【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4月9日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・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　鈴 木 郁 也
【本店の所在の場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号 （平成24年5月21日より、東京都港区芝3丁目33番1号（予定））
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長　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】	世界経済インデックスファンド
【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】

世界経済インデックスファンド
（以下「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。
②委託会社である三井住友トラスト・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又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。
③当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、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及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又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又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。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（http://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

(5)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜（※）3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成24年4月10日から平成25年4月9日までとします。
継続申込期間は、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り更新されます。

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(9)【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(11)【振替機関に関する事項】

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】

①受益権の取得申込みの方法

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

②受益権の取得申込みの受付の中止等

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、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並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。）及び外国金融商品市場（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で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

③受付不可日

申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

④振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(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従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(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従って支払われます。

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】

①ファンドの目的

国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、信託財産の中長期的な成長を目指します。

？ ＤＲ（預託証券）とは

ＤＲ（預託証券）とは、ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

②信託金限度額

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

③基本的性格

社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

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 追 加 型	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　）	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド ・オブ・ ファンズ	あり （　） なし
不動産投信 その他資産 （投資信託証券(資産複合 （株式、債券）（資産配分固定型）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類及び属性区分に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、これ以外の用語の定義については、社団法人投資信託協会のホームページhttp://www.toushin.or.jp/をご覧ください。

商品分類

「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。

「内 外」…目論見書又は投資信託約款において、国内及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。

「資産複合」…目論見書又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

「その他資産（投資信託証券）」…目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

「資産複合（株式、債券）資産配分固定型」…目論見書又は投資信託約款において、複数資産（株式、債券）を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

「年1回」…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

「グローバル（日本を含む）」…目論見書又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の資産（日本を含みます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「ファミリーファンド」…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。

「なし」…目論見書又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又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

④ファンドの特色

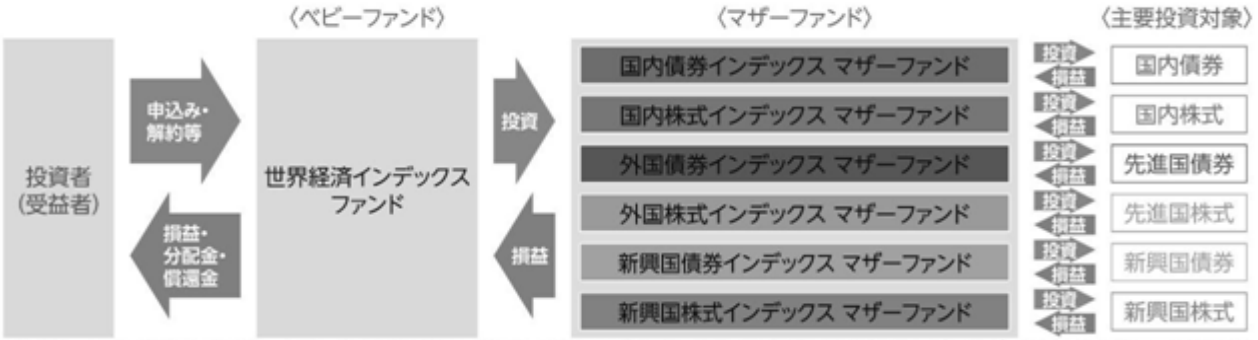
1.世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

・世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。

・各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数（インデックス）への連動を目指す運用を行います。

・原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



※マザーファンドの運用にあたっては、企業年金の運用等で国内外から定評のある三井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。

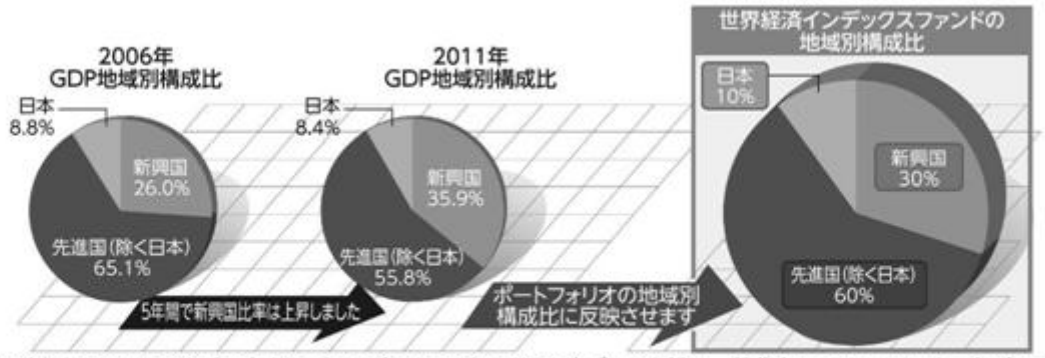
？ ファミリーファンド方式とは

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、その資金の全部又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.世界経済全体の発展を享受します。

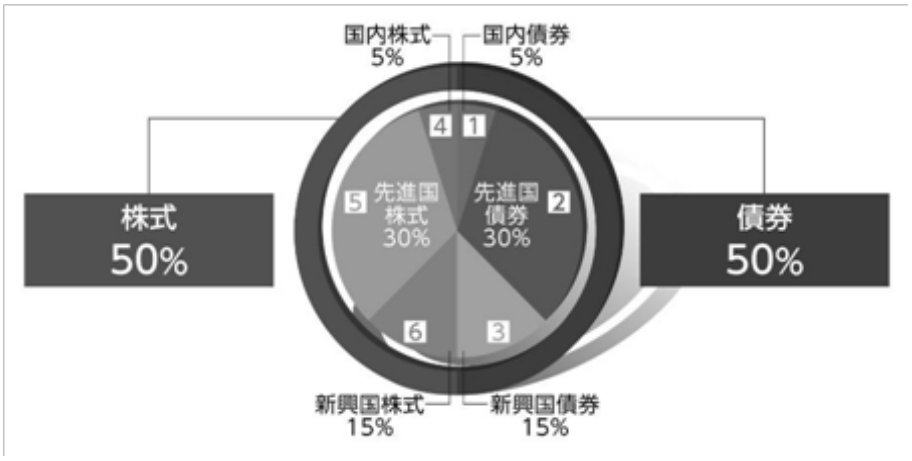
・基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。



(出所)IMF World Economic Outlook Database(September 2011)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※上記の地域別構成比は、2012年2月29日現在の基本組入比率であり、ファンドの実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
（2012年2月29日現在）



・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
・基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス
1 国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合)※1
2 先進国債券	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)※2
3 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)※3
4 国内株式	東証株価指数(TOPIX)※4
5 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)※5
6 新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)※6

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

※1「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全ての権利は、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。

※2「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・マーケッツ・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全ての権利は、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。

※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、世界の新興国の債券動向を測るためにJPモルガン社が開発した債券指数で、新興国の現地通貨建て債券で構成されている時価総額を加重平均し、指数化したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン社に帰属します。
「円換算ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

※4「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下㈱東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所第一部に上場されている全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、㈱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。

①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利及びTOPIXの商標に関する全ての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

②㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

④㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤当ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

⑥当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑦㈱東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

⑧㈱東京証券取引所は、委託会社又は「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑨前記の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」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「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及び公表を停止する権利を有しています。

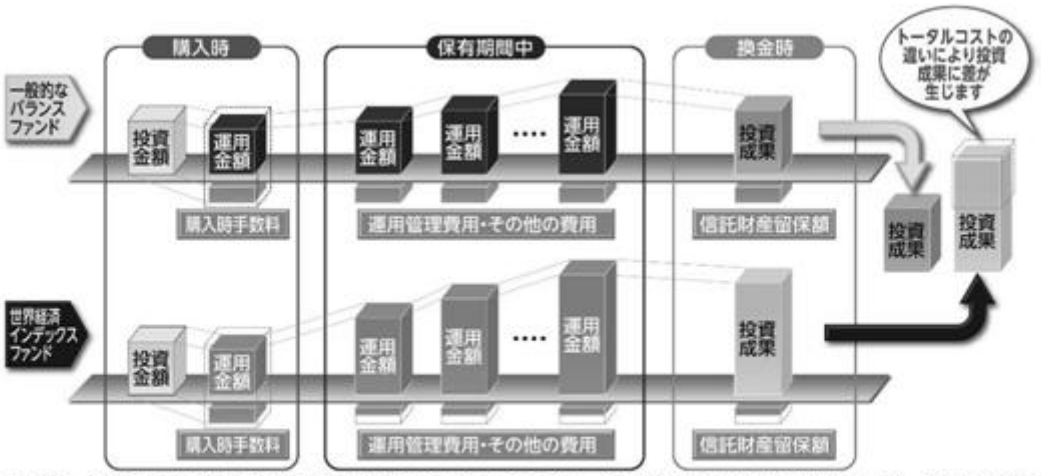
※6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、世界の新興国の株価動向を測るために、MSCI社が開発した株価指数で、各国の株式市場の時価総額等をベースに算出されます。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はMSCI社に帰属します。「円換算ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

3．魅力的な低コストファンドです。

・運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して**年率0.63%（税抜0.6%）**と、魅力的な低コストでご提供します。

※ご換金時には信託財産留保額として換金申込受付日の翌営業日の基準価額の**0.1%**がかかります。なお、一部のマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額をファンドが負担します。詳しくは後記「4手数料等及び税金 (4)その他の手数料等」をご覧ください。

コストが収益に与える影響（イメージ図）



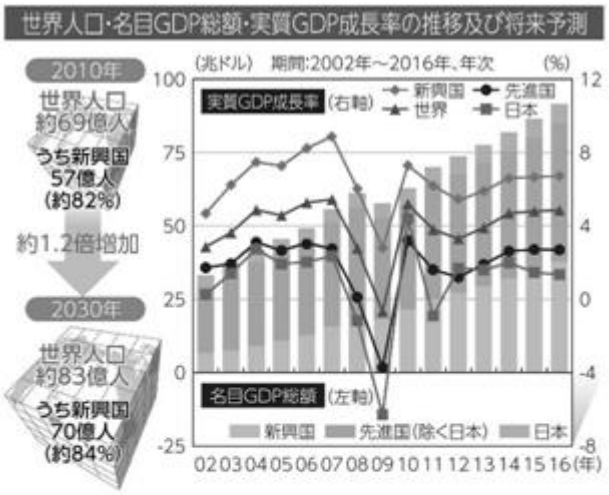
※上記はコストがファンドの収益に与える影響を分かりやすく説明するために一定の仮定に基づいて作成したイメージ図であり、ファンドに係る全てのコストを網羅したものではありません。また、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

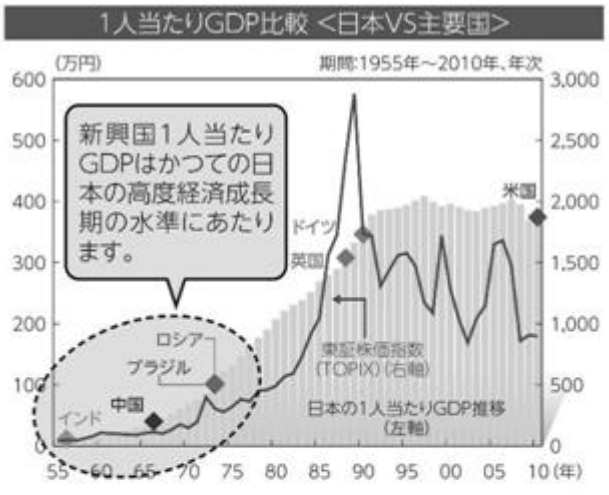
+i ご参考情報

世界経済は新興国の経済成長を下支えとして中長期的な成長が期待されています。

・**世界人口が増加し人々が生活水準の向上を目指し生産と消費を拡大することで、世界経済は長期にわたり持続的な成長を実現しました。新興国は経済のグローバル化進展による経済発展の恩恵を享受しつつ、今後は世界経済の成長を支えるものと期待されています。**



(出所)国連World Population Prospects(The 2010 Revision)及びIMF World Economic Outlook Database(September 2011及びUpdate January 2012)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※2030年の人口は国連推定、IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※先進国の名目GDP総額は日本を除く、実質GDP成長率は日本を含む数値です。



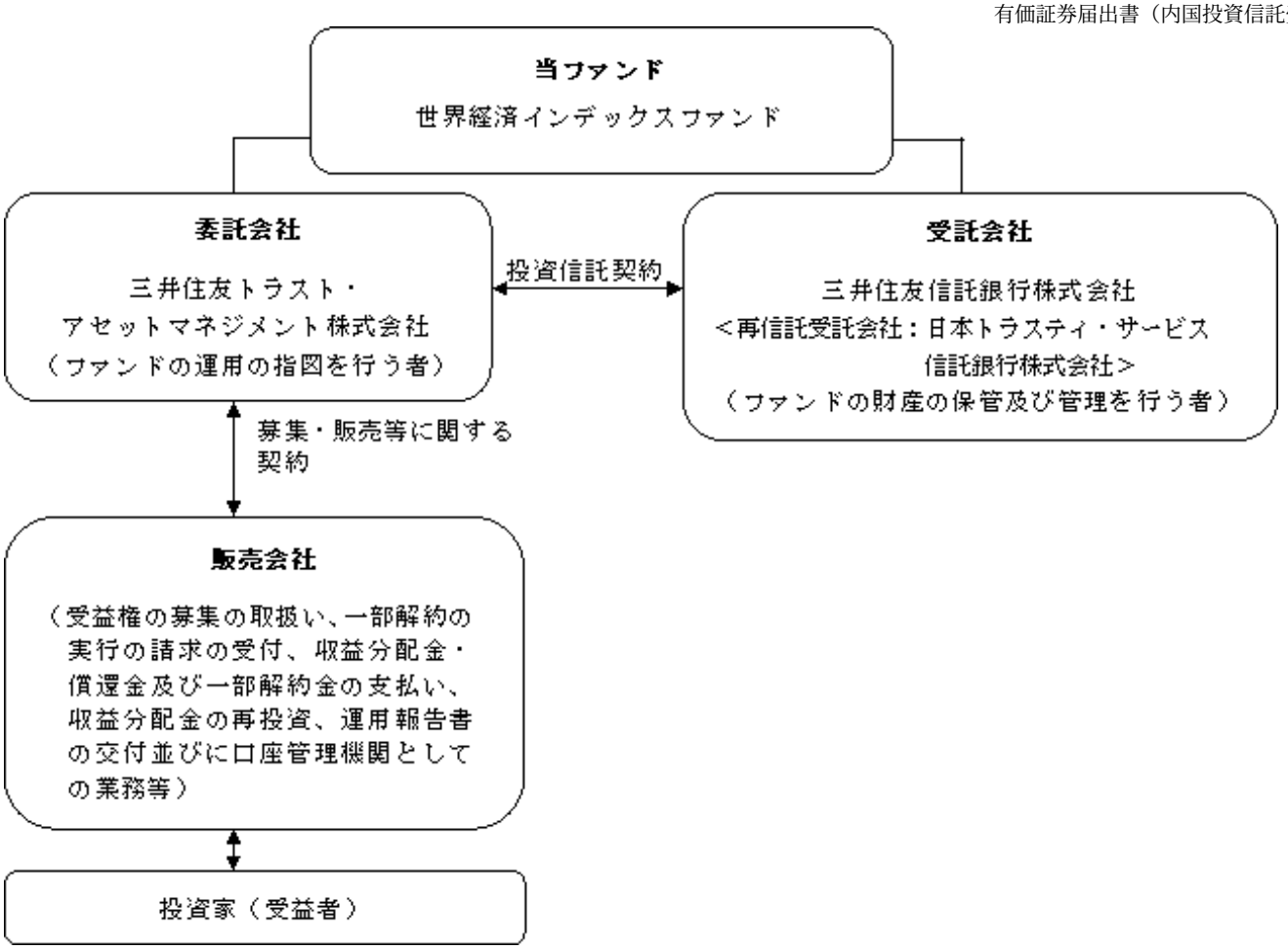
(出所)総務省、内閣府、IMF World Economic Outlook Database(September 2011)及びBloombergデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※上記新興国が日本と同じ軌跡をたどるとは限りません。
※主な新興国(インド、中国、ブラジル、ロシア)及び主な先進国(米国、英国、ドイツ)の1人当たりGDPは米ドル建てデータを2011年12月30日の三菱東京UFJ銀行の為替データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが円換算しています。
※指数に関する著作権等の知的財産権、その他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

(2)【ファンドの沿革】

平成12年 5月30日	当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」及び「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12月11日	当ファンドの主要投資対象である「住信 新興国債券インデックス 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12月12日	当ファンドの主要投資対象である「住信 新興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21年 1月16日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
平成24年 4月 1日	当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」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3)【ファンドの仕組み】

①当ファンドの関係法人



②委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成24年4月1日現在）

ロ．委託会社の沿革

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許可
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）
平成24年 4月1日	中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・ アセットマネジメント株式会社に商号変更

ハ.大株主の状況（平成24年4月1日現在）

株 主 名	住　　所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新

興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「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、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。

②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。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、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。

ニ．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回見直しを行う場合があります。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、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。

ヘ．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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所並びに等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ト．ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．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。）

1.有価証券

2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記(5)①ヘ.、ト.及びチ.に定めるものに限ります。）

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井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並びに7.から28.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

に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス マザーファンド
2.国内株式インデックス マザーファンド
3.外国債券インデックス マザーファンド
4.外国株式インデックス マザーファンド
5.新興国債券インデックス マザーファンド
6.新興国株式インデックス マザーファンド
7.株券又は新株引受権証書
8.国債証券
9.地方債証券
10.特別の法律により法人の発行する債券
11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16.コマーシャル・ペーパー
17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの
19.証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.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。）
26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28.外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ.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。

（参考）「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並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及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並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号及び第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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

（参考）「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②株式への組入比率は、原則として、100％に近い状態を維持します。

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

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

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

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

（参考）「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並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及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並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（参考）「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目指して、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100％に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10％以

下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（参考）「新興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、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）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

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（参考）「新興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、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）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

取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用す

ることがあります。

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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

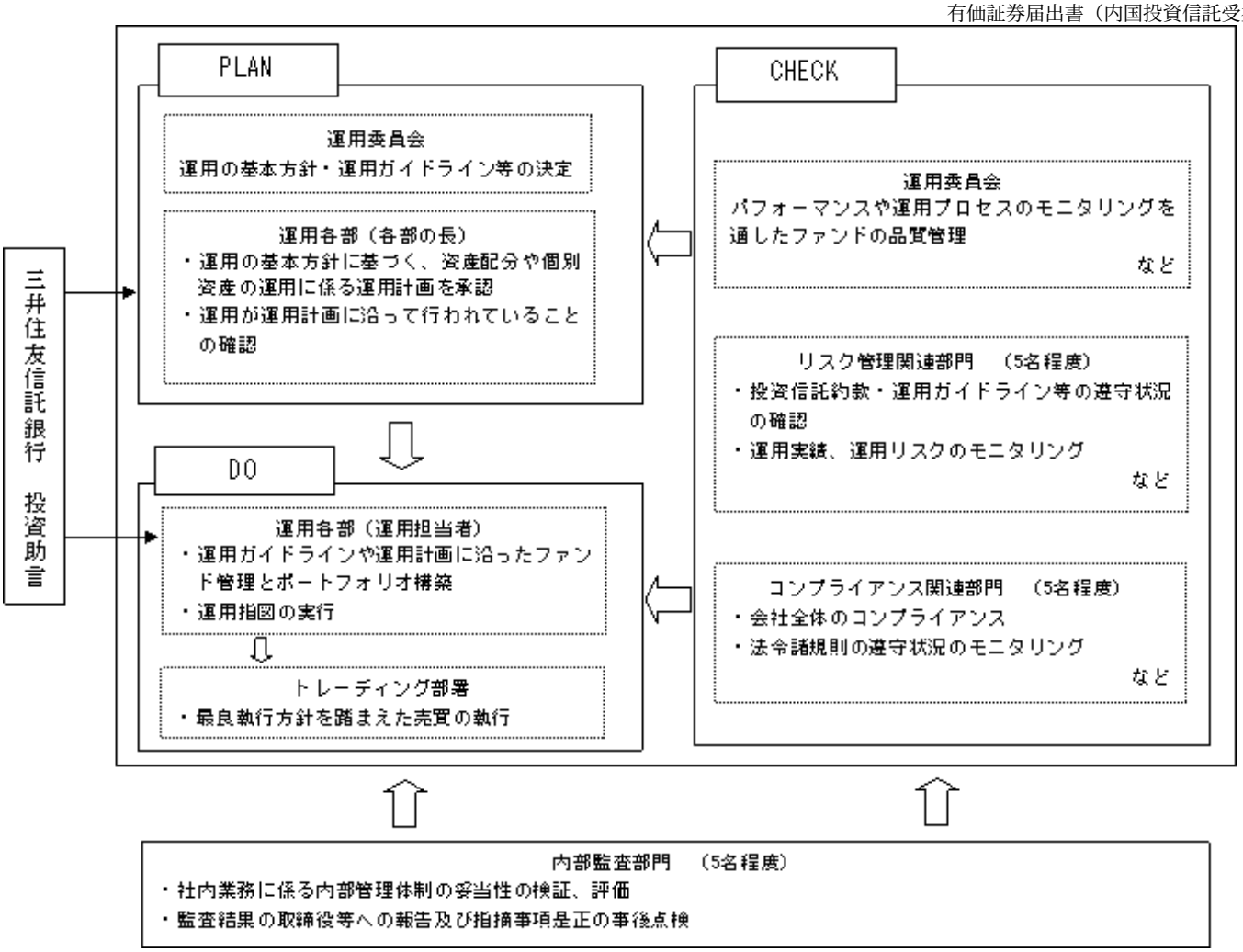
①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(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当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、委員会等の名称、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。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託先受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

(4)【分配方針】

①分配方針

毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として、以下の方針に基づき収益分配を行います。

イ．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。）及び売買益（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。

ロ．分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準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。

ハ．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、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

②収益の分配

イ．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。

（イ）投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及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（後記「4手数料等及び税金 (4)その他の手数料等 ①」の記載をご参照ください。）、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬及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。

（ロ）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。）、信託報酬及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。

ロ．上記イ．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。

ハ．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。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5)【投資制限】

①約款に定める投資制限

イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きま

す。）の行使により取得可能な株券

ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及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、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図するこ

とができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．委託会社は、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。

ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ワ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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、又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又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、解約代金及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。

②関連法令に基づく投資制限

イ．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

委託会社は、運用財産に関し、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会社等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用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（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。

ロ．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、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全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当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、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。従って、投資者の皆様の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及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及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ます。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及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ます。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

④信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑥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、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴い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分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益率を示すものではありません。
投資者の当ファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

③当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。

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

①委託会社では、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います（運用を外部委託しているファンドも含みます。）。

②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、コンプライアンスに関する委員会等に報告され、委員会等は適切な運用リスク管理・法令遵守に必要な措置を講じます。

③内部監査部門は、独立した立場でリスク管理体制の適切性・有効性を検証し、評価を行います。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜 3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

②「分配金再投資コース」（※）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱コースが異なる場合があります。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「第2 管理及び運営 1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.63%（税抜 0.6%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
販売会社	年率 0.315%	（税抜 0.3%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

平成24年4月20日以降、以下の内容となります。

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.525%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.21%	（税抜 0.2%）
販売会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用、組入資産の保管に要する費用（消費税等相当額を含みま

す。）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

⑥ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額(※)として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

※「信託財産留保額」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徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰入れられます。

手数料等の合計額については、当ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率 （内 訳）
平成24年12月31日まで	10% （所得税7%、住民税3%）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147% （所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315% （所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20% （所得税15%、住民税5%）

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

②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並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率 （所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%

平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

イ．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（申込手数料及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）に当たります。

ロ．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。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（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元本払戻金（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。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）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「元本払戻金（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、

イ．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又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、

ロ．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元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※上記は、平成24年2月29日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

※平成24年4月1日をもって「住信 国内債券インデックス マザーファンド」は「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」は「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」は「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」は「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」は「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれファンド名称を変更しました。（以下同じ。）

(1)【投資状況】

（平成24年2月29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	76,618,749	3.88
住信 国内株式インデックス マザーファンド	日本	92,888,439	4.70
住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	577,992,786	29.25

