

【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24年1月30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10兆円
【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」、「当ファンド」または「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】**

10兆円を上限とします。

**(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24年1月31日から平成25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

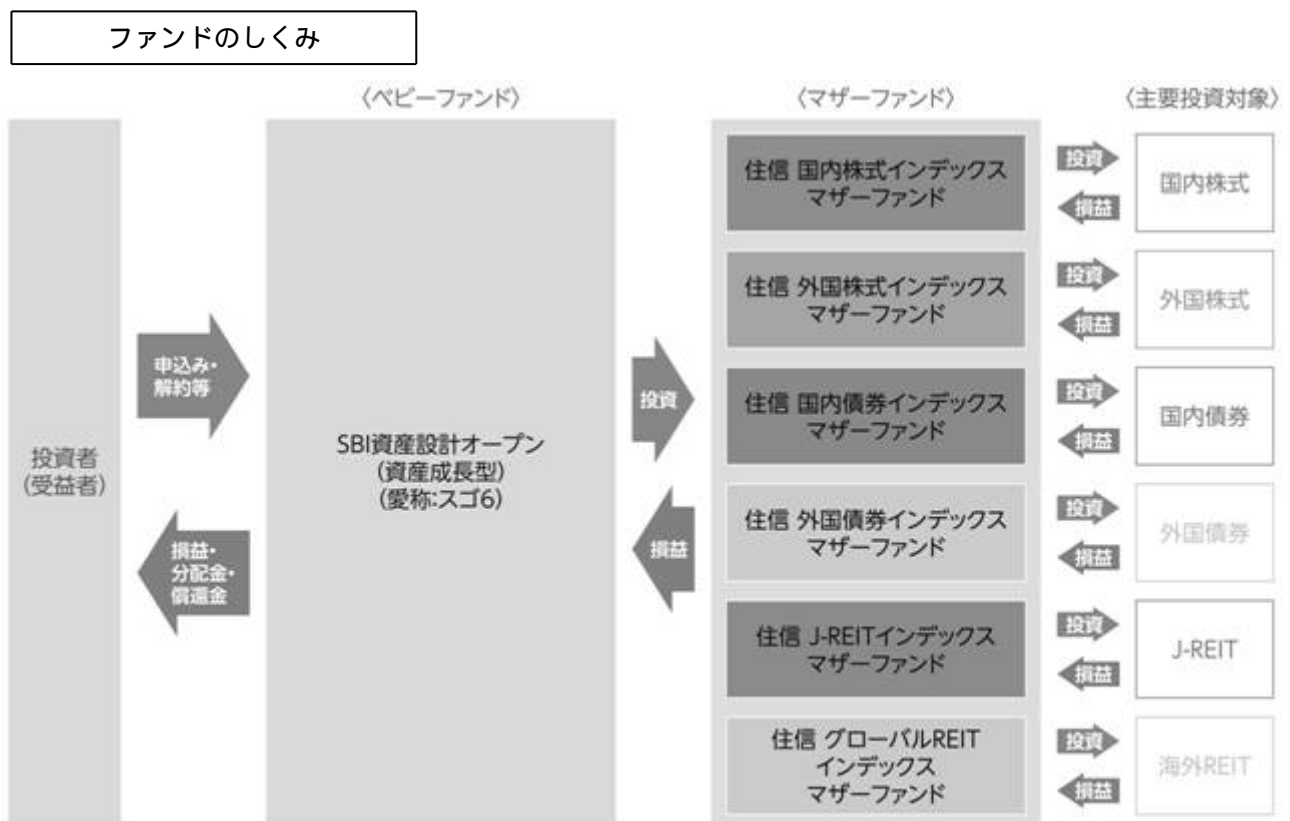
国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」ということがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

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。

- ・原則として、為替ヘッジは行いません。



※マザーファンド(「住信 J-REITインデックス マザーファンド」を除く)の運用にあたっては、企業年金の運用等で国内外から定評のある住友信託銀行からモデルポートフォリオの提示等の投資助言を受けます。

##### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX) <sup>*1</sup>
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース) <sup>*2</sup>
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) <sup>*3</sup>
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) <sup>*4</sup>
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み) <sup>*5</sup>
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) <sup>*6</sup>

\* 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銘柄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㈱）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㈱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㈱が有しています。なお、野村證券㈱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㈱東京証券取引所といいます。）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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱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。

㈱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。

㈱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㈱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、㈱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。

㈱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。

㈱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。

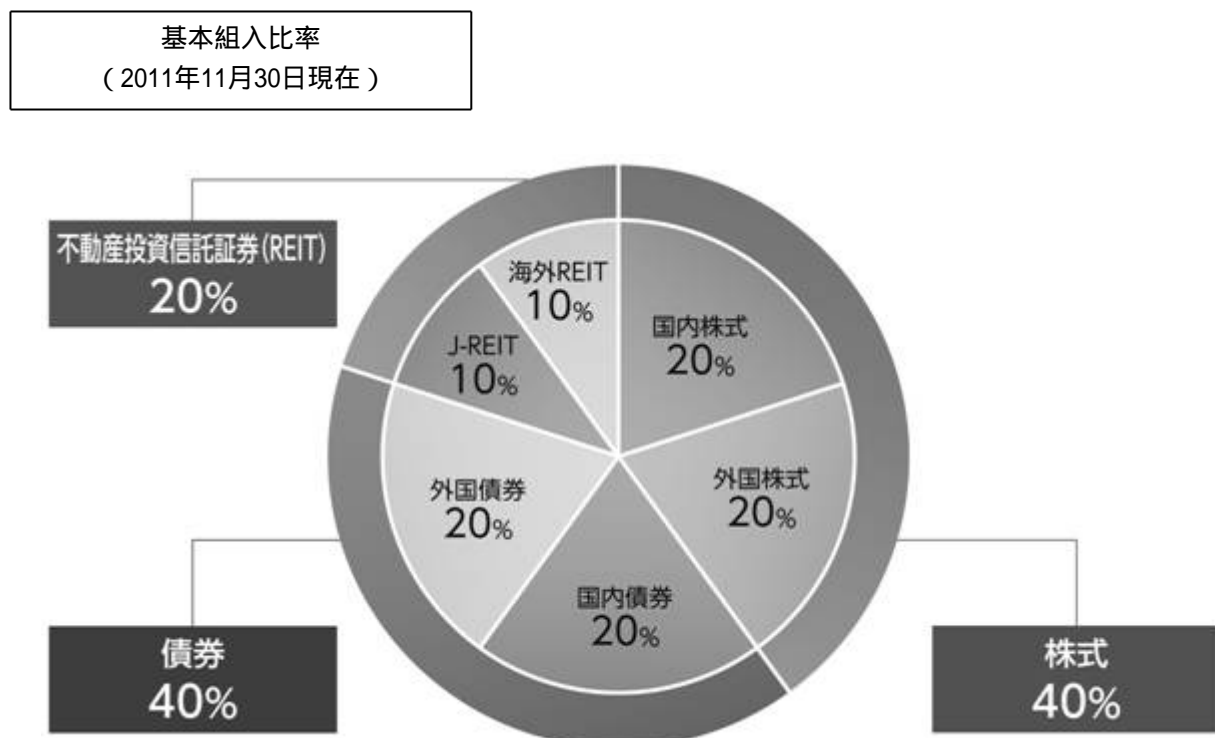
前記の項目に限らず、㈱東京証券取引所は本ファンドおよび「住信 J-REITインデックス マザーファンド」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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従する能力について、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。

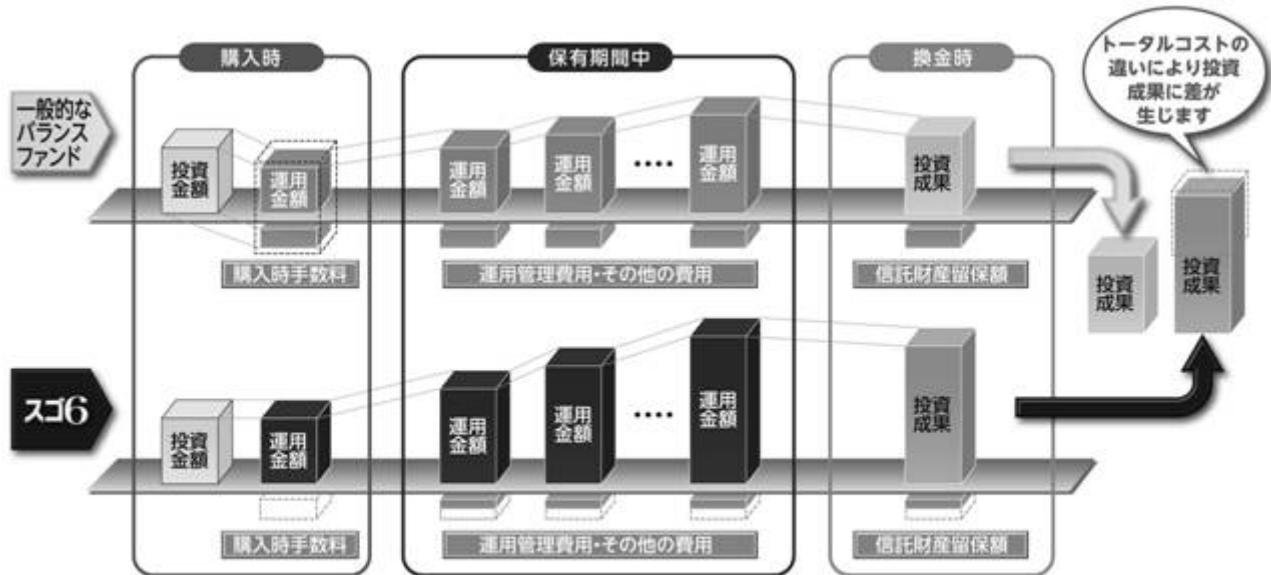


- ・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ・基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

## 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あるいは保証するものではありません。

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、前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

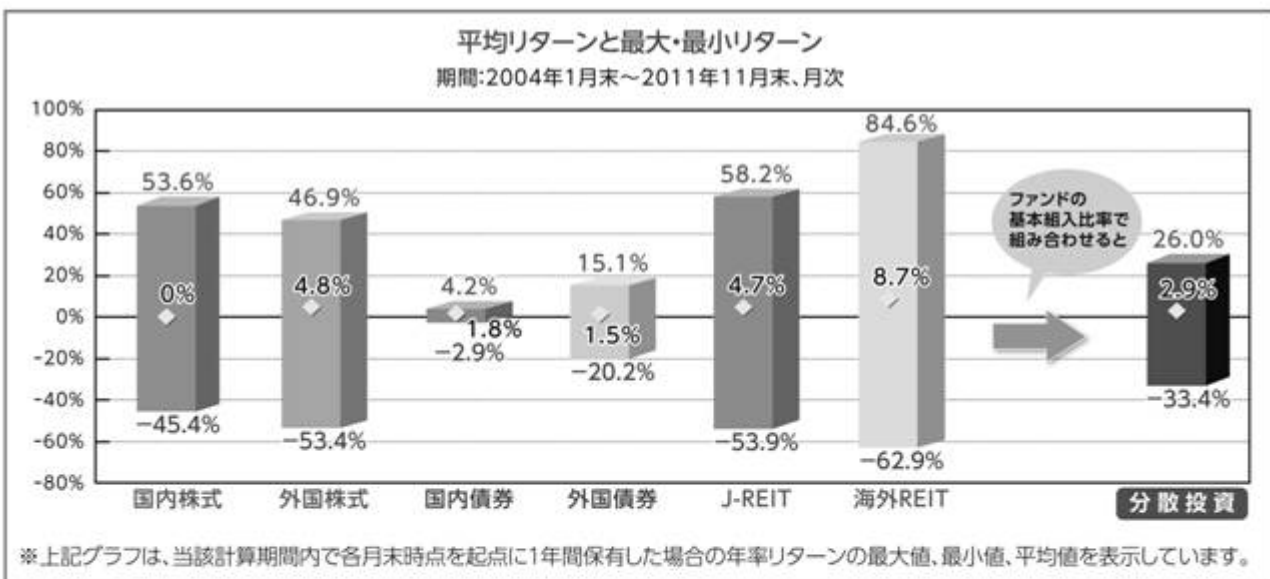
分散投資の魅力について



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	2011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 34.1%	国内債券 1.2%
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 5.8%	外国債券 0.6%
3位	外国株式 23.7%	国内債券 2.7%	<b>分散投資</b> <b>-31.7%</b>	<b>分散投資</b> <b>15.0%</b>	国内債券 2.4%	海外REIT -3.0%
4位	<b>分散投資</b> <b>14.4%</b>	<b>分散投資</b> <b>-1.5%</b>	国内株式 -40.6%	国内株式 7.6%	<b>分散投資</b> <b>2.0%</b>	<b>分散投資</b> <b>-7.1%</b>
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 1.0%	外国株式 -7.8%
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 -0.9%	国内株式 -17.1%
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 -12.7%	J-REIT -21.6%

※2011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、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、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あるいは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)	ファミリーファンド	あり ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本		
不動産投信	年4回	北米		
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券、不動 産投信)、(資産配分 固定型)))	年6回 (隔月)	欧州		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月)	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	年12回 (毎月)	オセアニア		
	年12回 (毎月)	中南米		
	日々	アフリカ		
	日々	中近東 (中東)		
	その他 ( )	エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

[区分における定義]

区分項目	該当区分	定義
------	------	----

投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、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・ファンズのものを行います。)、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行います。
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行います。
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行います。
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行います。
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行います。

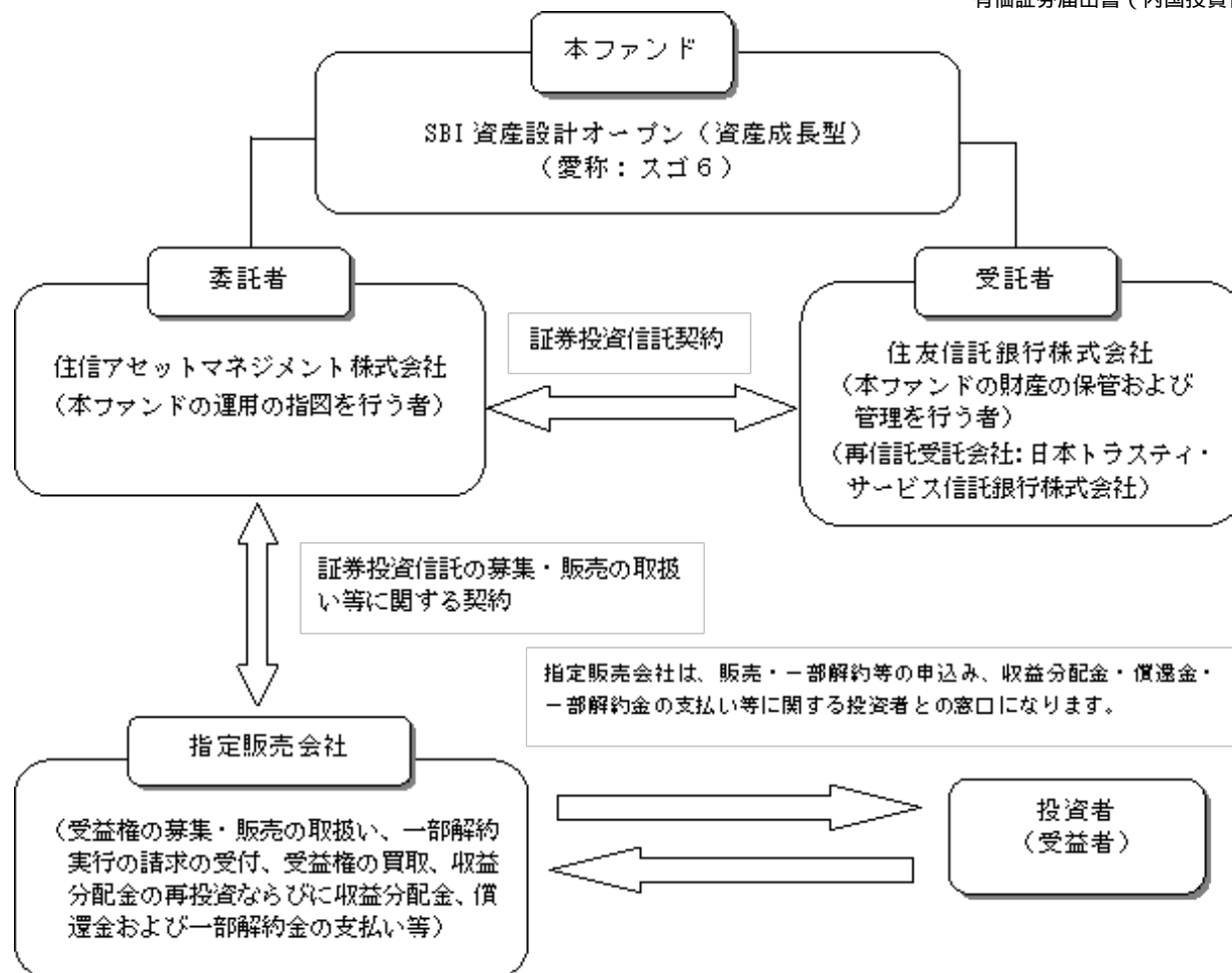
## (2) 【ファンドの沿革】

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23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23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号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに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。

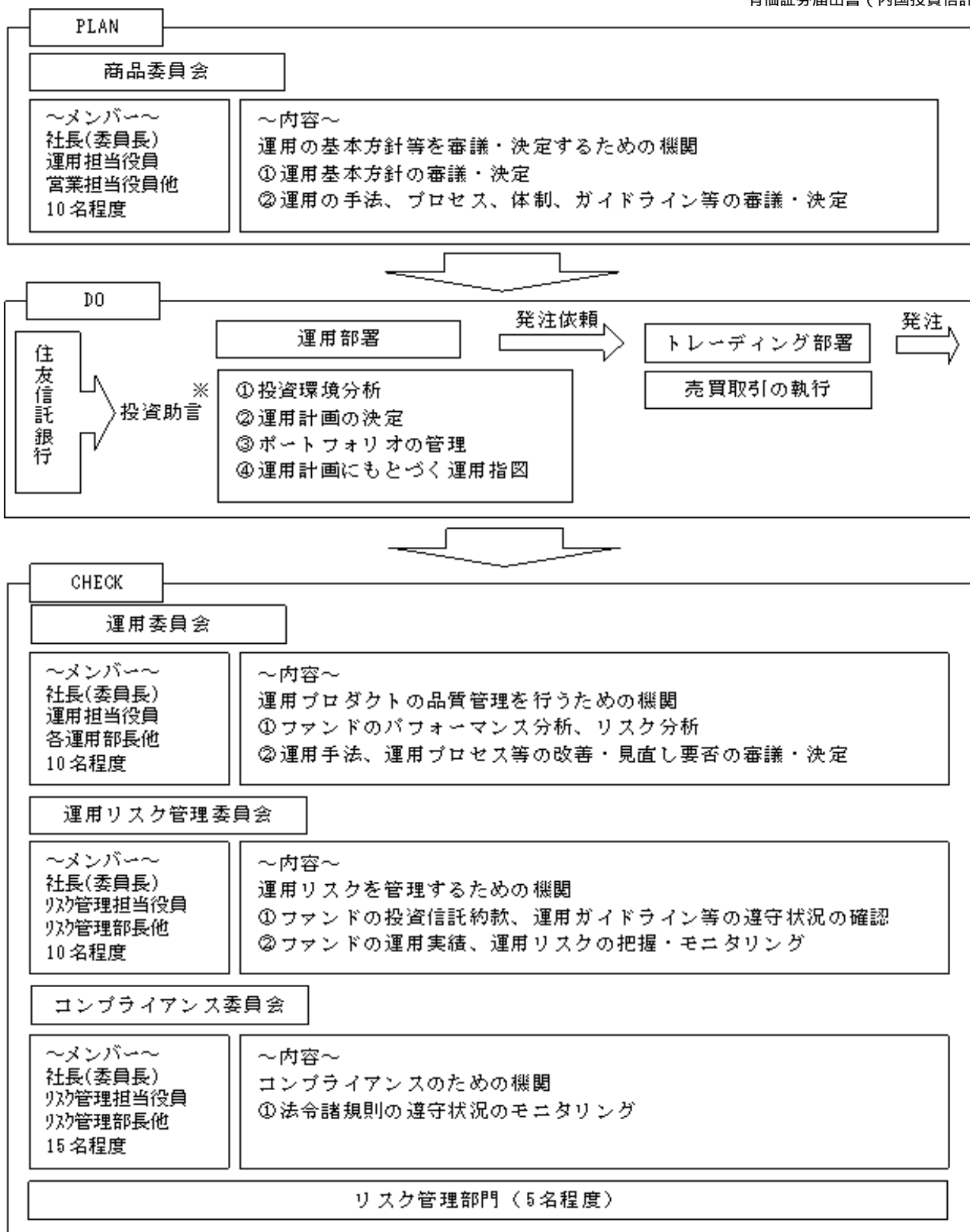
(八) 委託者は、信託金を、前記（ロ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

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。

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ことがあります。

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。

3) 分配金は信託財産から支払われるため、分配金支払い後の信託財産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。

本ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益や売買益等）を超えて分配を行う場合があります。分配金の水準は必ずしも当該計算期間の収益率を示すものではありません。またこの場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

#### （ロ）リスクの管理体制

##### 委託者におけるリスクマネジメント体制

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

ありません。

##### (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3) 【信託報酬等】

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23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25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26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25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用による申告不要の特例があります。詳しくは指定販売会社にお問い合わせください。

ご解約による換金時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告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25年12月31日までは、7%（所得税7%）、平成26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23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	571,598,318	17.71
住信 国内株式インデックス マザーファンド	日本	587,567,485	18.20

住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	624,962,265	19.36
住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	667,613,736	20.68
住信 J-REITインデックス マザーファンド	日本	352,580,031	10.92
住信 グローバルREITインデックス マザーファンド	日本	367,149,084	11.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		56,706,448	1.76
合計(純資産総額)		3,228,177,367	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23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	136,592,619,400	75.57
	ポーランド	98,773,000	0.05
	小計	136,691,392,400	75.63
地方債証券	日本	11,713,230,700	6.48
特殊債券	日本	17,446,001,869	9.65
	スウェーデン	96,011,000	0.05
	小計	17,542,012,869	9.71
社債券	日本	12,329,589,529	6.82
	アメリカ	493,725,000	0.27
	オーストラリア	399,961,000	0.22
	イギリス	191,165,000	0.11
	オランダ	101,540,000	0.06
	小計	13,515,980,529	7.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,278,891,195	0.71
合計(純資産総額)		180,741,507,693	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23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	110,514,145,150	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,136,836,957	1.90
合計(純資産総額)		112,650,982,107	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23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	82,313,502,698	40.24
	ドイツ	19,884,803,879	9.72
	フランス	18,812,504,854	9.20
	イギリス	17,881,682,308	8.74
	イタリア	16,491,956,212	8.06
	スペイン	8,098,355,879	3.96
	カナダ	5,845,207,992	2.86
	オランダ	5,184,972,353	2.53
	ベルギー	4,805,427,840	2.35
	オーストリア	3,321,698,694	1.62
	デンマーク	1,927,458,610	0.94
	メキシコ	1,726,734,966	0.84
	オーストラリア	1,686,196,000	0.82
	ポーランド	1,378,534,371	0.67
	アイルランド	1,302,689,744	0.64
	スウェーデン	1,230,219,506	0.60
	フィンランド	1,218,456,595	0.60
	マレーシア	1,043,658,458	0.51
	スイス	939,111,076	0.46
	シンガポール	776,453,772	0.38
ノルウェー	606,053,915	0.30	
小計	196,475,679,722	96.05	
特殊債券	オーストラリア	1,218,734,070	0.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,858,888,829	3.35
合計(純資産総額)		204,553,302,621	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23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	59,372,220,329	52.21
	イギリス	10,250,826,246	9.01
	カナダ	6,209,769,403	5.46
	スイス	4,735,587,095	4.16

	フランス	4,333,486,963	3.81
	オーストラリア	4,195,931,778	3.69
	ドイツ	4,139,405,041	3.64
	オランダ	2,586,708,940	2.27
	スペイン	1,680,044,625	1.48
	スウェーデン	1,453,436,183	1.28
	香港	1,181,996,163	1.04
	イタリア	1,148,011,534	1.01
	シンガポール	816,673,091	0.72
	アイルランド	685,196,575	0.60
	デンマーク	544,913,173	0.48
	アンティル	527,912,136	0.46
	バミューダ	503,979,367	0.44
	ベルギー	490,964,883	0.43
	フィンランド	471,296,584	0.41
	ノルウェー	391,899,262	0.34
	イスラエル	326,426,296	0.29
	ルクセンブルグ	236,688,733	0.21
	ジャージー	154,704,905	0.14
	オーストリア	122,572,087	0.11
	ポルトガル	107,041,516	0.09
	ケイマン島	87,708,436	0.08
	ニュージーランド	65,420,321	0.06
	マン島	39,055,065	0.03
	ギリシャ	35,505,623	0.03
	ガーンジー	30,518,674	0.03
	モーリシャス	20,488,655	0.02
	リベリア	20,225,255	0.02
	小計	106,966,614,937	94.06
投資信託受益証券	パナマ	80,999,039	0.07
	オーストラリア	22,453,977	0.02
	シンガポール	17,161,254	0.02
	小計	120,614,270	0.11
投資証券	アメリカ	1,226,746,987	1.08
	オーストラリア	304,536,463	0.27
	フランス	135,572,132	0.12
	イギリス	133,034,057	0.12
	香港	43,659,587	0.04

	シンガポール	30,116,801	0.03
	カナダ	17,648,272	0.02
	オランダ	14,375,644	0.01
	小計	1,905,689,943	1.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,733,639,726	4.16
合計(純資産総額)		113,726,558,876	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23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	4,751,884,390	97.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		110,817,029	2.28
合計(純資産総額)		4,862,701,419	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23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	4,585,600,678	63.80
	オーストラリア	884,972,513	12.31
	イギリス	441,378,179	6.14
	フランス	383,841,667	5.34
	シンガポール	253,234,946	3.52
	カナダ	226,086,327	3.15
	香港	136,895,205	1.90
	オランダ	108,578,130	1.51
	ベルギー	48,247,667	0.67
	ニュージーランド	29,686,413	0.41
	ドイツ	12,111,827	0.17
	イタリア	6,643,656	0.09
	イスラエル	2,183,293	0.03
	ギリシャ	924,678	0.01
小計	7,120,385,179	99.07	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		66,628,656	0.93
合計(純資産総額)		7,187,013,835	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23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	831,502,972	0.8259	686,806,421	0.8029	667,613,736	20.68
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	368,709,301	1.7145	632,157,759	1.6950	624,962,265	19.36
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	1,028,834,680	0.5724	588,970,049	0.5711	587,567,485	18.20
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	468,523,212	1.2256	574,265,187	1.2200	571,598,318	17.71
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	562,680,590	0.6760	380,376,828	0.6525	367,149,084	11.37
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	580,187,644	0.6123	355,276,992	0.6077	352,580,031	10.92

(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	98.24
合計	98.24

(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87回利付国債(5年)	2,140,000,000	100.77	2,156,478,000	100.86	2,158,425,400	0.5	2014/12/20	1.19
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,960,000,000	102.94	2,017,758,600	103.73	2,033,264,800	1.3	2019/12/20	1.12

日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,860,000,000	106.78	1,986,108,000	106.56	1,982,127,600	1.7	2017/03/20	1.10
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	1,820,000,000	105.44	1,919,121,800	105.70	1,923,740,000	1.5	2018/09/20	1.06
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,830,000,000	100.99	1,848,117,000	101.95	1,865,758,200	1.2	2020/12/20	1.03
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	1,760,000,000	100.27	1,764,910,400	100.47	1,768,324,800	0.4	2015/06/20	0.98
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	1,640,000,000	106.89	1,752,996,000	106.78	1,751,257,600	1.7	2017/09/20	0.97
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	1,690,000,000	101.14	1,709,333,600	100.81	1,703,705,900	0.9	2012/12/20	0.94
日本	国債証券	第85回利付国債(5年)	1,670,000,000	101.46	1,694,408,200	101.43	1,693,881,000	0.7	2014/09/20	0.94
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	1,570,000,000	106.67	1,674,811,100	106.39	1,670,432,900	1.7	2016/12/20	0.92
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1,650,000,000	99.60	1,643,530,700	100.52	1,658,712,000	1.0	2020/09/20	0.92
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,580,000,000	103.53	1,635,774,000	104.33	1,648,556,200	1.4	2020/03/20	0.91
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1,550,000,000	105.63	1,637,265,000	105.70	1,638,489,500	1.5	2017/12/20	0.91
日本	国債証券	第70回利付国債(5年)	1,610,000,000	101.13	1,628,303,700	100.86	1,623,958,700	0.8	2013/03/20	0.90
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1,550,000,000	104.05	1,612,925,000	103.66	1,606,823,000	1.5	2014/09/20	0.89
日本	国債証券	第84回利付国債(5年)	1,530,000,000	101.43	1,551,879,000	101.35	1,550,700,900	0.7	2014/06/20	0.86
日本	国債証券	第309回利付国債(10年)	1,520,000,000	100.96	1,534,625,400	101.62	1,544,715,200	1.1	2020/06/20	0.85
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	1,520,000,000	100.10	1,521,653,200	100.04	1,520,714,400	0.4	2016/09/20	0.84
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	1,490,000,000	100.73	1,500,877,000	100.84	1,502,635,200	0.5	2015/03/20	0.83
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	1,470,000,000	100.13	1,471,931,200	100.13	1,471,955,100	0.4	2016/06/20	0.81
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	101.78	1,374,078,000	102.59	1,385,005,500	1.3	2021/03/20	0.77
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	1,250,000,000	107.33	1,341,668,600	106.87	1,335,975,000	1.9	2016/06/20	0.74
日本	国債証券	第256回利付国債(10年)	1,270,000,000	102.98	1,307,957,400	102.56	1,302,562,800	1.4	2013/12/20	0.72
日本	国債証券	第269回利付国債(10年)	1,250,000,000	103.73	1,296,680,000	103.45	1,293,212,500	1.3	2015/03/20	0.72
日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	1,220,000,000	104.89	1,279,658,000	104.55	1,275,595,400	1.5	2015/09/20	0.71
日本	国債証券	第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	99.76	1,257,051,600	100.01	1,260,226,800	0.3	2015/09/20	0.70
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1,160,000,000	106.48	1,235,182,700	106.21	1,232,059,200	1.7	2016/09/20	0.68
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,170,000,000	101.00	1,181,733,100	101.47	1,187,269,200	1.2	2021/06/20	0.66
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	1,140,000,000	101.63	1,158,641,400	101.48	1,156,883,400	0.8	2014/03/20	0.64
日本	国債証券	第300回利付国債(10年)	1,010,000,000	105.09	1,061,409,000	105.69	1,067,499,300	1.5	2019/03/20	0.59

(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	75.63
地方債証券	6.48
特殊債券	9.71
社債券	7.48
合計	99.29

(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	1,430,500	3,310.82	4,736,128,010	2,509.00	3,589,124,500	3.19
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,319,100	372.25	3,096,784,975	328.00	2,728,664,800	2.42
日本	株式	キヤノン	電気機器	691,700	3,816.32	2,639,748,544	3,420.00	2,365,614,000	2.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	939,400	3,013.46	2,830,844,324	2,389.00	2,244,226,600	1.99
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	506,000	3,837.60	1,941,825,600	3,775.00	1,910,150,000	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	831,100	2,332.43	1,938,482,573	2,089.00	1,736,167,900	1.54
日本	株式	ファナック	電気機器	115,900	12,291.67	1,424,604,553	12,270.00	1,422,093,000	1.26
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,113,600	125.68	1,773,797,248	100.00	1,411,360,000	1.25
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	436,800	3,793.87	1,657,162,416	3,145.00	1,373,736,000	1.22
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	497,900	3,022.29	1,504,798,191	2,547.00	1,268,151,300	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	800,300	2,011.90	1,610,123,570	1,551.00	1,241,265,300	1.10
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,055	148,630.35	1,345,847,819	135,000.00	1,222,425,000	1.09
日本	株式	三井物産	卸売業	948,600	1,356.71	1,286,975,106	1,182.00	1,121,245,200	1.00
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,500,000	454.08	1,135,200,000	423.00	1,057,500,000	0.94
日本	株式	小松製作所	機械	552,500	2,400.19	1,326,104,975	1,895.00	1,046,987,500	0.93
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,766	317,713.84	878,796,481	364,500.00	1,008,207,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	459,700	2,108.76	969,396,972	2,127.00	977,781,900	0.87
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,406,600	791.55	1,113,394,230	690.00	970,554,000	0.86
日本	株式	三菱地所	不動産業	769,000	1,413.02	1,086,612,380	1,262.00	970,478,000	0.86
日本	株式	ソニー	電気機器	694,900	2,071.07	1,439,186,543	1,372.00	953,402,800	0.85
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,272,100	932.88	1,186,716,648	727.00	924,816,700	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	193,600	4,657.03	901,601,008	4,695.00	908,952,000	0.81
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,706	570,784.34	973,758,084	505,000.00	861,530,000	0.76
日本	株式	東芝	電気機器	2,344,000	415.34	973,556,960	347.00	813,368,000	0.72
日本	株式	信越化学工業	化学	209,100	4,118.14	861,103,074	3,805.00	795,625,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,114,000	886.28	987,315,920	712.00	793,168,000	0.70
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	1,517	561,559.04	851,885,063	504,000.00	764,568,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	417,200	2,168.43	904,668,996	1,832.00	764,310,400	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	258,900	3,097.27	801,883,203	2,938.00	760,648,200	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	63,700	18,083.14	1,151,896,018	11,630.00	740,831,000	0.66

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、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	98.10
合計	98.10

(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	0.11
		鉱業	0.76
		建設業	2.35
		食料品	3.62
		繊維製品	0.93
		パルプ・紙	0.40
		化学	6.00
		医薬品	4.75
		石油・石炭製品	0.93
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	1.16
		鉄鋼	1.81
		非鉄金属	1.14
		金属製品	0.68
		機械	5.01
		電気機器	14.00
		輸送用機器	9.31
		精密機器	1.33
		その他製品	1.66
		電気・ガス業	3.16
		陸運業	4.01
		海運業	0.33
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.60
		卸売業	5.33
小売業	4.18		
銀行業	9.08		
証券、商品先物取引業	0.97		
保険業	2.23		
その他金融業	0.79		
不動産業	2.31		

	サービス業	1.88
合計		98.10

(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	298	2,221,196,840	2,167,950,000	2,167,950,000	1.92

(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	7,946.06	2,145,437,592	8,148.40	2,200,070,610	1.750	2015/07/31	1.08
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	25,100,000	8,107.96	2,035,100,356	8,104.15	2,034,143,247	1.875	2014/04/30	0.99
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/15/13	23,000,000	7,941.33	1,826,506,908	7,918.59	1,821,277,451	1.375	2013/01/15	0.89
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	8,068.32	1,823,442,317	8,058.37	1,821,193,209	1.750	2014/01/31	0.89
アメリカ	国債証券	T 3.375% 07/31/13	21,000,000	8,291.30	1,741,174,291	8,222.26	1,726,676,047	3.375	2013/07/31	0.84
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	8,865.26	1,595,746,989	8,978.84	1,616,192,296	3.625	2021/02/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	18,400,000	7,600.58	1,398,507,467	8,337.93	1,534,180,212	2.625	2020/08/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/40	15,000,000	7,805.56	1,170,834,289	9,834.61	1,475,192,062	4.250	2040/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	17,500,000	7,559.68	1,322,945,387	8,320.84	1,456,147,875	2.625	2020/11/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	16,000,000	8,115.44	1,298,471,771	8,516.17	1,362,587,200	2.750	2017/05/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.625% 02/28/13	16,700,000	7,844.43	1,310,020,667	7,856.03	1,311,957,430	0.625	2013/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	15,900,000	7,994.89	1,271,188,528	8,180.45	1,300,692,369	1.875	2015/06/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/15/12	16,200,000	7,908.98	1,281,255,349	7,890.82	1,278,313,620	1.125	2012/12/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.875% 01/31/13	15,800,000	8,142.76	1,286,556,599	8,059.29	1,273,368,236	2.875	2013/01/31	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/15/13	16,200,000	7,798.35	1,263,332,801	7,847.79	1,271,342,352	0.500	2013/10/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/13	15,000,000	8,078.90	1,211,836,303	8,081.87	1,212,281,556	2.000	2013/11/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	14,500,000	8,167.63	1,184,307,363	8,294.29	1,202,672,483	2.375	2015/02/28	0.59
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 04/25/16	11,100,000	10,799.47	1,198,741,192	10,772.22	1,195,717,219	3.250	2016/04/25	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,163.97	1,142,956,450	8,503.96	1,190,554,706	2.750	2016/11/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/15/13	15,000,000	7,834.97	1,175,246,109	7,887.46	1,183,120,148	0.750	2013/12/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/16	14,000,000	8,285.11	1,159,915,473	8,276.28	1,158,680,113	2.125	2016/02/29	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/40	12,300,000	7,321.56	900,552,162	9,242.53	1,136,831,785	3.875	2040/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.75% 09/15/13	14,200,000	7,852.40	1,115,041,654	7,882.27	1,119,283,667	0.750	2013/09/15	0.55

アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	8,746.89	1,093,362,206	8,870.19	1,108,774,570	4.250	2015/08/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.0% 02/15/15	12,700,000	8,636.41	1,096,824,957	8,691.35	1,103,801,722	4.000	2015/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	8,700.99	1,044,119,475	8,630.00	1,035,600,939	4.250	2014/08/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 4.75% 02/01/13	10,100,000	10,756.60	1,086,416,923	10,211.11	1,031,322,845	4.750	2013/02/01	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,176.48	1,022,060,954	8,239.35	1,029,919,728	2.375	2014/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/15/39	10,000,000	7,995.04	799,504,290	10,014.06	1,001,406,859	4.375	2039/11/15	0.49
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	9,900,000	10,369.89	1,026,619,188	10,053.83	995,329,732	4.400	2015/01/31	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 (%)
国債証券	96.05
特殊債券	0.60
合計	96.65

(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	348,280	6,402.75	2,229,950,988	6,010.54	2,093,351,184	1.84
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	65,381	26,773.58	1,750,483,983	29,158.11	1,906,386,782	1.68
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	85,633	13,128.18	1,124,205,771	14,136.84	1,210,580,208	1.06
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,126	8,033.32	1,141,744,576	7,609.08	1,081,448,203	0.95
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,979	4,577.80	1,121,466,826	4,304.42	1,054,494,956	0.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	536,586	1,948.56	1,045,571,196	1,940.74	1,041,378,850	0.92
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	197,348	5,144.07	1,015,173,741	4,885.46	964,137,516	0.85
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	193,802	5,203.45	1,008,440,567	4,905.00	950,599,081	0.84

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	422,927	2,425.15	1,025,663,613	2,192.32	927,194,619	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	749,817	1,496.18	1,121,868,322	1,165.69	874,061,376	0.77
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	558,619	1,619.63	904,758,828	1,515.72	846,711,107	0.74
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,887	41,072.15	734,657,720	45,544.32	814,651,267	0.72
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	145,668	5,215.17	759,684,476	5,171.42	753,311,093	0.66
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,625,140	204.82	742,521,475	207.02	750,477,062	0.66
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,264,814	757.12	957,620,023	593.20	750,289,890	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	125,736	5,498.78	691,395,783	5,817.55	731,476,699	0.64
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,334,336	554.73	740,204,215	534.98	713,849,690	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	374,857	1,729.79	648,426,963	1,842.30	690,601,075	0.61
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	165,001	4,516.67	745,256,716	4,145.66	684,039,200	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	355,248	2,181.38	774,934,292	1,881.37	668,353,071	0.59
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	286,227	2,593.91	742,448,794	2,323.58	665,073,107	0.58
オランダ	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	254,177	2,594.45	659,451,449	2,610.30	663,480,053	0.58
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	280,944	3,307.24	929,150,049	2,231.39	626,896,418	0.55
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	227,054	3,433.16	779,512,756	2,748.72	624,109,778	0.55
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	135,033	4,256.52	574,770,989	4,544.82	613,700,962	0.54
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	364,787	1,604.46	585,288,776	1,666.64	607,970,940	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	49,672	12,467.56	619,288,888	12,021.83	597,148,836	0.53
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	218,225	2,804.08	611,921,601	2,693.92	587,881,215	0.52
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	150,077	4,062.23	609,648,792	3,881.00	582,449,077	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	202,042	2,857.21	577,277,251	2,861.90	578,224,383	0.51

