERVEST OFFICES	911.00	20,898.34	

	KLEPIERRE	12,848.00	351,778.24	
	MERCIALYS	6,137.00	171,805.31	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	4,803.00	72,045.00	
	SILIC	1,150.00	107,640.00	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	794.00	47,243.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,496.00	1,873,775.20	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL	2,693.00	31,548.49	
	VASTNED RETAIL NV	2,491.00	120,651.58	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,164.00	44,371.68	
	WERELDHAVE NV	2,926.00	211,608.32	
	小計	106,357.00	5,113,359.53 (575,406,347)	
合計			(5,526,185,356)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 108銘柄	100.0%	60.6%
カナダドル	投資証券 19銘柄	100.0%	2.8%
オーストラリアドル	投資証券 24銘柄	100.0%	13.5%
イギリスポンド	投資証券 13銘柄	100.0%	6.9%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 17銘柄	100.0%	3.4%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.03%
ユーロ	投資証券 21銘柄	100.0%	10.4%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成22年11月30日現在)

資産総額	2,523,797,297 円
負債総額	1,933,729 円
純資産総額（ - ）	2,521,863,568 円
発行済口数	3,242,591,732 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7777 円

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	162,057,676,175 円
負債総額	2,007,205,012 円
純資産総額（ - ）	160,050,471,163 円
発行済口数	133,590,656,588 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1981 円

住信 国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	132,483,416,129 円
負債総額	46,290,188 円
純資産総額（ - ）	132,437,125,941 円
発行済口数	200,780,113,834 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6596 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	242,416,201,386 円
負債総額	860,696,941 円
純資産総額（ - ）	241,555,504,445 円
発行済口数	138,525,983,718 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7438 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	121,778,926,862 円
負債総額	37,043,781 円
純資産総額（ - ）	121,741,883,081 円

発行済口数	137,455,958,463 口
1口当たり純資産額(/)	0.8857 円

住信 J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	3,658,715,970 円
負債総額	63,647,496 円
純資産総額(-)	3,595,068,474 円
発行済口数	5,124,980,319 口
1口当たり純資産額(/)	0.7015 円

住信 グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	5,638,562,016 円
負債総額	52,416,975 円
純資産総額(-)	5,586,145,041 円
発行済口数	8,021,435,315 口
1口当たり純資産額(/)	0.6964 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(イ) 名義書換

該当事項はありません。

(ロ) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(ハ) 譲渡制限

該当事項はありません。

(二) 振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合

には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みません。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(イ) 資本金の額

平成22年11月30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年間における資本金の額の増減	なし

(ロ) 会社の機構

経営体制

経営の意思決定機関として、取締役会をおきます。3名以上の取締役が、株主総会で選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって選任します。取締役の選任については、累積投票にはよりません。

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

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

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

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

運用体制

[PLAN(計画)]

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

[DO(実行)]

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

売買の執行は、運用部署から独立したトレーディング部署が行います。

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

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに、金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成22年11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は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	156	1,406,137
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	156	1,406,137

3【委託会社等の経理状況】

(イ) 委託者の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、前事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、当事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「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、財務諸表および中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）及び当事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表について、あずさ監査法人による監査を受けております。また、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、第25期事業年度の中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人の中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成21年3月31日現在）	当事業年度 （平成22年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		

現金及び預金	2	4,620,293	2	5,642,056
有価証券		324,008		-
前払金		-		6,819
前払費用		33,583		35,081
未収委託者報酬		762,027		942,664
未収運用受託報酬		37,916		48,083
未収還付法人税等		108,554		-
未収消費税等		13,438		-
繰延税金資産		26,084		44,119
その他		4,235		129
流動資産合計		5,930,144		6,718,954
固定資産				
有形固定資産				
建物		63,983		49,765
器具備品		40,445		26,485
有形固定資産合計	1	104,428	1	76,250
無形固定資産				
ソフトウェア		83,031		95,682
その他無形固定資産		146		126
無形固定資産合計		83,178		95,808
投資その他の資産				
投資有価証券		294,353		245,516
敷金・保証金		238,033		238,033
長期前払費用		225		449
繰延税金資産		55,356		55,356
その他の投資		255		225
投資その他の資産合計		588,223		539,579
固定資産合計		775,830		711,639
資産合計		6,705,974		7,430,593

(単位：千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,703	16,838
未払金	465,995	520,453