住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	613,375,594	31.04
住信 新興国債券インデックス マザーファンド	日本	297,313,177	15.05
住信 新興国株式インデックス マザーファンド	日本	292,417,639	14.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		25,222,631	1.28
合計(純資産総額)		1,975,829,015	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24年2月29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	146,006,943,700	76.28
	ポーランド	99,063,000	0.05
	小計	146,106,006,700	76.33
地方債証券	日本	12,458,987,202	6.51
特殊債券	日本	18,143,813,101	9.48
	アメリカ	101,790,000	0.05
	スウェーデン	97,224,000	0.05
	小計	18,342,827,101	9.58
社債券	日本	12,829,078,200	6.70
	アメリカ	601,695,000	0.31
	オーストラリア	402,473,000	0.21
	イギリス	195,125,000	0.10
	オランダ	101,158,000	0.05
	小計	14,129,529,200	7.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		366,771,777	0.19
合計(純資産総額)		191,404,121,980	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24年2月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	126,681,005,940	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,581,973,328	1.23
合計(純資産総額)		128,262,979,268	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24年2月29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	84,668,070,938	40.21
	フランス	19,905,100,819	9.45
	イタリア	19,515,344,139	9.27
	ドイツ	19,399,176,956	9.21
	イギリス	17,759,841,644	8.43
	スペイン	9,510,278,774	4.52
	カナダ	6,177,072,837	2.93
	ベルギー	5,420,109,164	2.57
	オランダ	5,280,286,941	2.51
	オーストリア	3,671,623,624	1.74
	メキシコ	1,855,413,007	0.88
	オーストラリア	1,839,275,162	0.87
	デンマーク	1,813,609,902	0.86
	ポーランド	1,571,645,639	0.75
	アイルランド	1,524,723,257	0.72
	フィンランド	1,300,747,747	0.62
	スウェーデン	1,287,010,140	0.61
	マレーシア	1,192,168,263	0.57
	スイス	963,139,151	0.46
	シンガポール	804,203,527	0.38
	ノルウェー	677,257,142	0.32
	小計	206,136,098,773	97.89
特殊債券	オーストラリア	1,240,901,416	0.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,196,933,941	1.52
合計(純資産総額)		210,573,934,130	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24年2月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	70,626,793,821	52.93
	イギリス	13,237,236,791	9.92
	カナダ	7,336,998,820	5.50
	スイス	5,580,884,641	4.18
	フランス	5,219,413,739	3.91

	ドイツ	5,160,115,617	3.87
	オーストラリア	4,778,612,470	3.58
	スウェーデン	1,935,766,347	1.45
	スペイン	1,861,081,359	1.39
	オランダ	1,687,854,632	1.27
	香港	1,464,463,625	1.10
	イタリア	1,391,222,642	1.04
	シンガポール	1,008,241,403	0.76
	アイルランド	834,288,956	0.63
	デンマーク	694,589,539	0.52
	バミューダ	614,419,744	0.46
	アンティル	611,228,249	0.46
	ベルギー	589,871,445	0.44
	フィンランド	537,799,816	0.40
	ノルウェー	490,791,740	0.37
	ジャージー	405,096,521	0.30
	イスラエル	367,924,746	0.28
	ルクセンブルグ	292,096,478	0.22
	オーストリア	161,398,604	0.12
	ケイマン島	153,777,345	0.12
	ポルトガル	110,072,945	0.08
	パナマ	78,972,502	0.06
	ニュージーランド	72,120,558	0.05
	マン島	44,570,975	0.03
	ギリシャ	37,225,681	0.03
	ガーンジー	35,567,962	0.03
	リベリア	23,394,944	0.02
	モーリシャス	23,009,541	0.02
	小計	127,466,904,198	95.53
投資信託受益証券	オーストラリア	31,454,928	0.02
	シンガポール	24,039,412	0.02
	香港	363,048	0.00
	小計	55,857,388	0.04
投資証券	アメリカ	1,640,437,027	1.23
	オーストラリア	349,189,525	0.26
	フランス	157,615,721	0.12
	イギリス	144,727,547	0.11
	香港	48,631,440	0.04

	シンガポール	34,863,098	0.03
	カナダ	31,154,945	0.02
	オランダ	17,085,430	0.01
	小計	2,423,704,733	1.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,479,080,306	2.61
合計(純資産総額)		133,425,546,625	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 新興国債券インデックス マザーファンドの投資状況

（平成24年2月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	南アフリカ	565,351,026	9.88
	ポーランド	564,814,981	9.87
	マレーシア	561,213,063	9.81
	トルコ	558,458,588	9.76
	メキシコ	552,040,462	9.65
	インドネシア	544,788,002	9.52
	ブラジル	528,285,032	9.23
	タイ	468,702,675	8.19
	ハンガリー	318,536,503	5.57
	コロンビア	234,115,267	4.09
	ロシア	189,278,622	3.31
	ペルー	119,459,381	2.09
	フィリピン	27,696,065	0.48
	小計	5,232,739,667	91.47
特殊債券	国際機関	344,902,885	6.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		143,062,273	2.50
合計(純資産総額)		5,720,704,825	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 新興国株式インデックス マザーファンドの投資状況

（平成24年2月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ブラジル	1,946,451,547	14.77
	韓国	1,837,159,991	13.94
	台湾	1,338,566,415	10.16
	中国	1,268,908,094	9.63

	南アフリカ	936,159,031	7.10
	ロシア	859,530,075	6.52
	インド	853,612,779	6.48
	メキシコ	568,214,276	4.31
	香港	561,295,583	4.26
	マレーシア	412,928,585	3.13
	ケイマン島	370,695,706	2.81
	インドネシア	329,498,481	2.50
	タイ	254,241,641	1.93
	チリ	225,497,179	1.71
	ポーランド	168,012,018	1.27
	トルコ	166,662,703	1.26
	コロンビア	119,562,457	0.91
	バミューダ	97,065,063	0.74
	フィリピン	90,332,544	0.69
	チェコ	48,082,028	0.36
	ハンガリー	42,558,671	0.32
	エジプト	37,059,635	0.28
	ペルー	28,009,130	0.21
	アメリカ	17,072,146	0.13
	モロッコ	13,590,028	0.10
	ルクセンブルグ	2,957,733	0.02
	小計	12,593,723,539	95.54
投資信託受益証券	南アフリカ	37,013,153	0.28
	ブラジル	26,512,663	0.20
	小計	63,525,816	0.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		523,718,961	3.97
合計(純資産総額)		13,180,968,316	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24年2月29日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

ａ．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	住信 外国株式インデックスマザーファンド	641,606,270	0.8662	555,759,352	0.9560	613,375,594	31.04
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	315,601,609	1.6961	535,291,890	1.8314	577,992,786	29.25

日本	親投資信託受益証券	住信 新興国債券インデックスマザーファンド	221,577,864	1.2139	268,973,370	1.3418	297,313,177	15.05
日本	親投資信託受益証券	住信 新興国株式インデックスマザーファンド	164,965,384	1.5718	259,292,591	1.7726	292,417,639	14.80
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	141,576,649	0.5935	84,025,742	0.6561	92,888,439	4.70
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	62,215,793	1.2281	76,407,216	1.2315	76,618,749	3.88

(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	98.72
合計	98.72

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄
a．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第９９回利付国債（５年）	2,220,000,000	100.08	2,221,982,200	100.53	2,231,943,600	0.4	2016/09/20	1.17
日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	2,060,000,000	106.78	2,199,838,000	106.89	2,202,119,400	1.7	2017/03/20	1.15
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	101.03	2,162,042,000	0.5	2014/12/20	1.13
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	104.86	2,055,275,600	1.3	2019/12/20	1.07
日本	国債証券	第２８４回利付国債（１０年）	1,920,000,000	106.66	2,047,972,700	106.66	2,048,006,400	1.7	2016/12/20	1.07
日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	1,880,000,000	105.46	1,982,702,000	106.43	2,001,034,400	1.5	2018/09/20	1.05
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	103.20	1,888,578,300	1.2	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	1,740,000,000	106.89	1,860,008,000	107.28	1,866,759,000	1.7	2017/09/20	0.98
日本	国債証券	第２６４回利付国債（１０年）	1,800,000,000	104.01	1,872,190,000	103.50	1,863,018,000	1.5	2014/09/20	0.97
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	100.76	1,773,534,400	0.4	2015/06/20	0.93
日本	国債証券	第２５６回利付国債（１０年）	1,720,000,000	102.81	1,768,497,600	102.32	1,760,041,600	1.4	2013/12/20	0.92
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	101.47	1,694,565,700	0.7	2014/09/20	0.89

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	101.76	1,679,073,000	1.0	2020/09/20	0.88
日本	国債証券	第３１８回利付国債（１０年）	1,650,000,000	99.47	1,641,262,700	100.61	1,660,114,500	1.0	2021/09/20	0.87
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	106.28	1,647,479,500	1.5	2017/12/20	0.86
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	100.72	1,621,624,200	0.8	2013/03/20	0.85
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	102.89	1,563,973,600	1.1	2020/06/20	0.82
日本	国債証券	第３０６回利付国債（１０年）	1,480,000,000	103.60	1,533,412,000	105.44	1,560,645,200	1.4	2020/03/20	0.82
日本	国債証券	第２８０回利付国債（１０年）	1,450,000,000	107.28	1,555,654,600	107.00	1,551,616,000	1.9	2016/06/20	0.81
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	101.34	1,550,639,700	0.7	2014/06/20	0.81
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	101.07	1,506,002,600	0.5	2015/03/20	0.79
日本	国債証券	第２６９回利付国債（１０年）	1,450,000,000	103.70	1,503,732,000	103.49	1,500,706,500	1.3	2015/03/20	0.78
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	100.59	1,478,731,800	0.4	2016/06/20	0.77
日本	国債証券	第９４回利付国債（５年）	1,310,000,000	101.01	1,323,344,000	101.46	1,329,230,800	0.6	2015/12/20	0.69
日本	国債証券	第３１５回利付国債（１０年）	1,270,000,000	101.13	1,284,394,100	102.70	1,304,340,800	1.2	2021/06/20	0.68
日本	国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	1,250,000,000	101.78	1,272,250,000	103.82	1,297,762,500	1.3	2021/03/20	0.68
日本	国債証券	第８１回利付国債（５年）	1,270,000,000	101.62	1,290,597,900	101.41	1,287,970,500	0.8	2014/03/20	0.67
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	104.63	1,276,498,200	1.5	2015/09/20	0.67
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	100.40	1,265,103,000	0.3	2015/09/20	0.66
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	106.42	1,234,472,000	1.7	2016/09/20	0.64

(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	76.33
地方債証券	6.51
特殊債券	9.58
社債券	7.38
合計	99.81

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

ｃ．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄
ａ．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,440,800	3,289.95	4,740,159,960	3,355.00	4,833,884,000	3.77
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	8,301,500	371.43	3,083,426,145	420.00	3,486,630,000	2.72
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	937,400	3,001.74	2,813,831,076	3,095.00	2,901,253,000	2.26
日本	株式	キヤノン	電気機器	690,200	3,808.99	2,628,964,898	3,680.00	2,539,936,000	1.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	829,300	2,328.60	1,931,107,980	2,757.00	2,286,380,100	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	505,000	3,837.77	1,938,073,850	3,835.00	1,936,675,000	1.51
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,090,700	125.24	1,764,719,268	136.00	1,916,335,200	1.49
日本	株式	ファナック	電気機器	115,700	12,289.14	1,421,853,498	14,730.00	1,704,261,000	1.33
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	435,900	3,783.86	1,649,384,574	3,670.00	1,599,753,000	1.25
日本	株式	三菱商事	卸売業	798,600	2,003.58	1,600,058,988	1,991.00	1,590,012,600	1.24
日本	株式	三井物産	卸売業	946,600	1,353.73	1,281,440,818	1,399.00	1,324,293,400	1.03
日本	株式	小松製作所	機械	542,700	2,390.37	1,297,253,799	2,422.00	1,314,419,400	1.02
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,036	148,448.03	1,341,376,399	138,800.00	1,254,196,800	0.98
日本	株式	ソニー	電気機器	693,200	2,058.49	1,426,945,268	1,737.00	1,204,088,400	0.94
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	496,800	3,010.32	1,495,526,976	2,421.00	1,202,752,800	0.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,760	318,522.34	879,121,658	432,000.00	1,192,320,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,495,000	453.33	1,131,058,350	473.00	1,180,135,000	0.92
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,403,700	789.73	1,108,544,001	832.00	1,167,878,400	0.91
日本	株式	三菱地所	不動産業	768,000	1,409.04	1,082,142,720	1,470.00	1,128,960,000	0.88
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	458,700	2,109.10	967,444,170	2,246.00	1,030,240,200	0.80
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	193,200	4,659.54	900,223,128	5,210.00	1,006,572,000	0.78
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,269,500	928.31	1,178,489,545	759.00	963,550,500	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	416,300	2,161.02	899,632,626	2,245.00	934,593,500	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	208,700	4,112.20	858,216,140	4,355.00	908,888,500	0.71
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,376,500	392.91	933,750,615	375.00	891,187,500	0.69
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,702	569,431.57	969,172,532	516,000.00	878,232,000	0.68
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	1,513	560,352.79	847,813,771	577,000.00	873,001,000	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	258,300	3,096.15	799,735,545	3,340.00	862,722,000	0.67
日本	株式	東芝	電気機器	2,339,000	413.76	967,784,640	356.00	832,684,000	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,111,000	883.51	981,579,610	729.00	809,919,000	0.63

(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	98.77
合計	98.77

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.77
		建設業	2.34
		食料品	3.43
		繊維製品	0.89
		パルプ・紙	0.37
		化学	5.80
		医薬品	4.67
		石油・石炭製品	0.84
		ゴム製品	0.77
		ガラス・土石製品	1.13
		鉄鋼	1.94
		非鉄金属	1.21
		金属製品	0.69
		機械	5.13
		電気機器	13.50
		輸送用機器	10.41
		精密機器	1.39
		その他製品	1.57
		電気・ガス業	3.00
		陸運業	3.81
		海運業	0.42
		空運業	0.29
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.03
		卸売業	5.62
		小売業	3.97
		銀行業	9.73
		証券、商品先物取引業	1.22
		保険業	2.42
		その他金融業	0.80
		不動産業	2.46
		サービス業	1.82
合計			98.77

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	55	431,591,200	458,425,000	458,425,000	0.36

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

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価（円）	帳簿価額 金額（円）	評価額 単価（円）	評価額 金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	8,542.31	3,194,826,827	8,509.53	3,182,565,673	2.625	2014/07/31	1.51
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	27,000,000	8,205.40	2,215,460,193	8,406.47	2,269,749,020	1.750	2015/07/31	1.08
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	25,100,000	8,372.59	2,101,521,780	8,337.14	2,092,623,012	1.875	2014/04/30	0.99
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	8,331.66	1,882,955,666	8,291.44	1,873,866,741	1.750	2014/01/31	0.89
アメリカ	国債証券	T 3.375% 07/31/13	21,000,000	8,561.91	1,798,002,583	8,425.38	1,769,331,317	3.375	2013/07/31	0.84
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	9,154.60	1,647,828,837	9,336.81	1,680,627,438	3.625	2021/02/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	18,400,000	7,848.65	1,444,151,830	8,688.85	1,598,749,844	2.625	2020/08/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	17,500,000	7,806.42	1,366,123,561	8,668.68	1,517,020,373	2.625	2020/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/40	14,300,000	8,059.93	1,152,570,276	9,977.21	1,426,741,973	4.250	2040/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	16,000,000	8,380.31	1,340,851,178	8,831.30	1,413,009,356	2.750	2017/05/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.625% 02/28/13	16,700,000	8,100.46	1,352,777,005	8,102.66	1,353,145,426	0.625	2013/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	15,900,000	8,255.83	1,312,677,466	8,435.78	1,341,290,190	1.875	2015/06/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/15/13	16,200,000	8,052.87	1,304,565,345	8,098.57	1,311,968,361	0.500	2013/10/15	0.62
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 04/25/16	11,100,000	11,265.00	1,250,415,039	11,636.41	1,291,642,065	3.250	2016/04/25	0.61
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/13	15,000,000	8,342.58	1,251,388,108	8,309.72	1,246,458,729	2.000	2013/11/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	14,500,000	8,434.21	1,222,960,682	8,532.22	1,237,172,644	2.375	2015/02/28	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,430.42	1,180,260,161	8,803.25	1,232,456,331	2.750	2016/11/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	14,400,000	8,528.36	1,228,083,851	8,496.61	1,223,512,200	2.625	2014/06/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/15/13	15,000,000	8,090.69	1,213,603,687	8,135.44	1,220,316,521	0.750	2013/12/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/16	14,000,000	8,555.51	1,197,772,691	8,547.03	1,196,585,250	2.125	2016/02/29	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.75% 09/15/13	14,200,000	8,108.69	1,151,434,285	8,129.14	1,154,337,929	0.750	2013/09/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/40	12,300,000	7,560.52	929,944,304	9,377.78	1,153,468,092	3.875	2040/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	9,032.37	1,129,047,265	9,097.30	1,137,162,543	4.250	2015/08/15	0.54
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,800,000	11,107.80	1,088,565,306	11,196.70	1,097,277,428	4.250	2014/08/01	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	8,984.97	1,078,197,354	8,836.66	1,060,399,933	4.250	2014/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,443.35	1,055,418,889	8,469.82	1,058,728,029	2.375	2014/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/15/39	10,000,000	8,255.98	825,598,440	10,165.04	1,016,504,972	4.375	2039/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	11,250,000	8,180.00	920,250,488	8,982.58	1,010,540,640	3.125	2021/05/15	0.48
イギリス	国債証券	UKT 4% 09/07/16	6,800,000	14,055.89	955,800,741	14,660.35	996,904,075	4.000	2016/09/07	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 01/31/13	12,000,000	8,408.46	1,009,016,352	8,267.49	992,099,266	2.875	2013/01/31	0.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.89
特殊債券	0.59
合計	98.48

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	66,071	27,739.39	1,832,769,738	43,196.87	2,854,060,979	2.14
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	346,511	6,608.49	2,289,917,527	7,030.45	2,436,130,061	1.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	537,388	2,012.96	1,081,743,772	2,571.27	1,381,770,502	1.04
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	85,113	13,578.44	1,155,702,104	15,973.02	1,359,512,195	1.02
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,748	8,293.09	1,183,823,039	8,843.33	1,262,368,356	0.95
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	235,183	4,864.12	1,143,959,086	5,002.14	1,176,419,349	0.88
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	755,460	1,536.95	1,161,107,268	1,545.82	1,167,811,825	0.88
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	195,844	5,309.55	1,039,843,666	5,437.02	1,064,808,763	0.80
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	425,607	2,499.46	1,063,790,396	2,463.16	1,048,338,308	0.79
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	195,298	5,367.64	1,048,289,434	5,258.72	1,027,017,967	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	556,038	1,670.88	929,074,330	1,712.02	951,953,514	0.71
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,276,463	792.65	1,011,801,033	718.53	917,180,417	0.69
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	357,467	2,246.93	803,206,186	2,530.93	904,724,526	0.68
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,118	42,603.07	771,882,494	49,891.70	903,937,914	0.68
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	277,876	3,405.50	946,307,496	3,163.46	879,050,389	0.66

イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,350,027	583.25	787,408,377	641.45	865,975,777	0.65
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	125,181	5,684.71	711,618,033	6,765.82	846,952,714	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	374,226	1,789.48	669,670,840	2,197.72	822,445,162	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	147,273	5,386.19	793,241,361	5,554.81	818,074,711	0.61
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,622,589	215.82	781,861,934	221.41	802,106,574	0.60
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	257,918	2,736.41	705,769,652	2,981.14	768,891,304	0.58
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	166,323	4,787.44	796,262,164	4,459.98	741,797,652	0.56
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	50,070	13,238.31	662,842,557	14,271.22	714,560,085	0.54
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	228,875	3,786.22	866,572,796	3,116.68	713,331,279	0.53
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	151,279	4,233.00	640,364,612	4,556.23	689,263,090	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	288,418	2,673.73	771,153,358	2,371.18	683,892,493	0.51
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	219,561	2,893.99	635,407,689	3,096.49	679,870,285	0.51
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	361,634	1,691.94	611,866,610	1,803.71	652,286,044	0.49
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	135,098	4,401.90	594,687,994	4,754.47	642,319,712	0.48
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	391,984	1,327.99	520,551,929	1,629.73	638,830,436	0.48

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	95.53
投資信託受益証券	0.04
投資証券	1.82
合計	97.39

(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	12.28
		素材	7.38
		資本財	7.39
		商業・専門サービス	0.81
		運輸	1.72
		自動車・自動車部品	1.36
		耐久消費財・アパレル	1.25
		消費者サービス	1.65
		メディア	2.51

		小売	2.71
		食品・生活必需品小売り	2.17
		食品・飲料・タバコ	6.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.71
		ヘルスケア機器・サービス	2.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.42
		銀行	7.19
		各種金融	4.50
		保険	3.90
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	5.79
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.79
		電気通信サービス	3.84
		公益事業	3.53
		半導体・半導体製造装置	1.67
合計			95.53

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	64	20,196,912	21,942,400	1,770,312,832	1.33
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	14	1,927,823	2,024,960	164,366,003	0.12
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	180	4,146,500	4,537,800	493,031,970	0.37
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	21	2,199,593	2,234,925	194,840,761	0.15
	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	43	2,361,035	2,538,935	326,176,979	0.24
	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	22	1,287,196	1,341,340	121,002,281	0.09

（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 新興国債券インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/14	4,800,000	4,727.55	226,922,564	4,766.75	228,804,355	10.000	2014/01/01	4.00
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	65,000,000	287.97	187,185,145	291.19	189,278,622	7.850	2018/03/10	3.31
トルコ	国債証券	TURKGB 11% 08/06/14	3,200,000	4,739.19	151,654,367	4,808.59	153,875,161	11.000	2014/08/06	2.69
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	2,630,000,000	5.80	152,593,357	5.73	150,867,648	12.000	2015/10/22	2.64
国際機関	特殊債券	IBRD 6.25% 12/11/13	43,300,000	282.75	122,430,919	280.79	121,583,789	6.250	2013/12/11	2.13
トルコ	国債証券	TURKGB 8% 10/09/13	2,500,000	4,468.40	111,710,151	4,538.59	113,464,777	8.000	2013/10/09	1.98
トルコ	国債証券	TURKGB 8% 01/29/14	2,500,000	4,451.42	111,285,584	4,533.01	113,325,325	8.000	2014/01/29	1.98
マレーシア	国債証券	MGS 5.094% 04/30/14	3,500,000	2,818.89	98,661,399	2,812.09	98,423,468	5.094	2014/04/30	1.72
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	1,730,000	5,616.43	97,164,341	5,681.18	98,284,586	12.500	2016/01/05	1.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	7,600,000	1,275.61	96,947,079	1,282.70	97,485,307	10.500	2026/12/21	1.70
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 04/25/14	3,600,000	2,695.48	97,037,287	2,690.80	96,869,134	5.750	2014/04/25	1.69
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	2,020,000	4,701.10	94,962,312	4,734.28	95,632,569	10.000	2015/06/17	1.67
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/13	2,000,000	4,754.36	95,087,361	4,780.20	95,604,013	10.000	2013/01/01	1.67
ポーランド	国債証券	POLGB 5% 10/24/13	3,400,000	2,651.96	90,166,880	2,652.33	90,179,502	5.000	2013/10/24	1.58
ポーランド	国債証券	POLGB 5% 04/25/16	3,200,000	2,632.71	84,246,984	2,645.48	84,655,593	5.000	2016/04/25	1.48
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	1,420,000,000	5.44	77,249,520	5.40	76,814,829	7.750	2021/04/14	1.34
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	6,800,000	1,129.49	76,805,669	1,128.84	76,761,749	8.250	2017/09/15	1.34
インドネシア	国債証券	INDOGB 11% 09/15/25	5,850,000,000	1.27	74,584,260	1.30	76,439,376	11.000	2025/09/15	1.34
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	7,600,000	1,004.23	76,322,188	1,003.39	76,257,763	6.750	2021/03/31	1.33
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	5,500,000	1,320.21	72,611,971	1,308.35	71,959,680	13.500	2015/09/15	1.26
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/19/13	10,500,000	674.73	70,846,650	665.11	69,837,201	8.000	2013/12/19	1.22
国際機関	特殊債券	EIB 6.5% 12/15/15	25,000,000	268.82	67,205,520	277.59	69,397,762	6.500	2015/12/15	1.21
ハンガリー	国債証券	HGB 5.5% 02/12/14	190,500,000	35.50	67,644,294	35.92	68,434,396	5.500	2014/02/12	1.20
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	6,300,000	1,044.40	65,797,535	1,046.83	65,950,606	7.250	2020/01/15	1.15
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 05/22/15	24,100,000	270.93	65,294,515	269.78	65,018,139	3.625	2015/05/22	1.14
メキシコ	国債証券	MBONO 9.5% 12/18/14	9,100,000	715.37	65,099,272	705.29	64,181,508	9.500	2014/12/18	1.12
マレーシア	国債証券	MGS 4.378% 11/29/19	2,150,000	2,829.66	60,837,712	2,861.03	61,512,149	4.378	2019/11/29	1.08
ハンガリー	国債証券	HGB 6.75% 02/24/17	170,000,000	35.40	60,195,990	34.90	59,345,684	6.750	2017/02/24	1.04
インドネシア	国債証券	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,600,000,000	1.22	56,479,888	1.27	58,628,196	10.500	2030/08/15	1.02
タイ	国債証券	THAIGB 5.25% 05/12/14	20,800,000	279.79	58,197,081	278.53	57,934,599	5.250	2014/05/12	1.01