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	94.06
投資信託受益証券	0.11
投資証券	1.68
合計	95.84

(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	12.16

素材	7.16
資本財	7.01
商業・専門サービス	0.78
運輸	1.71
自動車・自動車部品	1.19
耐久消費財・アパレル	1.19
消費者サービス	1.60
メディア	2.38
小売	2.73
食品・生活必需品小売り	2.41
食品・飲料・タバコ	6.92
家庭用品・パーソナル用品	1.77
ヘルスケア機器・サービス	2.62
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.61
銀行	6.62
各種金融	3.96
保険	3.79
不動産	0.63
ソフトウェア・サービス	5.75
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.32
電気通信サービス	4.25
公益事業	3.87
半導体・半導体製造装置	1.60
合計	94.06

(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	158	47,642,214	47,261,750	3,692,560,527	3.25
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	36	4,890,122	4,793,040	363,024,849	0.32
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	435	9,781,442.5	9,713,550	1,011,763,368	0.89
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	49	5,035,267	5,064,150	397,940,907	0.35
	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	106	5,687,825	5,647,150	688,500,528	0.61
	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	54	3,017,302	2,991,060	253,940,994	0.22

(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	922	731,670.08	674,599,821	710,000.00	654,620,000	13.46
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	780	634,090.24	494,590,391	643,000.00	501,540,000	10.31
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,996	120,140.65	359,941,411	118,300.00	354,426,800	7.29
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,352	85,162.27	285,463,932	82,100.00	275,199,200	5.66
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	386	673,537.92	259,985,639	639,000.00	246,654,000	5.07
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,562	144,951.88	226,414,846	143,000.00	223,366,000	4.59
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,139	181,966.60	207,259,962	188,000.00	214,132,000	4.40
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	309	652,792.83	201,712,987	640,000.00	197,760,000	4.07
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	486	398,860.29	193,846,101	396,000.00	192,456,000	3.96
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	310	507,888.90	157,445,561	506,000.00	156,860,000	3.23
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	236	650,793.70	153,587,314	627,000.00	147,972,000	3.04
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	453	311,988.52	141,330,800	326,000.00	147,678,000	3.04
日本	投資証券	ビ・ライフ投資法人	256	439,631.56	112,545,680	466,000.00	119,296,000	2.45
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	631	167,026.30	105,393,597	160,300.00	101,149,300	2.08
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	456	209,806.53	95,671,780	220,200.00	100,411,200	2.06
日本	投資証券	福岡リート投資法人	196	499,778.07	97,956,502	505,000.00	98,980,000	2.04
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	270	392,239.47	105,904,659	352,500.00	95,175,000	1.96
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	301	310,926.75	93,588,953	309,500.00	93,159,500	1.92
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	369	247,598.57	91,363,876	247,800.00	91,438,200	1.88
日本	投資証券	トップリート投資法人	247	357,919.95	88,406,228	344,500.00	85,091,500	1.75
日本	投資証券	プレミアム投資法人	308	241,644.63	74,426,548	248,300.00	76,476,400	1.57
日本	投資証券	グロ・バル・ワン不動産投資法人	154	532,834.62	82,056,532	491,500.00	75,691,000	1.56
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	2,121	27,355.07	58,020,120	30,550.00	64,796,550	1.33
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	200	362,103.37	72,420,675	320,500.00	64,100,000	1.32
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	149	396,932.24	59,142,905	390,500.00	58,184,500	1.20
日本	投資証券	M I D リート投資法人	293	183,695.47	53,822,774	189,400.00	55,494,200	1.14
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	183	266,042.54	48,685,786	284,000.00	51,972,000	1.07
日本	投資証券	阪急リート投資法人	136	353,947.52	48,136,863	335,000.00	45,560,000	0.94
日本	投資証券	平和不動産リート投資法人	1,109	38,688.62	42,905,684	36,650.00	40,644,850	0.84
日本	投資証券	いちご不動産投資法人	1,343	26,995.33	36,254,738	26,950.00	36,193,850	0.74

(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	97.72
合計	97.72

(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

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 (%)
不動産投信指数 先物取引	東証REIT指数先物	東京証券取引所	買建	円	131	111,930,900	110,826,000	110,826,000	2.28

(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 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	51,358	9,781.09	502,337,461	9,311.53	478,221,732	6.65
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	24,779	9,522.48	235,957,640	9,892.03	245,114,841	3.41
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	370,400	632.56	234,303,557	633.35	234,594,617	3.26
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	15,972	14,051.18	224,425,510	13,832.44	220,931,859	3.07
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	51,864	4,436.22	230,080,186	4,133.07	214,357,905	2.98
アメリカ	投資証券	HCP INC	71,228	2,929.87	208,689,136	2,872.05	204,571,004	2.85
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	50,366	4,090.10	206,002,253	3,932.28	198,053,360	2.76
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	25,698	7,484.85	192,345,778	7,028.57	180,620,315	2.51
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	32,262	6,198.05	199,961,582	5,555.04	179,216,797	2.49
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	80,293	2,160.29	173,456,526	2,036.06	163,481,991	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,451	9,759.99	160,561,753	9,282.62	152,708,468	2.12
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	123,525	1,046.16	129,227,000	1,031.31	127,393,308	1.77
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	32,963	3,888.59	128,179,795	3,787.74	124,855,352	1.74
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	106,547	1,113.35	118,624,368	1,057.88	112,713,961	1.57
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	135,665	824.17	111,812,271	815.64	110,654,451	1.54
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	416,863	260.09	108,425,982	260.88	108,753,553	1.51
香港	投資証券	LINK REIT	393,500	283.34	111,497,241	276.32	108,734,477	1.51
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	491,469	201.95	99,252,459	196.44	96,549,085	1.34
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	155,205	604.72	93,856,064	581.92	90,317,538	1.26

アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	23,076	3,798.68	87,658,353	3,728.36	86,035,718	1.20
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,384	4,869.84	84,657,348	4,933.12	85,757,500	1.19
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	71,193	1,275.86	90,832,507	1,163.35	82,822,782	1.15
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	299,332	246.74	73,857,536	246.74	73,857,536	1.03
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,987	6,749.65	74,158,412	6,669.17	73,274,245	1.02
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	14,950	5,194.08	77,651,531	4,737.02	70,818,477	0.99
アメリカ	投資証券	UDR INC	38,324	1,883.71	72,191,466	1,766.51	67,700,085	0.94
オーストラリア	投資証券	MIRVAC GROUP	597,439	99.01	59,152,913	98.61	58,918,179	0.82
オーストラリア	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	410,751	143.80	59,066,568	141.83	58,259,648	0.81
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	124,656	480.36	59,880,354	459.88	57,327,080	0.80
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	22,193	2,562.66	56,873,202	2,581.41	57,289,347	0.80

(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	99.07
合計	99.07

(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
第4期計算期間末 (平成23年11月10日)	(分配付)	3,227,431,682	(分配付)	0.7290
	(分配落)	3,227,431,682	(分配落)	0.7290
平成22年11月末日		2,521,863,568		0.7777
12月末日		2,612,164,371		0.7959
平成23年 1月末日		2,709,229,740		0.8045



2月末日	2,806,910,249	0.8187
3月末日	2,863,363,174	0.8134
4月末日	2,970,788,477	0.8238
5月末日	3,010,149,350	0.8107
6月末日	3,061,219,430	0.8029
7月末日	3,096,562,350	0.7844
8月末日	3,098,775,795	0.7496
9月末日	3,086,485,393	0.7233
10月末日	3,308,415,790	0.7543
11月末日	3,228,177,367	0.7181

## 【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
第4期計算期間（平成22年11月11日～平成23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
第4期計算期間（平成22年11月11日～平成23年11月10日）	6.4

(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。

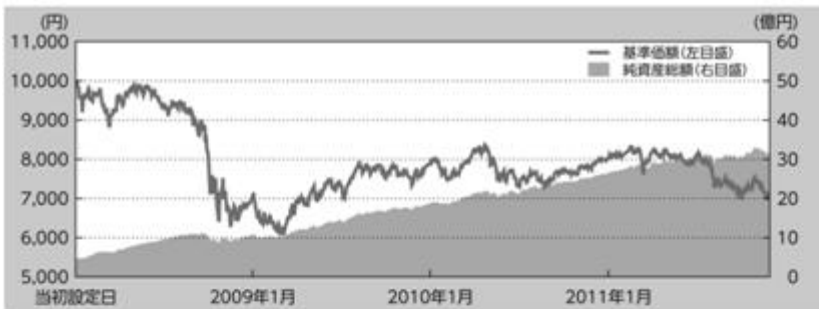
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（参考情報）

当初設定日：2008年1月 9日

作成基準日：2011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。

## 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	2011年11月	-
分配金	0円	0円	0円	0円	-

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

基準価額	7,181円
純資産総額	32億円

## 〈基準価額の騰落率〉

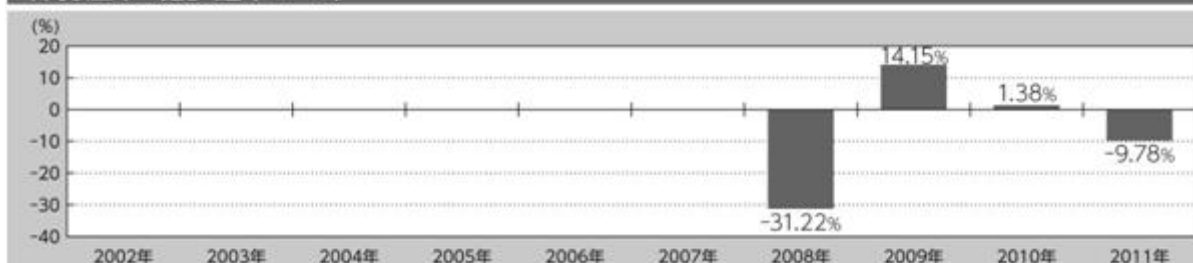
1ヶ月	-4.80%
3ヶ月	-4.20%
6ヶ月	-11.42%
1年	-7.66%
3年	5.45%
5年	-
設定来	-28.19%

※上記は作成基準日からの期間です。

## 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	20.7%	EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.4%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	-	-	0.3%
住信 外国債券 インデックス マザーファンド	19.4%	T 1.75% 07/31/15	アメリカ	国債証券	-	1.750%	2015/7/31	0.2%
		T 1.875% 04/30/14	アメリカ	国債証券	-	1.875%	2014/4/30	0.2%
住信 国内株式 インデックス マザーファンド	18.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
住信 国内債券 インデックス マザーファンド	17.7%	第87回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.5%	2014/12/20	0.2%
		第305回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.3%	2019/12/20	0.2%
住信 グローバル REITインデックス マザーファンド	11.4%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
住信 J-REIT インデックス マザーファンド	10.9%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.5%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.1%

## 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、2011年は年初から作成基準日までまでの収益率です。

※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

第4期計算期間 (平成22年11月11日～平成23年11月10日)	1,745,390,853	539,609,788	4,427,235,469
--------------------------------------	---------------	-------------	---------------

(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。

#### （八）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「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。

(a) 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

(b) 価格情報会社の提供する価額

(c) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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、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5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、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。
- (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。
- (e) 前記(c)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。
- (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、当該併合にかかる一又は複数の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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第



133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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)及び第4期計算期間(平成22年11月11日から平成23年11月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

SBI資産設計オープン（資産成長型）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (平成22年11月10日現在)	第4期 (平成23年11月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	55,013,219	65,059,737
親投資信託受益証券	2,464,729,946	3,176,318,667
未収利息	95	84
流動資産合計	2,519,743,260	3,241,378,488
資産合計	2,519,743,260	3,241,378,488
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,659,026	2,751,450
未払受託者報酬	481,571	649,597
未払委託者報酬	7,705,081	10,393,497
その他未払費用	110,542	152,262
流動負債合計	10,956,220	13,946,806
負債合計	10,956,220	13,946,806
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,221,454,404	4,427,235,469
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	712,667,364	1,199,803,787
（分配準備積立金）	95,692,058	145,700,199
元本等合計	2,508,787,040	3,227,431,682
純資産合計	2,508,787,040	3,227,431,682
負債純資産合計	2,519,743,260	3,241,378,488

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 (自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	第4期 (自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	35,022	31,154
有価証券売買等損益	50,572,218	200,501,279
営業収益合計	50,607,240	200,470,125
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	885,272	1,219,041
委託者報酬	14,164,221	19,504,618
その他費用	110,542	152,262
営業費用合計	15,160,035	20,875,921
営業利益又は営業損失（ ）	35,447,205	221,346,046
経常利益又は経常損失（ ）	35,447,205	221,346,046
当期純利益又は当期純損失（ ）	35,447,205	221,346,046
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（ ）	3,249,767	1,284,222
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	533,408,648	712,667,364
剰余金増加額又は欠損金減少額	93,218,553	118,022,981
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	93,218,553	118,022,981
剰余金減少額又は欠損金増加額	304,674,707	382,529,136
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	304,674,707	382,529,136
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	712,667,364	1,199,803,787

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第3期 (自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	第4期 (自 平成22年11月11日 至 平成23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3期 (平成22年11月10日現在)	第4期 (平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	2,297,854,767円	3,221,454,404円
期中追加設定元本額	1,325,647,358円	1,745,390,853円
期中一部解約元本額	402,047,721円	539,609,788円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を712,667,364 円下回っております。	純資産額は、元本を 1,199,803,787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	3,221,454,404口	4,427,235,469口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第3期 (自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	第4期 (自 平成22年11月11日 至 平成23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(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。	計算期間末における経費控除後の配当等収 益(62,850,681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(127,903,388円) 及び分配準備積立金(82,849,518円)によ り、分配対象収益は273,603,587円(1万口 当たり618円00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)

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)	第4期 (自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左

## 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)	第4期 (平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	<p>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。</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>	<p>a. 親投資信託受益証券 同左</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

## (追加情報)

第3期 (自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)	第4期 (自平成22年11月11日 至平成23年11月10日)
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第3期 (平成22年11月10日現在)	第4期 (平成23年11月10日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(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	52,517,701	197,241,355
合計	52,517,701	197,241,355

(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)

## 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)	第4期 (平成23年11月10日現在)
該当事項はありません。	同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 (自平成21年11月11日 至平成22年11月10日)	第4期 (自平成22年11月11日 至平成23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3期 (平成22年11月10日現在)	第4期 (平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 0.7788円	1口当たり純資産額 = 0.7290円

## (4)【附属明細表】（平成23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	572,939,120	351,039,798
	住信 グローバルREITインデックス マザーファンド	556,158,302	376,129,859
	住信 外国株式インデックス マザーファンド	820,835,530	678,256,398
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	363,571,270	623,524,728
	住信 国内株式インデックス マザーファンド	1,013,557,564	580,464,416
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	462,476,316	566,903,468
合計		3,789,538,102	3,176,318,667

## 2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 3)デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

「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」を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	509,080,780	453,384,148
国債証券	119,350,717,400	136,999,150,000
地方債証券	10,191,558,483	11,777,042,381
特殊債券	16,632,727,104	17,524,339,117
社債券	13,534,814,540	13,559,490,963
未収入金	100,695,000	
未収利息	552,828,919	600,652,444
前払費用	17,761,251	20,912,269
流動資産合計	160,890,183,477	180,934,971,322
資産合計	160,890,183,477	180,934,971,322
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	
未払解約金	93,398,108	71,594,677
流動負債合計	193,398,108	71,594,677
負債合計	193,398,108	71,594,677
純資産の部		
元本等		
元本	133,007,073,320	147,545,043,246
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	27,689,712,049	33,318,333,399
元本等合計	160,696,785,369	180,863,376,645
純資産合計	160,696,785,369	180,863,376,645
負債純資産合計	160,890,183,477	180,934,971,322

(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22年11月10日及び平成23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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成23年11月11日 至平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	128,418,752,745円	133,007,073,320円
期中追加設定元本額	25,696,599,139円	31,480,646,991円
期中一部解約元本額	21,108,278,564円	16,942,677,065円
期末元本額	133,007,073,320円	147,545,043,246円
元本額の内訳		
住信エマーシング株式オープン	10,940,920円	10,940,920円
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	330,348,752円	462,476,316円
SBI 資産設計オープン（分配型）	17,512,567円	16,566,774円
STAM 国内債券インデックス・オープン	1,417,506,500円	1,843,216,176円
世界経済インデックスファンド	28,055,069円	56,869,199円
住信 国内バランス30	496,123,003円	
住信 国内バランス60	88,157,699円	
すみしん マイセレクション25	262,470,505円	198,922,366円
すみしん マイセレクション50	219,900,273円	184,397,254円
すみしん マイセレクション75	52,760,517円	45,885,882円
すみしん DC マイセレクション25	6,243,921,182円	7,449,033,076円
すみしん DC マイセレクション50	8,639,136,026円	9,500,505,351円
すみしん DC マイセレクション75	2,341,078,155円	2,409,072,644円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	329,545,821円	351,773,470円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	26,736,620,207円	32,335,292,451円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	7,001,393,681円	10,892,020,778円
すみしん DC マイセレクションS25	559,774,695円	1,914,264,620円
すみしん DC マイセレクションS50	1,026,485,046円	2,268,511,224円
すみしん DC マイセレクションS75	210,405,626円	398,005,407円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	33,953,829円	47,546,994円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	111,094,439円	348,899,662円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	49,956,809円	149,559,346円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	9,671,720円	25,057,665円
DC世界経済インデックスファンド		32,718円
STAM 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	3,427,204,806円	5,847,109,049円

住信 国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	86,189,049円	69,119,130円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	617,595,311円	529,105,125円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	79,715,834円	69,236,770円
住信 国内バランス 30VA2 (適格機関投資家専用)	15,015,202円	12,787,670円
住信 国内バランス 60VA2 (適格機関投資家専用)	15,565,573円	13,785,012円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	3,436,291円	2,359,816円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	2,168,856,824円	2,056,181,393円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	3,277,667,468円	3,167,125,266円
すみしん バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	10,303,631,652円	9,392,395,069円
すみしん バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	886,811,564円	819,433,230円
すみしん バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	16,887,000,398円	15,428,404,110円
すみしん バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	1,828,352,411円	1,627,933,550円
すみしん バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	6,544,749,388円	5,757,186,634円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	3,917,487,814円	3,699,450,895円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	5,487,580,905円	5,170,415,169円
すみしん バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	2,910,505,287円	2,468,757,964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)	2,197,113,190円	2,028,051,322円
すみしん バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	3,427,510,425円	2,958,584,044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	3,749,447,722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	296,483,962円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,078,565,908円	2,063,712,772円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	7,568,568,412円	9,409,127,279円
2. 計算期間末日における受益権の総数	133,007,073,320口	147,545,043,246口

## (金融商品に関する注記)

## 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)	(自 平成23年11月11日 至 平成23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。	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左

## 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）	（平成23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。	同左
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。	a. 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 同左 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成23年11月11日 至 平成23年11月10日)
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	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	1,325,604,900
地方債証券	77,713,322	101,220,546
特殊債券	130,886,836	119,600,479
社債券	94,922,200	157,277,825
合計	1,423,589,858	1,389,148,100

(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)

## 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)	(平成23年11月10日現在)
該当事項はありません。	同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成23年11月11日 至 平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 1.2082円	1口当たり純資産額 = 1.2258円

## (3)附属明細表(平成23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）	400,000,000	436,460,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	179,252,800	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	156,741,200	
	第103回利付国債（20年）	280,000,000	309,349,600	
	第104回利付国債（20年）	260,000,000	279,611,800	
	第105回利付国債（20年）	570,000,000	612,282,600	
	第106回利付国債（20年）	270,000,000	294,032,700	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	203,847,200	
	第108回利付国債（20年）	450,000,000	469,381,500	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	208,286,000	
	第110回利付国債（30年）	120,000,000	105,904,800	
	第110回利付国債（20年）	580,000,000	621,475,800	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	217,070,000	
	第112回利付国債（20年）	500,000,000	535,055,000	
	第113回利付国債（20年）	930,000,000	993,863,100	
	第114回利付国債（20年）	380,000,000	405,520,800	
	第115回利付国債（20年）	550,000,000	595,886,500	
	第116回利付国債（20年）	480,000,000	519,364,800	
	第117回利付国債（20年）	600,000,000	639,816,000	
	第118回利付国債（20年）	700,000,000	734,860,000	
	第119回利付国債（20年）	180,000,000	183,189,600	
	第11回利付国債（30年）	90,000,000	88,876,800	
	第121回利付国債（20年）	940,000,000	970,991,800	
	第122回利付国債（20年）	120,000,000	121,972,800	
	第123回利付国債（20年）	610,000,000	648,911,900	
	第124回利付国債（20年）	280,000,000	293,165,600	
	第125回利付国債（20年）	380,000,000	410,343,000	
	第126回利付国債（20年）	230,000,000	240,743,300	
	第127回利付国債（20年）	330,000,000	340,348,800	
	第128回利付国債（20年）	470,000,000	483,813,300	
	第129回利付国債（20年）	470,000,000	475,856,200	
	第12回利付国債（30年）	120,000,000	126,938,400	
	第130回利付国債（20年）	350,000,000	354,403,000	
	第13回利付国債（30年）	90,000,000	93,510,000	
	第14回利付国債（30年）	260,000,000	288,766,400	
	第15回利付国債（30年）	190,000,000	214,637,300	

第16回利付国債(30年)	170,000,000	192,220,700	
第17回利付国債(30年)	130,000,000	144,372,800	
第18回利付国債(30年)	240,000,000	262,310,400	
第19回利付国債(30年)	180,000,000	196,695,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	47,121,200	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	161,101,500	
第20回利付国債(30年)	200,000,000	225,998,000	
第21回利付国債(30年)	130,000,000	141,876,800	
第22回利付国債(20年)	120,000,000	128,322,000	
第22回利付国債(30年)	220,000,000	248,589,000	
第23回利付国債(20年)	40,000,000	43,952,800	
第23回利付国債(30年)	150,000,000	169,488,000	
第244回利付国債(10年)	540,000,000	545,200,200	
第245回利付国債(10年)	940,000,000	948,018,200	
第246回利付国債(10年)	550,000,000	554,092,000	
第247回利付国債(10年)	290,000,000	292,641,900	
第248回利付国債(10年)	490,000,000	493,807,300	
第249回利付国債(10年)	300,000,000	301,929,000	
第24回利付国債(20年)	20,000,000	22,134,400	
第24回利付国債(30年)	210,000,000	237,066,900	
第250回利付国債(10年)	490,000,000	492,881,200	
第251回利付国債(10年)	660,000,000	668,085,000	
第252回利付国債(10年)	510,000,000	517,058,400	
第253回利付国債(10年)	800,000,000	821,656,000	
第254回利付国債(10年)	550,000,000	562,864,500	
第255回利付国債(10年)	240,000,000	246,055,200	
第256回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,139,337,300	
第257回利付国債(10年)	660,000,000	676,064,400	
第258回利付国債(10年)	210,000,000	215,686,800	
第259回利付国債(10年)	940,000,000	969,845,000	
第25回利付国債(20年)	60,000,000	65,562,600	
第25回利付国債(30年)	210,000,000	228,545,100	
第260回利付国債(10年)	490,000,000	508,424,000	
第261回利付国債(10年)	510,000,000	531,812,700	
第262回利付国債(10年)	480,000,000	501,772,800	
第263回利付国債(10年)	410,000,000	426,728,000	
第264回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,608,853,500	
第265回利付国債(10年)	670,000,000	697,114,900	
第266回利付国債(10年)	370,000,000	383,838,000	
第267回利付国債(10年)	450,000,000	465,444,000	
第268回利付国債(10年)	560,000,000	584,074,400	

第269回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,295,437,500	
第26回利付国債(20年)	20,000,000	22,454,600	
第26回利付国債(30年)	360,000,000	398,977,200	
第270回利付国債(10年)	640,000,000	664,531,200	
第271回利付国債(10年)	730,000,000	755,374,800	
第272回利付国債(10年)	130,000,000	135,695,300	
第273回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,278,340,400	
第274回利付国債(10年)	530,000,000	556,404,600	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	292,815,600	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	505,857,600	
第277回利付国債(10年)	270,000,000	285,228,000	
第278回利付国債(10年)	760,000,000	809,384,800	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	472,366,400	
第27回利付国債(20年)	50,000,000	56,846,000	
第27回利付国債(30年)	480,000,000	542,136,000	
第280回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,340,325,000	
第281回利付国債(10年)	550,000,000	592,240,000	
第282回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,236,096,000	
第283回利付国債(10年)	680,000,000	727,851,600	
第284回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,676,524,500	
第285回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,990,107,000	
第286回利付国債(10年)	990,000,000	1,066,418,100	
第287回利付国債(10年)	500,000,000	541,480,000	
第288回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,760,786,000	
第289回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,648,022,000	
第28回利付国債(20年)	20,000,000	23,195,000	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	339,039,000	
第290回利付国債(10年)	870,000,000	920,112,000	
第291回利付国債(10年)	420,000,000	441,604,800	
第292回利付国債(10年)	520,000,000	559,733,200	
第293回利付国債(10年)	710,000,000	769,902,700	
第294回利付国債(10年)	510,000,000	549,769,800	
第295回利付国債(10年)	500,000,000	532,425,000	
第296回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,832,642,800	
第297回利付国債(10年)	840,000,000	889,669,200	
第298回利付国債(10年)	860,000,000	904,659,800	
第299回利付国債(10年)	620,000,000	652,122,200	
第29回利付国債(20年)	60,000,000	69,048,600	
第29回利付国債(30年)	560,000,000	621,376,000	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	178,344,000	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	305,319,000	

第300回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,076,952,900	
第300回利付国債(2年)	700,000,000	700,693,000	
第301回利付国債(10年)	710,000,000	756,412,700	
第301回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,051,113,000	
第302回利付国債(10年)	600,000,000	634,860,000	
第302回利付国債(2年)	520,000,000	520,551,200	
第303回利付国債(10年)	940,000,000	992,997,200	
第303回利付国債(2年)	540,000,000	540,604,800	
第304回利付国債(10年)	590,000,000	618,856,900	
第304回利付国債(2年)	600,000,000	600,666,000	
第305回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,052,453,200	
第305回利付国債(2年)	280,000,000	280,330,400	
第306回利付国債(10年)	1,580,000,000	1,664,545,800	
第306回利付国債(2年)	480,000,000	480,595,200	
第307回利付国債(2年)	700,000,000	700,910,000	
第308回利付国債(10年)	500,000,000	521,570,000	
第308回利付国債(2年)	520,000,000	519,760,800	
第309回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,559,793,600	
第309回利付国債(2年)	270,000,000	269,843,400	
第30回利付国債(20年)	80,000,000	90,540,000	
第30回利付国債(30年)	440,000,000	478,121,600	
第310回利付国債(10年)	1,620,000,000	1,644,721,200	
第311回利付国債(10年)	460,000,000	459,047,800	
第312回利付国債(10年)	1,830,000,000	1,884,076,500	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,398,343,500	
第314回利付国債(10年)	650,000,000	661,771,500	
第315回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,198,875,600	
第316回利付国債(10年)	800,000,000	812,336,000	
第317回利付国債(10年)	700,000,000	709,135,000	
第318回利付国債(10年)	770,000,000	772,764,300	
第31回利付国債(20年)	80,000,000	91,077,600	
第31回利付国債(30年)	500,000,000	532,160,000	
第32回利付国債(20年)	50,000,000	57,353,000	
第32回利付国債(30年)	680,000,000	737,575,600	
第33回利付国債(20年)	140,000,000	163,406,600	
第33回利付国債(30年)	680,000,000	692,022,400	
第34回利付国債(20年)	50,000,000	58,290,500	
第34回利付国債(30年)	750,000,000	795,382,500	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	11,550,100	
第35回利付国債(30年)	290,000,000	294,120,900	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	80,443,300	



第37回利付国債(20年)	70,000,000	80,843,000	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	22,760,800	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	566,110,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	131,806,800	
第3回利付国債(40年)	340,000,000	345,385,600	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	111,878,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	351,502,800	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	91,638,400	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	164,005,800	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	193,964,900	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	328,857,100	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	189,837,300	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	100,537,200	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	148,617,300	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	155,019,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	131,518,200	
第4回利付国債(40年)	200,000,000	201,916,000	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	239,485,400	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	109,766,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	121,721,600	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	88,556,800	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	223,338,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	153,556,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	164,448,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	260,565,600	
第58回利付国債(20年)	200,000,000	216,976,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	212,602,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	53,978,500	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	361,273,500	
第61回利付国債(20年)	220,000,000	217,014,600	
第62回利付国債(20年)	220,000,000	211,580,600	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	213,956,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	345,561,600	
第65回利付国債(20年)	270,000,000	291,192,300	
第66回利付国債(20年)	180,000,000	192,117,600	
第67回利付国債(20年)	150,000,000	161,547,000	
第68回利付国債(20年)	140,000,000	155,551,200	
第68回利付国債(5年)	260,000,000	262,787,200	
第69回利付国債(20年)	220,000,000	241,804,200	
第69回利付国債(5年)	1,690,000,000	1,704,415,700	
第6回利付国債(30年)	90,000,000	100,230,300	

第70回利付国債(20年)	240,000,000	271,956,000	
第70回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,624,667,100	
第71回利付国債(20年)	220,000,000	244,202,200	
第71回利付国債(5年)	820,000,000	832,964,200	
第72回利付国債(20年)	540,000,000	592,774,200	
第72回利付国債(5年)	630,000,000	643,727,700	
第73回利付国債(20年)	190,000,000	206,036,000	
第73回利付国債(5年)	670,000,000	682,522,300	
第74回利付国債(20年)	150,000,000	164,533,500	
第74回利付国債(5年)	640,000,000	648,908,800	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	142,472,200	
第75回利付国債(5年)	440,000,000	447,858,400	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	257,102,400	
第76回利付国債(5年)	820,000,000	836,162,200	
第77回利付国債(20年)	160,000,000	173,424,000	
第77回利付国債(5年)	440,000,000	447,048,800	
第78回利付国債(20年)	200,000,000	213,862,000	
第78回利付国債(5年)	390,000,000	396,232,200	
第79回利付国債(20年)	140,000,000	151,495,400	
第79回利付国債(5年)	170,000,000	172,006,000	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	208,285,600	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	240,889,000	
第80回利付国債(5年)	380,000,000	385,278,200	
第81回利付国債(20年)	90,000,000	97,220,700	
第81回利付国債(5年)	1,140,000,000	1,157,692,800	
第82回利付国債(20年)	540,000,000	589,998,600	
第82回利付国債(5年)	390,000,000	396,965,400	
第83回利付国債(20年)	240,000,000	261,936,000	
第83回利付国債(5年)	220,000,000	224,292,200	
第84回利付国債(20年)	460,000,000	496,289,400	
第84回利付国債(5年)	1,530,000,000	1,551,940,200	
第85回利付国債(20年)	190,000,000	206,997,400	
第85回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,695,551,000	
第86回利付国債(20年)	170,000,000	189,747,200	
第86回利付国債(5年)	80,000,000	80,996,800	
第87回利付国債(20年)	350,000,000	385,976,500	
第87回利付国債(5年)	2,140,000,000	2,160,736,600	
第88回利付国債(20年)	470,000,000	523,481,300	
第88回利付国債(5年)	1,490,000,000	1,504,587,100	
第89回利付国債(20年)	280,000,000	308,266,000	
第89回利付国債(5年)	1,760,000,000	1,770,665,600	

	第8回利付国債(30年)	50,000,000	50,461,500	
	第90回利付国債(20年)	480,000,000	527,846,400	
	第91回利付国債(20年)	290,000,000	322,674,300	
	第91回利付国債(5年)	400,000,000	402,284,000	
	第92回利付国債(20年)	760,000,000	824,242,800	
	第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,262,394,000	
	第93回利付国債(20年)	250,000,000	267,255,000	
	第93回利付国債(5年)	820,000,000	827,634,200	
	第94回利付国債(20年)	440,000,000	476,489,200	
	第94回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,023,493,600	
	第95回利付国債(20年)	430,000,000	476,788,300	
	第95回利付国債(5年)	520,000,000	526,910,800	
	第96回利付国債(20年)	280,000,000	302,568,000	
	第96回利付国債(5年)	900,000,000	908,100,000	
	第97回利付国債(20年)	510,000,000	557,491,200	
	第97回利付国債(5年)	1,470,000,000	1,475,644,800	
	第98回利付国債(20年)	230,000,000	248,303,400	
	第99回利付国債(20年)	640,000,000	690,233,600	
	第99回利付国債(5年)	1,520,000,000	1,524,696,800	
	第9回ポーランド共和国円貨債券(2009)	100,000,000	99,535,000	
	第9回利付国債(30年)	70,000,000	65,668,400	
	小計	130,980,000,000	136,999,150,000	
地方債証券	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,913,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	102,456,000	
	第124回神奈川県公募公債	10,000,000	10,264,300	
	第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,781,000	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	107,105,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	103,437,462	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	106,903,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,610,000	
	第167回神奈川県公募公債	140,000,000	148,442,000	
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,690,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,879,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,988,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,196,000	
	第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,740,000	
	第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,548,000	
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,371,000	
	第252回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,682,000	
	第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,492,000	
	第271回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,804,000	

第284回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,815,000	
第28回1号宮城県公募公債	116,000,000	116,834,040	
第291回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,106,000	
第29回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,202,000	
第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,455,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,145,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,312,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,297,000	
第3回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,100,200	
第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,866,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	129,566,400	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,593,000	
第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	146,098,680	
第47回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	102,186,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	111,679,000	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,002,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	170,913,600	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,181,000	
第593回東京都公募公債	143,000,000	144,076,790	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,178,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	108,958,000	
第602回東京都公募公債	20,000,000	20,473,600	
第608回東京都公募公債	100,000,000	103,236,000	
第611回東京都公募公債	40,000,000	41,686,000	
第618回東京都公募公債	100,000,000	103,716,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	103,569,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	138,018,390	
第639回東京都公募公債	50,000,000	53,459,000	
第650回東京都公募公債	140,000,000	151,058,600	
第674回東京都公募公債	100,000,000	105,066,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,781,188	
第691回東京都公募公債	100,000,000	102,820,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,361,000	
第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,834,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,144,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,862,900	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,032,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,532,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,951,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	152,321,535	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,780,000	

第9回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,589,000	
第9回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,865,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	106,649,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	105,402,000	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,087,600	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,798,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,474,611	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	102,358,000	
平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	74,490,305	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,107,000	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	127,658,930	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,253,400	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,345,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,745,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,624,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	155,982,000	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	206,708,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,379,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,492,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	105,194,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	211,114,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	103,425,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	105,013,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	103,671,000	
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	104,708,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	107,233,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,977,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,318,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	107,113,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	108,125,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	107,209,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	107,508,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,295,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	107,071,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,543,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,141,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,280,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	106,569,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	106,321,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	108,306,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	106,251,000	

	平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,040,000	
	平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,172,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	198,529,450	
	平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,306,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,999,000	
	平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	120,854,400	
	平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,180,000	
	小計	11,207,580,000	11,777,042,381	
特殊債券	い第694号農林債	100,000,000	101,206,000	
	い第695号農林債	100,000,000	101,270,000	
	い第696号商工債	100,000,000	101,775,000	
	い第704号商工債	100,000,000	102,399,000	
	い第705号商工債	100,000,000	102,593,000	
	い第707号農林債	250,000,000	256,407,500	
	い第710号農林債	100,000,000	101,863,000	
	い第715号農林債	100,000,000	101,114,000	
	い第718号商工債	100,000,000	101,068,000	
	い第721号商工債	150,000,000	151,072,500	
	い第722号商工債	100,000,000	100,512,000	
	い第723号農林債	200,000,000	201,158,000	
	い第726号商工債	100,000,000	100,255,000	
	第10回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,514,000	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,454,000	71,825,359	
	第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,693,000	
	第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,910,000	
	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	101,186,000	
	第119号商工債(3年)	100,000,000	100,236,000	
	第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,937,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,755,000	
	第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,045,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,321,000	
	第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	184,074,650	
	第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,893,000	
	第134回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,530,000	
	第135回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,479,600	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	114,155,640	
	第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,054,000	
	第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,905,000	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,200,000	
	第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	69,171,000	72,151,578	
	第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	69,781,000	72,727,153	

第171回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,110,760	
第176回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,526,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	104,680,000	
第182回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,366,600	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	104,884,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	101,086,860	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,818,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	107,819,920	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,610,000	
第1回公営企業債券(5年)	200,000,000	202,048,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	216,024,860	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,225,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	105,164,000	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,845,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,618,000	
第1回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	49,731,000	52,383,154	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,101,000	69,517,760	
第1回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,935,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,850,000	
第21回道路債券	100,000,000	111,134,000	
第222回信金中金債(5年)	200,000,000	203,518,000	
第224回信金中金債(5年)	100,000,000	102,031,000	
第226回信金中金債(5年)	100,000,000	102,038,000	
第228回信金中金債(5年)	100,000,000	102,412,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,571,000	
第233回信金中金債(5年)	100,000,000	102,613,000	
第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,953,000	
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	106,589,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,097,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,860,000	82,850,047	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,860,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	107,913,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,748,000	87,603,757	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	154,924,770	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,439,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	51,466,000	54,553,960	
第30回公営企業債券	100,000,000	108,846,000	
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	106,787,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,946,000	88,923,171	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,424,800	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	226,746,000	

第316回政府保証道路債券	120,000,000	120,806,400	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,391,500	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,290,000	90,854,050	
第322回東京交通債券	10,000,000	11,177,700	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	102,774,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	103,205,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	117,792,780	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	106,528,800	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	49,957,920	
第344回東京交通債券	100,000,000	104,148,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	149,007,430	
第346回東京交通債券	20,000,000	19,597,800	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	187,988,410	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,928,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,853,000	92,268,509	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,561,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	232,367,700	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,395,000	65,715,257	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,710,000	94,884,083	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,059,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,837,000	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,798,000	66,012,428	
第3回公営企業債券(20年)	10,000,000	9,761,700	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	109,957,650	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,060,000	67,346,188	
第42回道路債券	100,000,000	108,503,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	107,208,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,410,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	99,563,412	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,034,000	62,799,188	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,690,000	100,390,326	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,041,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,315,000	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,473,000	101,599,032	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,065,000	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,901,000	69,974,999	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	101,149,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	57,066,000	59,713,862	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,062,000	70,118,867	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,110,000	201,631,703	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,939,000	100,850,501	