未払収益分配金		130		130
未払手数料	2	361,950	2	454,590
その他未払金		103,914		65,733
未払費用	2	85,253	2	126,959
未払法人税等		-		174,433
未払消費税等		-		11,758
賞与引当金		79,979		70,599
流動負債合計		648,932		921,042
固定負債				
退職給付引当金		91,962		122,901
固定負債合計		91,962		122,901
負債合計		740,894		1,043,943
純資産の部				
株主資本				
資本金		300,000		300,000
利益剰余金				
利益準備金		47,500		50,500
その他利益剰余金				
別途積立金		4,100,000		5,100,000
繰越利益剰余金		1,542,542		942,449
利益剰余金合計		5,690,042		6,092,949
株主資本合計		5,990,042		6,392,949
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		24,962		6,299
評価・換算差額等合計		24,962		6,299
純資産合計		5,965,080		6,386,650
負債・純資産合計		6,705,974		7,430,593

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,373,528	8,637,673
運用受託報酬	99,489	108,227
営業収益合計	9,473,018	8,745,901

営業費用				
支払手数料	1	4,753,041	1	4,414,750
広告宣伝費		227,750		123,104
公告費		2,934		2,520
受益証券発行費		-		95
調査費		881,688		835,300
調査費		80,845		85,751
委託調査費		798,694		747,629
図書費		2,148		1,918
営業雑経費		650,350		650,397
通信費		10,965		10,735
印刷費		177,337		164,695
協会費		10,450		9,726
諸会費		586		594
情報機器関連費		400,645		429,265
その他営業雑経費		50,366		35,380
営業費用合計		6,515,764		6,026,169
一般管理費				
給料		1,346,925		1,313,847
役員報酬		39,900		34,470
給料・手当		1,127,586		1,098,871
賞与		179,439		180,505
退職給付費用		65,654		52,327
役員退職慰労金		-		1,980
福利費		149,509		148,136
交際費		1,777		1,771
旅費交通費		54,749		43,688
租税公課		16,216		17,962
不動産賃借料		238,033		238,033
寄付金		3,960		3,745
減価償却費		60,600		58,878
諸経費		158,896		101,459
一般管理費合計		2,096,324		1,981,829
営業利益		860,928		737,901

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		2,532		1,046
有価証券利息		1,544		257
受取利息	1	12,425	1	6,564
投資有価証券売却益		291		1,179
その他		5,943		3,344
営業外収益合計		22,737		12,393
営業外費用				
支払保証料	1	64		-
投資有価証券売却損		2,275		12,836
投資有価証券評価損		637		-
固定資産除却損	2	24	2	1,136
その他		1,759		820
営業外費用合計		4,762		14,794
経常利益		878,903		735,501
税引前当期純利益		878,903		735,501
法人税、住民税及び事業税		328,438		333,431
法人税等調整額		29,609		30,837
法人税等合計		358,047		302,594
当期純利益		520,856		432,906

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
株主資本				
資本金				
前期末残高		300,000		300,000
当期変動額				
当期変動額合計		-		-
当期末残高		300,000		300,000
利益剰余金				
利益準備金				
前期末残高		44,500		47,500
当期変動額				

剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	47,500	50,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	3,100,000	4,100,000
当期変動額		
別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	1,000,000	1,000,000
当期末残高	4,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	2,054,686	1,542,542
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	520,856	432,906
別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	512,143	600,093
当期末残高	1,542,542	942,449
利益剰余金合計		
前期末残高	5,199,186	5,690,042
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,690,042	6,092,949
株主資本合計		
前期末残高	5,499,186	5,990,042
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,990,042	6,392,949

(単位：千円)

前事業年度	当事業年度
(自 平成20年4月1日	(自 平成21年4月1日
至 平成21年3月31日)	至 平成22年3月31日)

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金

前期末残高	2,238	24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	22,724	18,662
当期変動額合計	22,724	18,662
当期末残高	24,962	6,299

評価・換算差額等合計

前期末残高	2,238	24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	22,724	18,662
当期変動額合計	22,724	18,662
当期末残高	24,962	6,299

純資産合計

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

重要な会計方針

期別	前事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
項目		
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>	<p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>同 左</p> <p>時価のないもの</p> <p>同 左</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。</p>	<p>有形固定資産 同 左</p> <p>無形固定資産 同 左</p>

	ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。	
3 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(1) 賞与引当金 同 左</p> <p>(2) 退職給付引当金 同 左</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同 左