(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	91.47
特殊債券	6.03
合計	97.50

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 新興国株式インデックス マザーファンドの投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	4,558	71,105.58	324,099,268	85,438.50	389,428,683	2.95
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	222,442	940.60	209,231,074	1,071.43	238,331,121	1.81
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,009,389	202.35	204,259,072	215.94	217,970,488	1.65
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	249,000	790.21	196,764,635	852.80	212,347,200	1.61
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	171,640	1,041.69	178,797,017	1,157.37	198,652,377	1.51
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,485,620	58.95	146,529,042	67.60	168,027,912	1.27
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	92,900	1,554.16	144,382,205	1,740.11	161,656,274	1.23
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,647,340	107.98	177,880,577	96.89	159,617,361	1.21
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	77,915	1,867.75	145,526,308	2,040.75	159,005,269	1.21
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	123,000	1,165.05	143,301,310	1,220.17	150,080,971	1.14
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,511,515	54.07	135,800,388	58.96	148,099,016	1.12
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	732,000	162.86	119,216,448	184.70	135,203,328	1.03
ブラジル	株式	VALE SA	素材	56,800	2,229.21	126,619,388	2,096.88	119,103,102	0.90
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	78,100	1,531.35	119,598,839	1,460.87	114,094,314	0.87
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	22,057	4,638.33	102,307,692	5,111.07	112,735,047	0.86
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	858,000	110.03	94,407,456	122.51	105,115,296	0.80
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	369,680	225.96	83,536,091	270.26	99,913,413	0.76
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	68,553	1,461.52	100,192,053	1,449.37	99,358,730	0.75
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	30,500	2,904.85	88,598,109	3,253.78	99,240,534	0.75
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,757,200	29.88	82,399,296	34.94	96,347,596	0.73
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	6,400	16,922.43	108,303,570	15,032.85	96,210,240	0.73
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	21,446	4,064.05	87,157,830	4,327.63	92,810,374	0.70
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	78,069	815.67	63,678,915	1,108.54	86,542,859	0.66
ケイマン島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	41,200	1,731.60	71,341,920	2,088.32	86,038,784	0.65

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	17,709	4,493.68	79,578,677	4,768.18	84,439,770	0.64
コロンビア	株式	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	銀行	15,791	4,884.36	77,129,042	5,202.24	82,148,672	0.62
韓国	株式	POSCO	素材	2,674	27,677.54	74,009,762	29,849.39	79,817,295	0.61
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	309,000	240.76	74,394,840	249.08	76,965,720	0.58
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	15,935	3,979.22	63,408,893	4,419.80	70,429,513	0.53
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	52,536	1,219.11	64,047,500	1,322.18	69,462,573	0.53

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	95.54
投資信託受益証券	0.48
合計	96.03

(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	14.07
		素材	12.81
		資本財	4.81
		商業・専門サービス	0.02
		運輸	1.46
		自動車・自動車部品	3.34
		耐久消費財・アパレル	0.97
		消費者サービス	0.46
		メディア	0.92
		小売	1.80
		食品・生活必需品小売り	1.89
		食品・飲料・タバコ	4.35
		家庭用品・パーソナル用品	0.90
		ヘルスケア機器・サービス	0.37
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.60
		銀行	16.42
		各種金融	2.57
		保険	2.51
		不動産	1.64
		ソフトウェア・サービス	2.58
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.60
		電気通信サービス	7.39

		公益事業	3.63
		半導体・半導体製造装置	6.41
合計			95.54

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	122	6,157,369	6,564,820	529,649,677	4.02

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

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1期計算期間末 (平成22年 1月20日)	(分配付) (分配落)	473,632,486 473,632,486	(分配付) (分配落)	1.3329 1.3329
第2期計算期間末 (平成23年 1月20日)	(分配付) (分配落)	1,022,019,787 1,022,019,787	(分配付) (分配落)	1.2972 1.2972
第3期計算期間末 (平成24年 1月20日)	(分配付) (分配落)	1,737,011,301 1,737,011,301	(分配付) (分配落)	1.2000 1.2000
平成23年 2月末日		1,100,916,888		1.2958
3月末日		1,201,779,771		1.3368
4月末日		1,305,325,387		1.3644
5月末日		1,375,202,176		1.3228
6月末日		1,430,211,566		1.3099
7月末日		1,469,065,953		1.2701
8月末日		1,507,455,913		1.2066
9月末日		1,476,967,095		1.1347
10月末日		1,624,445,985		1.2223
11月末日		1,575,944,390		1.1537
12月末日		1,675,265,555		1.1667
平成24年 1月末日		1,760,980,337		1.2032
2月末日		1,975,829,015		1.3149

②【分配の推移】

期　間	１口当たりの分配金(円)
第1期計算期間（平成21年 1月16日～平成22年 1月20日）	0.0000
第2期計算期間（平成22年 1月21日～平成23年 1月20日）	0.0000
第3期計算期間（平成23年 1月21日～平成24年 1月20日）	0.0000

③【収益率の推移】

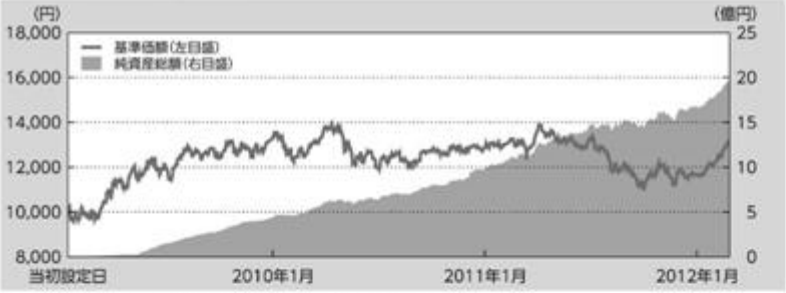
期　間	収益率(%)
第1期計算期間（平成21年 1月16日～平成22年 1月20日）	33.3
第2期計算期間（平成22年 1月21日～平成23年 1月20日）	△2.7
第3期計算期間（平成23年 1月21日～平成24年 1月20日）	△7.5

(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：2009年1月16日
作成基準日：2012年2月29日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	13,149円
純資産総額	20億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	9.28%
3ヶ月	13.97%
6ヶ月	8.98%
1年	1.47%
3年	30.71%
5年	−
設定来	31.49%

※上記は作成基準日からの期間です。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額:0円

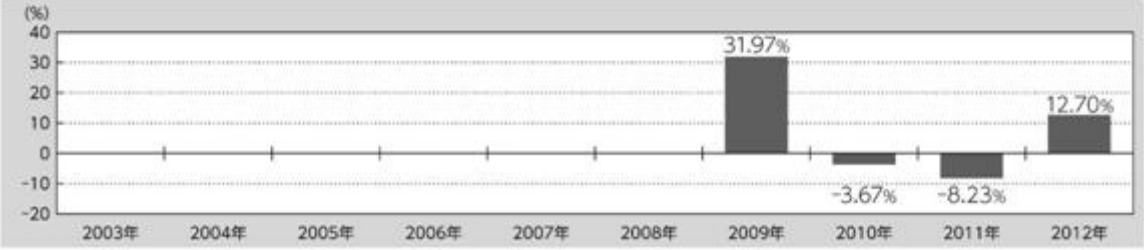
決算期	2010年1月	2011年1月	2012年1月	−	−
分配金	0円	0円	0円	−	−

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
住信 外国株式インデックスマザーファンド	31.0%	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	−	−	0.7%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	−	−	0.6%
住信 外国債券インデックスマザーファンド	29.3%	T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	−	2.625%	2014/7/31	0.4%
		T 1.75% 07/31/15	アメリカ	国債証券	−	1.750%	2015/7/31	0.3%
住信 新興国債券インデックスマザーファンド	15.0%	BNTNF 10% 01/01/14	ブラジル	国債証券	−	10.000%	2014/1/1	0.6%
		RUSSIA 7.85% 03/10/18	ロシア	国債証券	−	7.850%	2018/3/10	0.5%
住信 新興国株式インデックスマザーファンド	14.8%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	−	−	0.4%
		GAZPROM OAO-SPON ADR	ロシア	株式	エネルギー	−	−	0.3%
住信 国内株式インデックスマザーファンド	4.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	−	−	0.2%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	−	−	0.1%
住信 国内債券インデックスマザーファンド	3.9%	第99回利付国債(5年)	日本	国債証券	−	0.4%	2016/9/20	0.0%
		第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	−	1.7%	2017/3/20	0.0%

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2009年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2012年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

最新の運用の内容等は、委託会社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21年 1月16日～平成22年 1月20日)	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間 (平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間 (平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755

(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】

(1)申込手続

①受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

②当ファンドには、収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

④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販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（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又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。

⑤上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2)申込みの受付

申込期間中において、販売会社の営業日にお申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(3)申込単位

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。

詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「(1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(4)申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

(5)申込手数料

「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料」をご覧ください。

(6)申込代金の支払い

販売会社が定める期日までにお支払いください。

(7)受付不可日

分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

(8)申込受付の中止等

分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

(9)その他

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当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又は記録が行われます。なお、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又は記録を行うことができます。委託会社は、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又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、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、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。

2【換金（解約）手続等】

(1)一部解約手続

①受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
②委託会社は、一部解約の実行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。

(2)一部解約の受付

一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(3)解約単位

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

(4)解約価額

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先にお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（http://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。
なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

(5)一部解約代金の支払い

一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

(6)受付不可日

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

(7)一部解約受付の中止等

①委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、上記(2)による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及び既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消すことができます。

②上記①により一部解約の実行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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。

(8)その他

①当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

②一部解約の実行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会社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、社振法の規定に従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又は記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入有価証券を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価又は一部償却原価法により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金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

②基準価額の算出頻度及び照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（http://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

③主要な投資対象資産の評価方法

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

（ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

（ハ）公社債等

計算日（※）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における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計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします（平成21年1月16日設定）。
ただし、下記「(5)計算期間 ①信託の終了」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。
ただし、第1計算期間は平成21年1月16日から平成22年1月20日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）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、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①信託の終了

イ．委託会社の所定の手続きによる終了

（イ）委託会社は、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、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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。

（ロ）委託会社は、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、受託会社と合意のうえ、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。

（ハ）所定の手続き

a.委託会社は、上記（イ）及び（ロ）の事項について、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.委託会社は、上記（イ）及び（ロ）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、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社及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会社を除きます。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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社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、上記b.からd.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。

ロ．監督官庁の命令に伴う取扱い

委託会社は、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、その命令に従い、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

ハ．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

（イ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記②の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

ニ．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

（イ）受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記②の規定に従い、新受託会社を選任します。

（ロ）委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②投資信託約款の変更等

イ．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は当ファンドと他のファンドとの併合（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、変更又は併合しようとする旨及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②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ます。

ロ．委託会社は、上記イ．の事項（上記イ．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、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

ハ．上記ロ．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンド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会社を除きます。以下ハ．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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

ニ．上記ロ．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。

ホ．書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

ヘ．上記ロ．からホ．までの規定は、委託会社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全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。

ト．上記イ．からヘ．までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他のファンド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。

チ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、上記イ．からト．の規定に従います。

③反対者の買取請求権

投資信託契約の解約又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又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、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。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記①イ．（ハ）b.又は②ロ．に規定する書面に付記します。

④運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知れている受益者に対して交付します。

⑤公告

委託会社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。

⑥投資信託財産の管理

イ．混蔵寄託

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（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及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下イ．において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

ロ．信託財産の登記等及び記載等の留保等

（イ）信託の登記又は登録をすることができる信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

（ロ）上記イ．ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

（ハ）信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（ニ）動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

⑦信託事務処理の再信託

受託会社は、当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基づいて所定の事務を行います。

⑧関係法人との契約の更改等に関する手続き等

委託会社が販売会社と締結している投資信託受益権の取扱に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の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。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又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決算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販売会社の名義で記載又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営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社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、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し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。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

⑤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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

①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。

②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又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販売会社の名義で記載又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、原則として償還日から起算して5営業日までに支払います。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者は、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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)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、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

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2期計算期間(平成22年1月21日から平成23年1月20日まで)及び第3期計算期間(平成23年1月21日から平成24年1月20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】

世界経済インデックスファンド

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (平成23年１月20日現在)	第3期 (平成24年１月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,079,876	18,959,657
親投資信託受益証券	1,013,196,735	1,727,149,423
未収入金	4,420,000	―
未収利息	26	30
流動資産合計	1,034,696,637	1,746,109,110
資産合計	1,034,696,637	1,746,109,110
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,014,922	4,097,251
未払受託者報酬	217,574	410,593
未払委託者報酬	2,407,564	4,516,484
その他未払費用	36,790	73,481
流動負債合計	12,676,850	9,097,809
負債合計	12,676,850	9,097,809
純資産の部		
元本等		
元本	787,873,704	1,447,503,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	234,146,083	289,507,546
（分配準備積立金）	39,205,959	69,319,035
元本等合計	1,022,019,787	1,737,011,301
純資産合計	1,022,019,787	1,737,011,301
負債純資産合計	1,034,696,637	1,746,109,110

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 (自 平成22年１月21日 至 平成23年１月20日)	第3期 (自 平成23年１月21日 至 平成24年１月20日)
営業収益		
受取利息	8,213	8,477
有価証券売買等損益	1,536,118	△106,277,312
営業収益合計	1,544,331	△106,268,835
営業費用		
受託者報酬	369,054	736,094
委託者報酬	4,316,133	8,096,888
その他費用	36,790	73,481
営業費用合計	4,721,977	8,906,463
営業利益又は営業損失（△）	△3,177,646	△115,175,298
経常利益又は経常損失（△）	△3,177,646	△115,175,298
当期純利益又は当期純損失（△）	△3,177,646	△115,175,298
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（△）	△5,380,528	△13,141,343
期首剰余金又は期首欠損金（△）	118,285,619	234,146,083
剰余金増加額又は欠損金減少額	174,474,720	231,191,191
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	174,474,720	231,191,191
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,817,138	73,795,773
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,817,138	73,795,773
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	234,146,083	289,507,546

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第2期 （自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	第3期 （自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20日）
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 （平成23年 1月20日現在）	第3期 （平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	355,346,867円	787,873,704円
期中追加設定元本額	627,431,255円	911,791,372円
期中一部解約元本額	194,904,418円	252,161,321円
2．計算期間末日における受益権の総数	787,873,704口	1,447,503,755口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第2期 （自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	第3期 （自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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（18,493,362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（194,940,124円）及び分配準備積立金（20,712,597円）により、分配対象収益は234,146,083円（１万口当たり2,971円87銭）でありますが、分配は見送りとさせていただきました。	計算期間末における経費控除後の配当等収益（38,006,286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（220,188,511円）及び分配準備積立金（31,312,749円）により、分配対象収益は289,507,546円（１万口当たり2,000円04銭）でありますが、分配は見送りとさせていただきました。

(金融商品に関する注記)

Ｉ金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 （自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	第3期 （自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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 新興国債券インデックス マザーファンド」および「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して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 ・カントリーリスク	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

II 金融商品の時価に関する事項

項目	第2期 （平成23年 1月20日現在）	第3期 （平成24年 1月20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.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。	a.親投資信託受益証券 同左
	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。	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)

第2期 （自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	第3期 （自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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2期 （平成23年 1月20日現在）	第3期 （平成24年 1月20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	4,649,805	△103,574,688
合　計	4,649,805	△103,574,688

（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2期 （平成23年 1月20日現在）	第3期 （平成24年 1月20日現在）
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 （自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	第3期 （自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20日）

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

(1口当たり情報)

第2期 （平成23年 1月20日現在）	第3期 （平成24年 1月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.2972円	1口当たり純資産額 ＝ 1.2000円

(4)【附属明細表】（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数(口)	評価額（円）
親投資信託受益証券	住信 外国株式インデックス マザーファンド	623,836,884	539,806,055
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	306,465,337	519,366,806
	住信 国内株式インデックス マザーファンド	137,289,953	81,371,755
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	60,500,625	74,300,817
	住信 新興国株式インデックス マザーファンド	160,181,254	251,308,369
	住信 新興国債券インデックス マザーファンド	215,342,922	260,995,621
合計		1,503,616,975	1,727,149,423

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

次へ

(参考)
「世界経済インデックスファンド」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 新興国債券インデックス マザーファンド」、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	483,971,883	217,537,557
国債証券	121,400,651,300	142,034,447,600
地方債証券	10,593,651,347	12,217,060,991
特殊債券	16,486,865,822	18,341,792,658
社債券	13,735,452,970	14,157,895,348
未収入金	201,962,000	102,406,000
未収利息	514,244,919	576,514,014
前払費用	20,179,598	29,008,083
流動資産合計	163,436,979,839	187,676,662,251
資産合計	163,436,979,839	187,676,662,251
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	100,000,000
未払解約金	23,693,230	34,112,485
流動負債合計	223,693,230	134,112,485
負債合計	223,693,230	134,112,485
純資産の部		
元本等		
元本	136,196,704,745	152,711,768,197
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	27,016,581,864	34,830,781,569
元本等合計	163,213,286,609	187,542,549,766
純資産合計	163,213,286,609	187,542,549,766
負債純資産合計	163,436,979,839	187,676,662,251

（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、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	133,090,445,218円	136,196,704,745円
期中追加設定元本額	23,611,579,101円	34,282,533,313円
期中一部解約元本額	20,505,319,574円	17,767,469,861円
期末元本額	136,196,704,745円	152,711,768,197円
元本額の内訳		
住信 エマージング株式オープン	10,940,920円	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	341,748,710円	486,371,084円
SBI資産設計オープン（分配型）	18,687,899円	16,517,964円
STAM 国内債券インデックス・オープン	1,515,388,385円	1,902,208,941円
世界経済インデックスファンド	33,018,330円	60,500,625円
住信 国内バランス30	452,287,270円	—
住信 国内バランス60	87,848,401円	—
すみしん マイセレクション25	247,258,025円	196,619,614円
すみしん マイセレクション50	212,985,554円	181,038,867円
すみしん マイセレクション75	52,577,300円	45,071,935円
すみしん DCマイセレクション25	6,494,564,195円	7,977,459,110円
すみしん DCマイセレクション50	9,076,924,541円	9,764,699,051円
すみしん DCマイセレクション75	2,422,242,347円	2,429,133,850円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	331,963,730円	356,309,670円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	27,722,744,950円	34,236,578,274円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	7,198,094,552円	11,142,678,076円
すみしん DCマイセレクションS25	605,507,412円	1,977,164,259円
すみしん DCマイセレクションS50	1,095,076,795円	2,342,620,195円
すみしん DCマイセレクションS75	232,842,006円	411,346,587円

すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	33,864,196円	48,551,602円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	128,711,704円	384,457,995円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	59,010,575円	166,241,522円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	11,610,651円	28,544,609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）	3,992,594,670円	8,914,693,050円
住信 国内バランス６０VA１ （適格機関投資家専用）	86,189,049円	68,719,651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	521,222,882円
すみしん マイセレクション75ＶＡ1 （適格機関投資家専用）	80,649,519円	67,397,577円
住信 国内バランス３０VA2 （適格機関投資家専用）	15,006,859円	12,779,525円
住信 国内バランス６０VA2 （適格機関投資家専用）	15,515,569円	13,744,148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	2,042,367,645円
すみしん バランス50ＶＡ１ （適格機関投資家専用）	3,456,798,281円	3,121,909,210円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	10,207,739,396円	9,104,473,386円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	908,114,205円	788,875,056円
すみしん バランスA（25）VA1 （適格機関投資家専用）	16,810,848,016円	15,281,733,460円
すみしん バランスB（37.5）VA1 （適格機関投資家専用）	1,824,979,203円	1,617,158,728円
すみしん バランスC（50）VA1 （適格機関投資家専用）	6,612,500,324円	5,647,052,365円
すみしん 世界バランスVA1 （適格機関投資家専用）	4,009,381,385円	3,542,887,129円
すみしん 世界バランスVA2 （適格機関投資家専用）	5,535,975,882円	4,994,185,836円
すみしん バランスD（35）VA1 （適格機関投資家専用）	2,882,097,338円	2,414,823,369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）	2,219,070,369円	1,965,949,897円
すみしん バランスE（25）VA1 （適格機関投資家専用）	3,369,838,528円	2,886,548,056円
すみしん バランスF（25）VA1 （適格機関投資家専用）	3,006,688,390円	3,830,836,737円
すみしん 国内バランス25VA1 （適格機関投資家専用）	348,356,885円	317,696,740円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,193,258,248円	1,990,806,422円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	7,445,315,755円	9,398,460,044円

2．計算期間末日における受益権の総数	136,196,704,745口	152,711,768,197口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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

Ⅱ金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	（平成24年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△244,270,400	1,150,440,500
地方債証券	△31,716,014	83,363,896
特殊債券	△23,145,206	96,565,191
社債券	△5,514,370	△80,742,440
合　計	△304,645,990	1,249,627,147

（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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.1984円	1口当たり純資産額 ＝ 1.2281円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第１００回利付国債（２０年）	400,000,000	435,264,000	
	第１０１回利付国債（２０年）	160,000,000	178,601,600	
	第１０１回利付国債（５年）	120,000,000	120,346,800	
	第１０２回利付国債（２０年）	240,000,000	267,724,800	
	第１０３回利付国債（２０年）	280,000,000	308,467,600	
	第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	278,878,600	
	第１０５回利付国債（２０年）	570,000,000	610,281,900	
	第１０６回利付国債（２０年）	270,000,000	293,033,700	
	第１０７回利付国債（２０年）	190,000,000	203,178,400	
	第１０８回利付国債（２０年）	520,000,000	540,753,200	
	第１０９回利付国債（２０年）	200,000,000	207,654,000	
	第１０回利付国債（３０年）	120,000,000	105,517,200	
	第１１０回利付国債（２０年）	580,000,000	619,434,200	
	第１１１回利付国債（２０年）	200,000,000	216,332,000	
	第１１２回利付国債（２０年）	500,000,000	533,300,000	
	第１１３回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,097,104,500	
	第１１４回利付国債（２０年）	380,000,000	404,187,000	
	第１１５回利付国債（２０年）	550,000,000	593,439,000	
	第１１６回利付国債（２０年）	480,000,000	517,588,800	
	第１１７回利付国債（２０年）	600,000,000	637,704,000	
	第１１８回利付国債（２０年）	750,000,000	784,282,500	
	第１１９回利付国債（２０年）	180,000,000	182,649,600	
	第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	88,541,100	
	第１２１回利付国債（２０年）	940,000,000	967,307,000	