第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,113,000	69,324,769	
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	31,659,300	
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	117,146,070	
第5 回SBAB銀行AB(PUBL)円貨社債	100,000,000	99,038,000	
第5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,235,000	
第5 回公営企業債券	100,000,000	100,747,000	
第5 回新東京国際空港債券	100,000,000	102,985,000	
第5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,379,200	
第5 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,878,000	
第5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	105,427,000	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,834,000	41,412,223	
第5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,772,000	
第6 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,842,000	
第6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,173,000	
第6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	194,683,600	
第6 回公営企業債券	10,000,000	10,057,000	
第6 回阪神高速道路債券	100,000,000	103,765,000	
第6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,624,000	
第6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	86,592,000	92,062,882	
第6 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,615,000	61,045,764	
第6 回都市基盤整備債券	100,000,000	100,876,000	
第7 回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,527,000	
第7 回公営企業債券(30年)	100,000,000	111,737,000	
第7 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,904,000	
第7 回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,087,000	
第7 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,996,000	
第8 2 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,669,000	
第8 3 6 回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,254,900	
第8 3 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,205,000	
第8 3 9 回政府保証公営企業債券	128,000,000	132,232,960	
第8 4 0 回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,473,850	
第8 4 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,460,000	
第8 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	102,341,000	
第8 5 5 回政府保証公営企業債券	140,000,000	145,390,000	
第8 5 9 回政府保証公営企業債券	131,000,000	137,449,130	
第8 6 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	212,826,000	
第8 6 6 回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,689,000	
第8 6 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,830,000	
第8 7 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,474,000	
第8 7 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,833,000	
第8 7 5 回政府保証公営企業債券	112,000,000	119,744,800	

	第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	131,855,160	
	第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,698,000	
	第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,046,800	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	105,493,000	
	第8回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,070,000	
	第8回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	44,823,000	47,346,534	
	第8回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	63,362,000	66,471,173	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,878,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,501,000	
	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	312,906,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,549,000	
	第9回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	44,669,000	47,380,408	
	小計	16,787,999,000	17,524,339,117	
社債券	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	197,666,000	
	第11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	102,196,000	
	第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,221,000	
	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	101,456,000	
	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	105,391,000	
	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	102,093,000	
	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	100,792,000	
	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	102,490,000	
	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	100,640,000	
	第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,280,000	
	第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,171,000	
	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	103,330,000	
	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	204,568,000	
	第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,149,000	
	第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,759,000	
	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	109,942,000	
	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	211,236,000	
	第17回東日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	111,100,000	
	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	101,872,000	
	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	200,000,000	202,726,000	

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	111,495,000	
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	101,562,000	
第1回ラポバンク円貨社債	100,000,000	101,744,000	
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	101,427,000	
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	100,342,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	202,642,000	
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	107,521,000	
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	100,474,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,428,000	
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	100,389,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,257,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定特約付	100,000,000	99,949,000	
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	108,778,000	
第248回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,090,000	
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	101,284,000	
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	104,825,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,385,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,353,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,169,000	
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	99,404,000	
第261回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	31,000,000	34,338,390	
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	100,032,000	
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	106,763,000	
第27回大阪瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,880,000	
第285回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,080,000	
第286回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,609,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,540,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,142,000	
第2回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2008)	100,000,000	102,429,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,455,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,293,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,868,000	

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	104,156,000	
第30回京浜急行電鉄株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,603,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,546,000	
第32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	101,308,000	
第362回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,145,000	
第364回中国電力株式会社社債(一般担保付)	107,700,000	107,838,933	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	111,564,000	
第380回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,132,000	
第382回東北電力株式会社社債(一般担保付)	20,000,000	22,342,600	
第387回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,025,000	
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	102,802,000	
第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	96,510,000	
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	106,411,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,270,000	
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	107,634,000	
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	104,353,000	
第405回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	55,898,500	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,097,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	55,989,000	
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	101,135,000	
第425回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	85,678,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,863,000	
第455回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	73,432,800	
第459回東京電力株式会社社債(一般担保付)	10,000,000	6,438,700	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,344,000	
第471回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,159,000	
第473回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,966,000	
第474回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,015,000	
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	203,246,000	
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	104,413,000	
第4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	102,434,000	
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	100,283,000	
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	98,110,000	

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	102,598,000	
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	101,445,000	
第501回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	26,641,800	
第505回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	26,075,700	
第50回株式会社東芝無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,686,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,538,000	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	81,745,000	
第518回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	69,428,000	
第51回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,068,000	
第51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	107,291,000	
第521回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	67,023,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	59,130,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,460,000	
第536回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	60,870,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,947,000	
第53回三井物産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,877,000	
第542回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	61,158,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	61,804,000	
第554回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	58,901,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,244,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,705,000	
第5回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,939,000	
第5回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,102,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,991,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	99,522,000	
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	103,769,000	
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	104,761,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,575,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,788,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,914,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,713,000	
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	100,013,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	105,052,000	
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	105,885,000	
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	101,632,000	

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	204,466,000	
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	102,497,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,987,600	
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	104,499,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,895,000	
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	101,585,000	
第8回昭和シェル石油株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,266,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,152,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	96,529,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,892,000	
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	100,726,000	
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	21,037,940	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	114,003,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,496,000	
小計	13,487,700,000	13,559,490,963	
合計	172,463,279,000	179,860,022,461	

## 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,092,906,339	1,106,309,258
株式	128,947,760,855	110,841,678,065
派生商品評価勘定	99,404,080	57,480
未収入金	1,780,050	568,518,118
未収配当金	1,052,478,181	1,134,545,632
未収利息	3,644	1,441
差入委託証拠金	86,190,000	65,730,000
流動資産合計	132,280,523,149	113,716,839,994
資産合計	132,280,523,149	113,716,839,994
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		53,206,720
前受金	63,396,000	1,747,000
未払金		71,076,315
未払解約金	389,435,036	543,275,900
流動負債合計	452,831,036	669,305,935
負債合計	452,831,036	669,305,935
純資産の部		
元本等		
元本	201,643,731,909	197,377,667,906
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	69,816,039,796	84,330,133,847
元本等合計	131,827,692,113	113,047,534,059
純資産合計	131,827,692,113	113,047,534,059
負債純資産合計	132,280,523,149	113,716,839,994

(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22年11月10日及び平成23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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成22年11月11日 至平成23年11月10日)
1.資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	(1) 株式 同左  (2) 先物取引 同左
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

## (貸借対照表に関する注記)

	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	197,842,493,564円	201,643,731,909円
期中追加設定元本額	32,471,823,914円	42,982,092,406円
期中一部解約元本額	28,670,585,569円	47,248,156,409円
期末元本額	201,643,731,909円	197,377,667,906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)	6,776,729,065円	4,606,601,777円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	720,280,434円	1,013,557,564円
SBI資産設計オープン(分配型)	40,205,900円	35,241,312円
STAM TOPIXインデックス・オープン	4,513,258,119円	5,774,021,484円
世界経済インデックスファンド	60,905,923円	127,641,355円
住信 国内バランス30	620,093,119円	
住信 国内バランス60	493,753,346円	
すみしん マイセクション25	157,766,780円	133,721,713円
すみしん マイセクション50	358,249,010円	329,982,772円
すみしん マイセクション75	293,566,220円	274,012,920円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	18,689,133,492円	17,579,749,633円
すみしん DCマイセクション25	3,982,392,481円	5,243,819,954円
すみしん DCマイセクション50	14,383,018,119円	16,860,672,635円
すみしん DCマイセクション75	12,691,927,051円	14,507,511,868円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	2,832,300,006円	3,262,430,163円
すみしん DCマイセクションS25	351,854,072円	1,361,903,506円
すみしん DCマイセクションS50	1,630,953,406円	4,005,656,555円



すみしん DCマイセクションS75	1,225,185,836円	2,382,480,419円
すみしん DC日本株式インデックス・オープンS	496,505,464円	920,737,137円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	22,279,763円	31,812,121円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	103,193,534円	326,917,408円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	90,841,251円	274,677,114円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	37,530,680円	96,847,204円
DC世界経済インデックスファンド		84,034円
STAM 日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	4,197,536,460円	6,067,320,144円
住信 国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	469,417,569円	416,692,419円
すみしん マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	981,615,573円	945,620,324円
すみしん マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	449,972,845円	416,968,646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)	3,755,781,692円	3,399,517,297円
住信 国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	20,372,794円	19,408,078円
住信 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	83,304,696円	81,354,418円
すみしん マイセクション50VA2 (適格機関投資家専用)	5,484,542円	4,453,817円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	2,085,506,815円	2,024,251,177円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	7,754,776,157円	7,682,768,805円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	20,848,439,045円	19,740,638,500円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	6,148,024,375円	5,905,438,573円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	12,566,463,464円	13,063,294,606円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,599,854,749円	2,543,155,000円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	14,100,828,232円	13,965,617,343円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	6,343,097,930円	6,222,982,103円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,845,363,926円	4,741,416,788円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	3,422,685,864円	3,235,772,154円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	5,775,314,183円	5,944,598,134円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,101,275,914円	1,950,394,141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	2,502,454,494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	209,555,705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)	26,464,267,169円	12,862,092,189円

住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,313,547,632円	3,409,302,837円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	874,770,214円	872,519,566円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 69,816,039,796円下回っており ます。	純資産額は、元本を 84,330,133,847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	201,643,731,909口	197,377,667,906口

## (金融商品に関する注記)

## 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)	(自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部署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。	同左
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。	同左

## 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）	（平成23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。	同左
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 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。</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>	<p>a. 株式 同左</p> <p>b. 先物取引 同左</p> <p>c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

## (追加情報)

（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）	（自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日）
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	（平成22年11月10日現在）	（平成23年11月10日現在）
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	3,466,630,834	13,527,887,575
合計	3,466,630,834	13,527,887,575

（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)

## 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

		（平成22年11月10日現在）
--	--	-----------------

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	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。

#### 株式関連

区分	種類	(平成23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	2,225,518,000		2,172,420,000	53,098,000
合計		2,225,518,000		2,172,420,000	53,098,000

(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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成22年11月11日 至平成23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22年11月10日現在)	(平成23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 = 0.5727円

(3) 附属明細表 (平成23年11月10日現在)

1) 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	49,000	174.00	8,526,000	

日本水産	143,800	260.00	37,388,000
マルハニチロホールディングス	247,000	134.00	33,098,000
ハウスイ	9,000	89.00	801,000
サカタのタネ	18,400	1,091.00	20,074,400
ホクト	12,700	1,635.00	20,764,500
ショーボンドホールディングス	11,300	1,739.00	19,650,700
ミライト・ホールディングス	36,000	571.00	20,556,000
住石ホールディングス	36,600	63.00	2,305,800
日鉄鉱業	32,000	303.00	9,696,000
三井松島産業	82,000	132.00	10,824,000
国際石油開発帝石	1,517	514,000.00	779,738,000
日本海洋掘削	3,100	2,376.00	7,365,600
関東天然瓦斯開発	13,000	385.00	5,005,000
石油資源開発	17,800	3,070.00	54,646,000
ダイセキ環境ソリューション	18	177,900.00	3,202,200
間組	44,900	169.00	7,588,100
東急建設	44,290	204.00	9,035,160
コムシスホールディングス	60,900	783.00	47,684,700
ミサワホーム	12,100	472.00	5,711,200
高松コンストラクショングループ	11,300	1,175.00	13,277,500
東建コーポレーション	5,640	2,720.00	15,340,800
ヤマウラ	15,500	206.00	3,193,000
大成建設	636,000	214.00	136,104,000
大林組	379,000	350.00	132,650,000
清水建設	383,000	336.00	128,688,000
長谷工コーポレーション	780,000	49.00	38,220,000
松井建設	23,000	304.00	6,992,000
鹿島建設	593,000	255.00	151,215,000
鉄建建設	70,000	89.00	6,230,000
安藤建設	41,000	96.00	3,936,000
太平工業	22,000	409.00	8,998,000
三井住友建設	78,800	49.00	3,861,200
前田建設工業	86,000	286.00	24,596,000
ナカノフドー建設	21,500	181.00	3,891,500
奥村組	120,000	308.00	36,960,000
大和小田急建設	6,000	193.00	1,158,000
東鉄工業	18,000	655.00	11,790,000
イチケン	31,000	117.00	3,627,000
戸田建設	139,000	275.00	38,225,000
熊谷組	89,000	69.00	6,141,000
青木あすなる建設	8,500	406.00	3,451,000

北野建設	43,000	166.00	7,138,000
三井ホーム	22,000	381.00	8,382,000
矢作建設工業	15,400	376.00	5,790,400
ピーエス三菱	7,900	220.00	1,738,000
大東建託	47,400	7,040.00	333,696,000
新日本建設	34,300	195.00	6,688,500
N I P P O	29,000	678.00	19,662,000
東亜道路工業	34,000	140.00	4,760,000
前田道路	37,000	778.00	28,786,000
日本道路	42,000	191.00	8,022,000
東亜建設工業	109,000	132.00	14,388,000
五洋建設	163,500	259.00	42,346,500
大林道路	22,000	180.00	3,960,000
住友林業	87,400	650.00	56,810,000
日本基礎技術	19,700	243.00	4,787,100
日成ビルド工業	65,000	177.00	11,505,000
巴コーポレーション	15,500	271.00	4,200,500
パナホーム	47,000	540.00	25,380,000
大和ハウス工業	312,000	971.00	302,952,000
ライト工業	28,900	353.00	10,201,700
積水ハウス	352,000	676.00	237,952,000
北陸電気工事	10,000	205.00	2,050,000
ユアテック	21,000	358.00	7,518,000
西部電気工業	14,000	330.00	4,620,000
四電工	12,000	304.00	3,648,000
中電工	18,500	842.00	15,577,000
関電工	58,000	326.00	18,908,000
きんでん	83,000	621.00	51,543,000
東京エネシス	15,000	391.00	5,865,000
トーエネック	20,000	387.00	7,740,000
住友電設	10,600	444.00	4,706,400
日本電設工業	23,000	722.00	16,606,000
協和エクシオ	41,200	720.00	29,664,000
新日本空調	16,700	388.00	6,479,600
日本工営	39,000	265.00	10,335,000
日本電話施設	24,000	246.00	5,904,000
九電工	25,000	461.00	11,525,000
三機工業	34,000	400.00	13,600,000
日揮	118,000	1,980.00	233,640,000
中外炉工業	54,000	223.00	12,042,000
ヤマト	22,000	302.00	6,644,000

太平電業	18,000	499.00	8,982,000
高砂熱学工業	38,100	605.00	23,050,500
三晃金属工業	14,000	237.00	3,318,000
NEC ネットエスアイ	10,400	1,085.00	11,284,000
朝日工業社	22,000	304.00	6,688,000
アタカ大機	8,000	233.00	1,864,000
大気社	19,700	1,752.00	34,514,400
ダイダン	22,000	499.00	10,978,000
日比谷総合設備	15,800	740.00	11,692,000
東芝プラントシステム	24,000	774.00	18,576,000
日本製粉	78,000	340.00	26,520,000
日清製粉グループ本社	113,000	942.00	106,446,000
日東富士製粉	11,000	291.00	3,201,000
昭和産業	52,000	235.00	12,220,000
鳥越製粉	10,800	694.00	7,495,200
協同飼料	43,000	85.00	3,655,000
中部飼料	11,300	486.00	5,491,800
日本配合飼料	38,000	102.00	3,876,000
東洋精糖	23,000	89.00	2,047,000
日本甜菜製糖	69,000	154.00	10,626,000
三井製糖	44,000	299.00	13,156,000
ネクスト	7,000	320.00	2,240,000
日本M&Aセンター	24	433,500.00	10,404,000
ノバレーゼ	33	49,800.00	1,643,400
アコーディア・ゴルフ	490	58,700.00	28,763,000
パソナグループ	121	77,200.00	9,341,200
リンクアンドモチベーション	30	52,700.00	1,581,000
テンブホールディングス	16,000	728.00	11,648,000
森永製菓	122,000	178.00	21,716,000
中村屋	29,000	393.00	11,397,000
江崎グリコ	45,000	929.00	41,805,000
名糖産業	5,500	998.00	5,489,000
不二家	71,000	153.00	10,863,000
山崎製パン	91,000	1,045.00	95,095,000
モロゾフ	19,000	277.00	5,263,000
カルビー	6,700	3,395.00	22,746,500
森永乳業	106,000	293.00	31,058,000
ヤクルト本社	66,900	2,256.00	150,926,400
明治ホールディングス	37,000	3,325.00	123,025,000
雪印メグミルク	26,900	1,484.00	39,919,600
プリマハム	73,000	106.00	7,738,000

日本ハム	95,000	968.00	91,960,000
伊藤ハム	68,000	292.00	19,856,000
丸大食品	60,000	257.00	15,420,000
米久	11,000	692.00	7,612,000
S Foods	8,000	590.00	4,720,000
学情	4,300	246.00	1,057,800
スタジオアリス	5,900	1,215.00	7,168,500
シミック	4,100	1,274.00	5,223,400
システナ	132	42,650.00	5,629,800
NECフィールドینگ	9,400	925.00	8,695,000
新日鉄ソリューションズ	7,400	1,658.00	12,269,200
総合警備保障	42,300	835.00	35,320,500
日本駐車場開発	1,193	3,500.00	4,175,500
コア	4,200	635.00	2,667,000
カカクコム	18,100	2,971.00	53,775,100
ルネサンス	7,500	376.00	2,820,000
エムスリー	91	373,000.00	33,943,000
ベストプライダル	37	72,200.00	2,671,400
ディー・エヌ・エー	52,200	2,762.00	144,176,400
博報堂DYホールディングス	14,780	4,160.00	61,484,800
ぐるなび	8,500	914.00	7,769,000
一休	87	34,700.00	3,018,900
ジャパンベストレスキューシステム	19	70,000.00	1,330,000
ジェイコムホールディングス	2,800	777.00	2,175,600
PGMホールディングス	312	51,900.00	16,192,800
サッポロホールディングス	206,000	280.00	57,680,000
アサヒグループホールディングス	234,100	1,618.00	378,773,800
キリンホールディングス	500,000	902.00	451,000,000
宝ホールディングス	105,000	481.00	50,505,000
オエノンホールディングス	34,000	179.00	6,086,000
養命酒製造	9,000	718.00	6,462,000
三国コカ・コーラボトリング	13,000	670.00	8,710,000
コカ・コーラウエスト	42,300	1,344.00	56,851,200
コカ・コーラ セントラル ジャパン	14,000	1,018.00	14,252,000
ダイトードリンコ	5,700	2,991.00	17,048,700
伊藤園	37,800	1,320.00	49,896,000
キーコーヒー	10,900	1,385.00	15,096,500
ユニカフェ	2,900	342.00	991,800
ジャパンフーズ	1,800	772.00	1,389,600
日清オイリオグループ	48,000	331.00	15,888,000
不二製油	30,300	1,106.00	33,511,800



J - オイルミルズ	46,000	216.00	9,936,000
ローソン	34,700	4,575.00	158,752,500
インターニックス	4,500	334.00	1,503,000
サンエー	3,700	3,005.00	11,118,500
キリン堂	4,800	477.00	2,289,600
ダイユーエイト	1,700	674.00	1,145,800
カワチ薬品	7,700	1,523.00	11,727,100
エービーシー・マート	15,600	3,035.00	47,346,000
ハードオフコーポレーション	5,400	453.00	2,446,200
高千穂交易	4,600	860.00	3,956,000
アスクル	8,600	1,047.00	9,004,200
ゲオホールディングス	182	85,000.00	15,470,000
ポイント	9,290	3,325.00	30,889,250
シー・ヴィ・エス・バイエリア	7,000	97.00	679,000
伊藤忠食品	2,700	2,708.00	7,311,600
くらコーポレーション	5,800	971.00	5,631,800
キャンドウ	58	85,600.00	4,964,800
エレマテック	8,700	1,260.00	10,962,000
パル	3,200	2,960.00	9,472,000
J A L U X	3,100	700.00	2,170,000
エディオン	43,700	609.00	26,613,300
サーラコーポレーション	9,500	469.00	4,455,500
トーマンデバイス	1,700	1,707.00	2,901,900
あみやき亭	17	196,200.00	3,335,400
東京エレクトロン デバイス	22	130,900.00	2,879,800
ひらまつ	47	52,800.00	2,481,600
双日	735,600	128.00	94,156,800
ゲンキー	800	1,541.00	1,232,800
アルフレッサ ホールディングス	28,800	2,920.00	84,096,000
ハニーズ	9,670	1,095.00	10,588,650
キッコーマン	102,000	863.00	88,026,000
味の素	329,000	938.00	308,602,000
キューピー	63,500	1,072.00	68,072,000
ハウス食品	44,300	1,407.00	62,330,100
カゴメ	48,200	1,487.00	71,673,400
焼津水産化学工業	5,800	701.00	4,065,800
アリアケジャパン	11,400	1,361.00	15,515,400
ニチレイ	140,000	348.00	48,720,000
横浜冷凍	25,400	592.00	15,036,800
東洋水産	54,000	1,950.00	105,300,000
日清食品ホールディングス	48,700	2,977.00	144,979,900

永谷園	12,000	850.00	10,200,000
フジッコ	13,000	950.00	12,350,000
ロック・フィールド	6,000	1,240.00	7,440,000
日本たばこ産業	2,766	367,500.00	1,016,505,000
わらべや日洋	6,900	962.00	6,637,800
なとり	5,700	825.00	4,702,500
片倉工業	14,900	752.00	11,204,800
ゲンゼ	87,000	224.00	19,488,000
昭栄	20,000	584.00	11,680,000
神栄	14,000	132.00	1,848,000
山下医科器械	900	970.00	873,000
ラサ商事	4,800	324.00	1,555,200
アルペン	7,000	1,347.00	9,429,000
アルコニックス	2,900	1,610.00	4,669,000
ビックカメラ	418	40,750.00	17,033,500
DCMホールディングス	56,900	643.00	36,586,700
MonotaRO	6,200	777.00	4,817,400
あいホールディングス	19,600	326.00	6,389,600
J.フロントリテイリング	260,000	351.00	91,260,000
ドトール・日レスホールディングス	17,500	973.00	17,027,500
マツモトキヨシホールディングス	20,400	1,472.00	30,028,800
物語コーポレーション	1,200	1,308.00	1,569,600
ココカラファイン	11,500	1,980.00	22,770,000
三越伊勢丹ホールディングス	218,400	798.00	174,283,200
東洋紡績	493,000	106.00	52,258,000
ユニチカ	258,000	41.00	10,578,000
富士紡ホールディングス	49,000	139.00	6,811,000
日清紡ホールディングス	74,000	666.00	49,284,000
倉敷紡績	120,000	147.00	17,640,000
ダイワボウホールディングス	107,000	181.00	19,367,000
シキボウ	75,000	88.00	6,600,000
日東紡績	86,000	274.00	23,564,000
トヨタ紡織	38,900	827.00	32,170,300
クリエイトSDホールディングス	4,600	1,565.00	7,199,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,700	594.00	12,295,800
UKCホールディングス	6,500	725.00	4,712,500
丸善CHIホールディングス	3,200	198.00	633,600
TOKAIホールディングス	53,700	394.00	21,157,800
日本毛織	40,000	590.00	23,600,000
トーア紡コーポレーション	50,000	51.00	2,550,000
ダイドーリミテッド	14,500	759.00	11,005,500

東京建物不動産販売	4,300	219.00	941,700
野村不動産ホールディングス	53,100	1,207.00	64,091,700
常和ホールディングス	2,900	1,215.00	3,523,500
ヒューリック	35,600	827.00	29,441,200
帝国繊維	12,000	504.00	6,048,000
ブックオフコーポレーション	6,100	648.00	3,952,800
日本コークス工業	94,000	99.00	9,306,000
ミタチ産業	2,600	371.00	964,600
J F E 商事ホールディングス	74,000	313.00	23,162,000
あさひ	6,400	1,679.00	10,745,600
サークルKサンクス	23,900	1,287.00	30,759,300
日本調剤	1,390	2,690.00	3,739,100
コスモス薬品	5,500	3,710.00	20,405,000
シップヘルスケアホールディングス	14,300	1,909.00	27,298,700
ソフトクリエイト	1,200	1,064.00	1,276,800
セブン&アイ・ホールディングス	459,700	2,130.00	979,161,000
ツルハホールディングス	9,800	4,050.00	39,690,000
サンマルクホールディングス	3,200	2,866.00	9,171,200
フェリシモ	3,100	1,008.00	3,124,800
トリドール	9,500	725.00	6,887,500
クスリのアオキ	1,600	1,269.00	2,030,400
帝人	477,000	236.00	112,572,000
東レ	846,000	571.00	483,066,000
クラレ	185,300	1,054.00	195,306,200
旭化成	679,000	455.00	308,945,000
サカイオーベックス	35,000	106.00	3,710,000
稲葉製作所	5,600	886.00	4,961,600
三協・立山ホールディングス	157,000	100.00	15,700,000
トーカロ	6,600	1,547.00	10,210,200
アルファC o	4,600	824.00	3,790,400
SUMCO	72,500	708.00	51,330,000
川田テクノロジーズ	3,400	1,124.00	3,821,600
住江織物	32,000	132.00	4,224,000
日本フェルト	6,500	375.00	2,437,500
イチカワ	9,000	139.00	1,251,000
日本バイリーン	15,000	320.00	4,800,000
芦森工業	31,000	104.00	3,224,000
アツギ	92,000	93.00	8,556,000
ダイニック	22,000	128.00	2,816,000
共和レザー	6,800	262.00	1,781,600
セーレン	29,400	478.00	14,053,200

東海染工	16,000	83.00	1,328,000
小松精練	18,000	332.00	5,976,000
ワコールホールディングス	69,000	953.00	65,757,000
ホギメディカル	7,400	3,205.00	23,717,000
レナウン	25,200	141.00	3,553,200
クラウディア	1,800	990.00	1,782,000
T S Iホールディングス	52,100	399.00	20,787,900
デジタルハーツ	9	145,200.00	1,306,800
I Tホールディングス	33,400	844.00	28,189,600
グリー	48,000	2,757.00	132,336,000
コーエーテクモホールディングス	21,800	708.00	15,434,400
三菱総合研究所	4,300	1,309.00	5,628,700
ボルテージ	1,100	1,003.00	1,103,300
特種東海製紙	73,000	167.00	12,191,000
ドワンゴ	55	135,800.00	7,469,000
ベリサーブ	7	138,000.00	966,000
マクロミル	12,800	878.00	11,238,400
ティーガイア	71	153,900.00	10,926,900
GMOペイメントゲートウェイ	24	324,500.00	7,788,000
ザッパラス	61	74,800.00	4,562,800
インターネットイニシアティブ	64	292,600.00	18,726,400
ソネットエンタテインメント	62	300,000.00	18,600,000
S R Aホールディングス	5,800	749.00	4,344,200
J B I Sホールディングス	11,500	237.00	2,725,500
朝日ネット	9,000	350.00	3,150,000
王子製紙	515,000	394.00	202,910,000
三菱製紙	166,000	73.00	12,118,000
北越紀州製紙	72,500	514.00	37,265,000
中越パルプ工業	44,000	125.00	5,500,000
巴川製紙所	20,000	161.00	3,220,000
大王製紙	49,000	533.00	26,117,000
日本製紙グループ本社	56,300	1,719.00	96,779,700
レンゴー	94,000	574.00	53,956,000
トーモク	37,000	203.00	7,511,000
ザ・パック	6,900	1,141.00	7,872,900
コープケミカル	17,000	90.00	1,530,000
昭和電工	725,000	147.00	106,575,000
住友化学	801,000	265.00	212,265,000
日本化成	22,000	136.00	2,992,000
住友精化	22,000	331.00	7,282,000
日産化学工業	88,700	715.00	63,420,500

ラサ工業	47,000	119.00	5,593,000
クレハ	75,000	347.00	26,025,000
テイカ	20,000	283.00	5,660,000
石原産業	195,000	84.00	16,380,000
片倉チッカリン	8,000	182.00	1,456,000
日本曹達	69,000	326.00	22,494,000
東ソー	312,000	227.00	70,824,000
トクヤマ	181,000	242.00	43,802,000
セントラル硝子	111,000	367.00	40,737,000
東亜合成	146,000	327.00	47,742,000
ダイソー	46,000	243.00	11,178,000
関東電化工業	26,000	368.00	9,568,000
電気化学工業	245,000	295.00	72,275,000
イビデン	73,000	1,710.00	124,830,000
信越化学工業	209,100	3,685.00	770,533,500
日本カーバイド工業	37,000	100.00	3,700,000
堺化学工業	36,000	283.00	10,188,000
エア・ウォーター	95,000	1,044.00	99,180,000
大陽日酸	153,000	556.00	85,068,000
日本化学工業	46,000	122.00	5,612,000
日本パーカライズン	28,000	988.00	27,664,000
高圧ガス工業	17,000	430.00	7,310,000
チタン工業	13,000	391.00	5,083,000
四国化成工業	17,000	427.00	7,259,000
戸田工業	15,000	585.00	8,775,000
ステラ ケミファ	5,500	2,092.00	11,506,000
保土谷化学工業	23,000	203.00	4,669,000
日本触媒	88,000	795.00	69,960,000
大日精化工業	42,000	336.00	14,112,000
カネカ	145,000	412.00	59,740,000
協和発酵キリン	159,000	907.00	144,213,000
三菱瓦斯化学	201,000	453.00	91,053,000
三井化学	495,000	237.00	117,315,000
J S R	106,200	1,416.00	150,379,200
東京応化工業	20,900	1,536.00	32,102,400
三菱ケミカルホールディングス	729,000	438.00	319,302,000
日本合成化学工業	24,000	395.00	9,480,000
ダイセル	151,000	402.00	60,702,000
住友ベークライト	100,000	415.00	41,500,000
積水化学工業	242,000	600.00	145,200,000
日本ゼオン	109,000	630.00	68,670,000

アイカ工業	31,400	1,061.00	33,315,400
宇部興産	488,000	223.00	108,824,000
積水樹脂	16,000	688.00	11,008,000
タキロン	27,000	256.00	6,912,000
旭有機材工業	41,000	198.00	8,118,000
日立化成工業	50,400	1,361.00	68,594,400
ニチバン	11,000	260.00	2,860,000
リケンテクノス	19,000	224.00	4,256,000
大倉工業	28,000	278.00	7,784,000
積水化成品工業	30,000	281.00	8,430,000
群栄化学工業	31,000	209.00	6,479,000
タイガースポリマー	5,700	291.00	1,658,700
日本カーリット	9,300	401.00	3,729,300
日本化薬	82,000	743.00	60,926,000
イーピーエス	63	172,000.00	10,836,000
パナソニック電気インフォメーションシステムズ	2,600	2,125.00	5,525,000
フェイス	377	8,230.00	3,102,710
アミューズ	3,300	989.00	3,263,700
野村総合研究所	62,300	1,785.00	111,205,500
ドリームインキュベータ	40	56,400.00	2,256,000
サイバネットシステム	92	18,730.00	1,723,160
T A C	11,400	176.00	2,006,400
電通	105,800	2,236.00	236,568,800
インテージ	3,300	1,500.00	4,950,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	757	4,595.00	3,478,415
シンプレクス・ホールディングス	185	28,310.00	5,237,350
イオンファンタジー	4,200	1,123.00	4,716,600
メディカルシステムネットワーク	1,900	808.00	1,535,200
日本精化	9,700	503.00	4,879,100
A D E K A	50,200	742.00	37,248,400
日油	93,000	355.00	33,015,000
ミヨシ油脂	43,000	102.00	4,386,000
ハリマ化成	9,900	619.00	6,128,100
花王	309,300	2,057.00	636,230,100
第一工業製薬	21,000	212.00	4,452,000
三洋化成工業	37,000	492.00	18,204,000
武田薬品工業	436,800	3,365.00	1,469,832,000
アステラス製薬	258,900	3,010.00	779,289,000
大日本住友製薬	82,500	834.00	68,805,000
塩野義製薬	182,100	977.00	177,911,700
田辺三菱製薬	116,500	1,311.00	152,731,500

わかもと製薬	13,000	227.00	2,951,000
あすか製薬	14,000	521.00	7,294,000
日本新薬	24,000	910.00	21,840,000
中外製薬	135,400	1,186.00	160,584,400
科研製薬	46,000	998.00	45,908,000
エーザイ	143,500	3,060.00	439,110,000
ロート製薬	49,000	919.00	45,031,000
小野薬品工業	57,000	4,170.00	237,690,000
久光製薬	36,200	3,155.00	114,211,000
有機合成薬品工業	8,000	152.00	1,216,000
持田製薬	41,000	812.00	33,292,000
参天製薬	39,200	2,860.00	112,112,000
扶桑薬品工業	39,000	194.00	7,566,000
日本ケミファ	18,000	286.00	5,148,000
ツムラ	31,800	2,203.00	70,055,400
日医工	19,700	1,685.00	33,194,500
テルモ	88,700	3,640.00	322,868,000
みらかホールディングス	30,300	2,890.00	87,567,000
キッセイ薬品工業	21,600	1,459.00	31,514,400
生化学工業	22,300	837.00	18,665,100
栄研化学	9,000	977.00	8,793,000
日水製薬	4,700	662.00	3,111,400
鳥居薬品	8,000	1,380.00	11,040,000
東和薬品	5,900	3,335.00	19,676,500
沢井製薬	7,700	7,510.00	57,827,000
ゼリア新薬工業	17,000	1,235.00	20,995,000
第一三共	392,200	1,454.00	570,258,800
キョーリン製薬ホールディングス	29,000	1,399.00	40,571,000
大幸薬品	5,400	812.00	4,384,800
ダイト	3,200	1,226.00	3,923,200
大塚ホールディングス	231,400	2,059.00	476,452,600
大正製薬ホールディングス	28,000	5,000.00	140,000,000
大日本塗料	67,000	78.00	5,226,000
日本ペイント	110,000	566.00	62,260,000
関西ペイント	132,000	716.00	94,512,000
中国塗料	36,000	502.00	18,072,000
日本特殊塗料	9,000	309.00	2,781,000
藤倉化成	14,700	346.00	5,086,200
太陽ホールディングス	9,500	1,931.00	18,344,500
D I C	445,000	124.00	55,180,000
サカティンクス	22,000	329.00	7,238,000

東洋インキSCホールディングス	105,000	279.00	29,295,000
アルプス技研	5,300	674.00	3,572,200
ダイオーズ	2,100	477.00	1,001,700
日本空調サービス	3,100	690.00	2,139,000
オリエンタルランド	31,400	8,280.00	259,992,000
ダスキン	35,000	1,501.00	52,535,000
パーク24	56,700	911.00	51,653,700
明光ネットワークジャパン	11,000	681.00	7,491,000
ファルコSDホールディングス	7,300	891.00	6,504,300
クレスコ	2,800	551.00	1,542,800
フジ・メディア・ホールディングス	1,145	113,300.00	129,728,500
秀英予備校	5,100	307.00	1,565,700
田谷	2,000	652.00	1,304,000
ラウンドワン	38,400	574.00	22,041,600
リゾートトラスト	18,800	1,112.00	20,905,600
オービック	3,450	15,060.00	51,957,000
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,200	715.00	1,573,000
ヤフー	8,047	24,500.00	197,151,500
ビー・エム・エル	7,600	1,908.00	14,500,800
ワタベウェディング	3,700	611.00	2,260,700
トレンドマイクロ	48,500	2,487.00	120,619,500
もしもしホットライン	19,300	702.00	13,548,600
東急コミュニティー	3,000	2,443.00	7,329,000
リソー教育	1,277	4,140.00	5,286,780
日本オラクル	17,600	2,668.00	46,956,800
アルファシステムズ	3,000	1,119.00	3,357,000
フューチャーアーキテクト	133	30,900.00	4,109,700
ウェアハウス	4,600	238.00	1,094,800
シーエーシー	7,500	581.00	4,357,500
ソフトバンク・テクノロジー	2,600	636.00	1,653,600
トーセ	2,800	495.00	1,386,000
ユー・エス・エス	15,160	6,690.00	101,420,400
オービックビジネスコンサルタント	2,800	3,670.00	10,276,000
日立ビジネスソリューション	3,500	996.00	3,486,000
伊藤忠テクノソリューションズ	13,000	3,525.00	45,825,000
アイティフォー	12,300	280.00	3,444,000
東京個別指導学院	10,600	145.00	1,537,000
東計電算	2,000	1,109.00	2,218,000
エクスネット	10	115,000.00	1,150,000
テー・オー・ダブリュー	3,600	447.00	1,609,200
大塚商会	8,800	5,380.00	47,344,000



総合メディカル	2,700	2,599.00	7,017,300
サイボウズ	203	18,820.00	3,820,460
ソフトブレーン	165	7,240.00	1,194,600
アグレックス	3,000	738.00	2,214,000
セントラルスポーツ	4,300	933.00	4,011,900
電通国際情報サービス	6,800	694.00	4,719,200
ウェザーニューズ	3,300	2,496.00	8,236,800
C I J	11,100	266.00	2,952,600
WOWOW	34	167,500.00	5,695,000
富士フイルムホールディングス	249,100	1,738.00	432,935,800
コニカミノルタホールディングス	294,000	563.00	165,522,000
資生堂	193,600	1,392.00	269,491,200
ライオン	134,000	439.00	58,826,000
高砂香料工業	38,000	379.00	14,402,000
マンダム	11,700	2,004.00	23,446,800
ミルボン	6,200	2,475.00	15,345,000
ファンケル	29,300	1,070.00	31,351,000
コーセー	18,900	1,808.00	34,171,200
ドクターシーラボ	70	420,500.00	29,435,000
ポーラ・オルビスホールディングス	11,900	2,036.00	24,228,400
エステー	7,200	960.00	6,912,000
コニシ	8,500	1,012.00	8,602,000
長谷川香料	14,800	1,241.00	18,366,800
小林製薬	16,200	3,930.00	63,666,000
荒川化学工業	9,100	630.00	5,733,000
メック	8,300	259.00	2,149,700
日本高純度化学	33	200,800.00	6,626,400
荏原ユーザライト	1,600	1,900.00	3,040,000
アース製薬	8,400	2,837.00	23,830,800
イハラケミカル工業	20,000	263.00	5,260,000
北興化学工業	11,000	218.00	2,398,000
大成ラミック	3,300	2,354.00	7,768,200
クミアイ化学工業	27,000	263.00	7,101,000
日本農薬	27,000	347.00	9,369,000
昭和シェル石油	104,200	513.00	53,454,600
コスモ石油	322,000	194.00	62,468,000
富士興産	39,000	65.00	2,535,000
ニチレキ	15,000	385.00	5,775,000
東燃ゼネラル石油	176,000	904.00	159,104,000
ユシロ化学工業	6,300	893.00	5,625,900
ピーピー・カストロール	4,800	335.00	1,608,000

AOCホールディングス	27,000	424.00	11,448,000	
MORESCO	2,400	719.00	1,725,600	
出光興産	13,800	7,600.00	104,880,000	
JXホールディングス	1,294,100	474.00	613,403,400	
横浜ゴム	142,000	398.00	56,516,000	
東洋ゴム工業	88,000	187.00	16,456,000	
ブリヂストン	365,400	1,722.00	629,218,800	
住友ゴム工業	90,900	912.00	82,900,800	
藤倉ゴム工業	7,300	291.00	2,124,300	
オカモト	43,000	325.00	13,975,000	
アキレス	95,000	107.00	10,165,000	
フコク	4,900	652.00	3,194,800	
ニッタ	11,500	1,300.00	14,950,000	
クリエートメディック	3,400	795.00	2,703,000	
東海ゴム工業	21,600	900.00	19,440,000	
三ツ星ベルト	31,000	394.00	12,214,000	
バンドー化学	41,000	314.00	12,874,000	
鬼怒川ゴム工業	26,000	590.00	15,340,000	
旭硝子	574,000	600.00	344,400,000	
日本板硝子	504,000	142.00	71,568,000	
石塚硝子	15,000	141.00	2,115,000	
有沢製作所	19,400	308.00	5,975,200	
日本山村硝子	46,000	171.00	7,866,000	
日本電気硝子	224,000	671.00	150,304,000	
オハラ	4,400	709.00	3,119,600	
住友大阪セメント	236,000	230.00	54,280,000	
太平洋セメント	688,000	147.00	101,136,000	
デイ・シイ	13,500	226.00	3,051,000	
リゾートソリューション	16,000	139.00	2,224,000	
日本ヒューム	11,000	281.00	3,091,000	
日本コンクリート工業	21,000	183.00	3,843,000	
東海カーボン	101,000	369.00	37,269,000	
日本カーボン	53,000	215.00	11,395,000	
東洋炭素	6,500	3,540.00	23,010,000	
ノリタケカンパニーリミテド	60,000	231.00	13,860,000	
TOTO	180,000	651.00	117,180,000	
日本碍子	152,000	819.00	124,488,000	
日本特殊陶業	100,000	968.00	96,800,000	
MARUWA	3,400	3,160.00	10,744,000	
品川リフラクトリーズ	30,000	204.00	6,120,000	
黒崎播磨	27,000	226.00	6,102,000	