会計方針の変更

前事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。これによる損益に与える影響はありません。	-

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)												
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <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	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table> <tr> <td>建 物</td> <td>38,352千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>96,447千円</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>134,799千円</td> </tr> </table>	建 物	38,352千円	器具備品	96,447千円	計	134,799千円
建 物	24,134千円												
器具備品	93,840千円												
計	117,974千円												
建 物	38,352千円												
器具備品	96,447千円												
計	134,799千円												
<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table> <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	<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>預金</td> <td>3,498,856千円</td> </tr> <tr> <td>未払手数料</td> <td>353,462千円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td>119,557千円</td> </tr> </table>	預金	3,498,856千円	未払手数料	353,462千円	未払費用	119,557千円
預金	2,832,577千円												
未払手数料	305,246千円												
未払費用	80,084千円												
預金	3,498,856千円												
未払手数料	353,462千円												
未払費用	119,557千円												

(損益計算書関係)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 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	1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料 4,065,257千円 受取利息 1,030千円
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	2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。 器具備品 1,136千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当期末
普通株式（株）	6,000	-	-	6,000

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

4. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当期末

普通株式（株）	6,000	-	-	6,000
---------	-------	---	---	-------

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

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

4. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リ - ス取引関係)

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

(金融商品関係)

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

(追加情報)

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

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払を実行できなくなるリスク)の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	5,642,056	5,642,056	-
(2)未収委託者報酬	942,664	942,664	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	46,016	46,016	-
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

前事業年度(平成21年3月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

(単位:千円)

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

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
16,166	291	2,275

3. 時価評価されていない主な有価証券

(単位:千円)

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

4. その他有価証券のうち満期があるもの

該当事項はありません。

当事業年度(平成22年3月31日現在)

1. その他有価証券

(単位:千円)

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

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

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

（単位：千円）

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

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <p>退職給付債務 91,962千円</p> <p>退職給付引当金 91,962千円</p> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <p>退職給付債務 122,901千円</p> <p>退職給付引当金 122,901千円</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p>

退職給付費用 65,654千円	退職給付費用 52,327千円
(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。	(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。	(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。
4. 退職給付債務等の計算基礎	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。	同左

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	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)	(繰延税金資産)
賞与引当金損金算入限度超過額 32,543千円	未払事業税 15,392千円
退職給付引当金損金算入限度超過額 37,419千円	賞与引当金損金算入限度超過額 28,726千円
有価証券評価差額 17,125千円	退職給付引当金損金算入限度超過額 50,008千円
その他 811千円	有価証券評価差額 4,321千円
繰延税金資産 合計 87,900千円	その他 1,025千円
	繰延税金資産 合計 99,475千円
(繰延税金負債)	(繰延税金負債)
未収還付事業税 6,459千円	-
繰延税金負債 合計 6,459千円	
差引 繰延税金資産の純額 81,441千円	
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	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21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

(追加情報)

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

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	住友信託 銀行(株)	大阪市 中央区	287,537	信託業務 及び銀行 業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	4,504,556	未払 手数料	305,246
							投資助言 費用の支払	604,558	その他 未払金	223
									未払費用	80,084

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	----------------	-----	-----------------------	---------------	--------------------	-------------------	-----------	--------------	----	--------------

親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	4,065,257	未払 手数料	353,462
							投資助言 費用の支払	609,879	未払費用	119,557

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社(東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	994,180円05銭	1株当たり純資産額	1,064,441円67銭
1株当たり当期純利益	86,809円36銭	1株当たり当期純利益	72,151円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益	520,856千円	432,906千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	520,856千円	432,906千円
期中平均株式数	6,000株	6,000株

（重要な後発事象）

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第25期中間会計期間末

(平成22年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		5,862,811
未収委託者報酬		951,323
未収運用受託報酬		51,225
繰延税金資産		46,289
その他		46,185
流動資産合計		6,957,834

固定資産

有形固定資産

建物		44,283
器具備品		22,194
有形固定資産合計	1	66,478

無形固定資産

91,918

投資その他の資産

投資有価証券		232,187
敷金・保証金		229,854
繰延税金資産		70,926
その他		696
投資その他の資産合計		533,665

固定資産合計

692,061

資産合計

7,649,896

負債の部

流動負債

未払金		491,186
未払費用		145,186
未払法人税等		173,027
賞与引当金		78,920

その他	2	36,668
流動負債合計		924,989
固定負債		
退職給付引当金		146,992
固定負債合計		146,992
負債合計		1,071,981

(単位：千円)

第25期中間会計期間末

(平成22年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
利益剰余金		
利益準備金		53,500
その他利益剰余金		
別途積立金		5,100,000
繰越利益剰余金		1,134,728
利益剰余金合計		6,288,228
株主資本合計		6,588,228
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		10,312
評価・換算差額等合計		10,312
純資産合計		6,577,915
負債純資産合計		7,649,896

中間損益計算書

(単位：千円)