第１２２回利付国債（２０年）	120,000,000	121,526,400	
第１２３回利付国債（２０年）	610,000,000	646,752,500	
第１２４回利付国債（２０年）	280,000,000	292,224,800	
第１２５回利付国債（２０年）	380,000,000	408,625,400	
第１２６回利付国債（２０年）	230,000,000	239,965,900	
第１２７回利付国債（２０年）	330,000,000	339,042,000	
第１２８回利付国債（２０年）	470,000,000	482,304,600	
第１２９回利付国債（２０年）	470,000,000	474,775,200	
第１２回利付国債（３０年）	120,000,000	126,396,000	
第１３０回利付国債（２０年）	420,000,000	423,687,600	
第１３１回利付国債（２０年）	610,000,000	605,095,600	
第１３２回利付国債（２０年）	240,000,000	237,876,000	
第１３回利付国債（３０年）	110,000,000	113,812,600	
第１４回利付国債（３０年）	260,000,000	288,124,200	
第１５回利付国債（３０年）	190,000,000	214,135,700	
第１６回利付国債（３０年）	170,000,000	191,613,800	
第１７回利付国債（３０年）	130,000,000	144,050,400	
第１８回利付国債（３０年）	240,000,000	261,314,400	
第１９回利付国債（３０年）	180,000,000	195,946,200	
第１回利付国債（３０年）	40,000,000	46,864,800	
第１回利付国債（４０年）	150,000,000	162,757,500	
第２０回利付国債（３０年）	200,000,000	225,280,000	
第２１回利付国債（３０年）	130,000,000	141,334,700	
第２２回利付国債（２０年）	120,000,000	127,125,600	
第２２回利付国債（３０年）	220,000,000	247,797,000	
第２３回利付国債（２０年）	40,000,000	43,548,000	
第２３回利付国債（３０年）	230,000,000	259,051,300	
第２４７回利付国債（１０年）	290,000,000	292,259,100	
第２４８回利付国債（１０年）	490,000,000	493,253,600	
第２４９回利付国債（１０年）	300,000,000	301,650,000	
第２４回利付国債（２０年）	20,000,000	21,957,600	
第２４回利付国債（３０年）	210,000,000	236,512,500	
第２５０回利付国債（１０年）	490,000,000	492,601,900	
第２５１回利付国債（１０年）	660,000,000	667,194,000	
第２５２回利付国債（１０年）	510,000,000	516,267,900	
第２５３回利付国債（１０年）	800,000,000	819,520,000	
第２５４回利付国債（１０年）	550,000,000	561,605,000	
第２５５回利付国債（１０年）	240,000,000	245,460,000	
第２５６回利付国債（１０年）	1,720,000,000	1,761,589,600	
第２５７回利付国債（１０年）	660,000,000	674,704,800	
第２５８回利付国債（１０年）	210,000,000	215,239,500	

第２５９回利付国債（１０年）	940,000,000	967,476,200	
第２５回利付国債（２０年）	60,000,000	65,101,800	
第２５回利付国債（３０年）	210,000,000	228,053,700	
第２６０回利付国債（１０年）	490,000,000	506,988,300	
第２６１回利付国債（１０年）	510,000,000	530,119,500	
第２６２回利付国債（１０年）	480,000,000	500,083,200	
第２６３回利付国債（１０年）	410,000,000	425,534,900	
第２６４回利付国債（１０年）	1,800,000,000	1,863,450,000	
第２６５回利付国債（１０年）	670,000,000	695,319,300	
第２６６回利付国債（１０年）	370,000,000	382,916,700	
第２６７回利付国債（１０年）	450,000,000	464,409,000	
第２６８回利付国債（１０年）	560,000,000	582,680,000	
第２６９回利付国債（１０年）	1,450,000,000	1,499,648,000	
第２６回利付国債（２０年）	20,000,000	22,291,000	
第２６回利付国債（３０年）	360,000,000	398,080,800	
第２７０回利付国債（１０年）	840,000,000	870,315,600	
第２７１回利付国債（１０年）	730,000,000	754,009,700	
第２７２回利付国債（１０年）	330,000,000	343,794,000	
第２７３回利付国債（１０年）	1,220,000,000	1,275,412,400	
第２７４回利付国債（１０年）	530,000,000	555,270,400	
第２７５回利付国債（１０年）	280,000,000	292,269,600	
第２７６回利付国債（１０年）	480,000,000	504,744,000	
第２７７回利付国債（１０年）	270,000,000	284,553,000	
第２７８回利付国債（１０年）	760,000,000	807,196,000	
第２７９回利付国債（１０年）	440,000,000	471,028,800	
第２７回利付国債（２０年）	50,000,000	56,389,000	
第２７回利付国債（３０年）	480,000,000	540,859,200	
第２８０回利付国債（１０年）	1,450,000,000	1,551,079,500	
第２８１回利付国債（１０年）	550,000,000	590,727,500	
第２８２回利付国債（１０年）	1,160,000,000	1,233,660,000	
第２８３回利付国債（１０年）	680,000,000	726,294,400	
第２８４回利付国債（１０年）	2,020,000,000	2,153,461,400	
第２８５回利付国債（１０年）	2,060,000,000	2,200,615,600	
第２８６回利付国債（１０年）	990,000,000	1,064,665,800	
第２８７回利付国債（１０年）	500,000,000	540,355,000	
第２８８回利付国債（１０年）	1,740,000,000	1,865,019,000	
第２８９回利付国債（１０年）	1,550,000,000	1,645,449,000	
第２８回利付国債（２０年）	20,000,000	23,003,000	
第２８回利付国債（３０年）	300,000,000	338,238,000	
第２９０回利付国債（１０年）	870,000,000	918,894,000	
第２９１回利付国債（１０年）	420,000,000	440,958,000	

第２９２回利付国債（１０年）	520,000,000	558,714,000	
第２９３回利付国債（１０年）	710,000,000	768,191,600	
第２９４回利付国債（１０年）	610,000,000	656,207,500	
第２９５回利付国債（１０年）	500,000,000	531,500,000	
第２９６回利付国債（１０年）	1,880,000,000	1,999,098,000	
第２９７回利付国債（１０年）	840,000,000	887,762,400	
第２９８回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,112,851,600	
第２９９回利付国債（１０年）	620,000,000	650,857,400	
第２９回利付国債（２０年）	60,000,000	68,620,200	
第２９回利付国債（３０年）	560,000,000	619,959,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	177,569,600	
第２回利付国債（４０年）	300,000,000	309,162,000	
第３００回利付国債（１０年）	1,010,000,000	1,074,508,700	
第３０１回利付国債（１０年）	710,000,000	755,006,900	
第３０１回利付国債（２年）	1,050,000,000	1,050,882,000	
第３０２回利付国債（１０年）	400,000,000	422,520,000	
第３０２回利付国債（２年）	520,000,000	520,468,000	
第３０３回利付国債（１０年）	940,000,000	991,747,000	
第３０３回利付国債（２年）	640,000,000	640,620,800	
第３０４回利付国債（１０年）	390,000,000	408,626,400	
第３０４回利付国債（２年）	600,000,000	600,618,000	
第３０５回利付国債（１０年）	1,960,000,000	2,050,336,400	
第３０５回利付国債（２年）	280,000,000	280,308,000	
第３０６回利付国債（１０年）	1,480,000,000	1,557,448,400	
第３０６回利付国債（２年）	880,000,000	881,029,600	
第３０７回利付国債（２年）	700,000,000	700,868,000	
第３０８回利付国債（１０年）	500,000,000	521,315,000	
第３０８回利付国債（２年）	520,000,000	519,828,400	
第３０９回利付国債（１０年）	1,520,000,000	1,559,565,600	
第３０９回利付国債（２年）	700,000,000	699,755,000	
第３０回利付国債（２０年）	80,000,000	90,044,800	
第３０回利付国債（３０年）	440,000,000	477,941,200	
第３１０回利付国債（１０年）	1,650,000,000	1,675,344,000	
第３１０回利付国債（２年）	600,000,000	600,864,000	
第３１１回利付国債（１０年）	460,000,000	459,438,800	
第３１１回利付国債（２年）	380,000,000	380,570,000	
第３１２回利付国債（１０年）	1,830,000,000	1,884,552,300	
第３１３回利付国債（１０年）	1,250,000,000	1,294,987,500	
第３１４回利付国債（１０年）	860,000,000	876,013,200	
第３１５回利付国債（１０年）	1,170,000,000	1,198,852,200	
第３１６回利付国債（１０年）	800,000,000	812,456,000	

第３１７回利付国債（１０年）	700,000,000	709,282,000	
第３１８回利付国債（１０年）	1,650,000,000	1,656,550,500	
第３１９回利付国債（１０年）	600,000,000	606,768,000	
第３１回利付国債（２０年）	80,000,000	90,587,200	
第３１回利付国債（３０年）	500,000,000	532,010,000	
第３２回利付国債（２０年）	50,000,000	57,027,500	
第３２回利付国債（３０年）	680,000,000	737,317,200	
第３３回利付国債（２０年）	140,000,000	162,481,200	
第３３回利付国債（３０年）	680,000,000	691,968,000	
第３４回利付国債（２０年）	50,000,000	58,052,500	
第３４回利付国債（３０年）	820,000,000	868,585,000	
第３５回利付国債（２０年）	10,000,000	11,506,300	
第３５回利付国債（３０年）	670,000,000	678,844,000	
第３６回利付国債（２０年）	70,000,000	80,103,100	
第３７回利付国債（２０年）	70,000,000	80,490,200	
第３８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,692,000	
第３９回利付国債（２０年）	500,000,000	564,645,000	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	131,154,000	
第３回利付国債（４０年）	340,000,000	349,047,400	
第４０回利付国債（２０年）	100,000,000	111,516,000	
第４１回利付国債（２０年）	330,000,000	351,077,100	
第４２回利付国債（２０年）	80,000,000	91,310,400	
第４３回利付国債（２０年）	140,000,000	163,437,400	
第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	193,585,800	
第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	328,253,900	
第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	189,565,300	
第４７回利付国債（２０年）	90,000,000	100,360,800	
第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	148,307,900	
第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	154,926,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	130,872,500	
第４回利付国債（４０年）	350,000,000	357,518,000	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	239,516,200	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	109,678,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	121,617,100	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	88,405,600	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	222,926,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	153,395,200	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	164,284,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	260,469,600	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	325,365,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	212,612,000	

第５回利付国債（３０年）	50,000,000	53,752,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	361,098,500	
第６１回利付国債（２０年）	220,000,000	217,489,800	
第６２回利付国債（２０年）	220,000,000	212,025,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	214,180,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	345,545,600	
第６５回利付国債（２０年）	270,000,000	291,348,900	
第６６回利付国債（２０年）	180,000,000	192,247,200	
第６７回利付国債（２０年）	240,000,000	258,496,800	
第６８回利付国債（２０年）	140,000,000	155,419,600	
第６９回利付国債（２０年）	220,000,000	241,890,000	
第６回利付国債（３０年）	90,000,000	99,783,000	
第７０回利付国債（２０年）	240,000,000	271,672,800	
第７０回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,622,541,900	
第７１回利付国債（２０年）	340,000,000	377,308,200	
第７１回利付国債（５年）	820,000,000	831,086,400	
第７２回利付国債（２０年）	540,000,000	592,407,000	
第７２回利付国債（５年）	630,000,000	642,146,400	
第７３回利付国債（２０年）	250,000,000	270,980,000	
第７３回利付国債（５年）	670,000,000	681,048,300	
第７４回利付国債（２０年）	150,000,000	164,346,000	
第７４回利付国債（５年）	640,000,000	647,865,600	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	142,235,600	
第７５回利付国債（５年）	440,000,000	447,106,000	
第７６回利付国債（２０年）	240,000,000	256,744,800	
第７６回利付国債（５年）	820,000,000	834,596,000	
第７７回利付国債（２０年）	160,000,000	173,158,400	
第７７回利付国債（５年）	440,000,000	446,380,000	
第７８回利付国債（２０年）	200,000,000	213,450,000	
第７８回利付国債（５年）	390,000,000	395,733,000	
第７９回利付国債（２０年）	170,000,000	183,685,000	
第７９回利付国債（５年）	170,000,000	171,853,000	
第７回利付国債（３０年）	290,000,000	316,511,800	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	240,358,800	
第８０回利付国債（５年）	380,000,000	384,864,000	
第８１回利付国債（２０年）	90,000,000	97,078,500	
第８１回利付国債（５年）	1,270,000,000	1,288,084,800	
第８２回利付国債（２０年）	540,000,000	589,059,000	
第８２回利付国債（５年）	390,000,000	396,388,200	
第８３回利付国債（２０年）	280,000,000	304,936,800	
第８３回利付国債（５年）	220,000,000	223,944,600	

	第８４回利付国債（２０年）	460,000,000	495,286,600	
	第８４回利付国債（５年）	1,530,000,000	1,550,119,500	
	第８５回利付国債（２０年）	190,000,000	206,682,000	
	第８５回利付国債（５年）	1,670,000,000	1,693,363,300	
	第８６回利付国債（２０年）	170,000,000	189,184,500	
	第８６回利付国債（５年）	80,000,000	80,908,000	
	第８７回利付国債（２０年）	310,000,000	340,894,600	
	第８７回利付国債（５年）	2,140,000,000	2,159,131,600	
	第８８回利付国債（２０年）	470,000,000	522,254,600	
	第８８回利付国債（５年）	1,490,000,000	1,503,499,400	
	第８９回利付国債（２０年）	280,000,000	307,764,800	
	第８９回利付国債（５年）	1,760,000,000	1,770,084,800	
	第８回利付国債（３０年）	50,000,000	50,228,000	
	第９０回利付国債（２０年）	520,000,000	570,923,600	
	第９１回利付国債（２０年）	290,000,000	321,926,100	
	第９１回利付国債（５年）	400,000,000	402,168,000	
	第９２回利付国債（２０年）	760,000,000	822,548,000	
	第９２回利付国債（５年）	1,260,000,000	1,262,268,000	
	第９３回利付国債（２０年）	250,000,000	266,745,000	
	第９３回利付国債（５年）	820,000,000	827,273,400	
	第９４回利付国債（２０年）	440,000,000	475,516,800	
	第９４回利付国債（５年）	1,310,000,000	1,326,689,400	
	第９５回利付国債（２０年）	430,000,000	475,709,000	
	第９５回利付国債（５年）	520,000,000	526,713,200	
	第９６回利付国債（２０年）	280,000,000	302,150,800	
	第９６回利付国債（５年）	900,000,000	907,740,000	
	第９７回利付国債（２０年）	510,000,000	556,659,900	
	第９７回利付国債（５年）	1,470,000,000	1,476,056,400	
	第９８回利付国債（２０年）	320,000,000	344,774,400	
	第９９回利付国債（２０年）	640,000,000	688,416,000	
	第９９回利付国債（５年）	2,220,000,000	2,227,614,600	
	第９回ポーランド共和国円貨債券（２００９）	100,000,000	98,955,000	
	第９回利付国債（３０年）	70,000,000	65,399,600	
	小計	136,020,000,000	142,034,447,600	

地方債証券	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,627,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	102,067,000	
	第１２４回神奈川県公募公債	10,000,000	10,243,300	
	第１２回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,545,000	
	第１４４回神奈川県公募公債	100,000,000	106,945,000	
	第１４回共同発行市場公募地方債	100,200,000	103,218,024	
	第１５０回神奈川県公募公債	100,000,000	106,753,000	
	第１５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,356,000	
	第１６７回神奈川県公募公債	140,000,000	148,239,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	104,324,000	
	第１７２回神奈川県公募公債	200,000,000	208,432,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,543,000	
	第１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,722,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,852,000	
	第１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,647,000	
	第２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,313,000	
	第２３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,027,000	
	第２６２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,296,000	
	第２７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,551,000	
	第２８４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,572,000	
	第２９１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,861,000	
	第２９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,750,000	
	第３０７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,282,000	
	第３１１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,494,000	
	第３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,905,000	
	第３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,093,000	
	第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,035,000	
	第３回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,089,400	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,814,000	
	第４０回共同発行市場公募地方債	120,000,000	129,237,600	
	第４１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,364,000	
	第４６回共同発行市場公募地方債	136,500,000	145,892,565	
	第４７回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	102,040,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	111,317,000	
	第５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,795,000	
	第５３回大阪府公募公債（５年）	200,000,000	202,558,000	
	第５５回共同発行市場公募地方債	158,400,000	170,615,808	
	第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,019,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,944,000	
	第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	108,719,000	
	第６０２回東京都公募公債	20,000,000	20,428,400	

第６０８回東京都公募公債	100,000,000	103,003,000	
第６１１回東京都公募公債	40,000,000	41,566,000	
第６１８回東京都公募公債	100,000,000	103,469,000	
第６２２回東京都公募公債	100,000,000	103,361,000	
第６３３回東京都公募公債	129,000,000	137,645,580	
第６３９回東京都公募公債	50,000,000	53,360,500	
第６４９回東京都公募公債	102,000,000	109,183,860	
第６５０回東京都公募公債	140,000,000	150,788,400	
第６７４回東京都公募公債	100,000,000	104,943,000	
第６７回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,438,189	
第６９１回東京都公募公債	100,000,000	102,844,000	
第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,204,000	
第７２回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	100,817,000	
第７５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,728,000	
第７７回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,697,900	
第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,910,000	
第８１回川崎市公募公債	100,000,000	106,333,000	
第８２回川崎市公募公債	100,000,000	105,808,000	
第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,581,000	
第８９回共同発行市場公募地方債	150,300,000	152,407,206	
第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,805,000	
第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,619,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,893,000	
第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	106,418,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	105,071,000	
平成１４年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	100,684,000	
平成１４年度第８回札幌市公募公債	28,300,000	28,454,518	
平成１５年度第１回愛知県公募公債	100,000,000	102,133,000	
平成１５年度第５回札幌市公募公債	72,580,000	74,323,371	
平成１５年度第５回北海道公募公債	50,000,000	51,002,500	
平成１５年度第６回福岡市公募公債	124,600,000	127,440,880	
平成１５年度第６回兵庫県公募公債	10,000,000	10,231,300	
平成１６年度第１回広島県公募公債	100,000,000	103,132,000	
平成１６年度第１回新潟県公募公債	100,000,000	103,496,000	
平成１６年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	103,394,000	
平成１６年度第４回静岡県公募公債	150,000,000	155,583,000	
平成１６年度第４回兵庫県公募公債	200,000,000	206,254,000	
平成１６年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	103,164,000	
平成１７年度第１０回大阪市公募公債	100,000,000	104,307,000	
平成１７年度第１３回神戸市公募公債	100,000,000	104,981,000	
平成１７年度第１３回兵庫県公募公債	200,000,000	210,664,000	

	平成１７年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	103,211,000	
	平成１７年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	104,781,000	
	平成１７年度第３回埼玉県公募公債	100,000,000	103,463,000	
	平成１７年度第６回札幌市公募公債	100,000,000	104,488,000	
	平成１８年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	107,058,000	
	平成１８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	105,765,000	
	平成１８年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	107,057,000	
	平成１８年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	106,965,000	
	平成１９年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	107,908,000	
	平成１９年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	107,038,000	
	平成１９年度第９回兵庫県公募公債	100,000,000	107,331,000	
	平成２０年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	107,044,000	
	平成２０年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	106,873,000	
	平成２０年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	107,296,000	
	平成２１年度第１２回千葉県公募公債	100,000,000	105,056,000	
	平成２１年度第１回横浜市公募公債	200,000,000	212,882,000	
	平成２１年度第１回北海道公募公債（５年）	100,000,000	101,988,000	
	平成２１年度第２回千葉県公募公債	100,000,000	106,371,000	
	平成２１年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	106,131,000	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	107,943,000	
	平成２１年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	106,107,000	
	平成２１年度第８回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	104,918,000	
	平成２１年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	104,039,000	
	平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	198,583,490	
	平成２２年度第１回広島県公募公債	100,000,000	104,214,000	
	平成２２年度第５回大阪市公募公債	100,000,000	102,045,000	
	平成２２年度第８回千葉県公募公債	120,000,000	120,931,200	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	102,909,000	
	小計	11,640,580,000	12,217,060,991	
特殊債券	い第６９４号農林債	100,000,000	101,041,000	
	い第６９５号農林債	100,000,000	101,107,000	
	い第６９６号商工債	100,000,000	101,558,000	
	い第７０４号商工債	100,000,000	102,209,000	
	い第７０５号商工債	100,000,000	102,407,000	
	い第７０７号農林債	250,000,000	255,977,500	
	い第７１０号農林債	100,000,000	101,730,000	
	い第７１５号農林債	100,000,000	101,030,000	
	い第７１８号商工債	100,000,000	100,989,000	
	い第７２１号商工債	150,000,000	150,990,000	
	い第７２２号商工債	100,000,000	100,468,000	
	い第７２２号農林債	100,000,000	100,537,000	

い第７２３号農林債	200,000,000	201,064,000	
い第７２６号商工債	100,000,000	100,227,000	
第１０回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,506,000	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	67,028,000	70,224,565	
第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,589,000	
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	103,871,000	
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	101,247,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,742,000	
第１１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,540,000	
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	100,120,000	
第１２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,296,000	
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	104,971,000	
第１２回政府保証国民生活債券	179,000,000	183,714,860	
第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,675,000	
第１３４回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,472,000	
第１３５回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,434,000	
第１３回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	113,908,660	
第１３回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,836,000	
第１４５回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,669,000	
第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,075,000	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	67,605,000	70,461,987	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	68,339,000	71,168,234	
第１５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,544,000	
第１７６回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,472,600	
第１７回公営企業債券	100,000,000	104,428,000	
第１８２回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,343,300	
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	104,514,000	
第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	101,163,620	
第１９０回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,618,000	
第１９３回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	107,576,560	
第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,638,000	
第１回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,560,260	
第１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,037,000	
第１回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	104,903,000	
第１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	104,619,000	
第１回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,461,000	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	48,242,000	50,806,544	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,657,000	67,901,488	
第１回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,728,000	
第２００回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,639,000	
第２１回道路債券	100,000,000	110,591,000	

第２２２回信金中金債（５年）	200,000,000	203,088,000	
第２２４回信金中金債（５年）	100,000,000	101,807,000	
第２２６回信金中金債（５年）	100,000,000	101,845,000	
第２２８回信金中金債（５年）	100,000,000	102,202,000	
第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,601,000	
第２３３回信金中金債（５年）	100,000,000	102,437,000	
第２３７回信金中金債（５年）	100,000,000	101,832,000	
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	106,448,000	
第２４７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,626,000	
第２４回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,971,000	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,442,000	81,440,542	
第２５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,616,000	
第２８回公営企業債券	100,000,000	107,725,000	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,138,000	85,784,927	
第２回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	154,596,960	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,270,000	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	50,010,000	52,945,587	
第３０回公営企業債券	100,000,000	108,595,000	
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	106,654,000	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,968,000	87,807,856	
第３１５回政府保証道路債券	225,000,000	226,525,500	
第３１６回政府保証道路債券	120,000,000	120,711,600	
第３１９回政府保証道路債券	30,000,000	30,351,000	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,131,000	89,511,641	
第３２２回東京交通債券	10,000,000	11,113,700	
第３２３回政府保証道路債券	100,000,000	102,538,000	
第３２７回政府保証道路債券	100,000,000	102,983,000	
第３２８回政府保証道路債券	114,000,000	117,521,460	
第３３１回政府保証道路債券	102,000,000	106,229,940	
第３３３回政府保証道路債券	48,000,000	49,827,360	
第３３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,093,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,183,000	
第３４６回政府保証道路債券	143,000,000	148,677,100	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	19,642,400	
第３４７回政府保証道路債券	181,000,000	187,606,500	
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	106,754,000	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	90,643,457	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,255,000	
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	231,901,150	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,984,000	64,393,937	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,814,000	93,888,962	

第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,570,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,538,000	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,551,000	64,769,683	
第３回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,550,000	
第３回公営企業債券（２０年）	10,000,000	9,778,600	
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	100,000,000	111,150,000	
第３回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	109,821,690	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,718,000	65,804,965	
第４２回道路債券	100,000,000	108,333,000	
第４４回政府保証日本高速道路保有・債務返機構債	100,000,000	107,046,000	
第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,191,000	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,695,000	98,870,160	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,911,000	61,510,747	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,040,000	99,621,331	
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	105,914,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,956,000	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,805,000	100,774,973	
第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,816,000	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,821,000	67,670,682	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	55,612,000	58,120,657	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,644,000	68,500,014	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,866,000	200,086,912	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,223,000	100,165,850	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,338,000	67,367,033	
第５４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,615,500	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,809,000	99,802,013	
第５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,978,460	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,063,000	
第５回SBAB銀行AB(PUBL)円貨社債	100,000,000	96,183,000	
第５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,026,000	
第５回公営企業債券	100,000,000	100,646,000	
第５回新東京国際空港債券	100,000,000	102,710,000	
第５回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,288,800	
第５回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,689,000	
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	105,203,000	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	38,799,000	40,318,756	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,668,000	
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,865,000	
第６０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,940,000	
第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	194,296,260	
第６回公営企業債券	10,000,000	10,049,400	

	第６回阪神高速道路債券	100,000,000	103,532,000	
	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	108,507,000	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	83,092,000	88,255,336	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	56,890,000	59,183,804	
	第６回地方公共団体金融機構債券（５年）	100,000,000	100,199,000	
	第６回都市基盤整備債券	100,000,000	100,768,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,547,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	111,405,000	
	第７回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,861,000	
	第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	105,745,000	
	第７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,729,000	
	第８２７回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,591,000	
	第８３６回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,236,600	
	第８３８回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,971,000	
	第８３９回政府保証公営企業債券	128,000,000	131,929,600	
	第８４０回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,440,310	
	第８４８回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,240,000	
	第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,999,000	
	第８５５回政府保証公営企業債券	140,000,000	145,094,600	
	第８５９回政府保証公営企業債券	131,000,000	137,179,270	
	第８６２回政府保証公営企業債券	200,000,000	212,356,000	
	第８６６回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,455,000	
	第８６７回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,636,000	
	第８７２回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,168,000	
	第８７４回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,695,000	
	第８７５回政府保証公営企業債券	112,000,000	119,549,920	
	第８７６回政府保証公営企業債券	122,000,000	131,590,420	
	第８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,543,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	44,029,200	
	第８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	105,271,000	
	第８回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,082,000	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	43,129,000	45,520,071	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	61,874,000	64,817,346	
	第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,899,000	
	第８回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,617,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,197,000	
	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	312,549,000	
	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	108,483,000	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	43,038,000	45,606,938	
	小計	17,592,423,000	18,341,792,658	