東京窯業	14,000	156.00	2,184,000
ニッカトー	4,100	423.00	1,734,300
フジミインコーポレーテッド	10,600	880.00	9,328,000
ニチアス	52,000	442.00	22,984,000
新日本製鐵	3,059,000	187.00	572,033,000
住友金属工業	2,160,000	133.00	287,280,000
神戸製鋼所	1,616,000	121.00	195,536,000
日新製鋼	415,000	113.00	46,895,000
中山製鋼所	64,000	72.00	4,608,000
合同製鐵	65,000	184.00	11,960,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	276,200	1,344.00	371,212,800
東京製鐵	59,000	595.00	35,105,000
共英製鋼	12,400	1,389.00	17,223,600
大和工業	26,600	1,965.00	52,269,000
東京鐵鋼	23,000	209.00	4,807,000
大阪製鐵	7,300	1,371.00	10,008,300
淀川製鋼所	83,000	323.00	26,809,000
東洋鋼鈑	28,000	275.00	7,700,000
住友鋼管	6,800	514.00	3,495,200
丸一鋼管	35,800	1,669.00	59,750,200
モリ工業	18,000	281.00	5,058,000
大同特殊鋼	195,000	476.00	92,820,000
日本高周波鋼業	47,000	80.00	3,760,000
日本金属工業	90,000	70.00	6,300,000
日本冶金工業	88,000	116.00	10,208,000
山陽特殊製鋼	58,000	399.00	23,142,000
愛知製鋼	62,000	391.00	24,242,000
日立金属	76,000	870.00	66,120,000
日本金属	28,000	166.00	4,648,000
大平洋金属	81,000	424.00	34,344,000
日本電工	42,000	371.00	15,582,000
栗本鐵工所	56,000	123.00	6,888,000
日本鑄鉄管	14,000	153.00	2,142,000
日本製鋼所	180,000	472.00	84,960,000
三菱製鋼	70,000	198.00	13,860,000
日亜鋼業	18,000	189.00	3,402,000
日本精線	8,000	390.00	3,120,000
日本輕金属	266,000	100.00	26,600,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	269.00	4,842,000
三井金属鉱業	317,000	190.00	60,230,000
東邦亜鉛	66,000	295.00	19,470,000

三菱マテリアル	728,000	202.00	147,056,000	
住友金属鉱山	302,000	998.00	301,396,000	
DOWAホールディングス	139,000	483.00	67,137,000	
古河機械金属	196,000	66.00	12,936,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,500	4,395.00	50,542,500	
東邦チタニウム	18,900	1,690.00	31,941,000	
住友軽金属工業	281,000	67.00	18,827,000	
古河スカイ	48,000	162.00	7,776,000	
古河電気工業	367,000	177.00	64,959,000	
住友電気工業	411,700	804.00	331,006,800	
フジクラ	175,000	222.00	38,850,000	
昭和電線ホールディングス	149,000	72.00	10,728,000	
タツタ電線	22,000	352.00	7,744,000	
日立電線	91,000	166.00	15,106,000	
沖電線	12,000	138.00	1,656,000	
カナレ電気	1,500	1,228.00	1,842,000	
平河ヒューテック	2,300	753.00	1,731,900	
リョービ	65,000	303.00	19,695,000	
アサヒホールディングス	16,300	1,510.00	24,613,000	
東洋製罐	82,400	1,084.00	89,321,600	
ホッカンホールディングス	32,000	226.00	7,232,000	
コロナ	5,800	1,311.00	7,603,800	
横河ブリッジホールディングス	24,000	475.00	11,400,000	
駒井ハルテック	26,000	183.00	4,758,000	
高田機工	11,000	158.00	1,738,000	
三和ホールディングス	117,000	230.00	26,910,000	
文化シャッター	33,000	242.00	7,986,000	
東洋シャッター	3,300	333.00	1,098,900	
住生活グループ	151,500	1,543.00	233,764,500	
日本ファイルコン	9,600	410.00	3,936,000	
ノーリツ	22,800	1,388.00	31,646,400	
長府製作所	11,200	1,901.00	21,291,200	
リンナイ	18,700	5,940.00	111,078,000	
ユニプレス	17,700	2,164.00	38,302,800	
ダイニチ工業	6,700	787.00	5,272,900	
日東精工	16,000	193.00	3,088,000	
三洋工業	15,000	144.00	2,160,000	
岡部	23,000	383.00	8,809,000	
日立ツール	6,700	799.00	5,353,300	
東プレ	22,400	750.00	16,800,000	
高周波熱錬	15,500	594.00	9,207,000	

東京製綱	79,000	159.00	12,561,000	
パイオラックス	5,000	1,591.00	7,955,000	
日本発條	84,400	661.00	55,788,400	
中央発條	15,000	243.00	3,645,000	
三浦工業	17,300	2,127.00	36,797,100	
タクマ	39,000	346.00	13,494,000	
ツガミ	29,000	441.00	12,789,000	
オークマ	71,000	542.00	38,482,000	
東芝機械	64,000	380.00	24,320,000	
アマダ	165,000	470.00	77,550,000	
アイダエンジニアリング	30,300	358.00	10,847,400	
牧野フライス製作所	59,000	510.00	30,090,000	
オーエスジー	51,500	969.00	49,903,500	
ダイジェット工業	17,000	140.00	2,380,000	
旭ダイヤモンド工業	28,900	1,019.00	29,449,100	
森精機製作所	61,700	684.00	42,202,800	
ディスコ	11,800	3,895.00	45,961,000	
日東工器	6,800	1,830.00	12,444,000	
豊田自動織機	101,400	2,112.00	214,156,800	
豊和工業	68,000	57.00	3,876,000	
東洋機械金属	11,700	191.00	2,234,700	
津田駒工業	28,000	137.00	3,836,000	
島精機製作所	15,200	1,302.00	19,790,400	
日阪製作所	15,000	886.00	13,290,000	
やまびこ	4,600	899.00	4,135,400	
ペガサスミシン製造	13,300	194.00	2,580,200	
ナブテスコ	48,500	1,636.00	79,346,000	
三井海洋開発	9,700	1,301.00	12,619,700	
レオン自動機	13,000	172.00	2,236,000	
S M C	34,800	11,860.00	412,728,000	
新川	9,800	378.00	3,704,400	
ホソカワミクロン	20,000	361.00	7,220,000	
ユニオンツール	6,600	1,392.00	9,187,200	
オイレス工業	12,900	1,424.00	18,369,600	
サトーホールディングス	12,200	890.00	10,858,000	
日本エアーテック	4,400	331.00	1,456,400	
日精樹脂工業	10,100	245.00	2,474,500	
ワイエイシイ	5,900	674.00	3,976,600	
小松製作所	552,500	1,898.00	1,048,645,000	
住友重機械工業	298,000	426.00	126,948,000	
日立建機	59,600	1,441.00	85,883,600	

日工	16,000	270.00	4,320,000	
巴工業	4,500	1,289.00	5,800,500	
井関農機	120,000	166.00	19,920,000	
TOWA	12,900	327.00	4,218,300	
丸山製作所	26,000	163.00	4,238,000	
北川鉄工所	57,000	109.00	6,213,000	
シンニッタン	10,800	284.00	3,067,200	
クボタ	534,000	636.00	339,624,000	
荏原実業	2,800	1,208.00	3,382,400	
東洋エンジニアリング	79,000	248.00	19,592,000	
三菱化工機	36,000	132.00	4,752,000	
月島機械	17,000	567.00	9,639,000	
帝国電機製作所	4,100	1,383.00	5,670,300	
新東工業	25,600	671.00	17,177,600	
澁谷工業	6,600	781.00	5,154,600	
アイチ コーポレーション	19,400	292.00	5,664,800	
小森コーポレーション	33,300	427.00	14,219,100	
鶴見製作所	9,000	593.00	5,337,000	
住友精密工業	17,000	522.00	8,874,000	
酒井重工業	22,000	126.00	2,772,000	
荏原製作所	191,000	268.00	51,188,000	
石井鐵工所	20,000	136.00	2,720,000	
西島製作所	13,500	983.00	13,270,500	
千代田化工建設	102,000	820.00	83,640,000	
ダイキン工業	141,900	2,189.00	310,619,100	
オルガノ	22,000	619.00	13,618,000	
トーヨーカネツ	64,000	135.00	8,640,000	
栗田工業	64,300	2,050.00	131,815,000	
椿本チエイン	60,000	374.00	22,440,000	
大同工業	26,000	131.00	3,406,000	
日本コンベヤ	36,000	69.00	2,484,000	
日機装	44,000	613.00	26,972,000	
木村化工機	10,700	295.00	3,156,500	
新興プランテック	26,900	684.00	18,399,600	
アネスト岩田	19,000	311.00	5,909,000	
ダイフク	51,500	390.00	20,085,000	
加藤製作所	28,000	207.00	5,796,000	
油研工業	20,000	146.00	2,920,000	
タダノ	54,000	515.00	27,810,000	
フジテック	32,000	408.00	13,056,000	
シーケーディ	32,600	483.00	15,745,800	

キトー	53	52,700.00	2,793,100	
平和	24,200	1,360.00	32,912,000	
理想科学工業	8,100	1,275.00	10,327,500	
SANKYO	33,700	3,990.00	134,463,000	
日本金銭機械	10,300	605.00	6,231,500	
マースエンジニアリング	6,300	1,260.00	7,938,000	
福島工業	3,300	881.00	2,907,300	
オーイズミ	7,100	259.00	1,838,900	
ダイコク電機	5,400	664.00	3,585,600	
アマノ	33,800	674.00	22,781,200	
サンデン	62,000	218.00	13,516,000	
ブラザー工業	144,000	994.00	143,136,000	
マックス	17,000	910.00	15,470,000	
モリタホールディングス	18,000	411.00	7,398,000	
グローリー	33,200	1,650.00	54,780,000	
大和冷機工業	16,000	393.00	6,288,000	
セガサミーホールディングス	119,700	1,660.00	198,702,000	
日本ピストンリング	41,000	153.00	6,273,000	
リケン	41,000	291.00	11,931,000	
T P R	12,700	819.00	10,401,300	
ホシザキ電機	22,400	1,820.00	40,768,000	
大豊工業	8,900	627.00	5,580,300	
日本精工	248,000	505.00	125,240,000	
NTN	259,000	303.00	78,477,000	
ジェイテクト	106,800	728.00	77,750,400	
不二越	114,000	373.00	42,522,000	
ミネベア	166,000	307.00	50,962,000	
日本トムソン	36,000	447.00	16,092,000	
T H K	74,400	1,416.00	105,350,400	
ユーシン精機	5,600	1,387.00	7,767,200	
前澤給装工業	4,200	1,040.00	4,368,000	
イーグル工業	15,000	756.00	11,340,000	
前澤工業	13,000	175.00	2,275,000	
日本ピラー工業	12,000	445.00	5,340,000	
キッツ	46,800	307.00	14,367,600	
日立製作所	2,500,000	416.00	1,040,000,000	
東芝	2,344,000	323.00	757,112,000	
三菱電機	1,114,000	682.00	759,748,000	
富士電機	336,000	225.00	75,600,000	
東洋電機製造	19,000	313.00	5,947,000	
安川電機	131,000	629.00	82,399,000	

シンフォニアテクノロジー	67,000	171.00	11,457,000
明電舎	110,000	274.00	30,140,000
オリジン電気	18,000	265.00	4,770,000
デンヨー	10,500	1,015.00	10,657,500
日立工機	29,800	555.00	16,539,000
三櫻工業	14,100	557.00	7,853,700
マキタ	72,600	2,727.00	197,980,200
東芝テック	70,000	278.00	19,460,000
芝浦メカトロニクス	20,000	215.00	4,300,000
マブチモーター	15,200	3,420.00	51,984,000
日本電産	60,200	6,300.00	379,260,000
高岳製作所	44,000	169.00	7,436,000
ダイヘン	66,000	261.00	17,226,000
JVCケンウッド	67,300	309.00	20,795,700
第一精工	2,600	2,024.00	5,262,400
日新電機	23,000	437.00	10,051,000
大崎電気工業	16,000	717.00	11,472,000
オムロン	124,000	1,610.00	199,640,000
日東工業	16,700	914.00	15,263,800
I D E C	14,500	729.00	10,570,500
エルピーダメモリ	150,500	377.00	56,738,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	215,000	400.00	86,000,000
サクサホールディングス	30,000	109.00	3,270,000
メルコホールディングス	6,200	2,124.00	13,168,800
テクノメディカ	9	282,000.00	2,538,000
日本電気	1,531,000	162.00	248,022,000
富士通	1,073,000	398.00	427,054,000
沖電気工業	430,000	67.00	28,810,000
岩崎通信機	49,000	65.00	3,185,000
電気興業	34,000	287.00	9,758,000
サンケン電気	58,000	297.00	17,226,000
ナカヨ通信機	11,000	176.00	1,936,000
アイホン	6,400	1,410.00	9,024,000
ルネサスエレクトロニクス	28,900	543.00	15,692,700
セイコーエプソン	76,000	949.00	72,124,000
ワコム	219	116,500.00	25,513,500
アルバック	20,800	951.00	19,780,800
アクセル	5,200	1,718.00	8,933,600
ナナオ	9,400	1,515.00	14,241,000
日本信号	25,900	435.00	11,266,500
京三製作所	24,000	307.00	7,368,000



能美防災	15,000	475.00	7,125,000	
ホーチキ	10,000	346.00	3,460,000	
日本無線	24,000	182.00	4,368,000	
パナソニック	1,272,100	689.00	876,476,900	
シャープ	538,000	699.00	376,062,000	
アンリツ	53,000	909.00	48,177,000	
富士通ゼネラル	27,000	448.00	12,096,000	
日立国際電気	26,000	559.00	14,534,000	
ソニー	694,900	1,322.00	918,657,800	
T D K	58,300	3,255.00	189,766,500	
帝国通信工業	27,000	125.00	3,375,000	
ミツミ電機	39,400	484.00	19,069,600	
タムラ製作所	37,000	183.00	6,771,000	
アルプス電気	88,000	540.00	47,520,000	
パイオニア	157,800	309.00	48,760,200	
日本電波工業	8,700	960.00	8,352,000	
日本トリム	1,300	1,751.00	2,276,300	
ローランド ディー . ジー .	5,000	817.00	4,085,000	
フォスター電機	10,800	1,174.00	12,679,200	
クラリオン	68,000	126.00	8,568,000	
S M K	36,000	255.00	9,180,000	
ヨコオ	8,800	405.00	3,564,000	
東光	51,000	150.00	7,650,000	
ホシデン	30,300	502.00	15,210,600	
ヒロセ電機	19,400	6,990.00	135,606,000	
日本航空電子工業	26,000	517.00	13,442,000	
T O A	12,000	424.00	5,088,000	
ユニデン	33,000	270.00	8,910,000	
アルパイン	21,700	882.00	19,139,400	
スミダコーポレーション	7,000	555.00	3,885,000	
アイコム	6,200	1,850.00	11,470,000	
船井電機	10,000	1,661.00	16,610,000	
横河電機	120,700	719.00	86,783,300	
新電元工業	40,000	301.00	12,040,000	
山武	28,600	1,630.00	46,618,000	
日本光電工業	22,200	1,902.00	42,224,400	
チノー	20,000	186.00	3,720,000	
共和電業	12,000	245.00	2,940,000	
日本電子材料	4,400	392.00	1,724,800	
堀場製作所	20,600	2,396.00	49,357,600	
アドバンテスト	82,800	818.00	67,730,400	

小野測器	12,000	207.00	2,484,000
エスベック	11,600	474.00	5,498,400
パナソニック電工SUNX	9,900	396.00	3,920,400
キーエンス	24,800	20,240.00	501,952,000
日置電機	5,400	1,421.00	7,673,400
シスメックス	39,200	2,678.00	104,977,600
メガチップス	9,200	1,182.00	10,874,400
OBARA GROUP	8,000	916.00	7,328,000
日本電産コパル電子	11,600	476.00	5,521,600
ミヤチテクノス	5,500	557.00	3,063,500
東京電波	3,400	377.00	1,281,800
澤藤電機	6,000	228.00	1,368,000
デンソー	275,100	2,243.00	617,049,300
コーセル	16,200	1,039.00	16,831,800
日立メディコ	8,000	825.00	6,600,000
新日本無線	7,000	113.00	791,000
オブテックス	7,700	930.00	7,161,000
千代田インテグレ	5,400	1,000.00	5,400,000
東光電気	8,000	349.00	2,792,000
スタンレー電気	75,300	1,035.00	77,935,500
岩崎電気	41,000	160.00	6,560,000
ウシオ電機	67,600	1,067.00	72,129,200
岡谷電機産業	6,100	341.00	2,080,100
ヘリオス テクノ ホールディング	9,800	144.00	1,411,200
日本セラミック	7,300	1,367.00	9,979,100
新神戸電機	9,000	1,273.00	11,457,000
日本デジタル研究所	9,400	730.00	6,862,000
古河電池	8,000	338.00	2,704,000
双信電機	5,500	333.00	1,831,500
山一電機	11,300	168.00	1,898,400
図研	7,300	513.00	3,744,900
日本電子	41,000	206.00	8,446,000
カシオ計算機	106,100	433.00	45,941,300
ファナック	115,900	12,280.00	1,423,252,000
日本シイエムケイ	24,200	279.00	6,751,800
エンプラス	5,600	1,469.00	8,226,400
ローム	54,900	3,750.00	205,875,000
浜松ホトニクス	43,500	2,828.00	123,018,000
三井ハイテック	14,800	356.00	5,268,800
新光電気工業	37,500	510.00	19,125,000
京セラ	92,600	6,620.00	613,012,000

協栄産業	13,000	136.00	1,768,000
太陽誘電	50,100	608.00	30,460,800
村田製作所	116,800	4,100.00	478,880,000
ユーシン	15,600	606.00	9,453,600
双葉電子工業	19,100	1,398.00	26,701,800
日東電工	96,100	2,929.00	281,476,900
北陸電気工業	45,000	115.00	5,175,000
東海理化電機製作所	26,100	1,160.00	30,276,000
ニチコン	35,100	801.00	28,115,100
日本ケミコン	64,000	272.00	17,408,000
K O A	14,100	708.00	9,982,800
三井造船	431,000	116.00	49,996,000
日立造船	442,500	102.00	45,135,000
佐世保重工業	73,000	116.00	8,468,000
三菱重工業	1,866,000	321.00	598,986,000
川崎重工業	809,000	211.00	170,699,000
I H I	762,000	174.00	132,588,000
日本車輛製造	41,000	298.00	12,218,000
日本輸送機	15,000	208.00	3,120,000
近畿車輛	17,000	249.00	4,233,000
日産自動車	1,406,600	701.00	986,026,600
いすゞ自動車	704,000	346.00	243,584,000
トヨタ自動車	1,430,500	2,499.00	3,574,819,500
日野自動車	159,000	467.00	74,253,000
三菱自動車工業	2,489,000	98.00	243,922,000
エフテック	3,900	869.00	3,389,100
武蔵精密工業	10,800	1,691.00	18,262,800
トヨタ車体	20,200	1,120.00	22,624,000
日産車体	33,000	723.00	23,859,000
関東自動車工業	16,900	622.00	10,511,800
新明和工業	50,000	254.00	12,700,000
極東開発工業	19,200	417.00	8,006,400
日信工業	20,400	1,014.00	20,685,600
トピー工業	83,000	182.00	15,106,000
ティラド	40,000	259.00	10,360,000
曙ブレーキ工業	56,400	321.00	18,104,400
タチエス	14,500	1,318.00	19,111,000
N O K	53,900	1,215.00	65,488,500
フタバ産業	31,500	457.00	14,395,500
カヤバ工業	77,000	401.00	30,877,000
シロキ工業	25,000	208.00	5,200,000

市光工業	27,000	122.00	3,294,000
大同メタル工業	17,000	700.00	11,900,000
プレス工業	51,000	345.00	17,595,000
カルソニックカンセイ	66,000	403.00	26,598,000
太平洋工業	23,000	330.00	7,590,000
ケーヒン	23,000	1,134.00	26,082,000
河西工業	14,000	396.00	5,544,000
アイシン精機	91,700	2,327.00	213,385,900
富士機工	13,000	212.00	2,756,000
マツダ	923,000	143.00	131,989,000
ダイハツ工業	103,000	1,363.00	140,389,000
愛知機械工業	25,000	218.00	5,450,000
今仙電機製作所	8,200	898.00	7,363,600
本田技研工業	939,400	2,260.00	2,123,044,000
スズキ	232,800	1,610.00	374,808,000
富士重工業	352,000	443.00	155,936,000
ヤマハ発動機	181,400	1,091.00	197,907,400
ショーワ	23,700	421.00	9,977,700
小糸製作所	55,000	1,069.00	58,795,000
T B K	11,000	323.00	3,553,000
エクセディ	15,100	2,217.00	33,476,700
ミツバ	21,000	561.00	11,781,000
豊田合成	31,500	1,262.00	39,753,000
愛三工業	11,500	647.00	7,440,500
ヨロズ	6,700	1,700.00	11,390,000
エフ・シー・シー	18,200	1,609.00	29,283,800
新家工業	25,000	113.00	2,825,000
シマノ	42,200	3,855.00	162,681,000
タカタ	20,100	1,746.00	35,094,600
テイ・エス テック	23,500	1,004.00	23,594,000
小野建	9,600	608.00	5,836,800
はるやま商事	4,600	365.00	1,679,000
佐鳥電機	8,100	467.00	3,782,700
カップ・クリエイト	8,100	1,683.00	13,632,300
エコートレーディング	2,700	697.00	1,881,900
伯東	6,700	697.00	4,669,900
コンドーテック	3,900	883.00	3,443,700
中山福	6,300	581.00	3,660,300
ライトオン	8,200	491.00	4,026,200
ナガイレーベン	14,600	1,060.00	15,476,000
ジーンズメイト	3,500	179.00	626,500

三菱食品	10,100	1,750.00	17,675,000
良品計画	11,700	3,660.00	42,822,000
三城ホールディングス	13,600	609.00	8,282,400
松田産業	8,000	1,062.00	8,496,000
メディカルホールディングス	118,400	747.00	88,444,800
アドヴァン	6,500	699.00	4,543,500
S P K	2,600	1,274.00	3,312,400
アズワン	7,200	1,549.00	11,152,800
スズデン	3,600	494.00	1,778,400
尾家産業	3,500	786.00	2,751,000
シモジマ	6,700	945.00	6,331,500
ドウシシャ	5,200	1,969.00	10,238,800
コナカ	13,000	271.00	3,523,000
高速	6,600	593.00	3,913,800
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,223.00	1,467,600
G - 7ホールディングス	3,300	374.00	1,234,200
イオン北海道	6,900	330.00	2,277,000
コジマ	14,800	502.00	7,429,600
コーナン商事	11,400	1,316.00	15,002,400
黒田電気	13,600	791.00	10,757,600
ネットワンシステムズ	248	214,400.00	53,171,200
エコス	3,800	456.00	1,732,800
ワタミ	13,000	1,889.00	24,557,000
マルシェ	2,700	687.00	1,854,900
ドン・キホーテ	21,300	2,892.00	61,599,600
丸文	8,700	297.00	2,583,900
メガネトップ	15,800	926.00	14,630,800
西松屋チェーン	24,100	573.00	13,809,300
ゼンショーホールディングス	41,900	1,005.00	42,109,500
ハピネット	2,900	1,324.00	3,839,600
幸楽苑	6,800	1,143.00	7,772,400
トーマンエレクトロニクス	5,100	901.00	4,595,100
ハークスレイ	2,700	499.00	1,347,300
サイゼリヤ	16,300	1,267.00	20,652,100
エクセル	5,100	729.00	3,717,900
マルカキカイ	3,600	667.00	2,401,200
アルゴグラフィックス	4,000	978.00	3,912,000
ガリバーインターナショナル	3,330	3,360.00	11,188,800
日本エム・ディ・エム	9,300	167.00	1,553,100
ポプラ	3,400	417.00	1,417,800
ユナイテッドアローズ	11,900	1,476.00	17,564,400

進和	6,500	890.00	5,785,000
エスケイジャパン	2,700	226.00	610,200
ダイトエレクトロン	5,100	466.00	2,376,600
ハイデイ日高	4,800	1,168.00	5,606,400
シークス	7,000	943.00	6,601,000
京都きもの友禅	7,700	914.00	7,037,800
コロワイド	36,500	506.00	18,469,000
田中商事	3,400	394.00	1,339,600
オーハシテクニカ	6,200	558.00	3,459,600
壱番屋	4,400	2,350.00	10,340,000
マクニカ	5,600	1,615.00	9,044,000
白銅	3,600	760.00	2,736,000
トップカルチャー	4,000	354.00	1,416,000
スギホールディングス	19,700	2,107.00	41,507,900
島津製作所	140,000	658.00	92,120,000
JMS	17,000	229.00	3,893,000
クボテック	24	22,600.00	542,400
長野計器	7,800	706.00	5,506,800
ブイ・テクノロジー	35	306,000.00	10,710,000
スター精密	18,300	722.00	13,212,600
東京計器	64,000	128.00	8,192,000
愛知時計電機	26,000	243.00	6,318,000
日本電産トーソク	5,300	885.00	4,690,500
東京精密	23,000	1,411.00	32,453,000
ニコン	197,200	1,719.00	338,986,800
トプコン	25,600	397.00	10,163,200
理研計器	9,100	524.00	4,768,400
大日本スクリーン製造	105,000	540.00	56,700,000
キヤノン電子	10,200	1,928.00	19,665,600
タムロン	12,100	1,998.00	24,175,800
HOYA	273,600	1,633.00	446,788,800
ノーリツ鋼機	19,300	352.00	6,793,600
エー・アンド・デイ	26,600	290.00	7,714,000
キヤノン	691,700	3,365.00	2,327,570,500
リコー	335,000	627.00	210,045,000
日本電産コパル	13,400	807.00	10,813,800
日本電産サンキョー	27,000	493.00	13,311,000
シチズンホールディングス	146,300	427.00	62,470,100
リズム時計工業	51,000	101.00	5,151,000
大研医器	1,400	767.00	1,073,800
パラマウントベッドホールディングス	9,500	1,828.00	17,366,000

SHO - B I	3,200	450.00	1,440,000
S R Iスポーツ	7,100	827.00	5,871,700
バンダイナムコホールディングス	119,300	1,160.00	138,388,000
共立印刷	18,500	155.00	2,867,500
フランスベッドホールディングス	79,000	115.00	9,085,000
パイロットコーポレーション	97	151,800.00	14,724,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	20,800	871.00	18,116,800
トッパン・フォームズ	23,900	565.00	13,503,500
フジシールインターナショナル	12,500	1,393.00	17,412,500
タカラトミー	36,700	561.00	20,588,700
廣濟堂	9,500	190.00	1,805,000
レック	3,100	1,171.00	3,630,100
タカノ	4,400	446.00	1,962,400
プロネクサス	12,300	387.00	4,760,100
ウッドワン	19,000	277.00	5,263,000
大建工業	47,000	232.00	10,904,000
きもと	9,500	584.00	5,548,000
凸版印刷	339,000	567.00	192,213,000
大日本印刷	339,000	781.00	264,759,000
図書印刷	18,000	143.00	2,574,000
共同印刷	39,000	176.00	6,864,000
日本写真印刷	19,500	853.00	16,633,500
光村印刷	11,000	243.00	2,673,000
藤森工業	8,400	1,173.00	9,853,200
宝印刷	6,300	598.00	3,767,400
前澤化成工業	8,200	807.00	6,617,400
アシックス	103,700	863.00	89,493,100
ツツミ	5,600	1,745.00	9,772,000
J S P	7,600	1,082.00	8,223,200
ニチハ	12,900	918.00	11,842,200
ローランド	12,100	649.00	7,852,900
エフピコ	5,200	5,120.00	26,624,000
小松ウオール工業	4,200	778.00	3,267,600
ヤマハ	81,900	722.00	59,131,800
河合楽器製作所	41,000	141.00	5,781,000
クリナップ	13,700	475.00	6,507,500
ピジョン	9,800	2,853.00	27,959,400
天馬	9,300	635.00	5,905,500
キングジム	9,300	573.00	5,328,900
リンテック	21,200	1,438.00	30,485,600
信越ポリマー	22,900	358.00	8,198,200

東リ	30,000	137.00	4,110,000	
イトーキ	26,600	168.00	4,468,800	
任天堂	63,700	12,410.00	790,517,000	
三菱鉛筆	9,500	1,344.00	12,768,000	
タカスタンダード	51,000	568.00	28,968,000	
コクヨ	57,900	565.00	32,713,500	
ナカバヤシ	26,000	178.00	4,628,000	
ニフコ	26,000	1,967.00	51,142,000	
グローブライド	54,000	86.00	4,644,000	
岡村製作所	40,000	476.00	19,040,000	
日本バルカー工業	45,000	194.00	8,730,000	
MUTOHホールディングス	12,000	113.00	1,356,000	
伊藤忠商事	876,700	764.00	669,798,800	
丸紅	961,000	441.00	423,801,000	
スクロール	14,300	259.00	3,703,700	
高島	19,000	161.00	3,059,000	
F & A アクアホールディングス	8,400	763.00	6,409,200	
三陽商会	59,000	180.00	10,620,000	
長瀬産業	62,200	822.00	51,128,400	
蝶理	66,000	84.00	5,544,000	
豊田通商	122,400	1,259.00	154,101,600	
オンワードホールディングス	72,000	551.00	39,672,000	
三共生興	18,800	254.00	4,775,200	
兼松	234,000	69.00	16,146,000	
美津濃	55,000	373.00	20,515,000	
ツカモトコーポレーション	20,000	81.00	1,620,000	
ファミリーマート	33,800	3,080.00	104,104,000	
ルック	22,000	193.00	4,246,000	
三井物産	948,600	1,111.00	1,053,894,600	
日本紙パルプ商事	57,000	262.00	14,934,000	
東京エレクトロン	93,700	3,930.00	368,241,000	
日立ハイテクノロジーズ	33,300	1,621.00	53,979,300	
カメイ	14,000	529.00	7,406,000	
東都水産	18,000	129.00	2,322,000	
スターゼン	37,000	225.00	8,325,000	
セイコーホールディングス	65,000	154.00	10,010,000	
山善	42,200	527.00	22,239,400	
椿本興業	11,000	204.00	2,244,000	
住友商事	648,600	1,006.00	652,491,600	
日本ユニシス	26,600	454.00	12,076,400	
内田洋行	25,000	204.00	5,100,000	



三菱商事	800,300	1,560.00	1,248,468,000
第一実業	23,000	302.00	6,946,000
キヤノンマーケティングジャパン	36,600	862.00	31,549,200
西華産業	41,000	202.00	8,282,000
佐藤商事	9,800	433.00	4,243,400
菱洋エレクトロ	12,400	703.00	8,717,200
東京産業	11,000	240.00	2,640,000
ユアサ商事	112,000	107.00	11,984,000
神鋼商事	28,000	174.00	4,872,000
阪和興業	110,000	327.00	35,970,000
カナデン	11,000	495.00	5,445,000
菱電商事	16,000	432.00	6,912,000
ニプロ	53,400	650.00	34,710,000
フルサト工業	6,500	585.00	3,802,500
岩谷産業	120,000	264.00	31,680,000
すてきナイスグループ	48,000	157.00	7,536,000
昭光通商	39,000	113.00	4,407,000
ニチモウ	16,000	140.00	2,240,000
極東貿易	13,000	167.00	2,171,000
イワキ	17,000	184.00	3,128,000
兼松エレクトロニクス	7,000	759.00	5,313,000
三愛石油	26,000	325.00	8,450,000
稲畑産業	29,300	433.00	12,686,900
G S Iクレオス	27,000	96.00	2,592,000
明和産業	8,700	210.00	1,827,000
ゴールドウイン	26,000	259.00	6,734,000
ユニ・チャーム	64,400	3,700.00	238,280,000
デサント	29,000	427.00	12,383,000
ヤマトインターナショナル	7,300	350.00	2,555,000
東邦ホールディングス	35,200	1,033.00	36,361,600
サンゲツ	19,500	2,014.00	39,273,000
ミツウロコグループホールディングス	17,700	463.00	8,195,100
シナネン	24,000	345.00	8,280,000
伊藤忠エネクス	24,300	438.00	10,643,400
サンリオ	27,700	4,050.00	112,185,000
サンワテクノス	5,400	620.00	3,348,000
リョーサン	17,900	1,704.00	30,501,600
新光商事	12,100	607.00	7,344,700
トーヨー	23,000	302.00	6,946,000
三信電気	15,700	614.00	9,639,800
東陽テクニカ	15,900	810.00	12,879,000

モスフードサービス	14,400	1,476.00	21,254,400
加賀電子	11,900	748.00	8,901,200
三益半導体工業	9,900	631.00	6,246,900
ソーダニッカ	11,000	330.00	3,630,000
立花エレテック	6,700	586.00	3,926,200
木曽路	12,600	1,404.00	17,690,400
千趣会	19,800	515.00	10,197,000
タカキュー	8,500	138.00	1,173,000
ケーヨー	20,700	468.00	9,687,600
アデランス	14,400	796.00	11,462,400
上新電機	24,000	857.00	20,568,000
日本瓦斯	10,500	1,131.00	11,875,500
ベスト電器	34,500	202.00	6,969,000
マルエツ	22,000	276.00	6,072,000
ロイヤルホールディングス	18,400	893.00	16,431,200
東天紅	8,000	110.00	880,000
いなげや	12,300	904.00	11,119,200
島忠	24,900	1,766.00	43,973,400
チヨダ	14,400	1,361.00	19,598,400
ライフコーポレーション	7,200	1,519.00	10,936,800
カスミ	22,600	490.00	11,074,000
リンガーハット	9,900	1,065.00	10,543,500
MrMax	11,000	303.00	3,333,000
テンアライド	8,300	254.00	2,108,200
AOKIホールディングス	10,200	1,084.00	11,056,800
オークワ	16,000	1,144.00	18,304,000
コメリ	15,100	2,520.00	38,052,000
青山商事	30,300	1,209.00	36,632,700
しまむら	12,800	7,930.00	101,504,000
CFSコーポレーション	7,500	324.00	2,430,000
高島屋	149,000	559.00	83,291,000
松屋	23,600	433.00	10,218,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	57,000	542.00	30,894,000
ニッセンホールディングス	22,000	475.00	10,450,000
パルコ	20,000	561.00	11,220,000
丸井グループ	143,300	576.00	82,540,800
クレディセゾン	89,900	1,431.00	128,646,900
原信ナルスホールディングス	6,100	1,256.00	7,661,600
ダイエー	67,800	290.00	19,662,000
イズミヤ	40,000	371.00	14,840,000
イオン	387,500	1,058.00	409,975,000

ユニー	82,700	691.00	57,145,700
イズミ	33,000	1,221.00	40,293,000
東武ストア	15,000	260.00	3,900,000
平和堂	20,300	967.00	19,630,100
フジ	12,200	1,696.00	20,691,200
ヤオコー	4,900	2,615.00	12,813,500
ゼビオ	13,300	1,927.00	25,629,100
ケーズホールディングス	27,400	3,190.00	87,406,000
P a l t a c	7,700	1,390.00	10,703,000
O l y m p i c	7,300	713.00	5,204,900
新生銀行	856,000	81.00	69,336,000
あおぞら銀行	342,000	213.00	72,846,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,319,100	329.00	2,736,983,900
りそなホールディングス	956,400	350.00	334,740,000
三井住友トラスト・ホールディングス	2,154,000	255.00	549,270,000
三井住友フィナンシャルグループ	831,100	2,030.00	1,687,133,000
第四銀行	143,000	251.00	35,893,000
北越銀行	114,000	145.00	16,530,000
西日本シティ銀行	386,000	213.00	82,218,000
札幌北洋ホールディングス	165,700	271.00	44,904,700
千葉銀行	433,000	506.00	219,098,000
横浜銀行	706,000	380.00	268,280,000
常陽銀行	423,000	342.00	144,666,000
群馬銀行	251,000	431.00	108,181,000
武蔵野銀行	17,700	2,615.00	46,285,500
千葉興業銀行	21,000	429.00	9,009,000
筑波銀行	45,700	261.00	11,927,700
東京都民銀行	20,800	896.00	18,636,800
七十七銀行	172,000	312.00	53,664,000
青森銀行	82,000	235.00	19,270,000
秋田銀行	75,000	245.00	18,375,000
山形銀行	67,000	378.00	25,326,000
岩手銀行	7,400	3,500.00	25,900,000
東邦銀行	93,000	206.00	19,158,000
東北銀行	59,000	122.00	7,198,000
みちのく銀行	55,000	150.00	8,250,000
ふくおかフィナンシャルグループ	446,000	303.00	135,138,000
静岡銀行	332,000	817.00	271,244,000
十六銀行	138,000	242.00	33,396,000
スルガ銀行	107,000	693.00	74,151,000
八十二銀行	203,000	454.00	92,162,000

山梨中央銀行	67,000	319.00	21,373,000
大垣共立銀行	147,000	253.00	37,191,000
福井銀行	95,000	237.00	22,515,000
北國銀行	131,000	280.00	36,680,000
清水銀行	3,700	3,080.00	11,396,000
滋賀銀行	103,000	529.00	54,487,000
南都銀行	102,000	449.00	45,798,000
百五銀行	99,000	309.00	30,591,000
京都銀行	197,000	693.00	136,521,000
三重銀行	45,000	179.00	8,055,000
ほくほくフィナンシャルグループ	770,000	149.00	114,730,000
広島銀行	324,000	370.00	119,880,000
山陰合同銀行	65,000	603.00	39,195,000
中国銀行	90,000	1,074.00	96,660,000
鳥取銀行	35,000	162.00	5,670,000
伊予銀行	118,000	762.00	89,916,000
百十四銀行	121,000	309.00	37,389,000
四国銀行	79,000	289.00	22,831,000
阿波銀行	97,000	541.00	52,477,000
鹿児島銀行	71,000	518.00	36,778,000
大分銀行	71,000	227.00	16,117,000
宮崎銀行	73,000	166.00	12,118,000
肥後銀行	85,000	439.00	37,315,000
佐賀銀行	67,000	201.00	13,467,000
十八銀行	70,000	210.00	14,700,000
沖縄銀行	8,300	3,345.00	27,763,500
琉球銀行	23,100	970.00	22,407,000
八千代銀行	5,700	1,950.00	11,115,000
みずほフィナンシャルグループ	14,113,600	102.00	1,439,587,200
紀陽ホールディングス	436,000	118.00	51,448,000
山口フィナンシャルグループ	110,000	709.00	77,990,000
芙蓉総合リース	10,500	2,652.00	27,846,000
興銀リース	15,400	1,727.00	26,595,800
東京センチュリーリース	29,600	1,550.00	45,880,000
S B Iホールディングス	11,753	6,160.00	72,398,480
日本証券金融	47,400	360.00	17,064,000
大阪証券金融	26,000	150.00	3,900,000
ポケットカード	17,900	258.00	4,618,200
長野銀行	36,000	158.00	5,688,000
名古屋銀行	99,000	253.00	25,047,000
愛知銀行	4,000	4,440.00	17,760,000