第25期中間会計期間

(自 平成22年4月1日

至 平成22年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		4,294,261
運用受託報酬		58,408
営業収益合計		4,352,669
営業費用		2,960,129
一般管理費	1	1,023,511
営業利益		369,027

営業外収益	2	14,640
営業外費用		637
経常利益		383,030
特別損失		6,776
税引前中間純利益		376,253
法人税、住民税及び事業税		165,963
法人税等調整額		14,987
法人税等合計		150,975
中間純利益		225,278

中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第25期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
株主資本		
資本金		
前期末残高		300,000
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		300,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高		50,500
当中間期変動額		
剰余金の配当に伴う積立		3,000
当中間期変動額合計		3,000
当中間期末残高		53,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高		5,100,000
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高		942,449
当中間期変動額		
剰余金の配当		33,000
中間純利益		225,278
当中間期変動額合計		192,278

当中間期末残高	1,134,728
利益剰余金合計	
前期末残高	6,092,949
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	225,278
当中間期変動額合計	195,278
当中間期末残高	6,288,228
株主資本合計	
前期末残高	6,392,949
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	225,278
当中間期変動額合計	195,278
当中間期末残高	6,588,228
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	6,299
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,012
当中間期変動額合計	4,012
当中間期末残高	10,312
評価・換算差額等合計	
前期末残高	6,299
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,012
当中間期変動額合計	4,012
当中間期末残高	10,312
純資産合計	
前期末残高	6,386,650
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	225,278
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,012
当中間期変動額合計	191,265
当中間期末残高	6,577,915

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

第25期中間会計期間
（自 平成22年4月1日
至 平成22年9月30日）

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間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。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 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。

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、当中間会計期間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。

4. その他中間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。

会計方針の変更

第25期中間会計期間

（自 平成22年4月1日

至 平成22年9月30日）

当中間会計期間から「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成20年3月31日 企業会計基準第18号）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成20年3月31日 企業会計基準適用指針第21号）を適用しております。

これにより、営業利益、経常利益が1,402千円、税引前中間純利益が8,179千円減少しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第25期中間会計期間末 (平成22年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物	43,834千円
器具備品	102,921千円
計	146,755千円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第25期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	11,955千円
無形固定資産	14,200千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	11,412千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	6,000	-	-	6,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(リ - ス取引関係)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第25期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

金融商品の時価に関する事項

平成22年9月30日（当社の中間決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	5,862,811	5,862,811	-
(2)未収委託者報酬	951,323	951,323	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	32,687	32,687	-
(4)未払金	(491,186)	(491,186)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（有価証券関係）

第25期中間会計期間末（平成22年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	1,000	1,007	7

小計	1,000	1,007	7
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	49,075	31,680	17,395
小計	49,075	31,680	17,395
計	50,075	32,687	17,387

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

(デリバティブ取引関係)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

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

(関連情報)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

売上高

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第25期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第25期中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当中間会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成21年3月27日 企業会計基準第17号）及び「セグメント情報の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成20年3月21日 企業会計基準適用指針第20号）を適用しております。

（1株当たり情報）

第25期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,096,319円29銭
1株当たり中間純利益	37,546円42銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第25期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
中間純利益	225,278千円
普通株式に係る中間純利益	225,278千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	6,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- （イ）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- （ロ）運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- （ハ）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（ニ）およ

び（ホ）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

（ニ）委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

（ホ）前記（ハ）および（ニ）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（イ）委託者の定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会において株主の決議が必要です。

（ロ）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

住友信託銀行株式会社（受託者）

1) 資本金の額

平成22年9月末日現在 342,037百万円

2) 事業の内容

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

株式会社SBI証券（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成22年9月末日現在 47,937百万円

2) 事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（イ）受託者は、以下の業務を行います。

投資信託財産の保管・管理

投資信託財産の計算

投資信託財産に関する報告書の作成

その他前記の業務に付随する業務

（ロ）指定販売会社は、以下の業務を行います。

受益権の募集・販売の取扱い

追加設定の申込受付事務

受益者に対する収益分配金の再投資事務

受益者に対する一部解約等の事務

受益者に対する受益権の買取

受益者に対する一部解約金および償還金・収益分配金の支払事務

受益者に対する運用報告書の交付

その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

3【資本関係】

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

その他の前記関係法人と委託者との間に資本関係はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成22年9月末日現在）

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

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成22年12月3日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 石井 勝也
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（資産成長型）の平成21年11月11日から平成22年11月10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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成22年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月29日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 壁谷 惠嗣 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月14日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石 井 勝 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間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中間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、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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、当社が中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成21年12月4日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 壁谷 惠嗣 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（資産成長型）の平成20年11月11日から平成21年11月10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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成21年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月29日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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