社債券	第１１回シティグループ・インク円貨社債（２００３）	200,000,000	198,478,000	
	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	102,180,000	
	第１２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,208,000	
	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	101,269,000	
	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	105,039,000	
	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	101,976,000	
	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	100,744,000	
	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	102,240,000	
	第１５回ジ゛ェイ エフ イー ホールデ゛ィング゛ス株式会社無担保社債	100,000,000	100,599,000	
	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	102,076,000	
	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	100,187,000	
	第１５回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,909,000	
	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	204,166,000	
	第１６回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,879,000	
	第１７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債（社債間限定同順	100,000,000	99,881,000	
	第１７回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債（社債間限	100,000,000	100,639,000	
	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	109,622,000	
	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	209,594,000	
	第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	110,985,000	
	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	101,776,000	
	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	202,470,000	
	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	111,403,000	
	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	101,374,000	
	第１回ラボバンク円貨社債	100,000,000	101,227,000	
	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	101,340,000	
	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	100,320,000	
	第２０回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	202,336,000	
	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	107,377,000	
	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	100,198,000	
	第２１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,165,000	
	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	100,513,000	

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	99,970,000	
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	99,884,000	
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	108,426,000	
第２４８回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	113,268,000	
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	101,201,000	
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	104,623,000	
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	104,244,000	
第２５７回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,106,000	
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	101,091,000	
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	99,525,000	
第２６１回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	31,000,000	34,142,160	
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	100,037,000	
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	106,632,000	
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	101,721,000	
第２８５回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,692,000	
第２８６回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,352,000	
第２８回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,314,000	
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	100,173,000	
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	102,143,000	
第２回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,219,000	
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	101,192,000	
第２回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,982,000	
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	104,090,000	
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	102,428,000	
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	104,283,000	
第３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,218,000	
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	101,402,000	
第３６２回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,552,000	
第３６４回中国電力株式会社社債（一般担保付）	107,700,000	107,833,548	
第３７６回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	110,678,000	
第３８０回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	112,229,000	
第３８２回東北電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	22,171,600	

第３８７回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,616,000	
第３８回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	100,000,000	100,000,000	
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	102,568,000	
第３回エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	94,863,000	
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	106,276,000	
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	101,147,000	
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	107,468,000	
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	104,115,000	
第４０５回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	55,511,500	
第４０８回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,533,000	
第４０８回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	55,587,000	
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	101,067,000	
第４２５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	94,229,000	
第４５１回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,464,000	
第４５５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	120,000,000	85,752,000	
第４５９回東京電力株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	7,381,400	
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	102,189,000	
第４７１回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,068,000	
第４７３回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,413,000	
第４７４回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,454,000	
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	203,050,000	
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	104,379,000	
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	101,995,000	
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	99,857,000	
第４回バークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債（２０１０）	100,000,000	98,046,000	
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	102,594,000	
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	101,313,000	
第５０１回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	28,003,500	
第５０５回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	27,609,000	
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	100,676,000	
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	104,294,000	
第５１０回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	89,222,000	
第５１８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	80,725,000	

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	101,005,000	
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	107,037,000	
第５２１回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	78,800,000	
第５２８回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	68,145,000	
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	102,465,000	
第５３６回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	71,541,000	
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	104,867,000	
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	103,603,000	
第５４２回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	71,019,000	
第５４４回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	72,226,000	
第５５４回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	67,090,000	
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	106,109,000	
第５９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	106,677,000	
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	101,589,000	
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	100,881,000	
第５回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,958,000	
第６７回住友金属工業株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位	100,000,000	99,910,000	
第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,814,000	
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	99,010,000	
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	103,749,000	
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	104,684,000	
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	102,373,000	
第７４回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,682,000	
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	101,833,000	
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	104,455,000	
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	99,591,000	
第７回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	104,774,000	
第７回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,781,000	
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	101,489,000	
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	204,096,000	
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	102,323,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,965,400	
第８回旭化成株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,356,000	
第８回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,659,000	
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	101,239,000	

	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	100,265,000	
	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	107,955,000	
	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	96,616,000	
	第９回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,064,000	
	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	100,696,000	
	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	21,013,240	
	第９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,598,000	
	第９回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,435,000	
	小計	13,987,700,000	14,157,895,348	
合計		179,240,703,000	186,751,196,597	

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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,009,869,031	1,873,458,803
株式	136,231,355,980	116,743,176,880
派生商品評価勘定	35,866,000	33,591,360
未収入金	386,640	348,640
未収配当金	122,406,500	127,790,675
未収利息	1,591	3,027
差入委託証拠金	24,990,000	57,540,000
流動資産合計	137,424,875,742	118,835,909,385
資産合計	137,424,875,742	118,835,909,385
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	457,720	―
前受金	47,101,000	1,122,000
未払金	113,400	―
未払解約金	64,834,457	41,740,709
流動負債合計	112,506,577	42,862,709
負債合計	112,506,577	42,862,709
純資産の部		
元本等		
元本	193,076,891,875	200,419,822,981
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△55,764,522,710	△81,626,776,305
元本等合計	137,312,369,165	118,793,046,676
純資産合計	137,312,369,165	118,793,046,676
負債純資産合計	137,424,875,742	118,835,909,385

（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、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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。	（1）株式 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）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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	197,536,180,825円	193,076,891,875円
期中追加設定元本額	26,191,603,612円	46,304,376,427円
期中一部解約元本額	30,650,892,562円	38,961,445,321円
期末元本額	193,076,891,875円	200,419,822,981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）	5,964,011,661円	4,261,075,172円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	743,738,015円	1,073,730,069円
SBI資産設計オープン（分配型）	40,079,328円	35,102,438円
STAM TOPIXインデックス・オープン	4,646,722,632円	6,020,501,161円
世界経済インデックスファンド	71,831,149円	137,289,953円
住信 国内バランス30	562,700,565円	—
住信 国内バランス60	443,318,752円	—
すみしん マイセレクション25	146,718,113円	133,189,974円
すみしん マイセレクション50	328,414,404円	329,470,607円
すみしん マイセレクション75	285,351,229円	271,744,873円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	18,027,647,875円	17,446,193,584円
すみしん DCマイセレクション25	3,925,714,429円	5,623,579,775円
すみしん DCマイセレクション50	14,329,850,110円	17,640,851,195円
すみしん DCマイセレクション75	12,872,742,932円	15,105,068,796円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	2,944,369,450円	3,347,170,452円
すみしん DCマイセレクションS25	373,205,173円	1,406,685,945円
すみしん DCマイセレクションS50	1,733,921,709円	4,163,337,718円
すみしん DCマイセレクションS75	1,281,436,424円	2,484,626,311円

すみしん DC日本株式インデックス・オープンS	544,036,710円	966,645,899円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	22,166,668円	32,489,872円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	118,099,818円	360,940,545円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	105,862,398円	305,854,308円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	44,541,033円	110,566,861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）	4,399,235,488円	6,045,287,963円
住信 国内バランス６０VA１ （適格機関投資家専用）	469,417,569円	414,116,554円
すみしん マイセレクション50ＶＡ1 （適格機関投資家専用）	981,615,573円	941,357,509円
すみしん マイセレクション75ＶＡ1 （適格機関投資家専用）	412,507,725円	405,418,177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）	3,688,745,190円	3,375,982,843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）	82,954,151円	81,147,307円
すみしん マイセレクション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）	2,035,003,026円	2,017,326,120円
すみしん バランス50ＶＡ１ （適格機関投資家専用）	7,100,052,904円	7,608,543,704円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	18,337,718,692円	20,520,965,504円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	5,594,681,615円	6,099,183,217円
すみしん バランスA（25）VA1 （適格機関投資家専用）	12,490,403,307円	12,948,165,422円
すみしん バランスB（37.5）VA1 （適格機関投資家専用）	2,568,809,760円	2,529,969,831円
すみしん バランスC（50）VA1 （適格機関投資家専用）	13,117,514,793円	13,782,235,044円
すみしん 世界バランスVA1 （適格機関投資家専用）	5,766,549,029円	6,386,886,602円
すみしん 世界バランスVA2 （適格機関投資家専用）	4,342,917,098円	4,911,935,279円
すみしん バランスD（35）VA1 （適格機関投資家専用）	3,338,592,919円	3,171,946,754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）	5,334,934,593円	5,840,623,929円
すみしん バランスE（25）VA1 （適格機関投資家専用）	2,024,201,091円	1,922,513,157円
すみしん バランスF（25）VA1 （適格機関投資家専用）	1,782,241,520円	2,610,804,128円

すみしん 国内バランス25VA1 （適格機関投資家専用）	207,507,349円	225,468,597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）	25,444,086,316円	12,855,769,259円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,100,531,619円	3,572,030,345円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	874,332,635円	872,084,299円
2．元本の欠損	純資産額は、元本を55,764,522,710円下回っております。	純資産額は、元本を81,626,776,305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	193,076,891,875口	200,419,822,981口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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

II 金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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.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。	a.株式 同左
	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。	b.先物取引 同左
	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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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	7,511,338,753	△9,722,335,757

合　計	7,511,338,753	△9,722,335,757

（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23年 1月20日現在）			
		契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX先物	1,004,484,000	―	1,039,920,000	35,436,000
合　計		1,004,484,000	―	1,039,920,000	35,436,000

（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24年 1月20日現在）			
		契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX先物	2,000,820,000	―	2,034,450,000	33,630,000
合　計		2,000,820,000	―	2,034,450,000	33,630,000

（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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）

1口当たり純資産額 ＝ 0.7112円	1口当たり純資産額 ＝ 0.5927円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

銘 柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	50,000	185.00	9,250,000	
日本水産	146,500	264.00	38,676,000	
マルハニチロホールディングス	251,000	140.00	35,140,000	
ホウスイ	9,000	116.00	1,044,000	
サカタのタネ	18,800	1,077.00	20,247,600	
ホクト	12,900	1,678.00	21,646,200	
ショーボンドホールディングス	11,400	1,980.00	22,572,000	
ミライト・ホールディングス	36,300	616.00	22,360,800	
住石ホールディングス	37,300	87.00	3,245,100	
日鉄鉱業	33,000	344.00	11,352,000	
三井松島産業	83,000	152.00	12,616,000	
国際石油開発帝石	1,545	515,000.00	795,675,000	
日本海洋掘削	3,200	2,647.00	8,470,400	
関東天然瓦斯開発	13,000	415.00	5,395,000	
石油資源開発	18,100	3,340.00	60,454,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	163,900.00	3,605,800	
間組	45,800	215.00	9,847,000	
東急建設	45,120	215.00	9,700,800	
コムシスホールディングス	61,900	830.00	51,377,000	
ミサワホーム	12,300	633.00	7,785,900	
高松コンストラクショングループ	11,800	1,248.00	14,726,400	
東建コーポレーション	5,640	2,650.00	14,946,000	
ヤマウラ	15,500	233.00	3,611,500	
大成建設	644,000	214.00	137,816,000	
大林組	383,000	366.00	140,178,000	
清水建設	389,000	345.00	134,205,000	
長谷工コーポレーション	794,500	53.00	42,108,500	
松井建設	24,000	313.00	7,512,000	
鹿島建設	599,000	259.00	155,141,000	
鉄建建設	72,000	118.00	8,496,000	
安藤建設	42,000	116.00	4,872,000	
太平工業	22,000	419.00	9,218,000	

三井住友建設	78,800	74.00	5,831,200	
前田建設工業	89,000	320.00	28,480,000	
ナカノフドー建設	24,000	185.00	4,440,000	
奥村組	121,000	325.00	39,325,000	
大和小田急建設	6,000	212.00	1,272,000	
東鉄工業	18,000	750.00	13,500,000	
イチケン	33,000	135.00	4,455,000	
戸田建設	141,000	308.00	43,428,000	
熊谷組	91,000	86.00	7,826,000	
青木あすなろ建設	8,500	422.00	3,587,000	
北野建設	43,000	191.00	8,213,000	
植木組	39,000	200.00	7,800,000	
三井ホーム	22,000	406.00	8,932,000	
矢作建設工業	15,700	382.00	5,997,400	
ピーエス三菱	8,000	529.00	4,232,000	
大東建託	48,300	6,880.00	332,304,000	
新日本建設	34,300	223.00	7,648,900	
ＮＩＰＰＯ	30,000	806.00	24,180,000	
東亜道路工業	40,000	216.00	8,640,000	
前田道路	37,000	899.00	33,263,000	
日本道路	42,000	308.00	12,936,000	
東亜建設工業	111,000	160.00	17,760,000	
五洋建設	166,500	263.00	43,789,500	
大林道路	22,000	253.00	5,566,000	
住友林業	88,600	701.00	62,108,600	
日本基礎技術	21,900	354.00	7,752,600	
日成ビルド工業	67,000	180.00	12,060,000	
巴コーポレーション	15,800	297.00	4,692,600	
パナホーム	48,000	528.00	25,344,000	
大和ハウス工業	317,000	956.00	303,052,000	
ライト工業	29,500	472.00	13,924,000	
積水ハウス	358,000	724.00	259,192,000	
日特建設	61,000	118.00	7,198,000	
北陸電気工事	11,000	226.00	2,486,000	
ユアテック	21,000	401.00	8,421,000	
西部電気工業	14,000	354.00	4,956,000	
四電工	13,000	330.00	4,290,000	
中電工	19,200	835.00	16,032,000	
関電工	61,000	390.00	23,790,000	
きんでん	85,000	647.00	54,995,000	
東京エネシス	15,000	495.00	7,425,000	

トーエネック	22,000	426.00	9,372,000	
住友電設	11,000	477.00	5,247,000	
日本電設工業	24,000	780.00	18,720,000	
協和エクシオ	41,700	736.00	30,691,200	
新日本空調	17,100	431.00	7,370,100	
日本工営	40,000	288.00	11,520,000	
日本電話施設	24,000	255.00	6,120,000	
九電工	25,000	484.00	12,100,000	
三機工業	36,000	416.00	14,976,000	
日揮	120,000	2,019.00	242,280,000	
中外炉工業	55,000	264.00	14,520,000	
ヤマト	22,000	313.00	6,886,000	
太平電業	19,000	560.00	10,640,000	
高砂熱学工業	38,200	626.00	23,913,200	
三晃金属工業	14,000	230.00	3,220,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,600	1,165.00	12,349,000	
朝日工業社	22,000	341.00	7,502,000	
アタカ大機	9,000	277.00	2,493,000	
大氣社	19,900	1,691.00	33,650,900	
ダイダン	23,000	562.00	12,926,000	
日比谷総合設備	16,500	839.00	13,843,500	
東芝プラントシステム	24,000	882.00	21,168,000	
日本製粉	80,000	343.00	27,440,000	
日清製粉グループ本社	115,000	923.00	106,145,000	
日東富士製粉	11,000	300.00	3,300,000	
昭和産業	52,000	248.00	12,896,000	
鳥越製粉	11,000	674.00	7,414,000	
協同飼料	44,000	95.00	4,180,000	
中部飼料	11,400	505.00	5,757,000	
日本配合飼料	39,000	110.00	4,290,000	
東洋精糖	24,000	96.00	2,304,000	
日本甜菜製糖	71,000	172.00	12,212,000	
三井製糖	46,000	273.00	12,558,000	
ネクスト	7,900	302.00	2,385,800	
日本Ｍ＆Ａセンター	24	387,500.00	9,300,000	
ノバレーゼ	33	50,300.00	1,659,900	
アコーディア・ゴルフ	494	54,400.00	26,873,600	
パソナグループ	121	71,000.00	8,591,000	
リンクアンドモチベーション	46	38,950.00	1,791,700	
テンプホールディングス	16,200	750.00	12,150,000	
森永製菓	124,000	182.00	22,568,000	

中村屋	29,000	399.00	11,571,000	
江崎グリコ	46,000	865.00	39,790,000	
名糖産業	5,600	993.00	5,560,800	
不二家	73,000	155.00	11,315,000	
山崎製パン	93,000	986.00	91,698,000	
モロゾフ	19,000	277.00	5,263,000	
カルビー	6,800	3,825.00	26,010,000	
森永乳業	108,000	295.00	31,860,000	
ヤクルト本社	68,200	2,348.00	160,133,600	
明治ホールディングス	37,600	3,185.00	119,756,000	
雪印メグミルク	27,400	1,486.00	40,716,400	
プリマハム	73,000	136.00	9,928,000	
日本ハム	97,000	957.00	92,829,000	
伊藤ハム	70,000	314.00	21,980,000	
丸大食品	61,000	278.00	16,958,000	
米久	11,500	780.00	8,970,000	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	8,000	690.00	5,520,000	
学情	4,700	262.00	1,231,400	
スタジオアリス	6,000	1,147.00	6,882,000	
シミックホールディングス	4,100	1,136.00	4,657,600	
システナ	134	52,100.00	6,981,400	
ＮＥＣフィールディング	9,600	999.00	9,590,400	
新日鉄ソリューションズ	7,500	1,527.00	11,452,500	
綜合警備保障	43,200	858.00	37,065,600	
日本駐車場開発	1,228	3,525.00	4,328,700	
コア	4,200	675.00	2,835,000	
カカクコム	18,400	2,397.00	44,104,800	
ルネサンス	7,500	417.00	3,127,500	
エムスリー	93	292,500.00	27,202,500	
ベストブライダル	37	71,300.00	2,638,100	
ディー・エヌ・エー	52,200	1,807.00	94,325,400	
博報堂ＤＹホールディングス	15,060	4,485.00	67,544,100	
ぐるなび	8,600	829.00	7,129,400	
一休	90	32,950.00	2,965,500	
ジャパンベストレスキューシステム	20	74,200.00	1,484,000	
ジェイコムホールディングス	3,100	751.00	2,328,100	
ＰＧＭホールディングス	188	49,300.00	9,268,400	
サッポロホールディングス	210,000	292.00	61,320,000	
アサヒグループホールディングス	238,500	1,731.00	412,843,500	
キリンホールディングス	510,000	946.00	482,460,000	
宝ホールディングス	107,000	491.00	52,537,000	

オエノンホールディングス	35,000	179.00	6,265,000	
養命酒製造	10,000	749.00	7,490,000	
三国コカ・コーラボトリング	13,200	680.00	8,976,000	
コカ・コーラウエスト	43,100	1,311.00	56,504,100	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	14,300	980.00	14,014,000	
ダイドードリンコ	5,800	3,080.00	17,864,000	
伊藤園	38,600	1,300.00	50,180,000	
キーコーヒー	11,100	1,447.00	16,061,700	
ユニカフェ	3,000	351.00	1,053,000	
ジャパンフーズ	1,900	800.00	1,520,000	
日清オイリオグループ	50,000	326.00	16,300,000	
不二製油	30,900	1,071.00	33,093,900	
Ｊ－オイルミルズ	47,000	225.00	10,575,000	
ローソン	35,300	4,490.00	158,497,000	
インターニックス	4,600	358.00	1,646,800	
サンエー	3,800	3,060.00	11,628,000	
キリン堂	4,800	502.00	2,409,600	
ダイユーエイト	1,700	897.00	1,524,900	
カワチ薬品	7,800	1,600.00	12,480,000	
エービーシー・マート	15,900	2,717.00	43,200,300	
ハードオフコーポレーション	5,400	552.00	2,980,800	
高千穂交易	4,700	851.00	3,999,700	
アスクル	8,800	1,241.00	10,920,800	
ゲオホールディングス	186	81,600.00	15,177,600	
ポイント	9,460	3,100.00	29,326,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	7,000	161.00	1,127,000	
伊藤忠食品	2,800	2,770.00	7,756,000	
くらコーポレーション	5,800	1,033.00	5,991,400	
キャンドゥ	59	84,300.00	4,973,700	
エレマテック	8,700	1,363.00	11,858,100	
パル	3,250	3,235.00	10,513,750	
ＪＡＬＵＸ	3,200	772.00	2,470,400	
エディオン	43,700	579.00	25,302,300	
サーラコーポレーション	9,500	505.00	4,797,500	
トーメンデバイス	1,700	1,839.00	3,126,300	
あみやき亭	17	193,800.00	3,294,600	
東京エレクトロン デバイス	23	145,900.00	3,355,700	
ひらまつ	47	65,300.00	3,069,100	
双日	749,400	131.00	98,171,400	
ゲンキー	800	1,679.00	1,343,200	
アルフレッサ ホールディングス	29,300	3,280.00	96,104,000	

ハニーズ	9,830	1,235.00	12,140,050	
キッコーマン	104,000	871.00	90,584,000	
味の素	335,000	917.00	307,195,000	
キユーピー	64,700	1,114.00	72,075,800	
ハウス食品	45,100	1,433.00	64,628,300	
カゴメ	49,100	1,510.00	74,141,000	
焼津水産化学工業	6,000	709.00	4,254,000	
アリアケジャパン	11,600	1,470.00	17,052,000	
ニチレイ	142,000	376.00	53,392,000	
横浜冷凍	25,900	637.00	16,498,300	
東洋水産	55,000	1,872.00	102,960,000	
日清食品ホールディングス	49,700	2,938.00	146,018,600	
永谷園	12,000	882.00	10,584,000	
フジッコ	14,000	983.00	13,762,000	
ロック・フィールド	6,100	1,320.00	8,052,000	
日本たばこ産業	2,818	384,000.00	1,082,112,000	
わらべや日洋	7,200	1,068.00	7,689,600	
なとり	5,800	853.00	4,947,400	
片倉工業	15,000	713.00	10,695,000	
グンゼ	89,000	231.00	20,559,000	
昭栄	20,400	328.00	6,691,200	
神栄	14,000	158.00	2,212,000	
山下医科器械	900	950.00	855,000	
ラサ商事	4,900	359.00	1,759,100	
アルペン	7,100	1,423.00	10,103,300	
アルコニックス	2,900	1,573.00	4,561,700	
ビックカメラ	425	43,900.00	18,657,500	
ＤＣＭホールディングス	58,000	564.00	32,712,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,400	797.00	5,100,800	
あい ホールディングス	20,000	326.00	6,520,000	
Ｊ．フロント リテイリング	264,000	372.00	98,208,000	
ドトール・日レスホールディングス	17,800	1,046.00	18,618,800	
マツモトキヨシホールディングス	20,800	1,501.00	31,220,800	
物語コーポレーション	1,200	1,279.00	1,534,800	
ココカラファイン	11,700	1,992.00	23,306,400	
三越伊勢丹ホールディングス	222,500	841.00	187,122,500	
東洋紡績	503,000	108.00	54,324,000	
ユニチカ	262,000	44.00	11,528,000	
富士紡ホールディングス	49,000	170.00	8,330,000	
日清紡ホールディングス	76,000	752.00	57,152,000	
倉敷紡績	122,000	150.00	18,300,000	