第三銀行	62,000	162.00	10,044,000
中京銀行	45,000	195.00	8,775,000
東日本銀行	53,000	158.00	8,374,000
大光銀行	39,000	218.00	8,502,000
愛媛銀行	69,000	229.00	15,801,000
トマト銀行	42,000	135.00	5,670,000
みなと銀行	99,000	138.00	13,662,000
京葉銀行	91,000	385.00	35,035,000
関西アーバン銀行	153,000	140.00	21,420,000
栃木銀行	55,000	281.00	15,455,000
北日本銀行	3,400	1,808.00	6,147,200
東和銀行	110,000	90.00	9,900,000
福島銀行	127,000	37.00	4,699,000
大東銀行	70,000	55.00	3,850,000
リコーリース	7,700	1,673.00	12,882,100
イオンクレジットサービス	49,000	1,193.00	58,457,000
アコム	22,690	1,346.00	30,540,740
プロミス	56,300	777.00	43,745,100
ジャックス	72,000	246.00	17,712,000
オリエントコーポレーション	159,000	70.00	11,130,000
日立キャピタル	21,800	945.00	20,601,000
オリックス	57,200	6,640.00	379,808,000
三菱UFJリース	27,930	3,115.00	87,001,950
ジャフコ	14,200	1,453.00	20,632,600
トモニホールディングス	84,600	315.00	26,649,000
大和証券グループ本社	1,090,000	252.00	274,680,000
野村ホールディングス	2,381,600	247.00	588,255,200
岡三証券グループ	94,000	232.00	21,808,000
丸三証券	38,500	265.00	10,202,500
東洋証券	43,000	113.00	4,859,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126,000	207.00	26,082,000
水戸証券	38,000	99.00	3,762,000
いちよし証券	24,600	414.00	10,184,400
松井証券	65,200	348.00	22,689,600
NK S Jホールディングス	229,800	1,539.00	353,662,200
だいこう証券ビジネス	6,300	242.00	1,524,600
マネックスグループ	933	12,050.00	11,242,650
カブドットコム証券	44,900	215.00	9,653,500
極東証券	14,800	431.00	6,378,800
岩井コスモホールディングス	13,400	256.00	3,430,400
フィデアホールディングス	63,200	209.00	13,208,800

池田泉州ホールディングス	453,400	118.00	53,501,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	328,400	1,536.00	504,422,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	105,300	1,250.00	131,625,000
第一生命保険	5,877	75,500.00	443,713,500
東京海上ホールディングス	417,200	1,843.00	768,899,600
アサックス	15	92,300.00	1,384,500
N E C キャピタルソリューション	3,900	1,064.00	4,149,600
T & D ホールディングス	400,500	707.00	283,153,500
三井不動産	488,000	1,244.00	607,072,000
三菱地所	769,000	1,309.00	1,006,621,000
平和不動産	110,500	161.00	17,790,500
東京建物	217,000	221.00	47,957,000
ダイビル	33,400	502.00	16,766,800
サンケイビル	25,800	309.00	7,972,200
東急不動産	226,000	309.00	69,834,000
京阪神ビルディング	15,800	353.00	5,577,400
住友不動産	264,000	1,570.00	414,480,000
東宝不動産	11,600	416.00	4,825,600
大京	173,000	139.00	24,047,000
テーオーシー	42,600	341.00	14,526,600
東京楽天地	18,000	272.00	4,896,000
フジ住宅	14,000	366.00	5,124,000
空港施設	11,400	301.00	3,431,400
明和地所	5,400	347.00	1,873,800
住友不動産販売	3,960	3,140.00	12,434,400
ゴールドクレスト	9,900	1,279.00	12,662,100
東栄住宅	7,500	762.00	5,715,000
日本エスリード	5,200	631.00	3,281,200
東急リバブル	10,000	665.00	6,650,000
飯田産業	12,500	621.00	7,762,500
日神不動産	7,800	426.00	3,322,800
アーネストワン	18,200	768.00	13,977,600
タカラレーベン	16,900	416.00	7,030,400
サンヨーハウジング名古屋	46	73,600.00	3,385,600
イオンモール	50,100	1,773.00	88,827,300
フージャースコーポレーション	232	27,100.00	6,287,200
タクトホーム	58	66,200.00	3,839,600
トーセイ	215	20,450.00	4,396,750
エヌ・ティ・ティ都市開発	704	52,300.00	36,819,200
東武鉄道	632,000	376.00	237,632,000

相鉄ホールディングス	178,000	233.00	41,474,000
東京急行電鉄	655,000	384.00	251,520,000
京浜急行電鉄	286,000	713.00	203,918,000
小田急電鉄	357,000	742.00	264,894,000
京王電鉄	311,000	525.00	163,275,000
京成電鉄	179,000	535.00	95,765,000
富士急行	30,000	438.00	13,140,000
新京成電鉄	14,000	348.00	4,872,000
東日本旅客鉄道	193,600	4,805.00	930,248,000
西日本旅客鉄道	96,800	3,305.00	319,924,000
東海旅客鉄道	966	675,000.00	652,050,000
西日本鉄道	144,000	360.00	51,840,000
ハマキョウレックス	3,200	1,976.00	6,323,200
サカイ引越センター	2,000	1,578.00	3,156,000
近畿日本鉄道	1,006,000	277.00	278,662,000
阪急阪神ホールディングス	747,000	335.00	250,245,000
南海電気鉄道	232,000	324.00	75,168,000
京阪電気鉄道	249,000	362.00	90,138,000
名糖運輸	4,600	595.00	2,737,000
名古屋鉄道	389,000	205.00	79,745,000
日本通運	441,000	307.00	135,387,000
ヤマトホールディングス	226,500	1,308.00	296,262,000
山九	135,000	290.00	39,150,000
日新	42,000	179.00	7,518,000
丸運	6,000	189.00	1,134,000
丸全昭和運輸	37,000	244.00	9,028,000
センコー	45,000	301.00	13,545,000
トナミホールディングス	23,000	147.00	3,381,000
日本梱包運輸倉庫	33,400	780.00	26,052,000
日本石油輸送	13,000	182.00	2,366,000
福山通運	67,000	430.00	28,810,000
セイノーホールディングス	86,000	593.00	50,998,000
神奈川中央交通	13,000	401.00	5,213,000
日立物流	23,200	1,391.00	32,271,200
日本郵船	882,000	181.00	159,642,000
商船三井	584,000	261.00	152,424,000
川崎汽船	344,000	138.00	47,472,000
NSユナイテッド海運	48,000	109.00	5,232,000
乾汽船	12,300	283.00	3,480,900
飯野海運	55,900	381.00	21,297,900
共栄タンカー	19,000	106.00	2,014,000

第一中央汽船	74,000	96.00	7,104,000
全日本空輸	1,485,000	233.00	346,005,000
パスコ	15,000	237.00	3,555,000
三菱倉庫	79,000	843.00	66,597,000
三井倉庫	52,000	275.00	14,300,000
住友倉庫	81,000	357.00	28,917,000
澁澤倉庫	26,000	212.00	5,512,000
ヤマタネ	55,000	115.00	6,325,000
東陽倉庫	18,000	161.00	2,898,000
日本トランスシティ	23,000	234.00	5,382,000
ケイヒン	20,000	86.00	1,720,000
安田倉庫	8,700	450.00	3,915,000
東洋埠頭	32,000	123.00	3,936,000
宇徳	7,500	241.00	1,807,500
上組	123,000	682.00	83,886,000
サンリツ	2,900	518.00	1,502,200
キムラユニティー	2,500	675.00	1,687,500
キューソー流通システム	3,500	871.00	3,048,500
郵船ロジスティクス	8,800	1,004.00	8,835,200
近鉄エクスプレス	10,000	2,379.00	23,790,000
東海運	7,000	185.00	1,295,000
バンテック	13	140,000.00	1,820,000
東京放送ホールディングス	65,900	985.00	64,911,500
日本テレビ放送網	9,650	11,190.00	107,983,500
テレビ朝日	279	124,500.00	34,735,500
スカパーJ S A Tホールディングス	835	43,300.00	36,155,500
テレビ東京ホールディングス	7,000	1,110.00	7,770,000
アイ・ティー・シーネットワーク	9,400	470.00	4,418,000
イー・アクセス	840	19,810.00	16,640,400
NECモバイリング	4,000	2,570.00	10,280,000
日本電信電話	506,000	4,020.00	2,034,120,000
K D D I	1,706	589,000.00	1,004,834,000
光通信	10,100	1,853.00	18,715,300
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,055	138,200.00	1,251,401,000
GMOインターネット	32,700	301.00	9,842,700
学研ホールディングス	33,000	150.00	4,950,000
ゼンリン	15,900	671.00	10,668,900
昭文社	6,000	564.00	3,384,000
角川グループホールディングス	10,400	2,681.00	27,882,400
インプレスホールディングス	9,000	82.00	738,000
東京電力	888,900	290.00	257,781,000



中部電力	366,900	1,385.00	508,156,500
関西電力	454,400	1,141.00	518,470,400
中国電力	153,900	1,157.00	178,062,300
北陸電力	109,100	1,204.00	131,356,400
東北電力	278,200	810.00	225,342,000
四国電力	102,500	1,965.00	201,412,500
九州電力	245,900	1,040.00	255,736,000
北海道電力	104,200	996.00	103,783,200
沖縄電力	6,700	3,250.00	21,775,000
電源開発	69,100	1,958.00	135,297,800
東京瓦斯	1,344,000	331.00	444,864,000
大阪瓦斯	1,080,000	296.00	319,680,000
東邦瓦斯	283,000	461.00	130,463,000
北海道瓦斯	20,000	260.00	5,200,000
西部瓦斯	125,000	188.00	23,500,000
静岡瓦斯	29,000	483.00	14,007,000
アイネット	4,800	440.00	2,112,000
松竹	72,000	716.00	51,552,000
東宝	78,400	1,340.00	105,056,000
エイチ・アイ・エス	11,900	1,929.00	22,955,100
東映	46,000	347.00	15,962,000
葵プロモーション	5,000	393.00	1,965,000
エヌ・ティ・ティ・データ	679	253,700.00	172,262,300
共立メンテナンス	6,600	1,278.00	8,434,800
イチネンホールディングス	15,000	383.00	5,745,000
建設技術研究所	6,800	527.00	3,583,600
アインファーマシーズ	6,100	3,310.00	20,191,000
燦ホールディングス	2,700	1,243.00	3,356,100
スバル興業	9,000	229.00	2,061,000
東京テアトル	44,000	108.00	4,752,000
ホリプロ	3,900	626.00	2,441,400
よみうりランド	27,000	248.00	6,696,000
東京都競馬	90,000	105.00	9,450,000
カナモト	17,000	518.00	8,806,000
東京ドーム	99,000	172.00	17,028,000
D T S	11,400	825.00	9,405,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,900	1,619.00	58,122,100
シーイーシー	6,600	367.00	2,422,200
カプコン	21,100	2,100.00	44,310,000
日本空港ビルデング	35,100	1,027.00	36,047,700
トランス・コスモス	15,700	881.00	13,831,700

乃村工藝社	25,000	228.00	5,700,000
ジャステック	7,000	512.00	3,584,000
S C S K	22,400	1,237.00	27,708,800
藤田観光	30,000	252.00	7,560,000
日本管財	4,300	1,420.00	6,106,000
トーカイ	4,900	1,629.00	7,982,100
白洋舎	17,000	209.00	3,553,000
セコム	112,900	3,625.00	409,262,500
日本システムウエア	3,700	285.00	1,054,500
セントラル警備保障	5,200	795.00	4,134,000
アイネス	13,300	525.00	6,982,500
丹青社	16,000	207.00	3,312,000
メイテック	18,300	1,403.00	25,674,900
T K C	9,300	1,492.00	13,875,600
アサツー ディ・ケイ	20,300	1,906.00	38,691,800
富士ソフト	14,900	1,217.00	18,133,300
応用地質	12,600	771.00	9,714,600
船井総合研究所	11,900	530.00	6,307,000
N S D	21,300	578.00	12,311,400
進学会	6,200	280.00	1,736,000
丸紅建材リース	11,000	135.00	1,485,000
コナミ	49,600	2,485.00	123,256,000
ベネッセホールディングス	36,000	3,640.00	131,040,000
イオンディライト	13,100	1,590.00	20,829,000
ナック	3,200	1,465.00	4,688,000
福井コンピュータ	1,600	342.00	547,200
ニチイ学館	23,500	905.00	21,267,500
ダイセキ	18,700	1,394.00	26,067,800
日鐵商事	25,000	193.00	4,825,000
元気寿司	3,400	963.00	3,274,200
トラスコ中山	13,700	1,390.00	19,043,000
ヤマダ電機	53,470	5,680.00	303,709,600
オートバックスセブン	13,000	3,625.00	47,125,000
アークランドサカモト	7,200	1,373.00	9,885,600
ニトリホールディングス	21,750	7,560.00	164,430,000
グルメ杵屋	8,000	414.00	3,312,000
愛眼	8,800	377.00	3,317,600
吉野家ホールディングス	298	100,900.00	30,068,200
加藤産業	15,800	1,529.00	24,158,200
イノテック	6,700	536.00	3,591,200
イエローハット	10,400	1,070.00	11,128,000

富士エレクトロニクス	5,700	1,015.00	5,785,500
松屋フーズ	5,300	1,485.00	7,870,500
JBCホールディングス	8,600	506.00	4,351,600
JKホールディングス	9,300	341.00	3,171,300
サガミチェーン	13,000	511.00	6,643,000
日伝	4,600	2,545.00	11,707,000
北沢産業	9,000	150.00	1,350,000
杉本商事	5,900	696.00	4,106,400
因幡電機産業	13,000	2,219.00	28,847,000
住金物産	51,000	165.00	8,415,000
ブレナス	12,300	1,218.00	14,981,400
ミニストップ	8,200	1,370.00	11,234,000
アークス	15,110	1,386.00	20,942,460
パロー	21,900	1,162.00	25,447,800
ミスミグループ本社	40,600	1,720.00	69,832,000
江守商事	2,200	861.00	1,894,200
アルテック	5,400	180.00	972,000
ベルク	5,400	1,123.00	6,064,200
大庄	5,200	932.00	4,846,400
タキヒヨー	17,000	415.00	7,055,000
ファーストリテイリング	25,700	13,480.00	346,436,000
ソフトバンク	497,900	2,572.00	1,280,598,800
スズケン	42,200	1,920.00	81,024,000
サンドラッグ	20,900	2,329.00	48,676,100
ジェコス	7,600	298.00	2,264,800
ヤマザワ	2,900	1,344.00	3,897,600
やまや	1,700	849.00	1,443,300
ベルーナ	13,750	536.00	7,370,000
合計	168,456,297		110,841,678,065

#### 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	91,895,141	9,658,953
コール・ローン	807,791,355	1,228,674,416
国債証券	240,145,408,628	203,237,643,143
特殊債券	1,926,524,353	1,246,302,995
未収利息	2,956,457,437	2,510,133,186
前払費用	179,249,297	103,456,731
流動資産合計	246,107,326,211	208,335,869,424
資産合計	246,107,326,211	208,335,869,424
負債の部		
流動負債		
未払解約金	222,287,550	132,596,678
流動負債合計	222,287,550	132,596,678
負債合計	222,287,550	132,596,678
純資産の部		
元本等		
元本	139,664,878,320	121,402,583,483
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	106,220,160,341	86,800,689,263
元本等合計	245,885,038,661	208,203,272,746
純資産合計	245,885,038,661	208,203,272,746
負債純資産合計	246,107,326,211	208,335,869,424

(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22年11月10日及び平成23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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成22年11月11日 至平成23年11月10日)

1.資産の評価基準及び評価方法	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。	国債証券、特殊債券 同左
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条に基づいております。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	155,026,739,583円	139,664,878,320円
期中追加設定元本額	15,124,859,347円	16,660,913,886円
期中一部解約元本額	30,486,720,610円	34,923,208,723円
期末元本額	139,664,878,320円	121,402,583,483円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン（毎月決算型）	16,764,307,872円	10,733,197,475円
住信 外国債券オープン（3ヶ月決算型）	578,548,627円	416,009,496円
住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	5,731,989,023円	3,744,771,721円
住信 財産四分法ファンド（毎月決算型）	4,587,936,361円	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	255,369,049円	363,571,270円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,860,400円	13,166,801円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	1,943,970,190円	2,725,941,623円
世界経済インデックスファンド	135,887,207円	286,841,795円
すみしん マイセクション25	29,232,953円	23,379,324円
すみしん マイセクション50	18,009,939円	16,971,326円
すみしん マイセクション75	10,157,502円	9,891,875円
すみしん DCマイセクション25	714,977,313円	865,991,896円
すみしん DCマイセクション50	730,429,327円	841,471,709円
すみしん DCマイセクション75	426,378,053円	498,414,115円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	918,476,829円	1,046,409,114円
すみしん DCマイセクションS25	63,991,379円	228,599,285円

すみしん DCマイセレクションS50	85,599,760円	200,326,792円
すみしん DCマイセレクションS75	42,896,681円	82,386,554円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2015	1,974,523円	2,768,891円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2025	7,253,742円	22,513,816円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2035	4,546,718円	13,355,552円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2045	1,465,518円	3,635,693円
すみしん DCマルチアセット ファンド	177,850円	38,592円
DC世界経済インデックスファンド		175,603円
STAM 外国債券インデックス・オープン (SMA専用)	2,861,925,548円	5,059,710,583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	4,082,879,277円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	51,585,543円	47,494,251円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	15,839,419円	14,245,527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)	651,016,612円	598,891,601円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	284,680円	215,392円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	1,701,214,938円	1,630,638,978円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	2,711,320,274円	2,645,536,585円
すみしん バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	35,577,493,970円	33,641,087,292円
すみしん バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	3,497,019,825円	3,353,303,711円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	10,943,516,158円	10,536,934,124円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,540,316,874円	1,429,370,793円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	5,109,749,697円	4,808,988,546円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	5,637,744,032円	5,517,731,076円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	6,029,403,688円	5,890,941,734円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	1,876,422,091円	1,678,149,614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)	3,735,681,360円	3,559,319,116円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	771,218,255円	681,814,373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	883,814,112円

住信 FOFs用外国債券オープン （適格機関投資家専用）	16,500,578,797円	7,720,233,551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）	3,101,863,124円	2,141,906,179円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	388,585,136円	391,198,411円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	1,126,845,079円	1,065,063,272円
2. 計算期間末日における受益権の総数	139,664,878,320口	121,402,583,483口

## (金融商品に関する注記)

## 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）	（自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左

## 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）	（平成23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。	同左
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。	a. 国債証券、特殊債券 同左 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

## (追加情報)

（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）	（自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日）
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	（平成22年11月10日現在）	（平成23年11月10日現在）
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	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	5,101,505,346
特殊債券	788,942	44,052,899
合計	2,285,380,005	5,145,558,245

(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)

## 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）	（平成23年11月10日現在）
該当事項はありません。	同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

（自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日）	（自 平成22年11月11日 至 平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 1.7605円	1口当たり純資産額 = 1.7150円

## (3)附属明細表（平成23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	16,282,264.57	
		T 0.625% 02/28/13	16,700,000.00	16,795,894.57	
		T 0.75% 09/15/13	14,200,000.00	14,335,620.65	
		T 0.75% 12/15/13	15,000,000.00	15,155,859.45	
		T 1% 01/15/14	3,900,000.00	3,962,156.25	
		T 1.125% 12/15/12	16,200,000.00	16,370,858.32	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,147,578.12	
		T 1.375% 01/15/13	23,000,000.00	23,325,682.76	
		T 1.375% 05/15/13	5,000,000.00	5,088,574.05	
		T 1.375% 11/15/12	7,600,000.00	7,694,999.54	
		T 1.5% 12/31/13	8,650,000.00	8,879,765.62	
		T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	23,340,679.74	
		T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	6,310,640.62	
		T 1.75% 07/31/15	27,000,000.00	28,197,070.38	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	8,084,273.41	
		T 1.875% 04/30/14	25,100,000.00	26,064,781.25	
		T 1.875% 06/30/15	15,900,000.00	16,672,019.57	
		T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,223,007.78	
		T 1.875% 09/30/17	9,000,000.00	9,378,984.42	
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,603,906.25	
		T 2% 11/30/13	15,000,000.00	15,535,546.94	
		T 2.125% 02/29/16	14,000,000.00	14,856,406.32	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,187,687.50			
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,715,351.57			

T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,593,164.11	
T 2.25% 11/30/17	9,000,000.00	9,566,718.75	
T 2.375% 02/28/15	14,500,000.00	15,415,312.50	
T 2.375% 03/31/16	9,600,000.00	10,292,625.02	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,270,781.24	
T 2.375% 06/30/18	4,300,000.00	4,589,074.20	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	13,202,148.50	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,353,671.86	
T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,177,046.10	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,082,343.75	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,859,281.25	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,423,632.80	
T 2.625% 08/15/20	18,400,000.00	19,694,468.70	
T 2.625% 11/15/20	17,500,000.00	18,679,882.90	
T 2.625% 12/31/14	8,000,000.00	8,551,250.00	
T 2.75% 02/15/19	10,000,000.00	10,896,484.40	
T 2.75% 02/28/13	6,000,000.00	6,200,390.28	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,154,617.17	
T 2.75% 05/31/17	16,000,000.00	17,486,250.08	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,573,915.96	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,286,250.00	
T 2.875% 01/31/13	15,800,000.00	16,321,214.35	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,294,417.95	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,501,582.05	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,594,808.57	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,890,195.33	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,235,566.39	
T 3.125% 05/15/19	9,000,000.00	10,045,546.92	
T 3.125% 05/15/21	11,250,000.00	12,443,994.10	
T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,682,587.79	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,432,011.74	
T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,792,683.60	
T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,798,984.41	
T 3.25% 12/31/16	7,000,000.00	7,819,218.75	
T 3.375% 06/30/13	11,200,000.00	11,781,655.87	
T 3.375% 07/31/13	21,000,000.00	22,143,104.75	
T 3.375% 11/15/19	8,300,000.00	9,415,960.97	
T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,721,279.11	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,487,312.50	
T 3.5% 02/15/39	7,900,000.00	8,624,578.12	
T 3.5% 05/15/20	10,200,000.00	11,670,234.42	

T 3.5% 05/31/13	2,400,000.00	2,522,624.85	
T 3.625% 02/15/20	4,400,000.00	5,076,500.00	
T 3.625% 02/15/21	18,000,000.00	20,730,937.50	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,150,063.21	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,493,226.58	
T 3.625% 12/31/12	5,100,000.00	5,300,911.95	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	7,984,921.89	
T 3.875% 02/15/13	3,900,000.00	4,081,517.46	
T 3.875% 05/15/18	5,000,000.00	5,818,945.30	
T 3.875% 08/15/40	12,300,000.00	14,310,281.25	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,906,437.50	
T 4.0% 02/15/15	12,700,000.00	14,164,468.75	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,873,761.72	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,551,894.54	
T 4.25% 05/15/39	2,500,000.00	3,091,210.95	
T 4.25% 08/15/13	8,000,000.00	8,566,406.00	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	13,287,187.55	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	14,223,632.87	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,509,992.21	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,590,011.73	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,436,085.92	
T 4.25% 11/15/40	15,000,000.00	18,576,562.50	
T 4.375% 02/15/38	5,900,000.00	7,424,320.34	
T 4.375% 05/15/40	5,900,000.00	7,449,671.87	
T 4.375% 11/15/39	10,000,000.00	12,615,625.00	
T 4.5% 02/15/16	3,200,000.00	3,713,875.00	
T 4.5% 02/15/36	5,400,000.00	6,890,906.25	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,916,687.50	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,566,562.50	
T 4.5% 08/15/39	8,600,000.00	11,051,000.00	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,577,714.83	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,947,460.95	
T 4.625% 02/15/40	8,900,000.00	11,671,515.62	
T 4.75% 02/15/37	4,000,000.00	5,299,687.52	
T 4.75% 02/15/41	2,100,000.00	2,812,687.50	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,887,085.92	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,568,074.22	
T 5.0% 05/15/37	2,000,000.00	2,745,781.26	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,933,945.29	
T 5.25% 02/15/29	2,050,000.00	2,784,957.04	
T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,577,320.32	

	T 5.375% 02/15/31	2,610,000.00	3,648,902.35	
	T 5.5% 08/15/28	2,000,000.00	2,779,843.76	
	T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	3,135,687.50	
	T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,086,875.00	
	T 6.125% 11/15/27	3,220,000.00	4,722,582.82	
	T 6.25% 05/15/30	2,380,000.00	3,618,901.57	
	T 6.25% 08/15/23	3,490,000.00	4,952,800.79	
	T 6.375% 08/15/27	1,200,000.00	1,796,718.75	
	T 6.5% 11/15/26	1,310,000.00	1,964,488.28	
	T 6.625% 02/15/27	1,150,000.00	1,748,628.91	
	T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,525,156.25	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	8,197,701.15	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,907,718.75	
	T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,763,875.00	
	T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	5,449,562.50	
	T 8.0% 11/15/21	2,560,000.00	3,979,200.00	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,125,062.50	
	T 8.75% 05/15/17	4,800,000.00	6,803,812.51	
	T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,407,156.26	
	T 8.875% 02/15/19	4,800,000.00	7,291,687.48	
小計		966,420,000.00	1,072,844,680.20 (83,520,958,353)	
カナダドル	CAN 1.5% 11/01/13	500,000.00	505,850.00	
	CAN 1.5% 12/01/12	1,450,000.00	1,459,396.00	
	CAN 1.75% 03/01/13	5,200,000.00	5,258,188.00	
	CAN 2% 03/01/14	1,300,000.00	1,330,784.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,442,924.00	
	CAN 2% 12/01/14	3,000,000.00	3,082,080.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	2,000,000.00	2,093,860.00	
	CAN 2.5% 09/01/13	1,800,000.00	1,851,552.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	400,000.00	420,236.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	400,000.00	426,064.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,069,790.00	
	CAN 3.0% 06/01/14	4,900,000.00	5,146,715.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,300,000.00	2,530,736.00	
	CAN 3.5% 06/01/13	3,000,000.00	3,120,360.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,900,000.00	3,248,464.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,400,000.00	3,867,296.00	
	CAN 4% 06/01/16	4,000,000.00	4,475,400.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,700,000.00	3,063,285.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,600,000.00	3,272,048.00	

	CAN 4.25% 06/01/18	2,350,000.00	2,733,332.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,348,930.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,861,482.00	
	CAN 5% 06/01/37	3,400,000.00	4,801,548.00	
	CAN 5.25% 06/01/13	5,120,000.00	5,462,784.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,460,000.00	3,561,563.40	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,710,000.00	4,060,393.00	
	CAN 8.0% 06/01/23	900,000.00	1,427,922.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,450,000.00	2,490,998.50	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	620,133.50	
小計		68,590,000.00	79,034,114.40 (6,008,963,717)	
オーストラリアドル	ACGB 4.5% 04/15/20	3,500,000.00	3,586,940.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	900,000.00	919,359.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	400,000.00	415,236.00	
	ACGB 4.75% 11/15/12	1,200,000.00	1,210,476.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,450,000.00	2,634,803.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	250,000.00	271,102.50	
	ACGB 5.5% 12/15/13	700,000.00	726,166.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	1,400,000.00	1,565,858.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,500,000.00	2,806,050.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	1,550,000.00	1,679,750.50	
	ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,278,420.00	
	ACGB 6.5% 05/15/13	3,900,000.00	4,054,752.00	
小計		19,950,000.00	21,148,913.50 (1,666,745,872)	
イギリスポンド	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,353,495.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,800,000.00	4,985,760.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	5,400,000.00	5,742,630.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	903,680.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	4,000,000.00	4,559,400.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,350,000.00	3,814,812.50	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,400,000.00	2,732,520.00	
	UKT 4% 01/22/60	3,050,000.00	3,686,169.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,450,000.00	2,851,383.50	
	UKT 4% 09/07/16	6,800,000.00	7,720,720.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,650,000.00	5,564,655.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,910,000.00	4,667,093.30	
	UKT 4.25% 09/07/39	2,200,000.00	2,638,460.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	3,800,000.00	4,541,380.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,450,000.00	4,142,484.00	

	UKT 4.25% 12/07/46	3,850,000.00	4,726,760.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	3,400,000.00	4,211,580.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,400,000.00	4,277,642.00	
	UKT 4.5% 03/07/13	5,300,000.00	5,578,780.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,800,000.00	4,533,780.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,200,000.00	2,717,946.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	4,000,000.00	5,043,200.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	5,900,000.00	7,185,020.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,600,000.00	6,420,120.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	3,600,000.00	4,572,828.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	4,900,000.00	6,342,707.00	
	UKT 5% 03/07/18	3,200,000.00	3,880,800.00	
	UKT 5% 03/07/25	3,620,000.00	4,641,564.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,010,000.00	5,618,364.30	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,460,000.00	3,548,304.00	
	UKT 8% 06/07/21	3,840,000.00	5,793,907.20	
	UKT 8% 09/27/13	2,100,000.00	2,392,110.00	
	UKT 8% 12/07/15	3,345,000.00	4,291,969.50	
	UKT 8.75% 08/25/17	2,050,000.00	2,892,816.50	
小計		123,935,000.00	148,574,841.30 (18,403,965,591)	
スイスフラン	SWISS 3% 01/08/18	2,250,000.00	2,597,040.00	
	SWISS 4% 02/11/13	3,200,000.00	3,361,184.00	
	SWISS 4% 02/11/23	3,900,000.00	5,147,883.00	
小計		9,350,000.00	11,106,107.00 (949,572,148)	
シンガポールドル	SIGB 1.125% 04/01/16	700,000.00	718,046.00	
	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	816,904.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	500,000.00	528,555.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,550,000.00	1,604,048.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	550,000.00	596,662.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,000,000.00	1,086,890.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	550,000.00	603,922.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	1,023,183.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	900,000.00	1,025,406.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,200,000.00	1,402,212.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,413,997.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,200,000.00	1,376,040.00	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,069,371.00	
小計		12,050,000.00	13,265,236.50 (799,097,846)	

マレーシアリングット	MGS 3.21% 05/31/13	4,400,000.00	4,427,368.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	1,000,000.00	1,008,440.00	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,944,565.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,243,688.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	800,000.00	800,928.00	
	MGS 3.702% 02/25/13	1,850,000.00	1,869,332.50	
	MGS 3.741% 02/27/15	1,800,000.00	1,830,510.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,500,000.00	2,543,472.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,900,000.00	1,967,830.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	415,058.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	9,600,000.00	9,962,678.40	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,933,000.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,679,380.80	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,000,000.00	3,144,570.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	3,450,000.00	3,938,212.95	
小計		42,400,000.00	43,709,034.65 (1,079,613,155)	
スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	11,700,000.00	12,613,068.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,500,000.00	11,001,805.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	5,700,000.00	6,737,913.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	17,020,871.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	15,200,000.00	18,031,912.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	4,900,000.00	5,498,192.00	
	SGB 5% 12/01/20	15,100,000.00	19,396,705.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	18,000,000.00	20,493,000.00	
小計		94,200,000.00	110,793,466.00 (1,287,420,074)	
ノルウェークローネ	NGB 3.75% 05/25/21	5,650,000.00	6,271,952.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,100,000.00	9,035,550.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	4,750,000.00	5,448,392.50	
	NGB 5% 05/15/15	10,600,000.00	11,777,978.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	12,400,000.00	13,278,912.00	
小計		41,500,000.00	45,812,784.50 (621,679,485)	
デンマーククローネ	DGB 2% 11/15/14	800,000.00	831,480.00	
	DGB 3% 11/15/21	6,200,000.00	6,794,146.00	
	DGB 4% 11/15/12	11,650,000.00	12,051,342.50	
	DGB 4% 11/15/15	20,400,000.00	22,909,812.00	
	DGB 4% 11/15/17	15,200,000.00	17,557,520.00	
	DGB 4% 11/15/19	15,600,000.00	18,368,688.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	20,800,000.00	30,007,120.00	

	DGB 5% 11/15/13	20,100,000.00	21,858,348.00	
	DGB 7% 11/10/24	5,890,000.00	9,100,639.00	
小計		116,640,000.00	139,479,095.50 (1,973,629,201)	
メキシコペソ	MBONO 6% 06/18/15	80,000,000.00	83,131,200.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	43,882,317.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	61,400,000.00	69,814,870.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	38,900,000.00	42,606,781.00	
	MBONO 9% 12/20/12	72,700,000.00	76,300,104.00	
小計		291,700,000.00	315,735,272.00 (1,799,691,050)	
ポーランドズロチ	POLGB 5% 10/24/13	8,000,000.00	8,073,600.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	9,850,000.00	9,957,660.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	7,450,000.00	7,467,731.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,800,000.00	2,712,360.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,000,000.00	5,110,750.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,400,000.00	6,385,792.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	5,200,000.00	5,328,804.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,100,000.00	1,085,920.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,850,000.00	5,847,367.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,000,000.00	998,780.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,800,000.00	9,228,560.00	
小計		61,450,000.00	62,197,325.00 (1,490,869,880)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,050,000.00	2,990,372.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	900,855.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,039,800.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	4,800,000.00	4,639,104.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,340,250.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,400,000.00	2,403,792.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,650,000.00	3,546,340.00	
	BGB 4.0% 03/28/13	2,800,000.00	2,848,524.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,700,000.00	2,715,255.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,400,000.00	2,391,240.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,300,000.00	1,175,174.00	
	BGB 4.25% 09/28/13	4,100,000.00	4,196,268.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,950,000.00	3,023,543.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,085,755.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	2,970,963.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,400,000.00	3,710,250.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	2,050,000.00	2,213,282.50	



BGB 8.0% 03/28/15	1,900,000.00	2,169,002.00	
BKO 1% 12/14/12	1,200,000.00	1,209,696.00	
BKO 1.75% 06/14/13	5,500,000.00	5,622,760.00	
BTNS 2% 07/12/15	600,000.00	603,660.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	1,000,000.00	1,008,780.00	
BTNS 2.5% 01/12/14	4,600,000.00	4,711,688.00	
BTNS 2.5% 01/15/15	5,600,000.00	5,742,968.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,500,000.00	6,756,945.00	
BTNS 3.75% 01/12/13	8,200,000.00	8,464,450.00	
BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,055,900.00	
BTPS 2% 06/01/13	1,300,000.00	1,206,530.00	
BTPS 2% 12/15/12	1,200,000.00	1,136,316.00	
BTPS 2.25% 11/01/13	4,100,000.00	3,749,368.00	
BTPS 3% 04/01/14	2,500,000.00	2,279,875.00	
BTPS 3% 04/15/15	2,500,000.00	2,185,575.00	
BTPS 3% 06/15/15	500,000.00	434,735.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,397,444.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,300,000.00	3,024,384.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,000,000.00	1,559,860.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	1,912,834.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	6,675,375.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,900,000.00	6,811,222.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	6,164,400.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	3,900,000.00	3,653,832.00	
BTPS 4% 02/01/17	6,300,000.00	5,438,286.00	
BTPS 4% 02/01/37	5,500,000.00	3,540,240.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	2,811,830.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	5,766,894.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	6,900,000.00	5,756,187.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	2,428,971.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,800,000.00	1,732,374.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	5,800,000.00	5,550,194.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	7,886,555.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	3,900,000.00	3,214,263.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,250,000.00	2,797,860.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,050,000.00	5,895,774.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,450,000.00	3,765,056.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	3,350,000.00	2,458,330.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,600,000.00	5,632,638.00	
BTPS 4.75% 02/01/13	10,100,000.00	9,820,533.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,500,000.00	4,358,750.00	

BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	3,343,920.00	
BTPS 5% 03/01/22	1,500,000.00	1,248,750.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,850,000.00	3,034,955.00	
BTPS 5% 08/01/34	5,000,000.00	3,600,000.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,600,000.00	1,839,448.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,000,000.00	2,837,200.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,040,000.00	3,659,836.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,600,000.00	4,299,568.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	2,389,950.00	
BTPS 6% 05/01/31	6,330,000.00	5,223,199.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,500,000.00	4,873,990.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	2,000,000.00	1,906,440.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	862,544.00	
DBR 2.25% 09/04/20	5,400,000.00	5,693,382.00	
DBR 2.25% 09/04/21	4,000,000.00	4,190,120.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,436,736.00	
DBR 3% 07/04/20	5,000,000.00	5,589,750.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,600,000.00	2,955,108.00	
DBR 3.25% 07/04/15	7,200,000.00	7,887,456.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,412,500.00	
DBR 3.25% 07/04/42	1,600,000.00	1,868,448.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,915,040.00	
DBR 3.5% 07/04/19	7,000,000.00	8,060,710.00	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,817,830.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,100,000.00	6,958,392.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,050,000.00	4,720,599.00	
DBR 3.75% 07/04/13	5,000,000.00	5,280,350.00	
DBR 4% 07/04/16	4,400,000.00	5,037,120.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,267,835.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,800,000.00	4,842,834.00	
DBR 4.25% 01/04/14	5,000,000.00	5,414,750.00	
DBR 4.25% 07/04/14	8,000,000.00	8,795,200.00	
DBR 4.25% 07/04/17	4,200,000.00	4,937,436.00	
DBR 4.25% 07/04/18	5,700,000.00	6,801,240.00	
DBR 4.25% 07/04/39	3,100,000.00	4,182,365.00	
DBR 4.5% 01/04/13	7,800,000.00	8,179,470.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,800,000.00	5,018,660.00	
DBR 4.75% 07/04/34	4,700,000.00	6,478,950.00	
DBR 4.75% 07/04/40	4,100,000.00	5,992,560.00	
DBR 5.5% 01/04/31	3,600,000.00	5,219,280.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,970,000.00	2,828,624.50	

DBR 6% 06/20/16	560,000.00	689,584.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,200,000.00	3,190,440.00	
DBR 6.25% 01/04/30	2,000,000.00	3,108,360.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,600,000.00	2,473,440.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,000,000.00	3,815,920.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,800,000.00	6,038,090.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	11,100,000.00	11,650,893.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	3,700,000.00	3,718,981.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,361,755.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	5,794,208.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,650,000.00	4,547,002.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,600,000.00	4,922,690.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	7,600,000.00	7,975,820.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,600,000.00	6,981,348.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,409,825.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,400,000.00	6,927,040.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	2,876,597.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,700,000.00	1,685,771.00	
FRTR 4% 10/25/13	5,900,000.00	6,205,620.00	
FRTR 4% 10/25/14	2,900,000.00	3,100,970.00	
FRTR 4% 10/25/38	4,900,000.00	4,952,430.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	6,800,000.00	7,095,664.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,800,000.00	7,439,064.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,100,000.00	3,400,018.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,050,000.00	3,340,604.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	8,100,000.00	8,749,863.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,000,000.00	3,283,350.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,900,000.00	4,384,263.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,210,000.00	7,020,094.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,930,000.00	5,933,895.90	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,600,000.00	5,780,360.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,508,820.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,483,200.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,563,990.40	
FRTR 8.5% 12/26/12	1,200,000.00	1,300,260.00	
IRISH 4% 01/15/14	1,000,000.00	915,330.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,700,000.00	1,360,000.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,200,000.00	3,329,256.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,600,000.00	1,308,960.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,200,000.00	1,933,646.00	
IRISH 5% 04/18/13	2,650,000.00	2,525,582.50	