ダイワボウホールディングス	109,000	182.00	19,838,000	
シキボウ	77,000	109.00	8,393,000	
日東紡績	89,000	254.00	22,606,000	
トヨタ紡織	39,700	841.00	33,387,700	
クリエイトＳＤホールディングス	4,700	1,670.00	7,849,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,100	631.00	13,314,100	
ＵＫＣホールディングス	6,700	798.00	5,346,600	
丸善ＣＨＩホールディングス	3,300	210.00	693,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	54,700	393.00	21,497,100	
日本毛織	41,000	557.00	22,837,000	
トーア紡コーポレーション	51,000	57.00	2,907,000	
ダイドーリミテッド	14,800	672.00	9,945,600	
東京建物不動産販売	4,300	215.00	924,500	
野村不動産ホールディングス	54,300	1,193.00	64,779,900	
常和ホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000	
ヒューリック	36,700	898.00	32,956,600	
帝国繊維	12,000	471.00	5,652,000	
ブックオフコーポレーション	6,200	688.00	4,265,600	
日本コークス工業	96,000	112.00	10,752,000	
ミタチ産業	2,700	361.00	974,700	
ＪＦＥ商事ホールディングス	75,000	350.00	26,250,000	
あさひ	6,500	1,573.00	10,224,500	
サークルＫサンクス	24,300	1,288.00	31,298,400	
日本調剤	1,410	2,612.00	3,682,920	
コスモス薬品	5,600	3,650.00	20,440,000	
シップヘルスケアホールディングス	14,500	1,590.00	23,055,000	
ソフトクリエイト	1,200	1,088.00	1,305,600	
セブン＆アイ・ホールディングス	468,400	2,108.00	987,387,200	
ツルハホールディングス	10,000	4,115.00	41,150,000	
サンマルクホールディングス	3,200	2,945.00	9,424,000	
フェリシモ	3,200	1,042.00	3,334,400	
トリドール	9,700	715.00	6,935,500	
クスリのアオキ	1,600	1,401.00	2,241,600	
帝人	486,000	248.00	120,528,000	
東レ	862,000	576.00	496,512,000	
クラレ	188,800	1,134.00	214,099,200	
旭化成	692,000	484.00	334,928,000	
サカイオーベックス	36,000	129.00	4,644,000	
稲葉製作所	5,700	937.00	5,340,900	
三協・立山ホールディングス	160,000	148.00	23,680,000	
トーカロ	6,700	1,668.00	11,175,600	

アルファＣｏ	4,800	940.00	4,512,000	
ＳＵＭＣＯ	74,600	645.00	48,117,000	
川田テクノロジーズ	3,700	1,310.00	4,847,000	
住江織物	32,000	157.00	5,024,000	
日本フエルト	6,700	393.00	2,633,100	
イチカワ	10,000	159.00	1,590,000	
日本バイリーン	16,000	340.00	5,440,000	
芦森工業	35,000	112.00	3,920,000	
アツギ	93,000	95.00	8,835,000	
ダイニック	22,000	150.00	3,300,000	
共和レザー	6,900	306.00	2,111,400	
セーレン	29,700	450.00	13,365,000	
東海染工	17,000	87.00	1,479,000	
小松精練	18,000	362.00	6,516,000	
ワコールホールディングス	71,000	978.00	69,438,000	
ホギメディカル	7,500	3,185.00	23,887,500	
レナウン	25,700	144.00	3,700,800	
クラウディア	2,100	1,015.00	2,131,500	
ＴＳＩホールディングス	53,200	381.00	20,269,200	
デジタルハーツ	9	140,000.00	1,260,000	
ＩＴホールディングス	34,100	893.00	30,451,300	
グリー	48,900	1,978.00	96,724,200	
コーエーテクモホールディングス	22,200	607.00	13,475,400	
三菱総合研究所	4,400	1,401.00	6,164,400	
ボルテージ	1,100	907.00	997,700	
特種東海製紙	75,000	181.00	13,575,000	
ドワンゴ	56	138,600.00	7,761,600	
ベリサーブ	7	132,300.00	926,100	
マクロミル	13,100	721.00	9,445,100	
ティーガイア	72	145,000.00	10,440,000	
GMOペイメントゲートウェイ	24	300,500.00	7,212,000	
ザッパラス	62	82,300.00	5,102,600	
インターネットイニシアティブ	66	239,100.00	15,780,600	
ソネットエンタテインメント	63	267,600.00	16,858,800	
ＳＲＡホールディングス	5,900	795.00	4,690,500	
ＪＢＩＳホールディングス	11,700	242.00	2,831,400	
朝日ネット	9,000	358.00	3,222,000	
王子製紙	525,000	387.00	203,175,000	
三菱製紙	169,000	74.00	12,506,000	
北越紀州製紙	73,500	516.00	37,926,000	
中越パルプ工業	45,000	147.00	6,615,000	

巴川製紙所	20,000	179.00	3,580,000	
大王製紙	49,000	502.00	24,598,000	
日本製紙グループ本社	57,300	1,658.00	95,003,400	
レンゴー	95,000	528.00	50,160,000	
トーモク	37,000	218.00	8,066,000	
ザ・パック	7,000	1,139.00	7,973,000	
コープケミカル	18,000	113.00	2,034,000	
昭和電工	738,000	167.00	123,246,000	
住友化学	816,000	319.00	260,304,000	
日本化成	22,000	141.00	3,102,000	
住友精化	22,000	348.00	7,656,000	
日産化学工業	90,400	775.00	70,060,000	
ラサ工業	48,000	125.00	6,000,000	
クレハ	77,000	384.00	29,568,000	
テイカ	20,000	308.00	6,160,000	
石原産業	199,000	91.00	18,109,000	
片倉チッカリン	9,000	203.00	1,827,000	
日本曹達	71,000	349.00	24,779,000	
東ソー	318,000	226.00	71,868,000	
トクヤマ	185,000	274.00	50,690,000	
セントラル硝子	114,000	361.00	41,154,000	
東亜合成	149,000	328.00	48,872,000	
ダイソー	47,000	251.00	11,797,000	
関東電化工業	26,000	309.00	8,034,000	
電気化学工業	249,000	305.00	75,945,000	
イビデン	74,400	1,582.00	117,700,800	
信越化学工業	213,100	4,000.00	852,400,000	
日本カーバイド工業	38,000	118.00	4,484,000	
堺化学工業	37,000	297.00	10,989,000	
エア・ウォーター	96,000	1,013.00	97,248,000	
大陽日酸	154,000	532.00	81,928,000	
日本化学工業	47,000	138.00	6,486,000	
日本パーカライジング	28,000	977.00	27,356,000	
高圧ガス工業	18,000	474.00	8,532,000	
チタン工業	13,000	376.00	4,888,000	
四国化成工業	17,000	422.00	7,174,000	
戸田工業	15,000	705.00	10,575,000	
ステラ ケミファ	5,600	2,288.00	12,812,800	
保土谷化学工業	24,000	262.00	6,288,000	
日本触媒	86,000	877.00	75,422,000	
大日精化工業	43,000	344.00	14,792,000	

カネカ	148,000	438.00	64,824,000	
協和発酵キリン	162,000	927.00	150,174,000	
三菱瓦斯化学	204,000	460.00	93,840,000	
三井化学	504,000	252.00	127,008,000	
ＪＳＲ	108,200	1,556.00	168,359,200	
東京応化工業	21,300	1,609.00	34,271,700	
三菱ケミカルホールディングス	743,000	463.00	344,009,000	
日本合成化学工業	24,000	480.00	11,520,000	
ダイセル	154,000	484.00	74,536,000	
住友ベークライト	102,000	454.00	46,308,000	
積水化学工業	247,000	634.00	156,598,000	
日本ゼオン	111,000	669.00	74,259,000	
アイカ工業	31,700	1,075.00	34,077,500	
宇部興産	498,000	226.00	112,548,000	
積水樹脂	17,000	815.00	13,855,000	
タキロン	28,000	262.00	7,336,000	
旭有機材工業	42,000	215.00	9,030,000	
日立化成工業	51,400	1,420.00	72,988,000	
ニチバン	12,000	259.00	3,108,000	
リケンテクノス	19,000	217.00	4,123,000	
大倉工業	28,000	240.00	6,720,000	
積水化成品工業	30,000	297.00	8,910,000	
群栄化学工業	31,000	203.00	6,293,000	
タイガースポリマー	5,800	296.00	1,716,800	
日本カーリット	9,500	397.00	3,771,500	
日本化薬	84,000	726.00	60,984,000	
イーピーエス	64	140,400.00	8,985,600	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,600	2,022.00	5,257,200	
フェイス	384	8,380.00	3,217,920	
アミューズ	3,300	998.00	3,293,400	
野村総合研究所	63,400	1,685.00	106,829,000	
ドリームインキュベータ	43	57,800.00	2,485,400	
サイバネットシステム	93	20,370.00	1,894,410	
ＴＡＣ	12,300	158.00	1,943,400	
電通	107,800	2,479.00	267,236,200	
インテージ	3,300	1,475.00	4,867,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	773	5,590.00	4,321,070	
シンプレクス・ホールディングス	188	25,500.00	4,794,000	
イオンファンタジー	4,200	1,227.00	5,153,400	
メディカルシステムネットワーク	1,900	802.00	1,523,800	
日本精化	9,900	519.00	5,138,100	

ＡＤＥＫＡ	51,100	767.00	39,193,700	
日油	95,000	393.00	37,335,000	
ミヨシ油脂	44,000	106.00	4,664,000	
ハリマ化成	10,100	623.00	6,292,300	
花王	315,100	2,087.00	657,613,700	
第一工業製薬	22,000	232.00	5,104,000	
三洋化成工業	37,000	516.00	19,092,000	
武田薬品工業	445,000	3,245.00	1,444,025,000	
アステラス製薬	263,700	3,005.00	792,418,500	
大日本住友製薬	84,100	846.00	71,148,600	
塩野義製薬	185,500	985.00	182,717,500	
田辺三菱製薬	118,100	1,154.00	136,287,400	
わかもと製薬	13,000	234.00	3,042,000	
あすか製薬	14,000	473.00	6,622,000	
日本新薬	25,000	922.00	23,050,000	
中外製薬	138,000	1,196.00	165,048,000	
科研製薬	47,000	1,000.00	47,000,000	
エーザイ	146,200	3,150.00	460,530,000	
ロート製薬	50,000	920.00	46,000,000	
小野薬品工業	58,100	4,300.00	249,830,000	
久光製薬	36,900	3,335.00	123,061,500	
有機合成薬品工業	9,000	180.00	1,620,000	
持田製薬	42,000	860.00	36,120,000	
参天製薬	39,900	3,185.00	127,081,500	
扶桑薬品工業	40,000	204.00	8,160,000	
日本ケミファ	18,000	292.00	5,256,000	
ツムラ	32,400	2,241.00	72,608,400	
日医工	20,100	1,833.00	36,843,300	
テルモ	82,400	3,645.00	300,348,000	
みらかホールディングス	30,900	2,872.00	88,744,800	
キッセイ薬品工業	22,000	1,565.00	34,430,000	
生化学工業	22,700	857.00	19,453,900	
栄研化学	9,200	1,035.00	9,522,000	
日水製薬	4,800	698.00	3,350,400	
鳥居薬品	8,100	1,413.00	11,445,300	
東和薬品	6,000	3,315.00	19,890,000	
沢井製薬	7,800	7,950.00	62,010,000	
ゼリア新薬工業	17,000	1,314.00	22,338,000	
第一三共	399,600	1,434.00	573,026,400	
キョーリン製薬ホールディングス	29,000	1,311.00	38,019,000	
大幸薬品	5,500	797.00	4,383,500	

ダイト	3,200	1,200.00	3,840,000	
大塚ホールディングス	235,800	2,121.00	500,131,800	
大正製薬ホールディングス	28,600	6,450.00	184,470,000	
大日本塗料	68,000	87.00	5,916,000	
日本ペイント	112,000	586.00	65,632,000	
関西ペイント	134,000	720.00	96,480,000	
中国塗料	37,000	493.00	18,241,000	
日本特殊塗料	9,200	310.00	2,852,000	
藤倉化成	15,000	402.00	6,030,000	
太陽ホールディングス	9,700	2,052.00	19,904,400	
ＤＩＣ	453,000	155.00	70,215,000	
サカタインクス	22,000	352.00	7,744,000	
東洋インキＳＣホールディングス	107,000	302.00	32,314,000	
アルプス技研	5,300	617.00	3,270,100	
サニックス	17,200	221.00	3,801,200	
ダイオーズ	2,200	485.00	1,067,000	
日本空調サービス	3,100	720.00	2,232,000	
オリエンタルランド	32,000	7,900.00	252,800,000	
ダスキン	35,600	1,503.00	53,506,800	
パーク２４	57,800	948.00	54,794,400	
明光ネットワークジャパン	11,200	697.00	7,806,400	
ファルコＳＤホールディングス	7,400	900.00	6,660,000	
クレスコ	2,800	674.00	1,887,200	
フジ・メディア・ホールディングス	1,166	112,900.00	131,641,400	
秀英予備校	5,100	302.00	1,540,200	
田谷	2,000	676.00	1,352,000	
ラウンドワン	39,300	468.00	18,392,400	
リゾートトラスト	19,100	1,149.00	21,945,900	
オービック	3,510	14,600.00	51,246,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,300	799.00	1,837,700	
ヤフー	8,198	24,550.00	201,260,900	
ビー・エム・エル	7,800	1,812.00	14,133,600	
ワタベウェディング	3,900	702.00	2,737,800	
トレンドマイクロ	49,400	2,358.00	116,485,200	
もしもしホットライン	19,600	689.00	13,504,400	
東急コミュニティー	3,100	2,471.00	7,660,100	
リソー教育	1,278	5,140.00	6,568,920	
日本オラクル	17,900	2,524.00	45,179,600	
アルファシステムズ	3,100	1,200.00	3,720,000	
フューチャーアーキテクト	135	30,450.00	4,110,750	
ウェアハウス	4,600	246.00	1,131,600	

シーエーシー	7,600	627.00	4,765,200	
ソフトバンク・テクノロジー	2,700	609.00	1,644,300	
トーセ	2,800	522.00	1,461,600	
ユー・エス・エス	15,450	7,240.00	111,858,000	
オービックビジネスコンサルタント	2,850	3,600.00	10,260,000	
日立ビジネスソリューション	3,500	1,006.00	3,521,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	13,200	3,465.00	45,738,000	
アイティフォー	12,600	285.00	3,591,000	
東京個別指導学院	10,700	144.00	1,540,800	
東計電算	2,000	1,023.00	2,046,000	
エックスネット	10	114,900.00	1,149,000	
テー・オー・ダブリュー	3,600	465.00	1,674,000	
大塚商会	8,900	5,370.00	47,793,000	
総合メディカル	2,700	2,493.00	6,731,100	
サイボウズ	206	22,250.00	4,583,500	
ソフトブレーン	168	7,950.00	1,335,600	
アグレックス	3,000	749.00	2,247,000	
セントラルスポーツ	4,300	1,009.00	4,338,700	
電通国際情報サービス	6,900	713.00	4,919,700	
ウェザーニューズ	3,400	1,939.00	6,592,600	
ＣＩＪ	11,200	295.00	3,304,000	
WOWOW	34	202,300.00	6,878,200	
富士フイルムホールディングス	253,800	1,967.00	499,224,600	
コニカミノルタホールディングス	299,500	564.00	168,918,000	
資生堂	197,200	1,375.00	271,150,000	
ライオン	137,000	452.00	61,924,000	
高砂香料工業	39,000	369.00	14,391,000	
マンダム	11,900	1,982.00	23,585,800	
ミルボン	6,300	2,331.00	14,685,300	
ファンケル	29,800	1,064.00	31,707,200	
コーセー	19,200	1,909.00	36,652,800	
ドクターシーラボ	72	389,500.00	28,044,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	12,100	1,962.00	23,740,200	
エステー	7,300	1,005.00	7,336,500	
コニシ	8,600	1,096.00	9,425,600	
長谷川香料	15,100	1,217.00	18,376,700	
小林製薬	16,500	4,000.00	66,000,000	
荒川化学工業	9,200	698.00	6,421,600	
メック	8,500	279.00	2,371,500	
日本高純度化学	33	208,500.00	6,880,500	
荏原ユージライト	1,600	1,935.00	3,096,000	

アース製薬	8,500	2,895.00	24,607,500	
イハラケミカル工業	20,000	325.00	6,500,000	
北興化学工業	12,000	229.00	2,748,000	
大成ラミック	3,300	2,437.00	8,042,100	
クミアイ化学工業	28,000	327.00	9,156,000	
日本農薬	27,000	318.00	8,586,000	
昭和シェル石油	106,200	529.00	56,179,800	
コスモ石油	328,000	226.00	74,128,000	
富士興産	40,000	75.00	3,000,000	
ニチレキ	16,000	417.00	6,672,000	
東燃ゼネラル石油	179,000	736.00	131,744,000	
ユシロ化学工業	6,400	867.00	5,548,800	
ビーピー・カストロール	4,900	332.00	1,626,800	
ＡＯＣホールディングス	27,500	530.00	14,575,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,500	775.00	1,937,500	
出光興産	14,100	8,270.00	116,607,000	
ＪＸホールディングス	1,318,400	473.00	623,603,200	
横浜ゴム	145,000	450.00	65,250,000	
東洋ゴム工業	90,000	187.00	16,830,000	
ブリヂストン	372,300	1,716.00	638,866,800	
住友ゴム工業	92,600	922.00	85,377,200	
藤倉ゴム工業	7,400	287.00	2,123,800	
オカモト	43,000	296.00	12,728,000	
アキレス	96,000	113.00	10,848,000	
フコク	5,000	720.00	3,600,000	
ニッタ	11,700	1,445.00	16,906,500	
クリエートメディック	7,600	807.00	6,133,200	
東海ゴム工業	22,000	885.00	19,470,000	
三ツ星ベルト	31,000	410.00	12,710,000	
バンドー化学	42,000	307.00	12,894,000	
鬼怒川ゴム工業	26,000	650.00	16,900,000	
旭硝子	585,000	680.00	397,800,000	
日本板硝子	513,000	151.00	77,463,000	
石塚硝子	15,000	140.00	2,100,000	
有沢製作所	19,800	292.00	5,781,600	
日本山村硝子	47,000	211.00	9,917,000	
日本電気硝子	228,000	794.00	181,032,000	
オハラ	4,500	810.00	3,645,000	
住友大阪セメント	241,000	239.00	57,599,000	
太平洋セメント	699,000	163.00	113,937,000	
デイ・シイ	13,700	256.00	3,507,200	

リゾートソリューション	16,000	149.00	2,384,000	
日本ヒューム	11,000	340.00	3,740,000	
日本コンクリート工業	22,000	278.00	6,116,000	
東海カーボン	103,000	411.00	42,333,000	
日本カーボン	54,000	215.00	11,610,000	
東洋炭素	6,600	3,230.00	21,318,000	
ノリタケカンパニーリミテド	61,000	237.00	14,457,000	
ＴＯＴＯ	183,000	628.00	114,924,000	
日本碍子	155,000	976.00	151,280,000	
日本特殊陶業	102,000	966.00	98,532,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,500	3,360.00	11,760,000	
品川リフラクトリーズ	30,000	237.00	7,110,000	
黒崎播磨	28,000	275.00	7,700,000	
東京窯業	15,000	195.00	2,925,000	
ニッカトー	4,200	454.00	1,906,800	
フジミインコーポレーテッド	10,800	1,028.00	11,102,400	
ニチアス	53,000	435.00	23,055,000	
新日本製鐵	3,117,000	200.00	623,400,000	
住友金属工業	2,201,000	143.00	314,743,000	
神戸製鋼所	1,647,000	131.00	215,757,000	
日新製鋼	423,000	125.00	52,875,000	
中山製鋼所	68,000	95.00	6,460,000	
合同製鐵	67,000	190.00	12,730,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	281,400	1,419.00	399,306,600	
東京製鐵	60,200	616.00	37,083,200	
共英製鋼	12,700	1,440.00	18,288,000	
大和工業	27,200	2,385.00	64,872,000	
東京鐵鋼	23,000	246.00	5,658,000	
大阪製鐵	7,500	1,457.00	10,927,500	
淀川製鋼所	84,000	359.00	30,156,000	
東洋鋼鈑	29,000	284.00	8,236,000	
住友鋼管	7,000	647.00	4,529,000	
丸一鋼管	36,400	1,859.00	67,667,600	
モリ工業	18,000	261.00	4,698,000	
大同特殊鋼	199,000	509.00	101,291,000	
日本高周波鋼業	48,000	95.00	4,560,000	
日本金属工業	92,000	69.00	6,348,000	
日本冶金工業	90,500	124.00	11,222,000	
山陽特殊製鋼	59,000	444.00	26,196,000	
愛知製鋼	63,000	428.00	26,964,000	
日立金属	78,000	888.00	69,264,000	

日本金属	28,000	145.00	4,060,000	
大平洋金属	83,000	427.00	35,441,000	
日本電工	44,000	375.00	16,500,000	
栗本鐵工所	57,000	186.00	10,602,000	
日本鋳鉄管	15,000	186.00	2,790,000	
日本製鋼所	183,000	599.00	109,617,000	
三菱製鋼	72,000	227.00	16,344,000	
日亜鋼業	18,000	212.00	3,816,000	
日本精線	8,000	387.00	3,096,000	
日本軽金属	271,000	108.00	29,268,000	
大紀アルミニウム工業所	18,000	335.00	6,030,000	
三井金属鉱業	323,000	214.00	69,122,000	
東邦亜鉛	67,000	307.00	20,569,000	
三菱マテリアル	742,000	236.00	175,112,000	
住友金属鉱山	307,000	1,082.00	332,174,000	
ＤＯＷＡホールディングス	142,000	506.00	71,852,000	
古河機械金属	199,000	70.00	13,930,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	3,705.00	43,348,500	
東邦チタニウム	19,300	1,373.00	26,498,900	
住友軽金属工業	287,000	76.00	21,812,000	
古河スカイ	48,000	216.00	10,368,000	
古河電気工業	374,000	194.00	72,556,000	
住友電気工業	419,500	903.00	378,808,500	
フジクラ	178,000	238.00	42,364,000	
昭和電線ホールディングス	152,000	80.00	12,160,000	
タツタ電線	22,000	354.00	7,788,000	
日立電線	93,000	180.00	16,740,000	
沖電線	12,000	162.00	1,944,000	
カナレ電気	1,500	1,190.00	1,785,000	
平河ヒューテック	2,500	741.00	1,852,500	
リョービ	67,000	305.00	20,435,000	
アサヒホールディングス	16,600	1,586.00	26,327,600	
東洋製罐	84,000	1,096.00	92,064,000	
ホッカンホールディングス	32,000	230.00	7,360,000	
コロナ	5,800	1,204.00	6,983,200	
横河ブリッジホールディングス	24,000	554.00	13,296,000	
駒井ハルテック	27,000	319.00	8,613,000	
高田機工	13,000	270.00	3,510,000	
三和ホールディングス	120,000	263.00	31,560,000	
文化シヤッター	33,000	305.00	10,065,000	
東洋シヤッター	3,400	380.00	1,292,000	

住生活グループ	154,400	1,593.00	245,959,200	
日本フイルコン	10,400	402.00	4,180,800	
ノーリツ	23,300	1,358.00	31,641,400	
長府製作所	11,400	1,977.00	22,537,800	
リンナイ	19,100	5,340.00	101,994,000	
ユニプレス	18,100	2,345.00	42,444,500	
ダイニチ工業	7,000	722.00	5,054,000	
日東精工	18,000	213.00	3,834,000	
三洋工業	15,000	162.00	2,430,000	
岡部	23,500	399.00	9,376,500	
日立ツール	6,800	868.00	5,902,400	
東プレ	22,900	776.00	17,770,400	
高周波熱錬	15,800	654.00	10,333,200	
東京製綱	82,000	193.00	15,826,000	
パイオラックス	5,200	1,748.00	9,089,600	
日本発條	86,000	715.00	61,490,000	
中央発條	17,000	283.00	4,811,000	
三浦工業	17,700	2,215.00	39,205,500	
タクマ	40,000	365.00	14,600,000	
ツガミ	29,000	522.00	15,138,000	
オークマ	71,000	551.00	39,121,000	
東芝機械	65,000	413.00	26,845,000	
アマダ	168,000	537.00	90,216,000	
アイダエンジニアリング	30,700	373.00	11,451,100	
牧野フライス製作所	60,000	533.00	31,980,000	
オーエスジー	52,300	1,171.00	61,243,300	
ダイジェット工業	17,000	155.00	2,635,000	
旭ダイヤモンド工業	29,200	1,027.00	29,988,400	
森精機製作所	62,600	746.00	46,699,600	
ディスコ	12,100	4,450.00	53,845,000	
日東工器	6,900	1,807.00	12,468,300	
豊田自動織機	103,300	2,194.00	226,640,200	
豊和工業	70,000	70.00	4,900,000	
大阪機工	46,000	115.00	5,290,000	
東洋機械金属	13,000	200.00	2,600,000	
津田駒工業	29,000	202.00	5,858,000	
島精機製作所	15,500	1,410.00	21,855,000	
日阪製作所	15,000	866.00	12,990,000	
やまびこ	4,700	887.00	4,168,900	
ペガサスミシン製造	14,000	238.00	3,332,000	
ナブテスコ	49,300	1,587.00	78,239,100	