IRISH 5.4% 03/13/25	2,100,000.00	1,669,353.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	600,000.00	527,028.00	
NETHER 1% 01/15/14	1,000,000.00	1,007,200.00	
NETHER 1.75% 01/15/13	2,200,000.00	2,234,650.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,268,196.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	5,100,000.00	5,508,663.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,350,000.00	2,570,265.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,400,000.00	3,797,392.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,650,000.00	1,881,957.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	2,759,746.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,312,800.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,350,000.00	2,972,350.50	
NETHER 4% 07/15/16	2,750,000.00	3,093,970.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,900,000.00	3,336,015.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,950,000.00	3,377,691.00	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,400,000.00	4,671,480.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,400,000.00	5,112,140.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,300,000.00	3,217,585.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,050,000.00	1,587,043.50	
OBL 1.75% 10/09/15	2,100,000.00	2,189,628.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,697,925.00	
OBL 2.25% 04/11/14	6,000,000.00	6,279,300.00	
OBL 2.5% 02/27/15	4,600,000.00	4,889,340.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	4,021,540.00	
OBL 2.75% 04/08/16	1,000,000.00	1,086,130.00	
OBL 3.5% 04/12/13	6,450,000.00	6,737,992.50	
OBL 4% 10/11/13	1,400,000.00	1,497,160.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	300,000.00	313,890.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	633,318.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,400,000.00	3,608,522.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,400,000.00	3,528,928.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	2,900,000.00	3,052,250.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	3,098,012.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,400,000.00	3,691,142.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,300,000.00	2,514,406.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,369,400.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	850,000.00	935,340.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,300,000.00	1,431,326.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,950,000.00	4,418,272.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,600,000.00	1,852,288.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,900,000.00	2,540,642.00	

		RFGB 3.125% 09/15/14	1,500,000.00	1,598,895.00	
		RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,370,100.00	
		RFGB 3.5% 04/15/21	300,000.00	332,169.00	
		RFGB 3.875% 09/15/17	2,000,000.00	2,244,600.00	
		RFGB 4% 07/04/25	1,600,000.00	1,861,648.00	
		RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,559,222.00	
		RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,868,288.00	
		RFGB 5.375% 07/04/13	1,400,000.00	1,510,992.00	
		SPGB 2.3% 04/30/13	800,000.00	776,704.00	
		SPGB 2.5% 10/31/13	2,300,000.00	2,216,050.00	
		SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,604,040.00	
		SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	933,340.00	
		SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,212,350.00	
		SPGB 3.8% 01/31/17	3,050,000.00	2,868,220.00	
		SPGB 3.9% 10/31/12	2,950,000.00	2,936,430.00	
		SPGB 4% 04/30/20	4,300,000.00	3,870,430.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,211,156.50	
		SPGB 4.2% 01/31/37	3,100,000.00	2,253,080.00	
		SPGB 4.2% 07/30/13	4,300,000.00	4,282,585.00	
		SPGB 4.25% 01/31/14	2,300,000.00	2,281,209.00	
		SPGB 4.25% 10/31/16	700,000.00	674,401.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	1,300,000.00	1,202,305.00	
		SPGB 4.4% 01/31/15	9,900,000.00	9,822,087.00	
		SPGB 4.6% 07/30/19	4,200,000.00	3,973,116.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,100,000.00	948,310.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,539,900.00	
		SPGB 4.75% 07/30/14	4,900,000.00	4,908,330.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,900,000.00	3,494,010.00	
		SPGB 4.85% 10/31/20	3,200,000.00	3,024,000.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,800,000.00	2,228,744.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,328,872.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	2,800,000.00	2,840,516.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	3,050,000.00	2,817,742.50	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,241,539.00	
		SPGB 6.0% 01/31/29	4,350,000.00	4,176,130.50	
		SPGB 6.15% 01/31/13	4,300,000.00	4,386,215.00	
	小計		779,960,000.00	794,258,658.80 (83,635,436,771)	
国債証券計				(203,237,643,143)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	2,700,000.00	2,850,984.00	

		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,426,855.00	
		QTC 6% 06/14/21	900,000.00	982,800.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,700,000.00	2,789,019.00	
		QTC 6% 09/14/17	5,350,000.00	5,764,363.00	
	小計		14,950,000.00	15,814,021.00 (1,246,302,995)	
特殊債券計				(1,246,302,995)	
合計				(204,483,946,138)	

(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 126銘柄	100.0%	40.8%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.9%
オーストラリアドル	国債証券 12銘柄	57.2%	1.4%
	特殊債券 5銘柄	42.8%	
イギリスポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	9.0%
スイスフラン	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 15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%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	1.0%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 217銘柄	100.0%	41.0%

## 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,527,327,674	3,442,732,113
コール・ローン	74,977,261	121,267,251
株式	117,807,480,912	110,292,377,428
投資信託受益証券	272,581,092	125,596,533
投資証券	1,837,843,219	1,976,079,170
派生商品評価勘定	147,496,669	82,423,448
未収入金	794,446	21,859,769
未収配当金	138,364,268	153,536,271
未収利息	130	158
差入委託証拠金	854,263,224	991,131,024
流動資産合計	123,661,128,895	117,207,003,165
資産合計	123,661,128,895	117,207,003,165
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,959	32,661,339
未払解約金	54,231,137	103,959,444
流動負債合計	54,243,096	136,620,783
負債合計	54,243,096	136,620,783
純資産の部		
元本等		
元本	137,499,750,763	141,686,047,892
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	13,892,864,964	24,615,665,510
元本等合計	123,606,885,799	117,070,382,382
純資産合計	123,606,885,799	117,070,382,382
負債純資産合計	123,661,128,895	117,207,003,165

(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22年11月10日及び平成23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21年11月11日 至 平成22年11月10日）	（自 平成22年11月11日 至 平成23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) 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>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>(5) 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	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条に基づいております。</p>	同左



3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	136,011,705,064円	137,499,750,763円
期中追加設定元本額	24,447,846,054円	31,044,568,076円
期中一部解約元本額	22,959,800,355円	26,858,270,947円
期末元本額	137,499,750,763円	141,686,047,892円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	610,877,782円	820,835,530円
SBI資産設計オープン（分配型）	32,382,279円	28,239,668円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	12,361,531,587円	15,059,824,355円
世界経済インデックスファンド	284,805,324円	583,301,873円
すみしん マイセレクション25	33,186,238円	24,139,197円
すみしん マイセレクション50	120,117,512円	103,828,755円
すみしん マイセレクション75	115,146,923円	102,253,358円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,377,566,858円	1,438,950,007円
すみしん DCマイセレクション25	788,888,359円	979,271,537円
すみしん DCマイセレクション50	4,752,198,104円	5,310,567,861円
すみしん DCマイセレクション75	4,783,566,934円	5,439,972,996円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	4,083,164,105円	4,841,472,327円
すみしん DCマイセレクションS25	69,225,909円	258,141,413円
すみしん DCマイセレクションS50	557,960,060円	1,260,825,430円
すみしん DCマイセレクションS75	463,458,617円	885,156,858円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,545,966円	11,752,785円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	39,417,319円	121,975,097円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	34,727,029円	102,476,514円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	14,248,650円	36,093,000円
すみしん DCマルチアセット ファンド	386,285円	78,834円
DC世界経済インデックスファンド		367,963円
STAM 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	5,905,620,508円	9,115,754,930円
すみしん マイセレクション50VA1	337,690,473円	297,518,141円
（適格機関投資家専用）		
すみしん マイセレクション75VA1	163,489,062円	142,954,099円
（適格機関投資家専用）		
すみしん 外国株式インデックス・オープンVA1	625,233,056円	590,389,817円
（適格機関投資家専用）		

すみしん マイセレクション50V A 2 （適格機関投資家専用）	1,865,163円	1,447,450円
すみしん バランス30V A 1 （適格機関投資家専用）	1,569,285,926円	1,538,904,519円
すみしん バランス50V A 1 （適格機関投資家専用）	5,858,680,809円	5,241,650,852円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,964,802,145円	13,951,425,641円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	4,414,171,920円	4,172,393,765円
すみしん バランスA（25）VA1 （適格機関投資家専用）	6,811,301,768円	6,678,682,962円
すみしん バランスB（37.5）VA1 （適格機関投資家専用）	1,776,860,573円	1,702,948,757円
すみしん バランスC（50）VA1 （適格機関投資家専用）	10,754,476,654円	9,528,196,262円
すみしん 世界バランスVA1 （適格機関投資家専用）	22,936,196,675円	21,403,215,168円
すみしん 世界バランスVA2 （適格機関投資家専用）	10,513,717,311円	9,788,321,734円
すみしん バランスD（35）VA1 （適格機関投資家専用）	1,965,763,388円	1,803,655,980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）	1,645,797,479円	1,665,573,431円
すみしん バランスE（25）VA1 （適格機関投資家専用）	727,775,862円	616,999,538円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,574,890,506円	1,550,108,802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）	8,007,072,608円	8,247,424,210円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	6,413,657,037円	6,238,956,476円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 13,892,864,964円下回って おります。	純資産額は、元本を 24,615,665,510円下回って おります。
3. 計算期間末日における受益権の総数	137,499,750,763口	141,686,047,892口

## (金融商品に関する注記)

## 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）	（自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左

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"> <li>・ 価格変動リスク</li> <li>・ 為替変動リスク</li> </ul>	同左
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>	同左
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>	同左

## 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）	（平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	<p>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。</p>	<p>a. 株式、投資信託受益証券、投資証券 同左</p>

	<p>b. 先物取引</p> <p>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。</p> <p>外貨建て先物取引の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。</p> <p>c. 外国為替予約</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul> <p>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。</p> <p>d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>	<p>b. 先物取引</p> <p>同左</p> <p>c. 外国為替予約</p> <p>同左</p> <p>d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p>
--	--	--

(追加情報)

(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日)
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。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	12,225,345,857	11,809,662,188
投資信託受益証券	36,002,182	23,587,267
投資証券	184,559,433	174,902,595
合計	12,445,907,472	12,008,152,050

(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)

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)
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。

株式関連

(平成23年11月10日現在)	

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 FUTU	2,594,824,188		2,623,856,400	29,032,212
	S&P/TSE 60	262,040,433		262,265,482	225,049
	SPI 200 FUTU	291,533,951		307,619,071	16,085,120
	FTSE 100	492,773,439		499,659,371	6,885,932
	SWISS MKT IX	177,415,920		177,567,255	151,335
	DJ EURO STOXX	729,327,807		726,713,208	2,614,599
合計		4,547,915,738		4,597,680,787	49,765,049

(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。

#### 通貨関連

区分	種類	(平成23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	52,150,790		52,152,800	2,010
	イギリスポンド	3,715,350		3,715,500	150
	スイスフラン	2,564,640		2,564,700	60
	ユーロ	6,316,680		6,317,400	720
合 計		64,747,460		64,750,400	2,940

(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21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 0.8990円	1口当たり純資産額 = 0.8263円

(3) 附属明細表 (平成23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	47,727	79.00	3,770,433.00	
	ABBOTT LABORATORIES	109,890	52.94	5,817,576.60	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,225	56.28	350,343.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	45,905	56.71	2,603,272.55	
	ACE LTD	23,855	70.26	1,676,052.30	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	36,980	13.02	481,479.60	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,666	28.08	1,001,501.28	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,434	66.37	360,654.58	
	ADVANCED MICRO DEVICES	42,704	5.38	229,747.52	
	AES CORP	46,996	11.41	536,224.36	
	AETNA INC	26,831	39.45	1,058,482.95	

AFLAC	33,067	43.37	1,434,115.79	
AGCO CORP	6,928	45.03	311,967.84	
AGILENT TECHNOLOGIES	24,401	36.07	880,144.07	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,981	83.40	1,249,415.40	
AIRGAS INC	5,449	70.05	381,702.45	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,643	29.01	395,783.43	
ALCOA	75,055	10.20	765,561.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,911	64.07	827,207.77	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,367	46.44	342,123.48	
ALLERGAN INC	21,549	82.75	1,783,179.75	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,728	100.49	374,626.72	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,107	41.49	336,359.43	
ALLSTATE CORP	36,922	25.85	954,433.70	
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	16,554	25.91	428,914.14	
ALTERA CORPORATION	22,782	36.29	826,758.78	
ALTRIA GROUP INC	148,005	27.17	4,021,295.85	
AMAZON.COM	25,642	211.22	5,416,103.24	
AMEREN CORPORATION	17,050	32.88	560,604.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,063	38.43	1,309,041.09	
AMERICAN EXPRESS	76,494	49.21	3,764,269.74	
AMERICAN INT'L GROUP	33,526	22.54	755,676.04	
AMERICAN TOWER-A	28,326	57.18	1,619,680.68	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,813	30.82	394,896.66	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,130	45.35	776,845.50	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,369	38.23	740,476.87	
AMETEK INC	11,370	39.46	448,660.20	
AMGEN	65,733	57.51	3,780,304.83	
AMPHENOL CORPORATION	12,454	45.44	565,909.76	
ANADARKO PETROLEUM CORP	35,175	77.81	2,736,966.75	
ANALOG DEVICES	21,184	35.25	746,736.00	
AON CORP	21,033	47.50	999,067.50	
APACHE CORP	27,110	99.78	2,705,035.80	
APOLLO GROUP INC-CLA	9,307	46.14	429,424.98	
APPLE INC	65,381	395.28	25,843,801.68	
APPLIED MATERIALS	93,202	12.14	1,131,472.28	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,851	35.99	354,537.49	
ARCH COAL INC	15,406	16.87	259,899.22	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,099	28.52	1,286,223.48	
ARROW ELECTRONICS INC	8,481	34.17	289,795.77	
ASSURANT INC	6,946	37.91	263,322.86	
AT&T INC	422,927	28.91	12,226,819.57	



AUTODESK INC	16,247	32.54	528,677.38	
AUTOLIV INC	6,534	53.96	352,574.64	
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,330	50.79	1,794,410.70	
AUTOZONE INC	1,832	325.64	596,572.48	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,312	33.23	508,817.76	
AVERY DENNISON CORP	7,057	25.43	179,459.51	
AVNET INC	11,164	29.55	329,896.20	
AVON PRODUCTS INC	30,415	18.60	565,719.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,984	31.34	281,558.56	
BAKER HUGHES	30,729	55.77	1,713,756.33	
BALL CORP	11,693	34.06	398,263.58	
BANK NEW YORK CO	87,791	20.30	1,782,157.30	
BANK OF AMERICA CORP	716,412	6.16	4,413,097.92	
BARD C R INC	6,056	87.02	526,993.12	
BAXTER INTERNATIONAL	40,326	53.11	2,141,713.86	
BB&T CORP	49,241	22.83	1,124,172.03	
BEAM INC	9,810	48.71	477,845.10	
BECTON DICKINSON & CO	15,466	72.61	1,122,986.26	
BED BATH & BEYOND INC	17,664	61.47	1,085,806.08	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	63,810	75.40	4,811,274.00	
BEST BUY COMPANY INC	23,428	27.22	637,710.16	
BIOGEN IDEC INC	16,229	111.24	1,805,313.96	
BLACKROCK INC	6,549	153.23	1,003,503.27	
BLOCK H & R INC	22,367	15.34	343,109.78	
BMC SOFTWARE	12,923	35.70	461,351.10	
BOEING CO	49,587	64.55	3,200,840.85	
BORGWARNER INC	7,764	66.02	512,579.28	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,046	5.76	622,344.96	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,615	30.97	3,735,446.55	
BROADCOM CORP-CL A	34,120	34.05	1,161,786.00	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,151	73.14	449,884.14	
BUNGE LIMITED	10,410	61.58	641,047.80	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,522	67.16	773,817.52	
CA INC	28,626	21.28	609,161.28	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,403	14.62	225,191.86	
CABOT OIL & GAS CORP	7,386	80.34	593,391.24	
CALPINE CORP	22,805	14.97	341,390.85	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,324	49.41	855,978.84	
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,911	33.33	463,653.63	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,428	44.40	1,439,803.20	
CARDINAL HEALTH	24,787	42.88	1,062,866.56	

CAREFUSION CORP	16,327	24.28	396,419.56	
CARMAX INC	16,014	28.47	455,918.58	
CATERPILLAR	45,581	91.64	4,177,042.84	
CBRE GROUP INC-A	21,372	15.84	338,532.48	
CBS CORP-CL B	44,326	24.52	1,086,873.52	
CELANESE CORP-SERIES A	11,045	42.48	469,191.60	
CELGENE CORP	32,721	64.31	2,104,287.51	
CENTERPOINT ENERGY INC	28,573	19.58	559,459.34	
CENTURYLINK INC	43,902	36.76	1,613,837.52	
CERNER CORP	10,109	63.69	643,842.21	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,054	166.08	839,368.32	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	46,498	25.57	1,188,953.86	
CHEVRON CORP	142,126	104.28	14,820,899.28	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,206	332.84	734,245.04	
CHUBB CORPORATION	20,683	66.78	1,381,210.74	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,420	42.95	447,539.00	
CIGNA CORP	19,130	42.47	812,451.10	
CIMAREX ENERGY CO	6,250	63.62	397,625.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,315	28.32	320,440.80	
CINTAS CORP	9,556	28.65	273,779.40	
CISCO SYSTEMS	388,869	17.61	6,847,983.09	
CIT GROUP INC	13,468	33.81	455,353.08	
CITIGROUP	205,458	28.85	5,927,463.30	
CITRIX SYSTEMS INC	13,291	70.78	940,736.98	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,227	66.20	677,027.40	
CLOROX COMPANY	9,565	64.41	616,081.65	
CME GROUP INC	4,504	265.79	1,197,118.16	
COACH INC	20,818	62.56	1,302,374.08	
COCA-COLA CO	145,668	67.03	9,764,126.04	
COCA-COLA ENTERPRISES	22,979	25.91	595,385.89	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,511	67.58	1,453,713.38	
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,565	87.45	3,022,709.25	
COMCAST CORP-CL A	147,791	21.61	3,193,763.51	
COMCAST CORP-SPECIAL A	47,675	21.38	1,019,291.50	
COMERICA INC	14,682	25.54	374,978.28	
COMPUTER SCIENCES CORP	11,333	27.90	316,190.70	
CONAGRA	28,909	25.15	727,061.35	
CONCHO RESOURCES INC	6,944	95.17	660,860.48	
CONOCOPHILLIPS	94,940	70.22	6,666,686.80	
CONSOL ENERGY INC	16,024	41.91	671,565.84	
CONSOLIDATED EDISON INC	20,686	58.22	1,204,338.92	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,841	19.69	272,529.29	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	13,480	40.24	542,435.20	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	63.50	198,183.50	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	11,667	52.75	615,434.25	
CORNING	110,994	14.22	1,578,334.68	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,887	83.41	2,576,284.67	
COVANCE INC	4,199	47.06	197,604.94	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,831	31.29	338,901.99	
COVIDIEN PLC	35,049	45.04	1,578,606.96	
CREE INC	7,602	28.64	217,721.28	
CROWN CASTLE INTL CORP	20,742	41.48	860,378.16	
CROWN HOLDINGS INC	11,395	32.24	367,374.80	
CSX CORP	77,967	21.17	1,650,561.39	
CUMMINS INC	13,181	96.35	1,269,989.35	
CVS CAREMARK CORPORATION	95,867	38.39	3,680,334.13	
DANAHER CORP	39,907	48.04	1,917,132.28	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,674	46.46	449,454.04	
DAVITA INC	6,752	72.68	490,735.36	
DEERE&CO	29,674	72.78	2,159,673.72	
DELL INC	120,004	14.80	1,776,059.20	
DELTA AIR LINES INC	15,452	8.00	123,616.00	
DENBURY RESOURCES INC	29,366	16.51	484,832.66	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,287	35.27	362,822.49	
DEVON ENERGY CORPORATION	28,411	65.66	1,865,466.26	
DEVRY INC	4,788	36.54	174,953.52	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,079	64.05	325,309.95	
DIRECTV	54,439	44.57	2,426,346.23	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,566	23.65	912,085.90	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,193	42.00	428,106.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,805	38.93	381,708.65	
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,117	24.16	365,226.72	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	28.33	101,223.09	
DOLLAR GENERAL CORP	10,008	38.71	387,409.68	
DOLLAR TREE INC	8,670	78.76	682,849.20	
DOMINION RESOURCES	40,710	51.28	2,087,608.80	
DONNELLEY (RR) & SONS	14,356	15.51	222,661.56	
DOVER CORP	13,191	53.81	709,807.71	
DOW CHEMICAL CO	83,115	27.18	2,259,065.70	
DR HORTON INC	21,061	11.37	239,463.57	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,651	36.49	571,104.99	
DTE ENERGY COMPANY	11,973	50.89	609,305.97	

DU PONT (E.I) DE NEMOURS	65,661	47.59	3,124,806.99	
DUKE ENERGY CORP	94,127	20.56	1,935,251.12	
DUN & BRADSTREET CORP	3,610	65.76	237,393.60	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,382	39.03	405,209.46	
EATON CORP	22,917	43.95	1,007,202.15	
EATON VANCE CORP	8,676	24.97	216,639.72	
EBAY	82,587	31.18	2,575,062.66	
ECOLAB INC	16,402	53.81	882,591.62	
EDISON INTL	21,883	39.99	875,101.17	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,108	71.70	581,343.60	
EL PASO CORP	54,367	24.55	1,334,709.85	
ELECTRONIC ARTS INC	23,504	23.03	541,297.12	
EMC CORP	145,472	24.08	3,502,965.76	
EMERSON ELECTRIC CO	53,144	50.11	2,663,045.84	
ENERGEN CORP	5,267	49.63	261,401.21	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,092	69.19	352,315.48	
ENTERGY CORP	12,583	68.01	855,769.83	
EOG RESOURCES INC	18,979	98.23	1,864,307.17	
EQT CORPORATION	10,037	61.88	621,089.56	
EQUIFAX INC	8,993	35.08	315,474.44	
ESTEE LAUDER CO-CL A	8,508	114.93	977,824.44	
EVEREST RE GROUP LTD	3,967	90.57	359,291.19	
EXELON CORP	46,832	44.98	2,106,503.36	
EXPEDIA INC	14,523	27.02	392,411.46	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,015	44.01	660,810.15	
EXPRESS SCRIPTS INC	35,539	46.60	1,656,117.40	
EXXON MOBIL	348,280	77.39	26,953,389.20	
F5 NETWORKS INC	5,735	105.77	606,590.95	
FAMILY DOLLAR STORES	8,812	57.55	507,130.60	
FASTENAL CO	19,805	39.36	779,524.80	
FEDEX CORP	21,202	79.35	1,682,378.70	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,773	15.13	223,515.49	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,296	24.87	430,151.52	
FIFTH THIRD BANCORP	64,955	11.73	761,922.15	
FIRST SOLAR INC	4,092	44.98	184,058.16	
FIRSTENERGY CORP	29,568	44.74	1,322,872.32	
FISERV INC	10,153	56.87	577,401.11	
FLEXTRONICS INTL LTD	55,389	6.18	342,304.02	
FLIR SYSTEMS INC	11,668	25.46	297,067.28	
FLOWSERVE CORP	4,079	94.89	387,056.31	

FLUOR CORP	12,322	53.14	654,791.08	
FMC CORP	5,242	80.03	419,517.26	
FMC TECHNOLOGIES INC	16,991	45.46	772,410.86	
FORD MOTOR COMPANY	251,071	11.04	2,771,823.84	
FOREST LABORATORIES INC	20,232	30.05	607,971.60	
FOSSIL INC	3,941	92.03	362,690.23	
FOSTER WHEELER AG	8,680	19.42	168,565.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,981	103.43	1,135,764.83	
FREEMONT-MCMOR-B	66,976	38.80	2,598,668.80	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	72,722	5.69	413,788.18	
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,555	24.92	263,030.60	
GAP	28,920	19.46	562,783.20	
GARMIN LTD	8,530	35.19	300,170.70	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,356	62.96	1,407,533.76	
GENERAL ELECTRIC CO	749,817	15.85	11,884,599.45	
GENERAL MILLS INC	45,136	38.82	1,752,179.52	
GENERAL MOTORS CO	55,332	22.31	1,234,456.92	
GENUINE PARTS CO	11,155	56.86	634,273.30	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	35,846	6.56	235,149.76	
GILEAD SCIENCES INC	55,646	39.87	2,218,606.02	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	34,774	99.67	3,465,924.58	
GOODRICH CORP	8,829	122.52	1,081,729.08	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,889	13.38	239,354.82	
GOOGLE INC-CL A	17,887	600.95	10,749,192.65	
GRAINGER (WW) INC	4,163	172.67	718,825.21	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,028	67.02	605,056.56	
HALLIBURTON CO	64,692	36.43	2,356,729.56	
HANSEN NATURAL CORPORATION	5,312	90.09	478,558.08	
HARLEY-DAVIDSON	16,753	37.63	630,415.39	
HARRIS CORP	9,295	37.00	343,915.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,907	17.04	509,615.28	
HASBRO INC	8,984	36.45	327,466.80	
HCA HOLDINGS INC	10,778	25.02	269,665.56	
HEINZ (H.J) CO	22,753	52.60	1,196,807.80	
HELMERICH & PAYNE	7,816	51.85	405,259.60	
HENRY SCHEIN INC	6,522	64.38	419,886.36	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,657	56.55	659,203.35	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	11.45	214,653.15	
HESS CORP	21,618	61.39	1,327,129.02	
HEWLETT-PACKARD CO	152,992	26.33	4,028,279.36	
HOLLYFRONTIER CORP	14,780	30.47	450,346.60	

HOLOGIC INC	19,110	17.09	326,589.90	
HOME DEPOT	113,310	37.16	4,210,599.60	
HONEYWELL INTL INC	52,860	52.83	2,792,593.80	
HORMEL FOODS CORP	10,732	28.99	311,120.68	
HOSPIRA INC	12,259	31.41	385,055.19	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	5.62	185,184.62	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	13,856	9.49	131,493.44	
HUMANA INC	11,906	86.31	1,027,606.86	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,028	41.29	290,186.12	
IHS INC-CLASS A	3,080	83.87	258,319.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,819	46.14	1,468,128.66	
ILLUMINA INC	8,871	32.07	284,492.97	
INGERSOLL-RAND PLC	23,418	30.10	704,881.80	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,721	51.12	292,457.52	
INTEL CORP	374,857	23.84	8,936,590.88	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,198	124.15	645,331.70	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	35,808	9.29	332,656.32	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	85,633	182.24	15,605,757.92	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,874	53.82	316,138.68	
INT'L GAME TECHNOLOGY	21,975	17.10	375,772.50	
INT'L PAPER CO	29,369	28.07	824,387.83	
INTUIT INC	20,323	52.34	1,063,705.82	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,778	429.28	1,192,539.84	
INVESCO PLC	32,669	18.94	618,750.86	
IRON MOUNTAIN INC	13,198	29.40	388,021.20	
J.C. PENNEY CO INC	11,717	32.70	383,145.90	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,266	37.77	349,976.82	
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	10,112	11.18	113,052.16	
JM SMUCKER CO	8,200	75.94	622,708.00	
JOHNSON & JOHNSON	193,802	63.53	12,312,241.06	
JOHNSON CONTROLS INC	48,105	30.56	1,470,088.80	
JOY GLOBAL INC	7,409	83.56	619,096.04	
JPMORGAN CHASE & CO	280,944	32.54	9,141,917.76	
JUNIPER NETWORKS INC	37,689	23.31	878,530.59	
KBR INC	11,074	26.46	293,018.04	
KELLOGG CO	17,959	49.08	881,427.72	
KEY CORP	67,224	7.09	476,618.16	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,777	69.77	1,938,001.29	
KINDER MORGAN INC	7,631	27.03	206,265.93	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,369	65.94	419,971.86	
KLA-TENCOR CORP	11,871	45.51	540,249.21	

KOHL'S CORP	19,562	54.29	1,062,020.98	
KRAFT FOODS INC-A	118,070	34.76	4,104,113.20	
KROGER CO	40,734	22.75	926,698.50	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,503	68.65	515,080.95	
LABORATORY CRP OF AMER	7,084	80.70	571,678.80	
LAM RESEARCH CORP	9,097	41.91	381,255.27	
LAS VEGAS SANDS CORP	25,844	46.26	1,195,543.44	
LEGG MASON INC	10,328	25.92	267,701.76	
LEGGETT & PLATT INC	9,883	21.55	212,978.65	
LEUCADIA NATIONAL CORP	15,190	23.09	350,737.10	
LIBERTY GLOBAL INC-A	8,682	40.06	347,800.92	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,207	38.19	313,425.33	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	40,568	15.56	631,238.08	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,639	39.53	499,619.67	
LILLY (ELI) & CO	73,663	37.85	2,788,144.55	
LIMITED	19,191	41.46	795,658.86	
LINCOLN NATIONAL CORP	22,905	18.74	429,239.70	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,101	31.50	507,181.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,005	76.95	1,616,334.75	
LOEWS CORP	23,123	38.33	886,304.59	
LORILLARD INC	10,160	107.08	1,087,932.80	
LOWE'S COMPANIES	92,323	22.20	2,049,570.60	
LSI CORP	42,820	5.79	247,927.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,311	54.48	398,303.28	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,090	34.06	684,265.40	
M & T BANK CORP	7,949	70.57	560,960.93	
MACY'S INC	30,192	30.45	919,346.40	
MANPOWER GROUP	6,006	38.57	231,651.42	
MARATHON OIL CORP	50,346	26.86	1,352,293.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	25,109	37.02	929,535.18	
MARRIOTT INTL A	20,385	30.23	616,238.55	
MARSH & MCLENNAN COS	38,727	30.20	1,169,555.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,325	72.66	241,594.50	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	36,738	14.11	518,373.18	
MASCO CORP	25,016	8.94	223,643.04	
MASTERCARD INC-CLASS A	7,678	357.44	2,744,424.32	
MATTEL INC	24,646	28.01	690,334.46	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,883	25.89	540,660.87	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,767	48.35	423,884.45	
MCDONALD'S CORP	73,569	92.65	6,816,167.85	
MCGRAW-HILL COS	21,605	41.82	903,521.10	

MCKESSON CORP	17,825	79.38	1,414,948.50
MDU RESOURCES GROUP INC	13,795	20.21	278,796.95
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,447	69.23	1,000,165.81
MEADWESTVACO CORP	12,399	27.83	345,064.17
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	28,266	56.19	1,588,266.54
MEDTRONIC	75,662	34.10	2,580,074.20
MERCK & CO	218,225	33.79	7,373,822.75
METLIFE INC	74,734	32.05	2,395,224.70
METROPCS COMMUNICATIONS INC	18,351	8.43	154,698.93
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,467	35.45	477,405.15
MICRON TECHNOLOGY	65,861	5.35	352,356.35
MICROSOFT CORP	536,586	26.20	14,058,553.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,281	51.98	222,526.38
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,545	39.62	457,412.90
MONSANTO CO	37,894	71.93	2,725,715.42
MOODY'S CORP	14,495	34.02	493,119.90
MORGAN STANLEY	98,288	15.76	1,549,018.88
MOSAIC CO/THE	21,627	56.45	1,220,844.15
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS	19,811	39.04	773,421.44
MOTOROLA SOLUTIONS INC	21,605	44.55	962,502.75
MURPHY OIL CORP	12,992	53.31	692,603.52
MYLAN INC	31,056	18.10	562,113.60
NABORS INDUSTRIES LTD	20,998	19.48	409,041.04
NASDAQ OMX GROUP	8,573	25.25	216,468.25
NATIONAL OILWELL VARCO INC	29,912	67.05	2,005,599.60
NETAPP INC	26,009	42.03	1,093,158.27
NETFLIX INC	3,654	88.05	321,734.70
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,958	12.21	390,207.18
NEWELL RUBBERMAID	21,337	15.55	331,790.35
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,826	40.22	395,201.72
NEWMONT MINING CORP	34,904	69.28	2,418,149.12
NEWS CORP -CLASS A	129,621	16.44	2,130,969.24
NEWS CORP -CLASS B	31,140	16.95	527,823.00
NEXTERA ENERGY INC	28,341	54.88	1,555,354.08
NIELSEN HOLDINGS NV	6,225	29.48	183,513.00
NII HOLDINGS INC	12,436	22.79	283,416.44
NIKE B	25,875	92.36	2,389,815.00
NISOURCE INC	20,429	21.70	443,309.30
NOBLE CORP	17,828	35.92	640,381.76
NOBLE ENERGY INC	12,476	88.67	1,106,246.92
NORDSTROM INC	12,468	48.93	610,059.24



NORFOLK SOUTHERN CORP	24,973	71.95	1,796,807.35
NORTHEAST UTILITIES	12,917	33.71	435,432.07
NORTHERN TRUST CORP	15,386	38.52	592,668.72
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,661	57.29	1,126,378.69
NRG ENERGY INC	17,206	21.62	371,993.72
NSTAR	7,569	44.14	334,095.66
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,121	25.58	437,955.18
NUCOR CORP	22,346	37.70	842,444.20
NVIDIA CORP	42,441	14.32	607,755.12
NYSE EURONEXT	18,510	26.72	494,587.20
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,471	96.51	5,546,526.21
OLD REPUBLIC INTL CORP	17,119	8.22	140,718.18
OMNICARE INC	8,472	29.60	250,771.20
OMNICOM GROUP	19,933	42.87	854,527.71
ONEOK INC	7,195	75.42	542,646.90
ORACLE CORP	286,227	31.59	9,041,910.93
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,776	76.99	752,654.24
OWENS-ILLINOIS INC	11,984	19.49	233,568.16
PACCAR INC	23,255	41.80	972,059.00
PALL CORP	8,485	50.12	425,268.20
PARKER HANNIFIN CORP	11,466	80.20	919,573.20
PARTNERRE LTD	4,687	66.38	311,123.06
PATTERSON COMPANIES INC	6,826	29.55	201,708.30
PAYCHEX INC	23,025	28.61	658,745.25
PEABODY ENERGY CORP	19,141	40.89	782,675.49
PENTAIR INC	6,840	36.07	246,718.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,512	12.49	343,624.88
PEPCO HOLDINGS INC	16,497	19.30	318,392.10
PEPSICO INC	111,754	62.28	6,960,039.12
PERRIGO CO	5,900	89.31	526,929.00
PETSMART INC	8,199	45.94	376,662.06
PFIZER	558,619	19.34	10,803,691.46
PG&E CORP	28,136	40.01	1,125,721.36
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	7,861	33.05	259,806.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,736	69.62	8,753,740.32
PINNACLE WEST CAPITAL	7,966	45.56	362,930.96
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,429	86.30	641,122.70
PITNEY BOWES INC	14,896	19.21	286,152.16
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	10,303	34.23	352,671.69
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,209	51.81	1,927,798.29
PPG INDUSTRIES INC	11,182	85.42	955,166.44

PPL CORPORATION	40,805	29.78	1,215,172.90	
PRAXAIR INC	21,498	98.30	2,113,253.40	
PRECISION CASTPARTS CORP	10,142	164.25	1,665,823.50	
PRICE T ROWE GROUP INC	18,365	51.54	946,532.10	
PRICELINE.COM INC	3,520	536.55	1,888,656.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,718	23.26	528,420.68	
PROCTER & GAMBLE CO	197,348	62.72	12,377,666.56	
PROGRESS ENERGY INC	20,823	52.54	1,094,040.42	
PROGRESSIVE CORP	43,906	19.09	838,165.54	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,361	51.87	1,782,305.07	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,768	33.07	1,182,847.76	
PULTE GROUP INC	22,649	5.54	125,475.46	
QEP RESOURCES INC	12,916	34.61	447,022.76	
QUALCOMM	118,038	55.41	6,540,485.58	
QUANTA SERVICES INC	15,472	19.64	303,870.08	
QUEST DIAGNOSTICS	11,125	55.64	618,995.00	
RALCORP HOLDINGS INC	4,022	78.30	314,922.60	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,520	149.94	677,728.80	
RANGE RESOURCES CORP	11,357	67.67	768,528.19	
RAYTHEON COMPANY	25,182	44.38	1,117,577.16	
RED HAT INC	13,647	48.67	664,199.49	
REGIONS FINL CORP	91,811	4.08	374,588.88	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	69.56	255,424.32	
REPUBLIC SERVICES INC	21,451	27.19	583,252.69	
REYNOLDS AMERICAN INC	24,727	38.08	941,604.16	
ROBERT HALF INTL INC	10,193	25.57	260,635.01	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,061	60.29	305,127.69	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,203	70.34	717,679.02	
ROCKWELL COLLIN	10,892	54.17	590,019.64	
ROPER INDUSTRIES INC	6,780	81.59	553,180.20	
ROSS STORES INC	8,332	86.58	721,384.56	
ROWAN COMPANIES INC	9,313	34.15	318,038.95	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,334	26.59	274,781.06	
SAFEWAY INC	25,593	19.37	495,736.41	
SAIC INC	20,676	12.30	254,314.80	
SALESFORCE.COM INC	8,994	128.75	1,157,977.50	
SANDISK CORP	16,853	49.07	826,976.71	
SARA LEE CORP	39,299	18.36	721,529.64	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,282	38.67	320,264.94	
SCANA CORP	8,915	41.77	372,379.55	
SCHLUMBERGER	95,937	73.09	7,012,035.33	

SCHWAB (CHARLES) CORP	74,950	11.95	895,652.50	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,860	40.36	276,869.60	
SEAGATE TECHNOLOGY	30,408	17.13	520,889.04	
SEALED AIR CORP	11,100	17.50	194,250.00	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,037	73.05	221,852.85	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	15.89	164,445.61	
SEMPRA ENERGY	16,083	52.78	848,860.74	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,398	84.95	543,510.10	
SIGMA-ALDRICH	8,612	61.87	532,824.44	
SIRIUS XM RADIO INC	265,063	1.64	434,703.32	
SLM CORP	37,289	13.49	503,028.61	
SOUTHERN CO	60,034	43.19	2,592,868.46	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	8.17	106,103.79	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,597	40.36	992,734.92	
SPECTRA ENERGY CORP	45,956	28.87	1,326,749.72	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	218,606	2.74	598,980.44	
SPX CORP	3,727	57.25	213,370.75	
ST JUDE MEDICAL INC	23,250	37.48	871,410.00	
STANLEY BLACK&DECKER	11,291	64.45	727,704.95	
STAPLES INC	50,566	14.67	741,803.22	
STARBUCKS CORP	53,150	42.95	2,282,792.50	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	13,832	48.50	670,852.00	
STATE STREET CORP	35,636	39.44	1,405,483.84	
STERICYCLE INC	5,766	78.22	451,016.52	
STRYKER CORP	20,574	47.50	977,265.00	
SUNOCO INC	8,849	35.82	316,971.18	
SUNTRUST BANKS	37,959	18.82	714,388.38	
SYMANTEC CORP	53,418	16.57	885,136.26	
SYNOPSIS INC	10,718	26.98	289,171.64	
SYSCO CORP	41,253	27.52	1,135,282.56	
TARGET (DAYTON HUDSON)	46,420	51.69	2,399,449.80	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,700	16.47	275,049.00	
TE CONNECTIVITY LTD	31,090	33.95	1,055,505.50	
TERADATA CORP	11,934	55.15	658,160.10	
TEXAS INSTRUMENTS	82,096	30.31	2,488,329.76	
TEXTRON	20,179	17.98	362,818.42	
THE WALT DISNEY CO	127,319	33.79	4,302,109.01	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,097	48.55	1,315,559.35	
TIFFANY & CO	8,603	75.41	648,752.23	
TIME WARNER CABLE-A	23,852	60.09	1,433,266.68	
TIME WARNER INC	75,926	33.74	2,561,743.24	

TJX COMPANIES INC	27,377	58.85	1,611,136.45
TOLL BROTHERS INC	10,462	18.11	189,466.82
TORCHMARK CORP	8,125	40.98	332,962.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	19.45	222,255.15
TRAVELERS COS INC/THE	29,615	56.92	1,685,685.80
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,697	35.84	275,860.48
TYCO INTERNATIONAL LTD	33,155	44.74	1,483,354.70
TYSON FOODS INC	22,615	19.23	434,886.45
ULTRA PETROLEUM CORP	11,175	34.93	390,342.75
UNION PACIFIC CORP	34,690	98.36	3,412,108.40
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	17.85	96,229.35
UNITED HEALTHCARE CORP	76,600	45.54	3,488,364.00
UNITED PARCEL SERVICE B	52,163	68.99	3,598,725.37
UNITED STATES STEEL CORP	10,505	25.27	265,461.35
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,475	76.44	4,699,149.00
UNUM GROUP	21,762	21.66	471,364.92
URBAN OUTFITTERS INC	9,150	26.05	238,357.50
URS CORP	5,746	33.05	189,905.30
US BANCORP	136,216	25.11	3,420,383.76
VALERO ENERGY CORP	40,317	25.51	1,028,486.67
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,285	56.39	467,191.15
VERISIGN INC	11,357	32.10	364,559.70
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,475	37.46	354,933.50
VERIZON COMMUNICATIONS	202,042	36.89	7,453,329.38
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,564	30.86	449,445.04
VF CORP	6,205	131.05	813,165.25
VIACOM INC-CLASS B	38,040	40.30	1,533,012.00
VIRGIN MEDIA INC	21,310	23.55	501,850.50
VISA INC-CLASS A SHARES	36,994	93.13	3,445,251.22
VMWARE INC-CLASS A	5,914	96.91	573,125.74
VULCAN MATERIALS CO	9,434	29.05	274,057.70
WALGREEN CO	64,724	31.72	2,053,045.28
WAL-MART STORES	135,033	58.05	7,838,665.65
WALTER ENERGY INC	4,552	71.39	324,967.28
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	10,203	17.20	175,491.60
WASHINGTON POST -CL B	351	334.18	117,297.18
WASTE MANAGEMENT INC	31,850	30.99	987,031.50
WATERS CORP	6,479	77.48	501,992.92
WATSON PHARMACEUTICALS INC	8,942	64.82	579,620.44
WEATHERFORD INTL LTD	52,691	15.19	800,376.29
WELLPOINT INC	25,959	66.96	1,738,214.64

	WELLS FARGO & CO	355,248	24.99	8,877,647.52	
	WESTERN DIGITAL CORP	16,982	26.01	441,701.82	
	WESTERN UNION CO	44,702	17.02	760,828.04	
	WEYERHAEUSER CO	38,078	16.46	626,763.88	
	WHIRLPOOL CORP	5,585	52.64	293,994.40	
	WHITING PETROLEUM CORP	8,576	46.36	397,583.36	
	WHOLE FOODS MKT INC	10,560	66.78	705,196.80	
	WILLIAMS COS	41,583	30.29	1,259,549.07	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,942	36.16	431,822.72	
	WINDSTREAM CORP	37,264	11.79	439,342.56	
	WISCONSIN ENERGY CORP	16,526	32.12	530,815.12	
	WR BERKLEY CORP	8,797	34.64	304,728.08	
	WYNN RESORTS LTD	5,750	123.91	712,482.50	
	XCEL ENERGY INC	34,232	25.72	880,447.04	
	XEROX CORP	99,065	8.09	801,435.85	
	XILINX INC	18,780	31.95	600,021.00	
	XL GROUP PLC	21,876	20.43	446,926.68	
	XYLEM INC	12,780	23.89	305,314.20	
	YAHOO	87,513	15.92	1,393,206.96	
	YUM BRANDS INC	33,011	54.81	1,809,332.91	
	ZIMMER HOLDINGS INC	13,572	51.67	701,265.24	
小計		21,525,109		806,896,497.11 (62,816,892,300)	
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES	11,950	46.96	561,172.00	
	AGRIUM INC	11,150	78.94	880,181.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,017	30.69	276,731.73	
	ARC RESOURCES LTD	20,204	24.72	499,442.88	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	21,957	13.07	286,977.99	
	BANK MONTREAL	44,979	57.34	2,579,095.86	
	BANK NOVA SCOTIA	76,173	51.33	3,909,960.09	
	BARRICK GOLD CORP	70,654	52.24	3,690,964.96	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,164	52.67	429,997.88	
	BCE INC	18,284	39.49	722,035.16	
	BELL ALIANT INC	5,225	27.57	144,053.25	
	BOMBARDIER B	101,601	4.19	425,708.19	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,440	25.91	270,500.40	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	39,710	28.57	1,134,514.70	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	18,367	15.97	293,320.99	
	CAE INC	18,777	10.47	196,595.19	

CAMECO CORP	27,906	19.73	550,585.38	
CANADIAN IMPERIAL BANK	28,068	72.64	2,038,859.52	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,223	79.06	2,547,550.38	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,286	36.97	2,857,263.42	
CANADIAN OIL SANDS LTD	34,254	20.96	717,963.84	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,717	59.56	340,504.52	
CANADIAN UTILITIES LTD A	6,157	61.02	375,700.14	
CENOVUS ENERGY INC	53,300	33.13	1,765,829.00	
CENTERRA GOLD INC	12,066	20.30	244,939.80	
CGI GROUP INC - CL A	16,894	20.15	340,414.10	
CI FINANCIAL CORP	11,592	20.49	237,520.08	
CP RAILWAY LIMITED	11,975	61.79	739,935.25	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	17,303	41.70	721,535.10	
ELDORADO GOLD CORP	38,811	19.34	750,604.74	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	60.81	127,214.52	
ENBRIDGE	52,020	35.01	1,821,220.20	
ENCANA CORP	52,057	20.49	1,066,647.93	
ENERPLUS CORP	12,675	28.33	359,082.75	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,406	426.00	598,956.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	12,534	21.96	275,246.64	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,675	19.76	665,418.00	
FORTIS INC	13,050	32.79	427,909.50	
FRANCO-NEVADA CORP	8,927	42.92	383,146.84	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,462	26.53	224,496.86	
GOLDCORP INC	56,488	52.85	2,985,390.80	
GREAT-WEST LIFE CO INC	20,134	20.81	418,988.54	
HUSKY ENERGY INC	19,030	24.75	470,992.50	
IAMGOLD CORP	26,495	21.85	578,915.75	
IGM FINANCIAL INC	8,221	42.90	352,680.90	
IMPERIAL OIL	20,974	41.96	880,069.04	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	26.91	165,415.77	
INMET MINING CORPORATION	3,823	57.91	221,389.93	
INTACT FINANCIAL CORP	7,743	58.64	454,049.52	
IVANHOE MINES LTD	18,524	21.14	391,597.36	
KINROSS GOLD CORP	80,252	14.40	1,155,628.80	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,241	38.51	317,360.91	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,437	33.94	523,931.78	
MANULIFE FINANCIAL CORP	125,704	12.11	1,522,275.44	
MEG ENERGY CORP	8,799	44.29	389,707.71	
METRO INC -A	7,253	48.47	351,552.91	
NATIONAL BANK OF CANADA	11,503	68.98	793,476.94	

NEW GOLD INC	30,224	12.22	369,337.28	
NEXEN INC	37,238	17.01	633,418.38	
NIKO RESOURCES LTD	3,389	55.00	186,395.00	
ONEX CORP	6,914	34.76	240,330.64	
OPEN TEXT CORP	4,182	59.40	248,410.80	
OSISKO MINING CORP	25,136	12.14	305,151.04	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	18,028	20.32	366,328.96	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,491	27.79	208,174.89	
PENGROWTH ENERGY CORP	23,930	10.21	244,325.30	
PENN WEST PETROLEUM LTD	32,946	17.80	586,438.80	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	5,528	9.77	54,008.56	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	60,434	47.63	2,878,471.42	
POWER CORP OF CANADA	24,697	23.75	586,553.75	
POWER FINANCIAL CORP	17,519	25.99	455,318.81	
PRECISION DRILLING CORP	17,134	11.55	197,897.70	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	13,474	14.25	192,004.50	
RESEARCH IN MOTION	33,349	18.41	613,955.09	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,975	20.77	144,870.75	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	29,451	37.70	1,110,302.70	
ROYAL BANK OF CANADA	100,907	45.13	4,553,932.91	
SAPUTO INC	10,087	40.41	407,615.67	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,315	20.40	536,826.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,376	42.48	653,172.48	
SILVER WHEATON CORP	24,975	35.85	895,353.75	
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,661	50.83	541,898.63	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,879	21.50	878,898.50	
SUNCOR ENERGY	111,092	31.44	3,492,732.48	
TALTSMAN ENERGY INC	72,517	13.76	997,833.92	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,108	37.73	1,551,004.84	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	15,427	51.11	788,473.97	
THOMSON REUTERS CORP	26,670	29.50	786,765.00	
TIM HORTONS INC	11,633	49.54	576,298.82	
TMX GROUP INC	5,451	44.65	243,387.15	
TORONTO-DOMINION BANK	62,648	72.20	4,523,185.60	
TOURMALINE OIL CORP	8,840	33.04	292,073.60	
TRANSALTA CORP	15,411	21.70	334,418.70	
TRANSCANADA CORP	49,663	40.58	2,015,324.54	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	20,020	42.35	847,847.00	
VERMILION ENERGY INC	6,254	48.94	306,070.76	
VITERRA INC	27,159	10.29	279,466.11	

	WESTON (GEORGE) LTD	3,773	68.62	258,903.26	
	YAMANA GOLD INC	52,662	16.34	860,497.08	
小計		2,659,437		84,696,896.52 (6,439,505,042)	
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	32,615	15.00	489,225.00	
	ALUMINA LIMITED	178,308	1.54	274,594.32	
	AMCOR	86,780	7.22	626,551.60	
	AMP LTD	198,790	4.32	858,772.80	
	ASCIANO GROUP	213,813	1.49	318,581.37	
	ASX LTD	12,382	31.10	385,080.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	183,599	21.76	3,995,114.24	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,842	9.30	249,630.60	
	BHP BILLITON LTD	227,054	38.33	8,702,979.82	
	BLUESCOPE STEEL LTD	128,050	0.73	93,476.50	
	BORAL LIMITED	53,336	3.64	194,143.04	
	BRAMBLES LTD	104,592	6.68	698,674.56	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	13.46	132,782.90	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	40,193	12.00	482,316.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,146	52.70	218,494.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	110,197	49.96	5,505,442.12	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,482	8.24	267,651.68	
	CROWN LTD	33,250	8.18	271,985.00	
	CSL LIMITED	37,207	30.20	1,123,651.40	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	50,048	3.83	191,683.84	
	FAIRFAX MEDIA LTD	155,308	0.93	144,436.44	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,051	5.10	449,060.10	
	FOSTERS GROUP LTD	136,834	5.33	729,325.22	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	2.19	84,998.28	
	ILUKA RESOURCES LTD	29,603	18.06	534,630.18	
	INCITEC PIVOT LTD	115,153	3.56	409,944.68	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	146,990	3.15	463,018.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	31,955	6.20	198,121.00	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	11,065	20.56	227,496.40	
	LYNAS CORP LTD	124,409	1.19	148,046.71	
	MACARTHUR COAL LTD	12,141	16.21	196,805.61	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,522	23.64	579,700.08	
	METCASH LTD	56,181	4.16	233,712.96	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	153,410	25.76	3,951,841.60	
	NEWCREST MINING LIMITED	54,115	36.87	1,995,220.05	
	ONESTEEL LIMITED	92,775	0.99	92,311.12	
	ORICA LTD	25,680	26.40	677,952.00	



	ORIGIN ENERGY LIMITED	75,257	14.34	1,079,185.38	
	OZ MINERALS LTD	23,664	11.37	269,059.68	
	PALADIN ENERGY LIMITED	45,949	1.48	68,004.52	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.63	125,752.87	
	QBE INSURANCE GROUP	77,252	14.44	1,115,518.88	
	QR NATIONAL LTD	120,758	3.41	411,784.78	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,598	19.51	187,256.98	
	RIO TINTO LTD	30,809	70.75	2,179,736.75	
	SANTOS	63,882	13.43	857,935.26	
	SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	12,007	13.17	158,132.19	
	SONIC HEALTHCARE LTD	26,964	11.14	300,378.96	
	SP AUSNET	102,121	0.99	101,099.79	
	SUNCORP GROUP LIMITED	90,964	8.59	781,380.76	
	TABCORP HOLDINGS	47,608	2.88	137,111.04	
	TATTS GROUP LTD	96,358	2.37	228,368.46	
	TELSTRA CORP	307,909	3.13	963,755.17	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	49,295	4.88	240,559.60	
	TRANSURBAN GROUP	91,854	5.43	498,767.22	
	WESFARMERS LIMITED	71,069	32.75	2,327,509.75	
	WESFARMERS LTD-PPS	10,738	33.06	354,998.28	
	WESTPAC BANKING	212,786	21.56	4,587,666.16	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,866	36.70	1,646,582.20	
	WOOLWORTHS LTD	86,002	24.78	2,131,129.56	
	WORLEYPARSONS LTD	13,669	28.38	387,926.22	
小計		4,849,081		57,337,052.58 (4,518,733,113)	
イギリスポンド	3I GROUP PLC	70,981	1.99	141,891.01	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,827	8.87	131,589.62	
	AGGREKO PLC	18,806	17.71	333,054.26	
	AMEC PLC	24,255	9.07	220,114.12	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,505	23.53	2,200,172.65	
	ANTOFAGASTA PLC	27,880	11.85	330,378.00	
	ARM HOLDINGS PLC	95,175	6.16	586,278.00	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,188	11.14	280,594.32	
	ASTRAZENECA	97,491	28.38	2,766,794.58	
	AVIVA PIC	203,232	3.07	625,548.09	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	26,235	6.87	180,234.45	
	BAE SYSTEMS PLC	241,629	2.71	655,056.21	
	BALFOUR BEATTY PLC	50,164	2.39	120,192.94	
	BARCLAYS	821,943	1.72	1,414,152.93	
	BG GROUP	239,620	13.86	3,321,133.20	

BHP BILLITON PLC	151,182	19.67	2,974,505.85	
BP PLC	1,334,336	4.50	6,004,512.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	140,545	29.12	4,092,670.40	
BRITISH SKY BROADCASTING	80,553	7.26	585,217.54	
BT GROUP PLC	548,865	1.89	1,042,294.63	
BUNZL PLC	24,139	7.89	190,456.71	
BURBERRY GROUP PLC	30,816	14.01	431,732.16	
CAIRN ENERGY PLC	99,039	2.81	278,299.59	
CAPITA GROUP PLC	43,355	6.61	286,576.55	
CARNIVAL PLC	12,952	21.63	280,151.76	
CENTRICA PLC	365,091	2.99	1,093,447.54	
COBHAM PLC	83,173	1.78	148,131.11	
COMPASS GROUP PLC	133,945	5.55	743,394.75	
DIAGEO	177,002	13.19	2,334,656.38	
ESSAR ENERGY PLC	22,650	2.84	64,326.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	18,819	6.68	125,805.01	
EXPERIAN PLC	70,923	7.84	556,036.32	
FRESNILLO PLC	13,102	18.32	240,028.64	
G4S PLC	99,732	2.49	248,332.68	
GLAXOSMITHKLINE	364,787	13.74	5,012,173.38	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	58,733	4.40	258,718.86	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,264,814	5.06	6,403,753.28	
ICAP PLC	41,029	3.60	147,786.45	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	72,018	22.99	1,655,693.82	
INMARSAT PLC	33,741	4.58	154,601.26	
INTERCONTINENTAL HOTELS	20,522	10.47	214,865.34	
INTERNATIONAL POWER PLC	108,037	3.36	363,760.57	
INTERTEK GROUP PLC	11,322	18.79	212,740.38	
INVENSYS PLC	59,169	2.11	124,846.59	
INVESTEC PLC	35,352	3.57	126,418.75	
ITV PLC	269,974	0.63	172,108.42	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,178	18.29	277,605.62	
KAZAKHMYS PLC	15,644	9.23	144,394.12	
KINGFISHER PLC	167,136	2.53	424,358.30	
LEGAL & GENERAL GROUP	416,721	1.02	427,139.02	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,927,184	0.27	805,853.75	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,373	8.54	88,637.28	
LONMIN PLC	11,837	10.42	123,341.54	
MAN GROUP PLC	137,864	1.43	197,283.38	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	112,067	3.21	359,847.13	
MORRISON SUPERMARKETS	157,614	3.06	483,086.91	

NATIONAL GRID PLC	248,252	6.18	1,535,438.62	
NEW GKN	113,486	1.89	214,488.54	
NEXT PLC	12,520	27.48	344,049.60	
OLD MUTUAL PLC	392,414	1.06	415,958.84	
PEARSON	57,504	11.23	645,769.92	
PETROFAC LTD	18,332	13.97	256,098.04	
PRUDENTIAL	180,855	6.11	1,105,024.05	
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,438	75.55	486,390.90	
RECKITT BENCKISER PLC	43,760	32.03	1,401,632.80	
REED ELSEVIER PLC	85,974	5.35	460,390.77	
RESOLUTION LTD	104,082	2.54	264,472.36	
REXAM	64,080	3.28	210,630.96	
RIO TINTO PLC REG	100,795	34.84	3,512,201.77	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -C SHR	9,439,407	0.001	9,439.40	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	132,366	7.12	943,107.75	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,242,544	0.21	262,052.52	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	254,177	21.71	5,518,182.67	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	190,597	22.32	4,254,125.04	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	250,173	1.07	267,935.28	
SABMILLER PLC	67,340	22.10	1,488,550.70	
SAGE GROUP PLC	93,506	2.75	257,983.05	
SAINSBURY (J) PLC	86,156	2.97	256,400.25	
SCHRODERS PLC	8,264	13.19	109,002.16	
SERCO GROUP PLC	36,053	5.06	182,428.18	
SEVERN TRENT PLC	16,790	15.78	264,946.20	
SHIRE PLC	39,756	19.91	791,541.96	
SMITH & NEPHEW PLC	63,094	5.50	347,017.00	
SMITHS GROUP PLC	27,728	9.23	256,068.08	
SSE PLC	66,244	13.10	867,796.40	
STANDARD CHARTERED PLC	168,766	13.77	2,323,907.82	
STANDARD LIFE PLC	165,261	2.02	334,818.78	
TESCO	569,056	4.01	2,286,182.48	
TUI TRAVEL PLC	34,970	1.57	55,217.63	
TULLOW OIL PLC	62,912	13.60	855,603.20	
UNILEVER PLC	90,742	20.45	1,855,673.90	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	48,197	6.19	298,580.41	
VEDANTA RESOURCES PLC	8,738	12.50	109,225.00	
VODAFONE GROUP PLC	3,625,140	1.76	6,405,622.38	
WEIR GROUP PLC/THE	14,940	18.87	281,917.80	
WHITBREAD PLC	12,946	16.20	209,725.20	
WOLSELEY LTD	20,138	18.29	368,324.02	

	WPP PLC	89,477	6.54	585,179.58	
	XSTRATA PLC	146,725	10.20	1,497,328.62	
小計		30,312,961		97,603,204.78 (12,090,108,976)	
スイスフラン	ABB LTD	154,985	16.50	2,557,252.50	
	ACTELION LTD-REG	8,086	31.20	252,283.20	
	ADECCO	9,367	36.46	341,520.82	
	ARYZTA AG	6,174	41.75	257,764.50	
	BALOISE HOLDING AG	3,473	68.50	237,900.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	36,906	48.21	1,779,238.26	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	80,995	22.20	1,798,089.00	
	GAM HOLDING LTD	15,109	9.72	146,859.48	
	GEBERIT AG-REG	2,676	185.00	495,060.00	
	GIVAUDAN-REG	588	800.00	470,400.00	
	HOLCIM LTD	17,344	51.05	885,411.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,668	32.47	476,269.96	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,818	111.60	426,088.80	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	65	2,782.00	180,830.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	33,825.00	270,600.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,674	51.90	190,680.60	
	NESTLE SA - REGISTERED	244,979	50.60	12,395,937.40	
	NOVARTIS	165,001	49.95	8,241,799.95	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	66.25	124,550.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	49,672	140.80	6,993,817.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,573	106.00	166,738.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,437	103.90	357,104.30	
	SGS SA	387	1,483.00	573,921.00	
	SIKA AG-BR	149	1,555.00	231,695.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,590	93.00	333,870.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	545	154.10	83,984.50	
	SULZER AG-REG	1,753	101.50	177,929.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,180	361.30	787,634.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,172	63.50	201,422.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,227	97.55	217,243.85	
	SWISS RE LTD	25,000	46.98	1,174,500.00	
	SWISSCOM	1,648	347.90	573,339.20	
	SYNGENTA AG	6,688	267.50	1,789,040.00	
	SYNTHES INC	4,616	148.90	687,322.40	
	TRANSOCEAN LTD	22,594	46.50	1,050,621.00	
	UBS AG-REG	258,351	10.89	2,813,442.39	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,338	196.60	2,032,450.80	

小計		1,167,716		51,774,611.71 (4,426,729,301)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	596,000	24.85	14,810,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	85.55	1,180,590.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	28.95	3,160,182.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	261,500	18.32	4,790,680.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	13.86	1,136,520.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	98,000	96.95	9,501,100.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	33,000	44.30	1,461,900.00	
	CLP HOLDINGS	136,000	70.00	9,520,000.00	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	89,574	10.30	922,612.20	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	141,000	5.07	714,870.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	16.54	1,505,140.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	62,000	48.95	3,034,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	174,000	28.05	4,880,700.00	
	HANG SENG BANK	54,100	99.20	5,366,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	66,000	43.65	2,880,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	335,601	18.28	6,134,786.28	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	72,500	133.50	9,678,750.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	20.35	844,525.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	151,000	72.80	10,992,800.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	46,000	26.55	1,221,300.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	52,500	30.50	1,601,250.00	
	LI & FUNG	400,800	15.08	6,044,064.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	43,000	20.20	868,600.00	
	MTR CORP	105,500	25.85	2,727,175.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	175,000	7.86	1,375,500.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	11.80	1,168,200.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	37.15	538,675.00	
	PCCW LTD	292,000	3.15	919,800.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,000	59.50	5,831,000.00	
	SANDS CHINA LTD	170,800	23.65	4,039,420.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	102,000	15.36	1,566,720.00	
	SINO LAND CO	213,400	10.96	2,338,864.00	
SJM HOLDINGS LTD	121,000	13.82	1,672,220.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	100,000	107.00	10,700,000.00		
SWIRE PACIFIC A	51,000	98.05	5,000,550.00		
WHARF HOLDINGS	107,000	43.55	4,659,850.00		
WHEELOCK & CO LTD	67,000	24.15	1,618,050.00		
WING HANG BANK LIMITED	12,500	69.75	871,875.00		

	WYNN MACAU LTD	113,600	22.40	2,544,640.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	22.65	1,166,475.00	
小計		5,043,835		150,992,503.48 (1,511,434,959)	
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	181,500	2.66	482,790.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	1.35	133,650.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	35,000	10.63	372,050.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.41	184,710.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	0.97	65,960.00	
	DBS GROUP	122,000	12.90	1,573,800.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	67,000	6.23	417,410.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	431,000	1.70	734,855.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	134,000	1.78	238,520.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	488,000	0.67	326,960.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	46.56	372,480.00	
	KEPPEL CORP LTD	100,300	9.30	932,790.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	2.73	136,500.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	1.09	66,490.00	
	NOBLE GROUP LTD	280,363	1.60	449,982.61	
	OCBC BANK	177,000	8.49	1,502,730.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	98,000	2.62	256,760.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	72,000	4.17	300,240.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	61,000	4.11	250,710.00	
	SINGAPORE AIRLINES	39,533	11.20	442,769.60	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	63,000	6.53	411,390.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	108,000	3.89	420,120.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	112,000	2.84	318,080.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	563,243	3.16	1,779,847.88	
	STARHUB LTD	44,000	2.86	125,840.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	89,000	16.20	1,441,800.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	4.57	143,041.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	136,000	5.36	728,960.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	0.96	128,345.00	
小計		3,983,239		14,739,581.09 (887,912,364)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.35	158,975.15	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.71	145,622.13	
	FLETCHER BUILDING LTD	49,584	6.48	321,304.32	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.41	143,762.19	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	140,637	2.69	378,313.53	

小計		325,532		1,147,977.32 (69,659,263)
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	23,871	120.40	2,874,068.40
	ASSA ABLOY B	22,212	158.20	3,513,938.40
	ATLAS COPCO A	47,477	135.60	6,437,881.20
	ATLAS COPCO B	27,589	121.30	3,346,545.70
	BOLIDEN AB	19,986	90.70	1,812,730.20
	ELECTROLUX AB-SER B	17,558	116.70	2,049,018.60
	ERICSSON (LM) B	212,923	67.95	14,468,117.85
	GETINGE AB-B SHS	14,625	169.10	2,473,087.50
	HENNES & MAURITZ B	72,290	204.10	14,754,389.00
	HEXAGON AB-B SHS	18,518	97.05	1,797,171.90
	HOLMEN AB-B SHARES	3,671	180.70	663,349.70
	HUSQVARNA AB-B SHS	30,739	30.84	947,990.76
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	79.25	682,184.00
	INVESTOR AB-B SHS	32,334	124.30	4,019,116.20
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	15,037	134.20	2,017,965.40
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,397	723.00	3,902,031.00
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,529	323.70	1,142,337.30
	NORDEA BANK AB	186,749	53.75	10,037,758.75
	RATOS AB-B SHS	14,010	80.65	1,129,906.50
	SANDVIK AB	71,291	84.40	6,016,960.40
	SCA SV CELLULOSA B	40,814	91.30	3,726,318.20
	SCANIA AB-B SHS	22,624	106.60	2,411,718.40
	SECURITAS B	22,880	58.65	1,341,912.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	100,129	38.56	3,860,974.24
	SKANSKA B	28,274	102.30	2,892,430.20
	SKF AB-B	27,597	134.80	3,720,075.60
SSAB AB-A SHS	10,878	60.00	652,680.00	
SVENSKA HANDELSBK A	34,740	178.50	6,201,090.00	
SWEDBANK AB-A	57,463	86.95	4,996,407.85	
SWEDISH MATCH AB	15,059	219.50	3,305,450.50	
TELE2 AB-B SHS	22,414	131.60	2,949,682.40	
TELIASONERA AB	153,071	43.33	6,632,566.43	
VOLVO B	97,563	77.55	7,566,010.65	
小計		1,481,920		134,343,865.23 (1,561,075,713)
ノルウェークローネ	ACERGY S.A.	19,898	111.10	2,210,667.80
	AKER SOLUTIONS ASA	12,013	67.90	815,682.70
	DNB NOR ASA	69,375	62.50	4,335,937.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,625	62.00	906,750.00

	NORSK HYDRO	68,033	28.93	1,968,194.69	
	ORKLA	54,560	41.60	2,269,696.00	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	33,457	5.04	168,623.28	
	SEADRILL LTD	23,224	193.10	4,484,554.40	
	STATOIL ASA	78,904	145.80	11,504,203.20	
	TELENOR ASA	52,747	98.30	5,185,030.10	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,400	260.80	3,494,720.00	
小計		440,236		37,344,059.67 (506,758,889)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	40	32,780.00	1,311,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	93	34,360.00	3,195,480.00	
	CARLSBERG AS-B	7,563	377.70	2,856,545.10	
	COLOPLAST-B	1,664	844.00	1,404,416.00	
	DANSKE BANK A/S	46,299	71.95	3,331,213.05	
	DSV A/S	14,538	105.20	1,529,397.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	30,066	611.50	18,385,359.00	
	NOVOZYMES A/S	3,260	809.00	2,637,340.00	
	PANDORA A/S	3,792	50.85	192,823.20	
	TDC A/S	27,128	44.83	1,216,148.24	
	TRYG A/S	1,870	294.60	550,902.00	
	VESTAS WIND SYSEMS	14,885	79.65	1,185,590.25	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,705	423.00	721,215.00	
小計		152,903		38,517,629.44 (545,024,456)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOALIM BM	77,463	12.62	977,583.06	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	86,200	11.52	993,024.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	128,316	7.45	955,954.20	
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,998	77.01	307,885.98	
	DELEK GROUP LTD	299	730.10	218,299.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,551	152.50	236,527.50	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	31,422	41.02	1,288,930.44	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,458.00	395,738.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,988	5.60	307,932.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	30.39	249,198.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	124.30	521,438.50	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	5,625	40.60	228,375.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	66,457	153.00	10,167,921.00	
小計		468,875		16,848,808.38 (352,308,583)	
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS	27,432	11.04	302,849.28	
	ACCIONA SA	1,857	67.35	125,068.95	



ACCOR	10,777	20.94	225,670.38	
ACERINOX SA	6,932	9.54	66,138.21	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,011	25.64	256,732.09	
ADIDAS AG	14,792	50.29	743,889.68	
ADP	2,531	54.48	137,888.88	
AEGON	122,005	3.08	376,385.42	
AEM SPA	80,124	0.91	73,313.46	
AGEAS	161,673	1.35	218,258.55	
AHOLD (KON.)	82,147	9.14	750,987.87	
AIR FRANCE-KLM	9,087	4.86	44,208.25	
AIR LIQUIDE	20,046	88.64	1,776,877.44	
AKZO NOBEL	16,379	35.77	585,876.83	
ALCATEL-LUCENT	164,046	1.49	245,084.72	
ALLIANZ SE-REG	32,221	72.25	2,327,967.25	
ALSTOM RGPT	14,571	26.33	383,654.43	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,569	12.92	265,854.32	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	56,753	41.55	2,358,087.15	
ARCELORMITTAL	60,697	13.95	846,723.15	
ARKEMA	4,044	47.10	190,472.40	
ASML HOLDING NV	30,492	30.00	914,760.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	82,889	12.20	1,011,245.80	
ATLANTIA SPA	23,029	10.25	236,047.25	
ATOS	3,615	34.40	124,374.07	
AUTOGRILL SPA	7,704	8.06	62,132.76	
AXA	123,529	10.05	1,242,084.09	
AXEL SPRINGER AG	2,751	32.58	89,641.33	
BANCA CARIGE SPA	47,269	1.27	60,173.43	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	313,662	0.28	87,856.72	
BANCO BILBAO VIZCAYA	306,952	5.92	1,817,155.84	
BANCO DE SABADELL SA	81,312	2.41	196,693.72	
BANCO POPOLARE SPA	128,954	0.95	122,957.63	
BANCO POPULAR ESPANOL	71,010	3.02	214,734.24	
BANCO SANTANDER SA	599,154	5.57	3,339,085.24	
BANKIA SAU	63,345	3.56	225,508.20	
BANKINTER SA	15,579	4.05	63,094.95	
BASF SE	64,937	49.97	3,244,901.89	
BAYER	58,466	45.75	2,675,111.83	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,409	56.84	1,330,567.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,814	38.55	147,048.77	
BEIERSDORF AG	7,127	40.65	289,748.18	
BEKAERT NV	2,844	29.37	83,528.28	

BELGACOM	11,115	22.81	253,588.72	
BNP PARIBAS	68,072	30.68	2,088,448.96	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,165	25.10	129,641.50	
BOUYGUES ORD	13,386	25.98	347,768.28	
BRENNTAG AG	2,446	70.64	172,785.44	
BUREAU VERITAS SA	3,992	53.02	211,655.84	
CAIXABANK	54,400	3.44	187,136.00	
CAP GEMINI SA	10,462	27.64	289,169.68	
CARREFOUR	40,825	19.23	785,268.87	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,913	63.75	249,453.75	
CELESIO AG	5,912	10.68	63,169.72	
CHRISTIAN DIOR	3,854	97.03	373,953.62	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	10,539	17.38	183,220.51	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	14,731	5.22	76,925.28	
CNP ASSURANCES	10,861	10.45	113,497.45	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	13,390	13.51	180,898.90	
COLRUYT SA	5,534	30.65	169,644.77	
COMMERZBANK AG	254,024	1.50	381,798.07	
CONTINENTAL AG	5,656	53.84	304,519.04	
CREDIT AGRICOLE SA	68,195	5.01	342,066.12	
CRH	50,652	12.70	643,280.40	
DAIMLER AG	64,041	33.60	2,152,097.80	
DANONE (GROUPE)	41,288	48.70	2,010,725.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,273	60.29	257,619.17	
DELHAIZE GROUP	7,180	45.16	324,248.80	
DELTA LLOYD NV	6,994	12.03	84,137.82	
DEUTSCHE BANK NAMEN	65,983	27.29	1,801,005.98	
DEUTSCHE BOERSE AG NEW	13,843	40.44	559,810.92	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,731	9.55	159,914.89	
DEUTSCHE POST AG-REG	59,835	11.10	664,168.50	
DEUTSCHE TELEKOM	198,589	8.78	1,744,802.95	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	40,137	3.13	125,749.22	
E.ON AG	127,326	16.29	2,074,140.54	
EDENRED	11,555	18.93	218,793.92	
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	4.33	63,423.75	
EIFFAGE	2,815	22.06	62,098.90	
ELAN CORPORATION PLC	36,440	8.33	303,763.84	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,993	20.55	349,206.15	
ELISA A	10,330	15.08	155,776.40	
ENAGAS	13,083	13.53	177,012.99	

ENEL	465,380	3.15	1,466,877.76
ENEL GREEN POWER SPA	127,874	1.62	208,306.74
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,459	2.30	320,755.70
ENI	169,910	15.68	2,664,188.80
ERAMET	369	108.40	39,999.60
ERSTE GROUP BANK AG	13,827	14.55	201,182.85
ESSILOR INTERNATIONAL	14,216	52.04	739,800.64
EURAZEO	2,245	31.73	71,245.07
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	28,881	19.96	576,609.16
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,238	29.26	211,820.07
EXOR SPA	4,687	14.78	69,273.86
FERROVIAL SA	26,799	9.23	247,569.16
FIAT INDUSTRIAL	54,060	6.02	325,711.50
FIAT ORD	55,890	4.00	223,895.34
FINMECCANICA SPA	29,572	4.29	127,100.45
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	3,419	17.75	60,687.25
FORTUM OYJ	31,404	17.32	543,917.28
FRANCE TELECOM	131,092	12.35	1,619,641.66
FRAPORT AG	2,685	45.41	121,925.85
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,766	50.44	744,797.04
FRESENIUS SE&CO KGAA	8,040	72.59	583,623.60
FUGRO NV-CVA	4,986	39.66	197,744.76
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,905	14.95	252,729.75
GAS NATURAL SDG SA	22,809	12.78	291,499.02
GDF SUEZ	87,533	20.07	1,757,224.97
GEA GROUP AG	12,759	20.40	260,283.60
GRIFOLS SA	10,120	12.40	125,538.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,727	54.58	312,579.66
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	38,589	6.18	238,518.60
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,409	35.86	158,128.78
HEIDELBERGCEMENT AG	9,942	31.29	311,085.18
HEINEKEN HOLDING NV	8,146	29.86	243,239.56
HEINEKEN NV	18,326	34.22	627,207.35
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	17,908	3.39	60,708.12
HENKEL AG & CO KGAA	9,184	34.41	316,021.44
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,596	41.61	524,119.56
HOCHTIEF AG	3,095	49.73	153,914.35
IBERDROLA SA	279,094	4.80	1,341,325.76
ILIAD SA	1,399	83.15	116,326.85
IMERYS SA	2,361	38.75	91,488.75

IMMOFINANZ AG	68,672	2.36	162,615.29
INDITEX	15,425	64.24	990,902.00
INDRA SISTEMAS SA	6,845	11.70	80,086.50
INFINEON TECHNOLOGIES	76,834	6.51	500,880.84
ING GROEP	271,898	5.54	1,507,402.51
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,787	1.66	113,000.92
INTESA SANPAOLO	715,258	1.14	821,831.44
INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	0.94	61,207.67
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	0.00	0.00
JC DECAUX SA	4,621	18.42	85,141.92
JERONIMO MARTINS	16,094	12.74	205,037.56
K+S AG	12,179	44.50	541,965.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,363	42.78	272,240.95
KBC GROEP NV	11,778	13.11	154,409.58
KERRY GROUP PLC-A	9,928	26.45	262,595.60
KESKO OYJ-B SHS	4,889	24.62	120,367.18
KONE OYJ-B	11,008	40.37	444,392.96
KONINKLIJKE DSM NV	10,903	36.34	396,215.02
KPN (KON.)	108,049	9.41	1,017,389.38
LAFARGE (FRANCE)	14,177	27.51	390,080.15
LAGADERE S.C.A	8,624	17.50	150,920.00
LANXESS	6,080	41.39	251,651.20
LEGRAND SA	13,961	24.10	336,460.10
LINDE AG	11,954	107.05	1,279,675.70
LOREAL	16,996	77.43	1,316,000.28
LUXOTTICA GROUP SPA	8,527	20.56	175,315.12
LVMH	17,917	114.60	2,053,288.20
M6-METROPOLE TELEVISION	4,240	11.55	48,993.20
MAN SE	4,485	63.92	286,681.20
MAPFRE SA	55,064	2.47	136,283.40
MEDIASET	51,788	2.20	114,244.32
MEDIASET ESPANA COMUNICACION SA	11,312	4.39	49,716.24
MEDIOBANCA	37,781	5.47	206,662.07
MERCK KGAA	4,722	69.65	328,887.30
METRO STAMM	9,166	34.13	312,835.58
METSO OYJ	9,035	27.33	246,926.55
MICHELIN	12,486	48.66	607,631.19
MOBISTAR SA	2,086	40.20	83,867.63
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,379	88.13	1,179,091.27

NATIXIS	63,795	2.04	130,269.39
NEOPOST SA	2,357	55.99	131,968.43
NESTE OIL OYJ	8,623	8.59	74,114.68
NOKIA CORP	264,773	4.76	1,261,378.57
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,042	26.49	213,032.58
OKO BANK-A	9,611	7.02	67,517.27
OMV AG	11,569	24.42	282,514.98
OPAP SA	16,317	7.02	114,545.34
ORION OYJ-CLASS B	6,894	14.50	99,963.00
OUTOKUMPU OYJ	8,903	5.73	51,014.19
PARMALAT SPA	22,764	1.53	34,874.44
PERNOD-RICARD	14,011	68.00	952,748.00
PEUGEOT SA	11,116	13.88	154,290.08
PHILIPS ELECTRS (KON.)	71,336	14.23	1,015,111.28
PIRELLI & CO	17,381	6.47	112,541.97
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,826	42.89	464,381.27
PORTUGAL TELECOM	49,132	4.90	240,746.80
POST NL	24,330	2.81	68,488.95
PPR	5,380	110.35	593,683.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	5,151	15.23	78,449.73
PRYSMIAN SPA	14,881	10.29	153,125.49
PUBLIC POWER CORP	7,659	5.75	44,039.25
PUBLICIS GROUPE	8,807	35.11	309,257.80
QIAGEN N.V.	17,075	10.53	179,885.12
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	18.46	62,764.00
RANDSTAD HOLDING NV	8,741	21.60	188,849.30
RAUTARUUKKI OYJ	6,150	6.89	42,404.25
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,651	33.52	256,461.52
REED ELSEVIER NV	48,631	8.92	433,934.41
RENAULT SA	13,590	27.98	380,316.15
REPSOL YPF	56,106	22.19	1,245,272.67
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	25.62	67,214.37
RWE STAMM	29,604	28.06	830,688.24
SAFRAN SA	11,794	24.28	286,358.32
SAINT-GOBAIN	28,148	30.90	869,773.20
SAIPEM	18,719	31.68	593,017.92
SALZGITTER AG	2,854	39.48	112,690.19
SAMPO OYJ-A SHS	29,819	19.10	569,542.90
SANOFI	78,827	48.98	3,860,946.46
SANOMA OYJ	5,948	8.78	52,253.18