三井海洋開発	10,000	1,389.00	13,890,000	
レオン自動機	13,000	190.00	2,470,000	
ＳＭＣ	35,400	12,940.00	458,076,000	
新川	11,200	413.00	4,625,600	
ホソカワミクロン	20,000	370.00	7,400,000	
ユニオンツール	6,600	1,357.00	8,956,200	
オイレス工業	13,200	1,571.00	20,737,200	
サトーホールディングス	12,500	970.00	12,125,000	
日本エアーテック	4,400	362.00	1,592,800	
日精樹脂工業	10,600	351.00	3,720,600	
ワイエイシイ	6,100	638.00	3,891,800	
小松製作所	562,900	2,080.00	1,170,832,000	
住友重機械工業	303,000	482.00	146,046,000	
日立建機	60,700	1,478.00	89,714,600	
日工	17,000	335.00	5,695,000	
巴工業	4,600	1,437.00	6,610,200	
井関農機	123,000	175.00	21,525,000	
ＴＯＷＡ	12,900	429.00	5,534,100	
丸山製作所	27,000	175.00	4,725,000	
北川鉄工所	57,000	152.00	8,664,000	
シンニッタン	10,900	350.00	3,815,000	
クボタ	544,000	694.00	377,536,000	
荏原実業	2,800	1,191.00	3,334,800	
東洋エンジニアリング	79,000	313.00	24,727,000	
三菱化工機	36,000	145.00	5,220,000	
月島機械	18,000	598.00	10,764,000	
帝国電機製作所	4,200	1,390.00	5,838,000	
新東工業	25,900	723.00	18,725,700	
澁谷工業	6,900	893.00	6,161,700	
アイチ コーポレーション	19,900	345.00	6,865,500	
小森コーポレーション	33,800	541.00	18,285,800	
鶴見製作所	9,000	567.00	5,103,000	
住友精密工業	18,000	502.00	9,036,000	
酒井重工業	23,000	171.00	3,933,000	
荏原製作所	194,000	311.00	60,334,000	
石井鐵工所	21,000	158.00	3,318,000	
西島製作所	13,800	1,055.00	14,559,000	
千代田化工建設	105,000	853.00	89,565,000	
ダイキン工業	144,600	2,252.00	325,639,200	
オルガノ	22,000	611.00	13,442,000	
トーヨーカネツ	64,000	166.00	10,624,000	

栗田工業	65,500	2,076.00	135,978,000	
椿本チエイン	61,000	448.00	27,328,000	
大同工業	27,000	149.00	4,023,000	
日本コンベヤ	36,000	84.00	3,024,000	
日機装	50,000	683.00	34,150,000	
木村化工機	10,900	341.00	3,716,900	
新興プランテック	27,100	651.00	17,642,100	
アネスト岩田	20,000	353.00	7,060,000	
ダイフク	52,500	434.00	22,785,000	
加藤製作所	29,000	265.00	7,685,000	
油研工業	21,000	166.00	3,486,000	
タダノ	55,000	507.00	27,885,000	
フジテック	33,000	488.00	16,104,000	
シーケーディ	32,900	584.00	19,213,600	
キトー	59	57,400.00	3,386,600	
平和	24,600	1,316.00	32,373,600	
理想科学工業	8,300	1,095.00	9,088,500	
ＳＡＮＫＹＯ	34,400	3,645.00	125,388,000	
日本金銭機械	10,700	592.00	6,334,400	
マースエンジニアリング	6,400	1,331.00	8,518,400	
福島工業	3,400	949.00	3,226,600	
オーイズミ	7,200	244.00	1,756,800	
ダイコク電機	5,600	745.00	4,172,000	
アマノ	34,400	677.00	23,288,800	
サンデン	63,000	255.00	16,065,000	
ブラザー工業	146,700	1,014.00	148,753,800	
マックス	18,000	960.00	17,280,000	
モリタホールディングス	18,000	463.00	8,334,000	
グローリー	33,900	1,689.00	57,257,100	
大和冷機工業	16,000	407.00	6,512,000	
セガサミーホールディングス	121,900	1,603.00	195,405,700	
日本ピストンリング	41,000	164.00	6,724,000	
リケン	42,000	313.00	13,146,000	
ＴＰＲ	13,000	978.00	12,714,000	
ホシザキ電機	22,900	1,736.00	39,754,400	
大豊工業	9,000	740.00	6,660,000	
日本精工	253,000	570.00	144,210,000	
ＮＴＮ	264,000	337.00	88,968,000	
ジェイテクト	109,000	840.00	91,560,000	
不二越	117,000	387.00	45,279,000	
ミネベア	169,000	343.00	57,967,000	

日本トムソン	38,000	472.00	17,936,000	
ＴＨＫ	75,700	1,658.00	125,510,600	
ユーシン精機	5,800	1,449.00	8,404,200	
前澤給装工業	4,300	1,061.00	4,562,300	
イーグル工業	15,000	690.00	10,350,000	
前澤工業	13,400	240.00	3,216,000	
日本ピラー工業	13,000	580.00	7,540,000	
キッツ	47,700	337.00	16,074,900	
日立製作所	2,547,000	434.00	1,105,398,000	
東芝	2,388,000	327.00	780,876,000	
三菱電機	1,134,000	786.00	891,324,000	
富士電機	342,000	222.00	75,924,000	
東洋電機製造	20,000	294.00	5,880,000	
安川電機	133,000	686.00	91,238,000	
シンフォニアテクノロジー	69,000	182.00	12,558,000	
明電舎	112,000	277.00	31,024,000	
オリジン電気	18,000	253.00	4,554,000	
デンヨー	10,800	1,058.00	11,426,400	
日立工機	30,500	604.00	18,422,000	
三櫻工業	14,400	554.00	7,977,600	
マキタ	74,000	2,860.00	211,640,000	
東芝テック	71,000	283.00	20,093,000	
芝浦メカトロニクス	20,000	216.00	4,320,000	
マブチモーター	15,500	3,240.00	50,220,000	
日本電産	61,300	7,380.00	452,394,000	
高岳製作所	45,000	179.00	8,055,000	
ダイヘン	67,000	284.00	19,028,000	
ＪＶＣケンウッド	68,500	312.00	21,372,000	
第一精工	2,700	2,221.00	5,996,700	
日新電機	23,000	483.00	11,109,000	
大崎電気工業	16,000	778.00	12,448,000	
オムロン	126,400	1,670.00	211,088,000	
日東工業	17,100	953.00	16,296,300	
ＩＤＥＣ	14,900	824.00	12,277,600	
エルピーダメモリ	150,500	345.00	51,922,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	219,000	452.00	98,988,000	
サクサホールディングス	30,000	176.00	5,280,000	
メルコホールディングス	6,300	2,110.00	13,293,000	
テクノメディカ	9	285,000.00	2,565,000	
日本電気	1,560,000	165.00	257,400,000	
富士通	1,094,000	428.00	468,232,000	

沖電気工業	438,000	75.00	32,850,000	
岩崎通信機	50,000	77.00	3,850,000	
電気興業	35,000	341.00	11,935,000	
サンケン電気	58,000	266.00	15,428,000	
ナカヨ通信機	11,000	303.00	3,333,000	
アイホン	6,600	1,551.00	10,236,600	
ルネサスエレクトロニクス	29,500	510.00	15,045,000	
セイコーエプソン	77,500	987.00	76,492,500	
ワコム	224	111,400.00	24,953,600	
アルバック	21,000	1,058.00	22,218,000	
アクセル	5,300	1,557.00	8,252,100	
ナナオ	9,600	1,639.00	15,734,400	
日本信号	26,500	499.00	13,223,500	
京三製作所	25,000	346.00	8,650,000	
能美防災	15,000	525.00	7,875,000	
ホーチキ	10,000	391.00	3,910,000	
日本無線	25,000	216.00	5,400,000	
パナソニック	1,296,100	653.00	846,353,300	
シャープ	548,000	675.00	369,900,000	
アンリツ	54,000	792.00	42,768,000	
富士通ゼネラル	27,000	462.00	12,474,000	
日立国際電気	26,000	697.00	18,122,000	
ソニー	707,700	1,367.00	967,425,900	
ＴＤＫ	59,400	3,645.00	216,513,000	
帝国通信工業	27,000	138.00	3,726,000	
ミツミ電機	40,100	613.00	24,581,300	
タムラ製作所	38,000	227.00	8,626,000	
アルプス電気	89,600	581.00	52,057,600	
パイオニア	160,900	364.00	58,567,600	
日本電波工業	8,800	952.00	8,377,600	
日本トリム	1,350	1,844.00	2,489,400	
ローランド ディー．ジー．	5,100	847.00	4,319,700	
フォスター電機	11,100	1,085.00	12,043,500	
クラリオン	70,000	139.00	9,730,000	
ＳＭＫ	36,000	254.00	9,144,000	
ヨコオ	8,900	388.00	3,453,200	
東光	52,000	143.00	7,436,000	
ホシデン	30,800	548.00	16,878,400	
ヒロセ電機	19,700	7,390.00	145,583,000	
日本航空電子工業	26,000	562.00	14,612,000	
ＴＯＡ	13,000	520.00	6,760,000	

ユニデン	34,000	280.00	9,520,000	
アルパイン	22,200	951.00	21,112,200	
スミダコーポレーション	7,100	490.00	3,479,000	
アイコム	6,300	2,027.00	12,770,100	
船井電機	10,200	1,795.00	18,309,000	
横河電機	123,100	720.00	88,632,000	
新電元工業	40,000	352.00	14,080,000	
山武	29,100	1,643.00	47,811,300	
日本光電工業	22,600	1,818.00	41,086,800	
チノー	20,000	202.00	4,040,000	
共和電業	12,000	235.00	2,820,000	
日本電子材料	4,600	374.00	1,720,400	
堀場製作所	21,000	2,337.00	49,077,000	
アドバンテスト	84,400	762.00	64,312,800	
小野測器	12,000	217.00	2,604,000	
エスペック	11,800	504.00	5,947,200	
パナソニック電工ＳＵＮＸ	10,100	403.00	4,070,300	
キーエンス	25,300	19,650.00	497,145,000	
日置電機	5,500	1,305.00	7,177,500	
シスメックス	39,900	2,510.00	100,149,000	
メガチップス	9,400	1,213.00	11,402,200	
ＯＢＡＲＡ ＧＲＯＵＰ	8,100	896.00	7,257,600	
日本電産コパル電子	11,800	472.00	5,569,600	
ミヤチテクノス	5,600	655.00	3,668,000	
東京電波	3,400	379.00	1,288,600	
澤藤電機	6,000	214.00	1,284,000	
デンソー	280,200	2,221.00	622,324,200	
コーセル	16,500	1,116.00	18,414,000	
日立メディコ	8,000	850.00	6,800,000	
新日本無線	7,000	248.00	1,736,000	
オプテックス	7,800	1,009.00	7,870,200	
千代田インテグレ	5,500	938.00	5,159,000	
東光電気	8,000	305.00	2,440,000	
スタンレー電気	76,100	1,235.00	93,983,500	
岩崎電気	42,000	171.00	7,182,000	
ウシオ電機	68,900	1,154.00	79,510,600	
岡谷電機産業	6,200	344.00	2,132,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	10,000	153.00	1,530,000	
日本セラミック	7,400	1,439.00	10,648,600	
新神戸電機	9,000	1,709.00	15,381,000	
日本デジタル研究所	9,600	736.00	7,065,600	

古河電池	8,000	357.00	2,856,000	
双信電機	5,600	331.00	1,853,600	
山一電機	11,500	184.00	2,116,000	
図研	7,500	570.00	4,275,000	
日本電子	42,000	210.00	8,820,000	
カシオ計算機	108,200	459.00	49,663,800	
ファナック	118,100	13,050.00	1,541,205,000	
日本シイエムケイ	24,600	294.00	7,232,400	
エンプラス	5,700	1,675.00	9,547,500	
ローム	55,900	3,785.00	211,581,500	
浜松ホトニクス	44,300	2,730.00	120,939,000	
三井ハイテック	15,100	318.00	4,801,800	
新光電気工業	38,200	587.00	22,423,400	
京セラ	94,300	6,550.00	617,665,000	
協栄産業	14,000	141.00	1,974,000	
太陽誘電	51,000	701.00	35,751,000	
村田製作所	119,000	4,205.00	500,395,000	
ユーシン	15,900	644.00	10,239,600	
双葉電子工業	19,400	1,290.00	25,026,000	
日東電工	97,900	2,864.00	280,385,600	
北陸電気工業	46,000	120.00	5,520,000	
東海理化電機製作所	26,600	1,288.00	34,260,800	
ニチコン	35,800	795.00	28,461,000	
日本ケミコン	65,000	277.00	18,005,000	
ＫＯＡ	14,300	726.00	10,381,800	
三井造船	439,000	135.00	59,265,000	
日立造船	449,500	113.00	50,793,500	
佐世保重工業	74,000	134.00	9,916,000	
三菱重工業	1,901,000	346.00	657,746,000	
川崎重工業	824,000	224.00	184,576,000	
ＩＨＩ	776,000	201.00	155,976,000	
日本車輌製造	41,000	324.00	13,284,000	
日本輸送機	15,000	219.00	3,285,000	
近畿車輛	17,000	234.00	3,978,000	
日産自動車	1,433,100	721.00	1,033,265,100	
いすゞ自動車	717,000	379.00	271,743,000	
トヨタ自動車	1,470,900	2,729.00	4,014,086,100	
日野自動車	162,000	500.00	81,000,000	
三菱自動車工業	2,536,000	92.00	233,312,000	
エフテック	3,900	916.00	3,572,400	
武蔵精密工業	11,000	1,778.00	19,558,000	

日産車体	33,000	804.00	26,532,000	
新明和工業	51,000	345.00	17,595,000	
極東開発工業	19,600	608.00	11,916,800	
日信工業	20,700	1,202.00	24,881,400	
トピー工業	85,000	215.00	18,275,000	
ティラド	41,000	296.00	12,136,000	
曙ブレーキ工業	57,500	365.00	20,987,500	
タチエス	14,800	1,449.00	21,445,200	
ＮＯＫ	54,900	1,434.00	78,726,600	
フタバ産業	32,100	468.00	15,022,800	
カヤバ工業	79,000	418.00	33,022,000	
シロキ工業	25,000	227.00	5,675,000	
市光工業	27,000	145.00	3,915,000	
大同メタル工業	17,000	874.00	14,858,000	
プレス工業	52,000	380.00	19,760,000	
カルソニックカンセイ	67,000	483.00	32,361,000	
太平洋工業	23,000	373.00	8,579,000	
ケーヒン	23,500	1,462.00	34,357,000	
河西工業	14,000	414.00	5,796,000	
アイシン精機	93,400	2,365.00	220,891,000	
富士機工	13,000	220.00	2,860,000	
マツダ	941,000	129.00	121,389,000	
ダイハツ工業	105,000	1,462.00	153,510,000	
愛知機械工業	26,000	288.00	7,488,000	
今仙電機製作所	8,300	881.00	7,312,300	
本田技研工業	957,000	2,658.00	2,543,706,000	
スズキ	237,100	1,669.00	395,719,900	
富士重工業	358,000	505.00	180,790,000	
ヤマハ発動機	184,800	1,047.00	193,485,600	
ショーワ	24,100	486.00	11,712,600	
小糸製作所	56,000	1,203.00	67,368,000	
ＴＢＫ	11,000	374.00	4,114,000	
エクセディ	15,400	2,318.00	35,697,200	
ミツバ	21,000	625.00	13,125,000	
豊田合成	32,100	1,238.00	39,739,800	
愛三工業	11,700	640.00	7,488,000	
ヨロズ	6,800	1,790.00	12,172,000	
エフ・シー・シー	18,500	1,631.00	30,173,500	
新家工業	26,000	124.00	3,224,000	
シマノ	42,900	3,725.00	159,802,500	
タカタ	20,500	1,805.00	37,002,500	

テイ・エス テック	24,000	1,333.00	31,992,000	
小野建	9,800	654.00	6,409,200	
はるやま商事	4,700	400.00	1,880,000	
佐鳥電機	8,300	493.00	4,091,900	
カッパ・クリエイト	8,200	1,767.00	14,489,400	
エコートレーディング	2,800	714.00	1,999,200	
伯東	6,800	750.00	5,100,000	
コンドーテック	7,900	497.00	3,926,300	
中山福	6,400	605.00	3,872,000	
ライトオン	8,400	585.00	4,914,000	
ナガイレーベン	14,800	1,068.00	15,806,400	
三菱食品	10,200	2,091.00	21,328,200	
良品計画	11,900	3,605.00	42,899,500	
三城ホールディングス	13,800	606.00	8,362,800	
松田産業	8,200	1,228.00	10,069,600	
メディパルホールディングス	120,600	815.00	98,289,000	
アドヴァン	6,700	707.00	4,736,900	
ＳＰＫ	2,600	1,332.00	3,463,200	
アズワン	7,300	1,623.00	11,847,900	
スズデン	3,600	526.00	1,893,600	
尾家産業	3,600	834.00	3,002,400	
シモジマ	6,900	1,053.00	7,265,700	
ドウシシャ	5,300	2,364.00	12,529,200	
コナカ	13,200	593.00	7,827,600	
高速	6,700	651.00	4,361,700	
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,251.00	1,626,300	
Ｇ－７ホールディングス	3,300	389.00	1,283,700	
イオン北海道	7,000	359.00	2,513,000	
コジマ	15,100	500.00	7,550,000	
コーナン商事	12,200	1,160.00	14,152,000	
黒田電気	13,800	833.00	11,495,400	
ネットワンシステムズ	253	194,600.00	49,233,800	
エコス	3,800	479.00	1,820,200	
ワタミ	13,200	1,722.00	22,730,400	
マルシェ	2,700	705.00	1,903,500	
ドン・キホーテ	21,700	2,738.00	59,414,600	
丸文	8,900	343.00	3,052,700	
メガネトップ	16,000	816.00	13,056,000	
西松屋チェーン	24,500	605.00	14,822,500	
ゼンショーホールディングス	42,700	1,024.00	43,724,800	
ハピネット	6,000	676.00	4,056,000	

幸楽苑	6,900	1,220.00	8,418,000	
トーメンエレクトロニクス	5,200	965.00	5,018,000	
ハークスレイ	2,700	549.00	1,482,300	
サイゼリヤ	16,600	1,209.00	20,069,400	
エクセル	5,200	770.00	4,004,000	
マルカキカイ	3,600	703.00	2,530,800	
アルゴグラフィックス	4,100	1,040.00	4,264,000	
ガリバーインターナショナル	3,400	2,888.00	9,819,200	
日本エム・ディ・エム	9,400	252.00	2,368,800	
ポプラ	3,800	478.00	1,816,400	
ユナイテッドアローズ	12,100	1,499.00	18,137,900	
進和	6,600	910.00	6,006,000	
エスケイジャパン	2,700	255.00	688,500	
ダイトエレクトロン	5,200	403.00	2,095,600	
ハイデイ日高	4,900	1,319.00	6,463,100	
シークス	7,100	924.00	6,560,400	
京都きもの友禅	7,800	924.00	7,207,200	
コロワイド	37,000	560.00	20,720,000	
田中商事	3,500	431.00	1,508,500	
オーハシテクニカ	6,300	601.00	3,786,300	
壱番屋	4,500	2,228.00	10,026,000	
マクニカ	5,800	1,838.00	10,660,400	
白銅	3,600	805.00	2,898,000	
トップカルチャー	4,100	388.00	1,590,800	
スギホールディングス	20,100	2,153.00	43,275,300	
島津製作所	147,000	659.00	96,873,000	
ＪＭＳ	38,000	247.00	9,386,000	
クボテック	24	22,280.00	534,720	
モリテックス	2,400	313.00	751,200	
長野計器	8,000	798.00	6,384,000	
ブイ・テクノロジー	37	305,000.00	11,285,000	
スター精密	18,300	710.00	12,993,000	
東京計器	94,000	155.00	14,570,000	
愛知時計電機	35,000	289.00	10,115,000	
日本電産トーソク	5,400	954.00	5,151,600	
東京精密	25,300	1,532.00	38,759,600	
ニコン	202,700	1,794.00	363,643,800	
トプコン	26,100	406.00	10,596,600	
理研計器	18,200	589.00	10,719,800	
大日本スクリーン製造	107,000	661.00	70,727,000	
キヤノン電子	10,400	2,002.00	20,820,800	

タムロン	14,000	1,907.00	26,698,000	
ＨＯＹＡ	280,600	1,673.00	469,443,800	
ノーリツ鋼機	29,500	348.00	10,266,000	
エー・アンド・デイ	37,800	272.00	10,281,600	
キヤノン	704,700	3,430.00	2,417,121,000	
リコー	341,000	650.00	221,650,000	
日本電産コパル	16,600	868.00	14,408,800	
日本電産サンキョー	27,000	524.00	14,148,000	
シチズンホールディングス	154,800	457.00	70,743,600	
リズム時計工業	103,000	143.00	14,729,000	
大研医器	7,000	816.00	5,712,000	
パラマウントベッドホールディングス	9,700	2,216.00	21,495,200	
ＳＨＯ－ＢＩ	3,300	462.00	1,524,600	
ＳＲＩスポーツ	7,200	845.00	6,084,000	
バンダイナムコホールディングス	119,300	1,061.00	126,577,300	
共立印刷	18,800	221.00	4,154,800	
フランスベッドホールディングス	79,000	141.00	11,139,000	
パイロットコーポレーション	99	153,800.00	15,226,200	
エイベックス・グループ・ホールディングス	21,200	936.00	19,843,200	
トッパン・フォームズ	24,400	584.00	14,249,600	
フジシールインターナショナル	12,700	1,394.00	17,703,800	
タカラトミー	38,500	537.00	20,674,500	
廣済堂	9,700	201.00	1,949,700	
レック	3,500	1,191.00	4,168,500	
タカノ	5,400	458.00	2,473,200	
プロネクサス	12,600	392.00	4,939,200	
ウッドワン	19,000	285.00	5,415,000	
大建工業	48,000	258.00	12,384,000	
きもと	9,600	512.00	4,915,200	
凸版印刷	345,000	605.00	208,725,000	
大日本印刷	345,000	793.00	273,585,000	
図書印刷	20,000	128.00	2,560,000	
共同印刷	40,000	186.00	7,440,000	
日本写真印刷	19,700	990.00	19,503,000	
光村印刷	11,000	253.00	2,783,000	
藤森工業	8,500	1,134.00	9,639,000	
宝印刷	6,400	565.00	3,616,000	
前澤化成工業	8,300	820.00	6,806,000	
アシックス	105,700	836.00	88,365,200	
ツツミ	5,700	1,799.00	10,254,300	
ＪＳＰ	7,700	1,214.00	9,347,800	

ニチハ	13,200	905.00	11,946,000	
ローランド	12,500	669.00	8,362,500	
エフピコ	5,300	5,150.00	27,295,000	
小松ウオール工業	4,800	816.00	3,916,800	
ヤマハ	83,400	691.00	57,629,400	
河合楽器製作所	42,000	155.00	6,510,000	
クリナップ	14,000	487.00	6,818,000	
ピジョン	10,000	2,973.00	29,730,000	
天馬	9,500	692.00	6,574,000	
キングジム	9,500	601.00	5,709,500	
リンテック	21,800	1,486.00	32,394,800	
信越ポリマー	23,300	344.00	8,015,200	
東リ	31,000	160.00	4,960,000	
イトーキ	27,100	176.00	4,769,600	
任天堂	64,900	10,700.00	694,430,000	
三菱鉛筆	9,700	1,386.00	13,444,200	
タカラスタンダード	52,000	611.00	31,772,000	
コクヨ	59,000	539.00	31,801,000	
ナカバヤシ	26,000	193.00	5,018,000	
ニフコ	26,500	2,125.00	56,312,500	
グローブライド	55,000	91.00	5,005,000	
岡村製作所	40,000	568.00	22,720,000	
日本バルカー工業	46,000	209.00	9,614,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	12,000	285.00	3,420,000	
伊藤忠商事	893,200	804.00	718,132,800	
丸紅	979,000	505.00	494,395,000	
スクロール	14,500	290.00	4,205,000	
高島	19,000	194.00	3,686,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	8,600	766.00	6,587,600	
三陽商会	61,000	182.00	11,102,000	
長瀬産業	63,400	885.00	56,109,000	
蝶理	68,000	95.00	6,460,000	
豊田通商	124,700	1,450.00	180,815,000	
オンワードホールディングス	73,000	591.00	43,143,000	
三共生興	19,100	282.00	5,386,200	
兼松	238,000	81.00	19,278,000	
美津濃	56,000	413.00	23,128,000	
ツカモトコーポレーション	20,000	93.00	1,860,000	
ファミリーマート	34,400	3,020.00	103,888,000	
ルック	23,000	193.00	4,439,000	
三井物産	966,400	1,266.00	1,223,462,400	