SAP AG	65,054	43.70	2,842,859.80	
SBM OFFSHORE NV	12,325	15.76	194,242.00	
SCHNEIDER ELECTRIC	34,610	39.20	1,356,712.00	
SCOR SE	12,355	16.25	200,768.75	
SES	21,188	18.49	391,872.06	
SIEMENS	58,172	72.36	4,209,325.92	
SNAM RETE GAS	113,618	3.32	377,893.46	
SOCIETE BIC SA	2,129	63.52	135,234.08	
SOCIETE GENERALE	45,039	18.20	819,709.80	
SODEXO	6,666	52.00	346,632.00	
SOLVAY SA	4,192	68.72	288,074.24	
STMICROELECTRONICS	46,564	5.23	243,529.72	
STORA ENSO OYJ R	42,511	4.32	183,902.58	
SUEDZUCKER AG	4,843	19.84	96,109.33	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	19,681	10.09	198,679.69	
TECHNIP S.A.	7,015	66.28	464,954.20	
TELECOM ITALIA ORD	663,571	0.82	549,768.57	
TELECOM ITALIA RNC	426,054	0.71	302,711.36	
TELEFONICA	290,412	13.89	4,033,822.68	
TELEKOM AUSTRIA AG	24,278	8.13	197,550.08	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,577	8.97	76,995.72	
TENARIS SA	33,386	12.83	428,342.38	
TERNA SPA	88,123	2.70	238,284.59	
THALES SA	7,274	24.67	179,485.95	
THYSSEN KRUPP	27,281	20.03	546,574.83	
TNT EXPRESS	25,745	5.08	130,913.32	
TOTAL SA	150,077	37.22	5,585,865.94	
TUI AG	9,910	4.14	41,067.04	
UCB (GROUPE)	7,369	29.81	219,669.89	
UMICORE	8,330	30.92	257,563.60	
UNICREDIT SPA	957,762	0.75	721,194.78	
UNILEVER NV-CVA	115,172	24.38	2,808,469.22	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	58,086	2.50	145,563.51	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,820	13.64	106,703.90	
UPM KYMMENE CORP	36,762	8.16	300,161.73	
VALLOUREC	7,922	45.72	362,193.84	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,702	9.03	223,157.86	
VERBUND AG	4,976	20.16	100,316.16	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	28.30	79,466.40	
VINCI S.A.	31,447	32.65	1,026,744.55	

VIVENDI	87,503	15.41	1,348,421.23	
VOESTALPINE AG	8,029	23.77	190,849.33	
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,225	124.95	1,277,613.75	
VOLKSWAGEN STAMM	2,156	114.55	246,969.80	
VOPAK	5,138	39.01	200,459.07	
WACKER CHEMIE AG	1,088	69.97	76,127.36	
WARTSILA OYJ	11,853	21.49	254,720.97	
WENDEL	2,399	50.28	120,621.72	
WOLTERS KLUWER	21,116	12.60	266,061.60	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	9.52	97,113.52	
小計	12,836,522		138,330,811.68 (14,566,234,469)	
合計	85,247,366		(110,292,377,428)	

(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 564銘柄	100.0%	56.9%
カナダドル	株式 99銘柄	100.0%	5.8%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	100.0%	4.1%
イギリスポンド	株式 99銘柄	100.0%	11.0%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%	4.0%
香港ドル	株式 40銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式 29銘柄	100.0%	0.8%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%	0.5%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 13銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	株式 252銘柄	100.0%	13.2%

#### 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	CARNIVAL CORP	32,347.00	1,052,247.91	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	382,000.00	259,760.00	
	小計		414,347.00	1,312,007.91 (102,139,815)	
	オーストラリアドル	LEND LEASE GROUP	39,632.00	297,636.32	
	小計		39,632.00	297,636.32 (23,456,718)	

投資信託受益証券計				(125,596,533)
投資証券	アメリカドル	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	67,240.00	1,094,667.20
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,649.00	830,593.08
		BOSTON PROPERTIES	10,294.00	986,165.20
		DUKE REALTY CORP	17,553.00	200,981.85
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	20,832.00	1,182,840.96
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,548.00	392,901.72
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	30,759.00	438,315.75
		HCP INC	28,707.00	1,076,512.50
		HEALTH CARE REIT INC	12,497.00	621,100.90
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	48,513.00	649,589.07
		KIMCO REALTY CORP	28,770.00	469,814.10
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,421.00	263,156.25
		MACERICH CO/THE	9,255.00	449,978.10
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,833.00	433,087.80
		PROLOGIS INC	32,126.00	888,283.90
		PUBLIC STORAGE	10,254.00	1,249,757.52
		RAYONIER INC	8,893.00	362,122.96
		REGENCY CENTERS CORP	6,569.00	246,271.81
		SIMON PROPERTY GROUP	20,741.00	2,596,565.79
		VENTAS INC	19,362.00	1,013,600.70
VORNADO REALTY TRUST	11,723.00	929,985.59		
小計		415,539.00	16,376,292.75 (1,274,894,390)	
カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,313.00	232,359.35	
小計		9,313.00	232,359.35 (17,666,281)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	134,870.00	246,812.10	
	DEXUS PROPERTY GROUP	353,593.00	305,857.94	
	GOODMAN GROUP	513,315.00	328,521.60	
	GPT GROUP	124,629.00	391,335.06	
	MIRVAC GROUP	249,678.00	314,594.28	
	STOCKLAND	168,483.00	557,678.73	
	WESTFIELD GROUP	155,086.00	1,248,442.30	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	205,136.00	527,199.52	
小計		1,904,790.00	3,920,441.53 (308,969,996)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	59,832.00	296,886.38	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	40,840.00	127,420.80	
	HAMMERSON PLC	52,079.00	205,503.73	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	54,856.00	371,100.84	



	SEGRO PLC	54,233.00	127,447.55	
小計		261,840.00	1,128,359.30 (139,769,866)	
香港ドル	LINK REIT	158,000.00	4,463,500.00	
小計		158,000.00	4,463,500.00 (44,679,635)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	129,000.00	259,290.00	
	CAPITAMALL TRUST	140,000.00	250,600.00	
小計		269,000.00	509,890.00 (30,715,773)	
ユーロ	CORIO NV	4,387.00	150,825.06	
	FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	95,081.80	
	GECINA SA	1,603.00	106,166.69	
	ICADE	1,705.00	107,568.45	
	KLEPIERRE	7,627.00	175,230.32	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,514.00	878,738.60	
小計		23,747.00	1,513,610.92 (159,383,229)	
投資証券計			(1,976,079,170)	
合計			(2,101,675,703)	

(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	2銘柄	7.4%	65.5%
	投資証券	21銘柄	92.6%	
カナダドル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.8%
オーストラリアドル	投資信託 受益証券	1銘柄	7.1%	15.8%
	投資証券	8銘柄	92.9%	
イギリスポンド	投資証券	5銘柄	100.0%	6.7%
香港ドル	投資証券	1銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券	2銘柄	100.0%	1.5%
ユーロ	投資証券	6銘柄	100.0%	7.6%

## 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,149,551	55,920,526
投資証券	3,291,249,760	4,744,152,310
未収配当金	40,075,888	68,583,662
未収利息	22	72
前払金		9,154,000
差入委託証拠金		3,213,000
流動資産合計	3,344,475,221	4,881,023,570
資産合計	3,344,475,221	4,881,023,570
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		10,099,000
未払金	11,250,131	12,655,335
未払解約金	1,403,595	5,554,210
流動負債合計	12,653,726	28,308,545
負債合計	12,653,726	28,308,545
純資産の部		
元本等		
元本	4,927,249,401	7,919,817,576
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,595,427,906	3,067,102,551
元本等合計	3,331,821,495	4,852,715,025
純資産合計	3,331,821,495	4,852,715,025
負債純資産合計	3,344,475,221	4,881,023,570

## (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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成22年11月11日 至平成23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。	(1) 投資証券 同左  (2) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	2,479,283,257円	4,927,249,401円
期中追加設定元本額	2,917,774,258円	4,531,669,963円
期中一部解約元本額	469,808,114円	1,539,101,788円
期末元本額	4,927,249,401円	7,919,817,576円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	440,229,615円	572,939,120円
SBI資産設計オープン（分配型）	26,280,747円	20,548,698円
STAM J-REITインデックス・オープン	1,868,171,050円	2,115,573,006円
STAM Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	2,592,567,989円	5,210,756,752円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を1,595,427,906円下回っております。	純資産額は、元本を3,067,102,551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	4,927,249,401口	7,919,817,576口

## (金融商品に関する注記)

## 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)	(自平成22年11月11日 至平成23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。	同左
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	同左
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。	同左
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。	同左

## 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）	（平成23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。	同左
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。	a. 投資証券 同左

	<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>	<p>b. 先物取引 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。</p> <p>c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
--	--	--

## (追加情報)

(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日)
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	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	855,136,705
合計	235,452,007	855,136,705

(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)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 投資証券関連

区分	種類	(平成22年11月10日現在)			(平成23年11月10日現在)		
		契約額等(円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等(円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建 東証REIT指数先物				118,648,000	108,549,000	10,099,000
	合計				118,648,000	108,549,000	10,099,000

## (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21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 0.6762円	1口当たり純資産額 = 0.6127円

## (3)附属明細表（平成23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	M I Dリート投資法人	290	53,273,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,548	224,460,000	
	いちご不動産投資法人	1,331	35,937,000	
	インヴィンシブル投資法人	2,129	16,031,370	
	オリックス不動産投資法人	449	140,088,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	153	81,549,000	
	ケネディクス不動産投資法人	452	94,829,600	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	167	26,235,700	
	ジャパンエクセレント投資法人	298	92,678,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	772	489,448,000	
	スターツプロシード投資法人	171	16,929,000	
	トップリート投資法人	245	87,710,000	
	ビ・ライフ投資法人	247	108,556,500	
	プレミア投資法人	261	63,031,500	
	フロンティア不動産投資法人	306	199,818,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,321	282,949,200	
	阪急リート投資法人	135	47,790,000	
	産業ファンド投資法人	148	58,756,000	
	森トラスト総合リート投資法人	382	257,468,000	
	森ヒルズリート投資法人	366	90,621,600	

積水ハウス・S I 投資法人	182	48,412,000	
大和証券オフィス投資法人	625	104,437,500	
東急リアル・エステ - ト投資法人	267	104,797,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	307	155,956,000	
日本ビルファンド投資法人	914	669,048,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,129	205,478,000	
日本ホテルファンド投資法人	92	17,590,400	
日本リテールファンド投資法人	2,969	356,873,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	234	152,334,000	
日本賃貸住宅投資法人	2,101	57,441,340	
福岡リート投資法人	194	97,000,000	
平和不動産リート投資法人	1,099	42,531,300	
野村不動産オフィスファンド投資法人	482	192,318,000	
野村不動産レジデンシャル投資法人	198	71,775,000	
合計	23,964	4,744,152,310	

## 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 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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	38,932,553	21,032,906
コール・ローン	27,241,904	20,819,760
投資証券	5,526,185,356	7,394,380,889
派生商品評価勘定	17,315	
未収入金	84,314	32,183,897
未収配当金	12,420,688	17,674,359
未収利息	47	27
流動資産合計	5,604,882,177	7,486,091,838
資産合計	5,604,882,177	7,486,091,838
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		15,750
未払金	21,722,873	1,008,652
未払解約金	211,024	12,422,313
流動負債合計	21,933,897	13,446,715
負債合計	21,933,897	13,446,715
純資産の部		
元本等		
元本	7,960,298,789	11,048,967,075
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,377,350,509	3,576,321,952
元本等合計	5,582,948,280	7,472,645,123
純資産合計	5,582,948,280	7,472,645,123
負債純資産合計	5,604,882,177	7,486,091,838

## (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21年11月11日 至平成22年11月10日)	(自平成22年11月11日 至平成23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	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条に基づいております。</p>	同左
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。</p>	<p>受取配当金 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1. 期首元本額	3,760,454,998円	7,960,298,789円
期中追加設定元本額	6,041,142,925円	5,201,025,575円
期中一部解約元本額	1,841,299,134円	2,112,357,289円
期末元本額	7,960,298,789円	11,048,967,075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	1,281,597,491円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	425,272,546円	556,158,302円
SBI資産設計オープン（分配型）	21,626,290円	19,305,373円
STAM グローバルREITインデックス・オープン	3,665,991,902円	4,584,016,654円
すみしん DCマルチアセット ファンド	347,668円	60,400円
STAM グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	1,075,035,260円	4,607,828,855円

2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 2,377,350,509円下回っており ます。	純資産額は、元本を 3,576,321,952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	7,960,298,789口	11,048,967,075口

## (金融商品に関する注記)

## 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)	(自 平成22年11月11日 至 平成23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。	同左
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	同左
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。	同左

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。	同左
----------------------------	---	----

## 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）	（平成23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。	同左
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. 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。</p> <p>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。</p>	<p>a. 投資証券 同左</p> <p>b. 外国為替予約 同左</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。	c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
--	--	-----------------------------

## (追加情報)

(自 平成21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日)
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。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	(平成22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	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	140,191,079
合計	841,590,626	140,191,079

(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)

## 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。

## 通貨関連

区分	種 類	(平成23年11月10日現在)			
		契 約 額 等(円)		時 価	評 価 損 益

			うち1年超	(円)	(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 カナダドル				
		1,155,900		1,140,150	15,750
	合 計	1,155,900		1,140,150	15,750

## (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21年11月11日 至 平成22年11月10日)	(自 平成22年11月11日 至 平成23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22年11月10日現在)	(平成23年11月10日現在)
1口当たり純資産額 = 0.7013円	1口当たり純資産額 = 0.6763円

## (3) 附属明細表 (平成23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	7,063.00	137,375.35	
		AGREE REALTY CORP	1,727.00	41,292.57	
		ALEXANDER'S INC	358.00	141,213.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,876.00	731,084.72	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,847.00	114,835.08	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,211.00	467,803.41	
		APARTMENT INVEST & MGMT	21,214.00	469,253.68	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,900.00	95,914.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	7,273.00	121,968.21	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,515.00	2,063,053.80	
		BIOMED REALTY TRUST INC	23,050.00	416,974.50	
		BOSTON PROPERTIES	25,798.00	2,471,448.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	23,918.00	220,284.78	

BRE PROPERTIES-CL A	13,125.00	623,437.50	
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,499.00	735,066.19	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	5,373.00	52,064.37	
CAPLEASE INC	11,918.00	45,884.30	
CBL & ASSOCIATES PRYS	26,054.00	373,093.28	
CEDAR REALTY TRUST INC	9,766.00	33,888.02	
CHATHAM LODGING TRUST	2,420.00	24,998.60	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5,632.00	81,382.40	
COGDELL SPENCER INC	8,939.00	35,756.00	
COLONIAL PROPERTIES TRUST	15,314.00	294,181.94	
COMMONWEALTH REIT	14,426.00	248,992.76	
CORESITE REALTY CORP	3,477.00	54,901.83	
CORPORATE OFFICE PPTYS	12,628.00	294,611.24	
COUSINS PROPERTIES INC	18,163.00	115,153.42	
CUBESMART	15,673.00	144,505.06	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	43,332.00	205,827.00	
DDR CORPORATION	38,376.00	447,080.40	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29,394.00	252,200.52	
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,451.00	1,087,720.83	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	22,412.00	407,450.16	
DUKE REALTY CORP	44,391.00	508,276.95	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	10,761.00	241,261.62	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	4,734.00	201,384.36	
EDUCATION REALTY TRUST INC	12,687.00	115,324.83	
ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	8,194.00	362,174.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,157.00	453,395.95	
EQUITY ONE INC	10,521.00	173,175.66	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	52,066.00	2,956,307.48	
ESSEX PROPERTY TRUST	5,747.00	764,063.65	
EXCEL TRUST INC	5,420.00	55,446.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,554.00	364,022.46	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,029.00	952,795.31	
FELCOR LODGING TRUST INC	21,798.00	67,355.82	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15,168.00	142,275.84	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,766.00	114,659.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	12,407.00	139,206.54	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	106,960.00	1,524,180.00	
GETTY REALTY CORP	4,737.00	71,528.70	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,886.00	31,081.28	
GLIMCHER REALTY TRUST	18,816.00	165,204.48	
HCP INC	71,504.00	2,681,400.00	

HEALTH CARE REIT INC	31,313.00	1,556,256.10	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13,734.00	242,954.46	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	26,477.00	113,586.33	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,714.00	370,231.68	
HOME PROPERTIES INC	8,254.00	458,674.78	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	21,680.00	478,477.60	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	124,004.00	1,660,413.56	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	2,998.00	36,635.56	
INLAND REAL ESTATE CORP	13,538.00	96,390.56	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	14,229.00	101,025.90	
KILROY REALTY CORPORATION	10,267.00	371,768.07	
KIMCO REALTY CORP	71,470.00	1,167,105.10	
KITE REALTY GROUP TRUST	11,135.00	43,649.20	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	14,941.00	351,262.91	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	24,238.00	183,724.04	
LIBERTY PROPERTY TRUST	20,312.00	634,750.00	
LTC PROPERTIES INC	5,313.00	149,029.65	
MACERICH CO/THE	23,166.00	1,126,330.92	
MACK-CALI REALTY CORP	15,287.00	404,188.28	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	19,712.00	191,206.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,522.00	386,493.72	
MISSION WEST PROPERTIES	3,520.00	26,048.00	
MONMOUTH REIT -CL A	6,202.00	51,166.50	
MPG OFFICE TRUST INC	7,290.00	16,985.70	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,539.00	433,321.80	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,891.00	206,889.30	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,105.00	316,656.45	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,895.00	29,618.85	
PARKWAY PROPERTIES INC	3,873.00	46,476.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	8,913.00	160,612.26	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,752.00	92,546.48	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	30,350.00	505,934.50	
POST PROPERTIES	8,863.00	357,887.94	
PROLOGIS INC	80,604.00	2,228,700.60	
PS BUSINESS PARKS INC	3,333.00	173,915.94	
PUBLIC STORAGE	24,875.00	3,031,765.00	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	6,751.00	62,244.22	
REALTY INCOME CORP	22,280.00	730,784.00	
REGENCY CENTERS CORP	15,788.00	591,892.12	
SAUL CENTERS INC	2,022.00	67,555.02	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	28,339.00	602,203.75	



	SIMON PROPERTY GROUP	51,558.00	6,454,546.02	
	SL GREEN REALTY CORP	15,008.00	997,731.84	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	4,889.00	197,368.93	
	STAG INDUSTRIAL INC	2,394.00	24,634.26	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	28,601.00	145,293.08	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,777.00	37,021.75	
	SUN COMMUNITIES INC	3,765.00	138,326.10	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	20,531.00	149,260.37	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,088.00	416,579.68	
	TAUBMAN CENTERS INC	10,166.00	608,231.78	
	TERRENO REALTY CORP	1,320.00	15,760.80	
	UDR INC	38,472.00	927,559.92	
	UMH PROPERTIES INC	2,210.00	22,122.10	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,212.00	80,937.08	
	URSTADT BIDDLE - CL A	4,037.00	68,830.85	
	VENTAS INC	50,561.00	2,646,868.35	
	VORNADO REALTY TRUST	32,387.00	2,569,260.71	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	11,580.00	324,587.40	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	21,220.00	447,317.60	
	WINTHROP REALTY TRUST	5,127.00	46,040.46	
小計		2,066,817.00	61,310,857.36 (4,773,050,245)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	4,320.00	102,556.80	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,151.00	94,607.73	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,516.00	219,929.20	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	2,239.00	49,907.31	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	8,905.00	235,359.15	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,324.00	149,189.88	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,811.00	203,152.56	
	CANMARC CANADA REAL ESTATE INVESTMENT	4,478.00	58,169.22	
	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	12,363.00	90,744.42	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	5,962.00	132,296.78	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,537.00	47,006.73	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	5,272.00	172,394.40	
	EXTENDICARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,888.00	49,869.12	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	13,529.00	293,579.30	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	8,026.00	32,986.86	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,890.00	75,795.00	

	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	2,525.00	72,215.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	3,013.00	34,318.07	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	6,878.00	140,311.20	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,126.00	576,993.70	
	TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	4,950.00	56,479.50	
	WHITEROCK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,895.00	37,895.55	
小計		148,598.00	2,925,757.48 (222,445,341)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	44,725.00	85,648.37	
	ALE PROPERTY GROUP	26,532.00	53,859.96	
	ASPEN GROUP	103,787.00	43,590.54	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	10,577.00	23,798.25	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	41,141.00	107,789.42	
	BWP TRUST	69,312.00	119,216.64	
	CENTRO RETAIL GROUP	213,286.00	57,587.22	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	412,345.00	754,591.35	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	76,239.00	38,881.89	
	CHARTER HALL GROUP	42,208.00	81,672.48	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	72,540.00	245,185.20	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	43,353.00	139,596.66	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	430,170.00	402,208.95	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	136,218.00	88,541.70	
	DEXUS PROPERTY GROUP	849,773.00	735,053.64	
	GOODMAN GROUP	1,155,843.00	739,739.52	
	GPT GROUP	300,493.00	943,548.02	
	INVESTA OFFICE FUND	497,308.00	313,304.04	
	MIRVAC GROUP	599,757.00	755,693.82	
	STOCKLAND	418,481.00	1,385,172.11	
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUND	44,631.00	23,208.12	
	WESTFIELD GROUP	371,837.00	2,993,287.85	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	493,376.00	1,267,976.32	
小計		6,453,932.00	11,399,152.07 (898,367,174)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	20,084.00	53,242.68	
	BRITISH LAND CO PLC	155,807.00	773,114.33	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	104,890.00	327,256.80	
	DERWENT LONDON PLC	14,346.00	241,012.80	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	54,908.00	199,316.04	
	HAMMERSON PLC	125,140.00	493,802.44	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	136,191.00	921,332.11	

	LONDON & STAMFORD PROPERTY	96,314.00	111,627.92	
	METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	33,272.00	31,941.12	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	11,939.00	36,443.79	
	SEGRO PLC	130,243.00	306,071.05	
	SHAFTESBURY PLC	43,990.00	221,929.55	
	WORKSPACE GROUP PLC	18,665.00	45,075.97	
小計		945,789.00	3,762,166.60 (466,019,576)	
香港ドル	CHAMPION REIT	457,000.00	1,448,690.00	
	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	202,000.00	751,440.00	
	GZI REAL ESTATE INVMT TRUST	120,000.00	434,400.00	
	LINK REIT	395,000.00	11,158,750.00	
	PROSPERITY REIT	189,000.00	300,510.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	145,000.00	266,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	208,000.00	472,160.00	
小計		1,716,000.00	14,832,750.00 (148,475,827)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	68,000.00	66,640.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	297,266.00	597,504.66	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	105,000.00	110,250.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	98,000.00	95,060.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	208,000.00	97,760.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	352,000.00	403,040.00	
	CAPITAMALL TRUST	460,500.00	824,295.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	70,000.00	81,900.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	113,000.00	183,060.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	85,000.00	67,575.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	80,000.00	116,400.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	82,600.00	65,254.00	
	K-REIT ASIA	59,000.00	60,475.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	114,000.00	49,590.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	188,000.00	161,680.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	175,160.00	190,924.40	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	253,920.00	215,832.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	62,000.00	114,080.00	
	SAIZEN REIT	207,800.00	30,546.60	
	STARHILL GLOBAL REIT	243,000.00	142,155.00	
	SUNTEC REIT	391,000.00	463,335.00	
小計		3,713,246.00	4,137,356.66 (249,234,365)	

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY TRUST	94,857.00	76,359.88	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	43,180.00	54,406.80	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	136,580.00	135,214.20	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	170,316.00	187,347.60	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	50,188.00	59,221.84	
小計		495,121.00	512,550.32 (31,101,553)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	15,609.00	102,363.82	
小計		15,609.00	102,363.82 (2,140,427)	
ユーロ	AEDIFICA	1,234.00	54,542.80	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	9,696.00	84,898.17	
	ALTAREA	254.00	32,004.00	
	ANF IMMOBILIER	1,969.00	57,691.70	
	BEFIMMO S.C.A.	2,497.00	134,463.45	
	BENI STABILI SPA	143,987.00	54,916.64	
	COFINIMMO	2,458.00	215,419.12	
	CORIO NV	16,207.00	557,196.66	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE	2,551.00	10,459.10	
	EUROCOMMERCIAL	6,301.00	166,850.48	
	FONCIERE DES REGIONS	6,856.00	341,120.28	
	GECINA SA	4,587.00	303,797.01	
	HAMBORNER REIT AG	5,975.00	36,925.50	
	ICADE	4,021.00	253,684.89	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	24,294.00	24,172.53	
	INTERVEST OFFICES	1,108.00	21,606.00	
	KLEPIERRE	16,349.00	375,618.27	
	MERCIALYS	7,901.00	208,546.89	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	9,319.00	100,645.20	
	SILIC	1,497.00	113,846.85	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	1,004.00	41,666.00	
UNIBAIL-RODAMCO SE	16,034.00	2,162,986.60		
VASTNED RETAIL NV	3,239.00	111,097.70		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,593.00	60,199.47		
WERELDHAVE NV	3,807.00	207,329.22		
小計		294,738.00	5,731,684.53 (603,546,381)	
合計			(7,394,380,889)	

(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 115銘柄	100.0%	64.6%
カナダドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.0%
オーストラリアドル	投資証券 23銘柄	100.0%	12.1%
イギリスポンド	投資証券 13銘柄	100.0%	6.3%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 21銘柄	100.0%	3.4%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.02%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100.0%	8.2%

## 2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 3)デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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23年11月30日現在)

資産総額	3,243,732,763 円
負債総額	15,555,396 円
純資産総額（ - ）	3,228,177,367 円
発行済口数	4,495,298,705 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7181 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	181,387,908,863 円
負債総額	646,401,170 円
純資産総額（ - ）	180,741,507,693 円
発行済口数	148,147,607,403 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2200 円

住信 国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	112,735,671,838 円
負債総額	84,689,731 円
純資産総額（ - ）	112,650,982,107 円
発行済口数	197,240,336,157 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5711 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	204,703,008,439 円
負債総額	149,705,818 円
純資産総額（ - ）	204,553,302,621 円
発行済口数	120,683,124,686 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6950 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	113,849,420,255 円
負債総額	122,861,379 円
純資産総額（ - ）	113,726,558,876 円
発行済口数	141,642,052,527 口

1口当たり純資産額（ / ）	0.8029 円
----------------	----------

住信 J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	4,892,289,043 円
負債総額	29,587,624 円
純資産総額（ - ）	4,862,701,419 円
発行済口数	8,002,362,884 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6077 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	7,192,847,794 円
負債総額	5,833,959 円
純資産総額（ - ）	7,187,013,835 円
発行済口数	11,014,016,637 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6525 円

**第4【内国投資信託受益証券事務の概要】**

（イ）名義書換

該当事項はありません。

（ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

（ニ）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、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

す。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (イ) 資本金の額

平成23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。

###### [ CHECK(検証・評価) ]

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23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	158	1,256,510
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	158	1,256,510

## 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21年4月1日至平成22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22年4月1日至平成23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21年4月1日至平成22年3月31日）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、また、当事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）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。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26期事業年度の中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23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っております。

### (1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		

現金及び預金	2	5,642,056	2	6,223,302
前払金		6,819		-
前払費用		35,081		34,720
未収委託者報酬		942,664		953,916
未収運用受託報酬		48,083		42,516
繰延税金資産		44,119		50,152
その他		129		34
流動資産合計		6,718,954		7,304,641
固定資産				
有形固定資産				
建物		49,765		38,802
器具備品		26,485		27,919
有形固定資産合計	1	76,250	1	66,721
無形固定資産				
ソフトウェア		95,682		91,774
その他無形固定資産		126		1,415
無形固定資産合計		95,808		93,189
投資その他の資産				
投資有価証券		245,516		239,090
敷金・保証金		238,033		228,451
長期前払費用		449		409
繰延税金資産		55,356		80,017
その他の投資		225		195
投資その他の資産合計		539,579		548,164
固定資産合計		711,639		708,076
資産合計		7,430,593		8,012,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	16,838	18,485
未払金	520,453	495,343
未払収益分配金	130	130
未払手数料	2 454,590	2 452,781
その他未払金	65,733	42,432

未払費用	2	126,959	2	135,706
未払法人税等		174,433		220,711
未払消費税等		11,758		25,316
賞与引当金		70,599		79,835
流動負債合計		921,042		975,399
固定負債				
退職給付引当金		122,901		171,115
固定負債合計		122,901		171,115
負債合計		1,043,943		1,146,514
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		50,500		53,500
その他利益剰余金				
別途積立金		5,100,000		5,100,000
繰越利益剰余金		942,449		1,421,205
利益剰余金合計		6,092,949		6,574,705
株主資本合計		6,392,949		6,874,705
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		6,299		8,501
評価・換算差額等合計		6,299		8,501
純資産合計		6,386,650		6,866,203
負債・純資産合計		7,430,593		8,012,717

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		8,637,673		8,619,288
運用受託報酬		108,227		126,038
営業収益合計		8,745,901		8,745,326
営業費用				
支払手数料	1	4,414,750	1	4,301,606
広告宣伝費		123,104		67,247

公告費	2,520	2,744
受益証券発行費	95	-
調査費	835,300	898,998
調査費	85,751	87,937
委託調査費	747,629	809,173
図書費	1,918	1,887
営業雑経費	650,397	640,623
通信費	10,735	11,303
印刷費	164,695	152,354
協会費	9,726	10,102
諸会費	594	594
情報機器関連費	429,265	433,365
その他営業雑経費	35,380	32,903
営業費用合計	6,026,169	5,911,221
一般管理費		
給料	1,313,847	1,315,974
役員報酬	34,470	38,295
給料・手当	1,098,871	1,062,048
賞与	180,505	215,631
退職給付費用	52,327	63,772
役員退職慰労金	1,980	-
福利費	148,136	156,648
交際費	1,771	1,350
旅費交通費	43,688	31,880
租税公課	17,962	17,981
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	3,745	7,972
減価償却費	58,878	57,385
敷金償却	-	2,804
諸経費	101,459	91,394
一般管理費合計	1,981,829	1,985,197
営業利益	737,901	848,907

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

営業外収益

受取配当金		1,046		1,280
有価証券利息		257		-
受取利息	1	6,564	1	14,783
投資有価証券売却益		1,179		756
その他		3,344		1,877
営業外収益合計		12,393		18,697
営業外費用				
投資有価証券売却損		12,836		480
固定資産除却損	2	1,136		-
その他		820		242
営業外費用合計		14,794		722
経常利益		735,501		866,883
特別損失				
資産除去債務会計基準 の適用に伴う影響額		-		6,776
特別損失合計		-		6,776
税引前当期純利益		735,501		860,106
法人税、住民税及び事業税		333,431		377,534
法人税等調整額		30,837		29,183
法人税等合計		302,594		348,350
当期純利益		432,906		511,755

## (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21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月1日 至 平成23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	47,500	50,500
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	50,500	53,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	4,100,000	5,100,000
当期変動額		
別途積立金の積立	1,000,000	-
当期変動額合計	1,000,000	-
当期末残高	5,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	1,542,542	942,449
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	432,906	511,755
別途積立金の積立	1,000,000	-
当期変動額合計	600,093	478,755
当期末残高	942,449	1,421,205
利益剰余金合計		
前期末残高	5,690,042	6,092,949
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,092,949	6,574,705
株主資本合計		
前期末残高	5,990,042	6,392,949
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,392,949	6,874,705

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成21年4月1日	(自 平成22年4月1日
	至 平成22年3月31日)	至 平成23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	24,962	6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	2,202
当期変動額合計	18,662	2,202
当期末残高	6,299	8,501
評価・換算差額等合計		
前期末残高	24,962	6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	2,202
当期変動額合計	18,662	2,202
当期末残高	6,299	8,501
純資産合計		
前期末残高	5,965,080	6,386,650
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	2,202
当期変動額合計	421,569	479,553
当期末残高	6,386,650	6,866,203

## 重要な会計方針

項目	期別 前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
1 有価証券の評価基準 及び評価方法	<p>           其他有価証券            時価のあるもの              決算末日の市場価格等に基づく時価            法によっております。(評価差額は、全            部純資産直入法により処理し、売却原価            は、移動平均法により算定してありま            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。         </p>	<p>           其他有価証券            時価のあるもの              同 左              時価のないもの              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。              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。         </p>	<p>           有形固定資産              同 左              無形固定資産              同 左         </p>
3 引当金の計上基準	<p>           (1) 賞与引当金              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あります。         </p>	<p>           (1) 賞与引当金              同 左         </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。	(2) 退職給付引当金 同左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同左

## 会計方針の変更

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
-	資産除去債務に関する会計基準等の適用 当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 これにより、当事業年度の営業利益及び経常利益が2,804千円減少し、税引前当期純利益が9,581千円減少しております。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 38,352千円 器具備品 96,447千円 計 134,799千円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 49,316千円 器具備品 113,320千円 計 162,636千円
2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金 3,498,856千円 未払手数料 353,462千円 未払費用 119,557千円	2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金 3,477,508千円 未払手数料 333,570千円 未払費用 123,687千円

## (損益計算書関係)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23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 4,065,257千円 受取利息 1,030千円	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 3,761,890千円 受取利息 6,579千円

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	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
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. 当事業年度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. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
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. 当事業年度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

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成23年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

(1) 配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

- (3) 1株当たり配当額 5,000円
- (4) 基準日 平成23年3月31日
- (5) 効力発生日 平成23年6月29日

## (リ - ス取引関係)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

## (金融商品関係)

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## (追加情報)

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

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

2)を参照ください)。

(単位:千円)

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

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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23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	6,223,302	6,223,302	-
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	39,590	39,590	-
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	-

(\*)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	6,223,302	-	-	-
未収委託者報酬	953,916	-	-	-

（有価証券関係）

前事業年度(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

当事業年度(平成23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	3,000	3,075	75
小計	3,000	3,075	75
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	50,925	36,515	14,409
小計	50,925	36,515	14,409
計	53,925	39,590	14,334

(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22年4月1日至平成23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
7,639	756	480

## （デリバティブ取引関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)												
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>122,901千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>122,901千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>52,327千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。</p>	退職給付債務	122,901千円	退職給付引当金	122,901千円	退職給付費用	52,327千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>171,115千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>171,115千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>63,772千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,307千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>同左</p>	退職給付債務	171,115千円	退職給付引当金	171,115千円	退職給付費用	63,772千円
退職給付債務	122,901千円												
退職給付引当金	122,901千円												
退職給付費用	52,327千円												
退職給付債務	171,115千円												
退職給付引当金	171,115千円												
退職給付費用	63,772千円												

## （税効果会計関係）

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p>	<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p>

未払事業税	15,392千円	未払事業税	17,667千円
賞与引当金損金算入限度超過額	28,726千円	賞与引当金損金算入限度超過額	32,484千円
退職給付引当金損金算入限度超過額	50,008千円	退職給付引当金損金算入限度超過額	69,626千円
有価証券評価差額	4,321千円	有価証券評価差額	5,832千円
その他	1,025千円	その他	4,558千円
繰延税金資産 合計	99,475千円	繰延税金資産 合計	130,169千円
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22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
該当事項はありません。	同左

## (セグメント情報等)

## (セグメント情報)

前事業年度（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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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)

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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

## (1) 売上高

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が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、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)



当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31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）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）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」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（関連当事者情報）

前事業年度（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）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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	3,761,890	未払 手数料	333,570
							投資助言費用 の支払	692,451	未払費用	123,687

(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（非上場）

## (1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	1,064,441円67銭	1株当たり純資産額	1,144,367円30銭
1株当たり当期純利益	72,151円14銭	1株当たり当期純利益	85,292円63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		同左	

ては、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（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21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
当期純利益	432,906千円	511,755千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	432,906千円	511,755千円
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21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23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26期中間会計期間末

（平成23年9月30日）

### 資産の部

#### 流動資産

現金及び預金	6,348,503
未収委託者報酬	931,255
未収運用受託報酬	30,340
繰延税金資産	42,883
その他	46,838
流動資産合計	7,399,822

#### 固定資産

##### 有形固定資産

建物	25,631
器具備品	22,797
有形固定資産合計	1 48,428

無形固定資産 80,075

投資その他の資産

投資有価証券		230,782
敷金・保証金		222,422
繰延税金資産		95,717
その他		754
投資その他の資産合計		549,677
固定資産合計		678,181
資産合計		8,078,003

## 負債の部

流動負債		
未払金		489,894
未払費用		119,669
未払法人税等		143,080
賞与引当金		76,075
その他	2	32,182
流動負債合計		860,902
固定負債		
退職給付引当金		188,834
固定負債合計		188,834
負債合計		1,049,736

(単位：千円)

第26期中間会計期間末

(平成23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		56,500
その他利益剰余金		
別途積立金		5,100,000
繰越利益剰余金		1,583,847
利益剰余金合計		6,740,347
株主資本合計		7,040,347
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		12,079
評価・換算差額等合計		12,079
純資産合計		7,028,267

負債純資産合計	8,078,003
---------	-----------

## 中間損益計算書

（単位：千円）

第26期中間会計期間		
（自 平成23年4月1日		
至 平成23年9月30日）		
営業収益		
委託者報酬		4,032,339
運用受託報酬		51,906
営業収益合計		4,084,245
営業費用		
一般管理費	1	987,887
営業利益		330,990
営業外収益	2	14,771
営業外費用		75
経常利益		345,686
特別損失	1	16,061
税引前中間純利益		329,624
法人税、住民税及び事業税		139,960
法人税等調整額		5,977
法人税等合計		133,982
中間純利益		195,641

## 中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

第26期中間会計期間		
（自 平成23年4月1日		
至 平成23年9月30日）		
株主資本		
資本金		
当期首残高		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		
当期首残高		53,500
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	56,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	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	
当期首残高	1,421,205
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	162,641
当中間期末残高	1,583,847
利益剰余金合計	
当期首残高	6,574,705
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	165,641
当中間期末残高	6,740,347
株主資本合計	
当期首残高	6,874,705
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	165,641
当中間期末残高	7,040,347
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	8,501
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)	3,578
当中間期変動額合計	3,578
当中間期末残高	12,079
評価・換算差額等合計	
当期首残高	8,501
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)	3,578
当中間期変動額合計	3,578
当中間期末残高	12,079
純資産合計	
当期首残高	6,866,203
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	195,641
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	3,578

当中間期変動額合計	162,063
当中間期末残高	7,028,267

## 重要な会計方針

第26期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23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。

## 追加情報

<p>第26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）</p>
<p>当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

<p>第26期中間会計期間末 （平成23年9月30日）</p>							
1	有形固定資産の減価償却累計額						
	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">62,486千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">119,721千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">182,208千円</td> </tr> </table>	建 物	62,486千円	器具備品	119,721千円	計	182,208千円
建 物	62,486千円						
器具備品	119,721千円						
計	182,208千円						
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）

<p>第26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）</p>					
1	減価償却実施額				
	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">20,670千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">15,864千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	20,670千円	無形固定資産	15,864千円
有形固定資産	20,670千円				
無形固定資産	15,864千円				
2	営業外収益の主要項目				
	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">受取利息</td> <td style="text-align: right;">10,373千円</td> </tr> </table>	受取利息	10,373千円		
受取利息	10,373千円				

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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	当期首	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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

### (リ - ス取引関係)

第26期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

### (金融商品関係)

第26期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

平成23年9月30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	6,348,503	6,348,503	-
(2)未収委託者報酬	931,255	931,255	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	31,282	31,282	-
(4)未払金	(489,894)	(489,894)	-

(\*)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

「有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成23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	1,031	31
小計	1,000	1,031	31
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの			
その他	50,650	30,251	20,398
小計	50,650	30,251	20,398
計	51,650	31,282	20,367

（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26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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

(1)売上高

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26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23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26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,171,377円87銭
1株当たり中間純利益	32,606円94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いません。	

（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26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）
中間純利益	195,641千円
普通株式に係る中間純利益	195,641千円
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23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23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23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とき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もと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23年12月2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 石井 勝也

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22年11月11日から平成23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23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23年6月27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23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

[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23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23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23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、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、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中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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、我が国において一般に公正妥当と認められ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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

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23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23年4月1日から平成23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。

### 利害関係

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  
業務執行社員 公認会計士 石井勝也

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. 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22年6月29日

住信アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 壁谷 恵嗣 印  
業務執行社員

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

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

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

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

以上

---

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