日本紙パルプ商事	58,000	288.00	16,704,000	
東京エレクトロン	95,400	4,335.00	413,559,000	
日立ハイテクノロジーズ	34,000	1,764.00	59,976,000	
カメイ	15,000	823.00	12,345,000	
東都水産	19,000	143.00	2,717,000	
スターゼン	37,000	245.00	9,065,000	
セイコーホールディングス	66,000	169.00	11,154,000	
山善	43,000	577.00	24,811,000	
椿本興業	12,000	222.00	2,664,000	
住友商事	660,700	1,091.00	720,823,700	
日本ユニシス	27,100	477.00	12,926,700	
内田洋行	26,000	218.00	5,668,000	
三菱商事	815,400	1,703.00	1,388,626,200	
第一実業	24,000	351.00	8,424,000	
キヤノンマーケティングジャパン	37,300	937.00	34,950,100	
西華産業	42,000	217.00	9,114,000	
佐藤商事	10,000	452.00	4,520,000	
菱洋エレクトロ	12,600	939.00	11,831,400	
東京産業	11,000	261.00	2,871,000	
ユアサ商事	114,000	121.00	13,794,000	
神鋼商事	28,000	205.00	5,740,000	
阪和興業	112,000	362.00	40,544,000	
カナデン	11,000	519.00	5,709,000	
菱電商事	16,000	471.00	7,536,000	
ニプロ	59,000	676.00	39,884,000	
フルサト工業	6,600	690.00	4,554,000	
岩谷産業	122,000	265.00	32,330,000	
すてきナイスグループ	49,000	175.00	8,575,000	
昭光通商	40,000	124.00	4,960,000	
ニチモウ	16,000	177.00	2,832,000	
極東貿易	13,000	212.00	2,756,000	
イワキ	17,000	198.00	3,366,000	
兼松エレクトロニクス	7,100	800.00	5,680,000	
三愛石油	27,000	350.00	9,450,000	
稲畑産業	29,900	472.00	14,112,800	
ＧＳＩクレオス	28,000	107.00	2,996,000	
明和産業	8,800	226.00	1,988,800	
ゴールドウイン	27,000	372.00	10,044,000	
ユニ・チャーム	65,600	3,865.00	253,544,000	
デサント	30,000	400.00	12,000,000	
ヤマトインターナショナル	7,300	370.00	2,701,000	

東邦ホールディングス	35,900	1,070.00	38,413,000	
サンゲツ	19,800	2,084.00	41,263,200	
ミツウロコグループホールディングス	18,100	484.00	8,760,400	
シナネン	24,000	344.00	8,256,000	
伊藤忠エネクス	24,800	440.00	10,912,000	
サンリオ	28,200	3,395.00	95,739,000	
サンワテクノス	5,500	748.00	4,114,000	
リョーサン	18,200	1,671.00	30,412,200	
新光商事	12,300	633.00	7,785,900	
トーホー	23,000	317.00	7,291,000	
三信電気	16,000	654.00	10,464,000	
東陽テクニカ	16,200	831.00	13,462,200	
モスフードサービス	14,700	1,548.00	22,755,600	
加賀電子	12,200	850.00	10,370,000	
三益半導体工業	10,500	662.00	6,951,000	
ソーダニッカ	12,000	337.00	4,044,000	
立花エレテック	6,800	665.00	4,522,000	
木曽路	12,800	1,462.00	18,713,600	
千趣会	20,100	515.00	10,351,500	
タカキュー	8,500	152.00	1,292,000	
ケーヨー	21,100	498.00	10,507,800	
アデランス	14,600	942.00	13,753,200	
上新電機	24,000	851.00	20,424,000	
日本瓦斯	10,700	1,294.00	13,845,800	
ベスト電器	35,000	175.00	6,125,000	
マルエツ	23,000	292.00	6,716,000	
ロイヤルホールディングス	18,700	916.00	17,129,200	
東天紅	8,000	171.00	1,368,000	
いなげや	12,500	921.00	11,512,500	
島忠	25,300	1,755.00	44,401,500	
チヨダ	14,700	1,415.00	20,800,500	
ライフコーポレーション	7,400	1,381.00	10,219,400	
カスミ	23,000	511.00	11,753,000	
リンガーハット	10,100	1,057.00	10,675,700	
ＭｒＭａｘ	11,200	326.00	3,651,200	
テンアライド	8,400	277.00	2,326,800	
ＡＯＫＩホールディングス	10,300	1,252.00	12,895,600	
オークワ	16,000	1,090.00	17,440,000	
コメリ	15,300	2,247.00	34,379,100	
青山商事	30,900	1,327.00	41,004,300	
しまむら	13,000	7,790.00	101,270,000	

ＣＦＳコーポレーション	8,000	375.00	3,000,000	
高島屋	152,000	575.00	87,400,000	
松屋	24,100	457.00	11,013,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	58,000	611.00	35,438,000	
ニッセンホールディングス	22,400	359.00	8,041,600	
パルコ	20,300	576.00	11,692,800	
丸井グループ	146,000	609.00	88,914,000	
クレディセゾン	91,600	1,464.00	134,102,400	
原信ナルスホールディングス	6,200	1,340.00	8,308,000	
ダイエー	69,100	274.00	18,933,400	
イズミヤ	41,000	410.00	16,810,000	
イオン	394,800	993.00	392,036,400	
ユニー	84,400	709.00	59,839,600	
イズミ	33,700	1,359.00	45,798,300	
東武ストア	15,000	268.00	4,020,000	
平和堂	20,700	988.00	20,451,600	
フジ	12,500	1,854.00	23,175,000	
ヤオコー	5,000	2,536.00	12,680,000	
ゼビオ	13,500	1,772.00	23,922,000	
ケーズホールディングス	27,900	2,710.00	75,609,000	
Ｐａｌｔａｃ	11,800	992.00	11,705,600	
Ｏｌｙｍｐｉｃ	7,400	755.00	5,587,000	
日産東京販売ホールディングス	16,000	137.00	2,192,000	
新生銀行	872,000	83.00	72,376,000	
あおぞら銀行	349,000	215.00	75,035,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,475,300	350.00	2,966,355,000	
りそなホールディングス	974,400	346.00	337,142,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,194,000	238.00	522,172,000	
三井住友フィナンシャルグループ	846,700	2,373.00	2,009,219,100	
第四銀行	146,000	257.00	37,522,000	
北越銀行	116,000	160.00	18,560,000	
西日本シティ銀行	393,000	223.00	87,639,000	
札幌北洋ホールディングス	168,800	282.00	47,601,600	
千葉銀行	442,000	488.00	215,696,000	
横浜銀行	719,000	365.00	262,435,000	
常陽銀行	431,000	341.00	146,971,000	
群馬銀行	256,000	419.00	107,264,000	
武蔵野銀行	18,000	2,629.00	47,322,000	
千葉興業銀行	21,400	418.00	8,945,200	
筑波銀行	46,500	272.00	12,648,000	
東京都民銀行	21,200	988.00	20,945,600	

七十七銀行	175,000	364.00	63,700,000	
青森銀行	84,000	243.00	20,412,000	
秋田銀行	77,000	228.00	17,556,000	
山形銀行	68,000	391.00	26,588,000	
岩手銀行	7,600	3,425.00	26,030,000	
東邦銀行	94,000	239.00	22,466,000	
東北銀行	60,000	145.00	8,700,000	
みちのく銀行	56,000	150.00	8,400,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	454,000	329.00	149,366,000	
静岡銀行	338,000	793.00	268,034,000	
十六銀行	140,000	261.00	36,540,000	
スルガ銀行	109,000	693.00	75,537,000	
八十二銀行	206,000	453.00	93,318,000	
山梨中央銀行	68,000	340.00	23,120,000	
大垣共立銀行	149,000	258.00	38,442,000	
福井銀行	96,000	237.00	22,752,000	
北國銀行	134,000	303.00	40,602,000	
清水銀行	3,800	3,110.00	11,818,000	
滋賀銀行	105,000	520.00	54,600,000	
南都銀行	104,000	427.00	44,408,000	
百五銀行	101,000	319.00	32,219,000	
京都銀行	200,000	672.00	134,400,000	
三重銀行	46,000	184.00	8,464,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	784,000	157.00	123,088,000	
広島銀行	330,000	363.00	119,790,000	
山陰合同銀行	67,000	591.00	39,597,000	
中国銀行	92,000	1,051.00	96,692,000	
鳥取銀行	36,000	150.00	5,400,000	
伊予銀行	120,000	742.00	89,040,000	
百十四銀行	123,000	368.00	45,264,000	
四国銀行	81,000	306.00	24,786,000	
阿波銀行	99,000	529.00	52,371,000	
鹿児島銀行	72,000	543.00	39,096,000	
大分銀行	72,000	225.00	16,200,000	
宮崎銀行	75,000	195.00	14,625,000	
肥後銀行	87,000	447.00	38,889,000	
佐賀銀行	68,000	197.00	13,396,000	
十八銀行	72,000	220.00	15,840,000	
沖縄銀行	8,500	3,320.00	28,220,000	
琉球銀行	23,500	976.00	22,936,000	
八千代銀行	5,900	1,857.00	10,956,300	

みずほフィナンシャルグループ	14,381,400	115.00	1,653,861,000	
紀陽ホールディングス	446,000	119.00	53,074,000	
山口フィナンシャルグループ	112,000	739.00	82,768,000	
芙蓉総合リース	10,700	2,793.00	29,885,100	
興銀リース	16,300	1,878.00	30,611,400	
東京センチュリーリース	30,200	1,494.00	45,118,800	
ＳＢＩホールディングス	11,952	6,000.00	71,712,000	
日本証券金融	49,900	391.00	19,510,900	
大阪証券金融	26,000	181.00	4,706,000	
ポケットカード	18,200	267.00	4,859,400	
長野銀行	37,000	165.00	6,105,000	
名古屋銀行	101,000	263.00	26,563,000	
愛知銀行	4,000	4,635.00	18,540,000	
第三銀行	63,000	177.00	11,151,000	
中京銀行	46,000	207.00	9,522,000	
東日本銀行	54,000	166.00	8,964,000	
大光銀行	40,000	263.00	10,520,000	
愛媛銀行	70,000	231.00	16,170,000	
トマト銀行	43,000	133.00	5,719,000	
みなと銀行	101,000	148.00	14,948,000	
京葉銀行	92,000	383.00	35,236,000	
関西アーバン銀行	156,000	126.00	19,656,000	
栃木銀行	56,000	281.00	15,736,000	
北日本銀行	3,500	1,965.00	6,877,500	
東和銀行	112,000	91.00	10,192,000	
福島銀行	130,000	51.00	6,630,000	
大東銀行	71,000	69.00	4,899,000	
リコーリース	7,800	1,787.00	13,938,600	
イオンクレジットサービス	49,900	1,129.00	56,337,100	
アコム	23,300	1,365.00	31,804,500	
プロミス	9,850	835.00	8,224,750	
ジャックス	74,000	242.00	17,908,000	
オリエントコーポレーション	162,000	77.00	12,474,000	
日立キャピタル	22,200	1,090.00	24,198,000	
オリックス	58,260	7,220.00	420,637,200	
三菱ＵＦＪリース	28,450	3,195.00	90,897,750	
ジャフコ	14,300	1,474.00	21,078,200	
トモニホールディングス	86,100	350.00	30,135,000	
大和証券グループ本社	1,111,000	273.00	303,303,000	
野村ホールディングス	2,427,000	281.00	681,987,000	
岡三証券グループ	96,000	257.00	24,672,000	

丸三証券	39,400	254.00	10,007,600	
東洋証券	45,000	115.00	5,175,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	129,000	223.00	28,767,000	
水戸証券	38,000	104.00	3,952,000	
いちよし証券	26,200	360.00	9,432,000	
松井証券	66,500	404.00	26,866,000	
ＮＫＳＪホールディングス	234,100	1,563.00	365,898,300	
だいこう証券ビジネス	7,000	264.00	1,848,000	
マネックスグループ	939	11,990.00	11,258,610	
カブドットコム証券	45,900	245.00	11,245,500	
極東証券	16,000	500.00	8,000,000	
岩井コスモホールディングス	14,000	261.00	3,654,000	
フィデアホールディングス	64,400	219.00	14,103,600	
池田泉州ホールディングス	461,900	118.00	54,504,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	334,600	1,501.00	502,234,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	107,300	1,258.00	134,983,400	
第一生命保険	5,988	81,100.00	485,626,800	
東京海上ホールディングス	425,100	1,827.00	776,657,700	
アサックス	15	84,900.00	1,273,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,400	1,199.00	5,275,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	408,100	776.00	316,685,600	
三井不動産	497,000	1,258.00	625,226,000	
三菱地所	784,000	1,264.00	990,976,000	
平和不動産	112,000	177.00	19,824,000	
東京建物	218,000	282.00	61,476,000	
ダイビル	34,600	499.00	17,265,400	
サンケイビル	25,800	377.00	9,726,600	
東急不動産	229,000	329.00	75,341,000	
京阪神ビルディング	15,900	341.00	5,421,900	
住友不動産	269,000	1,461.00	393,009,000	
東宝不動産	11,800	476.00	5,616,800	
大京	176,000	175.00	30,800,000	
テーオーシー	43,400	374.00	16,231,600	
東京楽天地	18,000	291.00	5,238,000	
フジ住宅	15,800	390.00	6,162,000	
空港施設	12,000	311.00	3,732,000	
明和地所	6,200	340.00	2,108,000	
住友不動産販売	4,030	3,210.00	12,936,300	
ゴールドクレスト	10,740	1,348.00	14,477,520	
東栄住宅	7,600	846.00	6,429,600	

リロ・ホールディング	3,600	1,995.00	7,182,000	
日本エスリード	5,400	685.00	3,699,000	
東急リバブル	10,400	607.00	6,312,800	
飯田産業	12,700	599.00	7,607,300	
日神不動産	8,600	462.00	3,973,200	
アーネストワン	18,500	830.00	15,355,000	
タカラレーベン	16,900	482.00	8,145,800	
サンヨーハウジング名古屋	47	78,400.00	3,684,800	
イオンモール	51,100	1,729.00	88,351,900	
フージャースコーポレーション	232	33,100.00	7,679,200	
タクトホーム	59	63,700.00	3,758,300	
トーセイ	215	20,310.00	4,366,650	
エヌ・ティ・ティ都市開発	712	57,100.00	40,655,200	
ランドビジネス	75	14,720.00	1,104,000	
東武鉄道	644,000	394.00	253,736,000	
相鉄ホールディングス	181,000	241.00	43,621,000	
東京急行電鉄	668,000	369.00	246,492,000	
京浜急行電鉄	291,000	694.00	201,954,000	
小田急電鉄	363,000	744.00	270,072,000	
京王電鉄	317,000	550.00	174,350,000	
京成電鉄	182,000	556.00	101,192,000	
富士急行	31,000	476.00	14,756,000	
新京成電鉄	15,000	355.00	5,325,000	
東日本旅客鉄道	197,200	4,675.00	921,910,000	
西日本旅客鉄道	98,600	3,150.00	310,590,000	
東海旅客鉄道	984	636,000.00	625,824,000	
西日本鉄道	147,000	375.00	55,125,000	
ハマキョウレックス	3,200	2,285.00	7,312,000	
サカイ引越センター	2,100	1,647.00	3,458,700	
近畿日本鉄道	1,025,000	296.00	303,400,000	
阪急阪神ホールディングス	761,000	329.00	250,369,000	
南海電気鉄道	236,000	344.00	81,184,000	
京阪電気鉄道	254,000	376.00	95,504,000	
名糖運輸	4,600	613.00	2,819,800	
名古屋鉄道	396,000	210.00	83,160,000	
日本通運	449,000	301.00	135,149,000	
ヤマトホールディングス	230,800	1,237.00	285,499,600	
山九	138,000	294.00	40,572,000	
日新	43,000	209.00	8,987,000	
丸運	6,100	192.00	1,171,200	
丸全昭和運輸	38,000	260.00	9,880,000	

センコー	45,000	316.00	14,220,000	
トナミホールディングス	23,000	178.00	4,094,000	
日本梱包運輸倉庫	34,000	802.00	27,268,000	
日本石油輸送	13,000	192.00	2,496,000	
福山通運	69,000	448.00	30,912,000	
セイノーホールディングス	88,000	590.00	51,920,000	
神奈川中央交通	13,000	419.00	5,447,000	
日立物流	23,600	1,272.00	30,019,200	
日本郵船	899,000	187.00	168,113,000	
商船三井	595,000	273.00	162,435,000	
川崎汽船	351,000	134.00	47,034,000	
ＮＳユナイテッド海運	49,000	119.00	5,831,000	
乾汽船	12,600	269.00	3,389,400	
飯野海運	56,800	334.00	18,971,200	
共栄タンカー	20,000	126.00	2,520,000	
第一中央汽船	77,000	99.00	7,623,000	
全日本空輸	1,512,000	219.00	331,128,000	
パスコ	15,000	294.00	4,410,000	
三菱倉庫	81,000	847.00	68,607,000	
三井倉庫	53,000	297.00	15,741,000	
住友倉庫	83,000	373.00	30,959,000	
澁澤倉庫	27,000	237.00	6,399,000	
ヤマタネ	56,000	118.00	6,608,000	
東陽倉庫	18,000	177.00	3,186,000	
日本トランスシティ	24,000	278.00	6,672,000	
ケイヒン	21,000	88.00	1,848,000	
安田倉庫	8,800	495.00	4,356,000	
東洋埠頭	33,000	130.00	4,290,000	
宇徳	7,700	280.00	2,156,000	
上組	126,000	656.00	82,656,000	
サンリツ	3,000	515.00	1,545,000	
キムラユニティー	2,600	687.00	1,786,200	
キユーソー流通システム	3,600	856.00	3,081,600	
郵船ロジスティクス	8,900	961.00	8,552,900	
近鉄エクスプレス	10,100	2,220.00	22,422,000	
東海運	7,100	246.00	1,746,600	
バンテック	13	231,700.00	3,012,100	
東京放送ホールディングス	67,100	1,000.00	67,100,000	
日本テレビ放送網	9,830	11,590.00	113,929,700	
テレビ朝日	284	129,300.00	36,721,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	851	38,450.00	32,720,950	

テレビ東京ホールディングス	7,100	1,037.00	7,362,700	
アイ・ティー・シーネットワーク	9,500	503.00	4,778,500	
イー・アクセス	856	17,590.00	15,057,040	
ＮＥＣモバイリング	4,100	2,587.00	10,606,700	
日本電信電話	515,600	3,820.00	1,969,592,000	
ＫＤＤＩ	1,738	481,000.00	835,978,000	
光通信	10,300	1,955.00	20,136,500	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,225	136,800.00	1,261,980,000	
ＧＭＯインターネット	33,300	294.00	9,790,200	
学研ホールディングス	34,000	149.00	5,066,000	
ゼンリン	16,200	705.00	11,421,000	
昭文社	6,200	597.00	3,701,400	
角川グループホールディングス	10,600	2,523.00	26,743,800	
インプレスホールディングス	9,200	110.00	1,012,000	
東京電力	896,400	217.00	194,518,800	
中部電力	373,800	1,469.00	549,112,200	
関西電力	462,900	1,268.00	586,957,200	
中国電力	156,800	1,423.00	223,126,400	
北陸電力	111,100	1,484.00	164,872,400	
東北電力	283,400	806.00	228,420,400	
四国電力	104,400	2,264.00	236,361,600	
九州電力	250,500	1,145.00	286,822,500	
北海道電力	106,200	1,136.00	120,643,200	
沖縄電力	6,800	3,270.00	22,236,000	
電源開発	70,400	2,028.00	142,771,200	
東京瓦斯	1,369,000	346.00	473,674,000	
大阪瓦斯	1,101,000	303.00	333,603,000	
東邦瓦斯	288,000	477.00	137,376,000	
北海道瓦斯	20,000	278.00	5,560,000	
西部瓦斯	128,000	212.00	27,136,000	
静岡瓦斯	29,500	509.00	15,015,500	
アイネット	4,900	471.00	2,307,900	
松竹	74,000	760.00	56,240,000	
東宝	79,900	1,309.00	104,589,100	
エイチ・アイ・エス	12,100	2,198.00	26,595,800	
東映	47,000	369.00	17,343,000	
葵プロモーション	5,500	408.00	2,244,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	692	243,300.00	168,363,600	
共立メンテナンス	6,600	1,420.00	9,372,000	
イチネンホールディングス	15,000	403.00	6,045,000	
建設技術研究所	6,900	530.00	3,657,000	

アインファーマシーズ	6,200	3,355.00	20,801,000	
燦ホールディングス	2,700	1,419.00	3,831,300	
スバル興業	9,000	302.00	2,718,000	
東京テアトル	45,000	113.00	5,085,000	
ホリプロ	4,000	1,048.00	4,192,000	
よみうりランド	27,000	244.00	6,588,000	
東京都競馬	92,000	107.00	9,844,000	
カナモト	17,000	694.00	11,798,000	
東京ドーム	99,000	203.00	20,097,000	
ＤＴＳ	11,600	979.00	11,356,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,600	1,492.00	54,607,200	
シーイーシー	6,700	374.00	2,505,800	
カプコン	21,500	1,587.00	34,120,500	
日本空港ビルデング	35,700	1,043.00	37,235,100	
トランス・コスモス	15,700	967.00	15,181,900	
乃村工藝社	25,000	250.00	6,250,000	
ジャステック	7,200	451.00	3,247,200	
ＳＣＳＫ	22,900	1,244.00	28,487,600	
藤田観光	30,000	249.00	7,470,000	
日本管財	4,400	1,450.00	6,380,000	
トーカイ	4,900	1,685.00	8,256,500	
白洋舎	17,000	218.00	3,706,000	
セコム	115,000	3,535.00	406,525,000	
日本システムウエア	3,800	309.00	1,174,200	
セントラル警備保障	5,400	792.00	4,276,800	
アイネス	13,600	549.00	7,466,400	
丹青社	16,000	222.00	3,552,000	
メイテック	18,600	1,460.00	27,156,000	
ＴＫＣ	9,400	1,613.00	15,162,200	
アサツー ディ・ケイ	20,700	2,110.00	43,677,000	
富士ソフト	15,100	1,389.00	20,973,900	
応用地質	12,700	909.00	11,544,300	
船井総合研究所	12,200	528.00	6,441,600	
ＮＳＤ	21,700	610.00	13,237,000	
進学会	6,200	306.00	1,897,200	
丸紅建材リース	11,000	175.00	1,925,000	
コナミ	50,600	1,963.00	99,327,800	
ベネッセホールディングス	36,700	3,425.00	125,697,500	
イオンディライト	13,400	1,521.00	20,381,400	
ナック	3,200	1,503.00	4,809,600	
福井コンピュータ	1,600	395.00	632,000	

ニチイ学館	23,700	916.00	21,709,200	
ダイセキ	19,100	1,362.00	26,014,200	
日鐵商事	25,000	215.00	5,375,000	
元気寿司	3,400	977.00	3,321,800	
トラスコ中山	14,000	1,425.00	19,950,000	
ヤマダ電機	54,470	4,910.00	267,447,700	
オートバックスセブン	13,300	3,560.00	47,348,000	
アークランドサカモト	7,300	1,413.00	10,314,900	
ニトリホールディングス	22,150	6,850.00	151,727,500	
グルメ杵屋	8,000	438.00	3,504,000	
愛眼	8,900	368.00	3,275,200	
吉野家ホールディングス	303	106,900.00	32,390,700	
加藤産業	16,100	1,498.00	24,117,800	
イノテック	6,800	540.00	3,672,000	
イエローハット	10,600	1,107.00	11,734,200	
富士エレクトロニクス	5,800	1,153.00	6,687,400	
松屋フーズ	5,400	1,606.00	8,672,400	
ＪＢＣＣホールディングス	8,800	529.00	4,655,200	
ＪＫホールディングス	9,400	378.00	3,553,200	
サガミチェーン	13,000	517.00	6,721,000	
日伝	4,600	2,263.00	10,409,800	
北沢産業	9,500	163.00	1,548,500	
杉本商事	6,100	727.00	4,434,700	
因幡電機産業	13,200	2,231.00	29,449,200	
住金物産	52,000	210.00	10,920,000	
プレナス	12,500	1,309.00	16,362,500	
ミニストップ	8,300	1,396.00	11,586,800	
アークス	15,400	1,479.00	22,776,600	
バロー	22,300	1,163.00	25,934,900	
ミスミグループ本社	41,400	1,809.00	74,892,600	
江守商事	2,200	901.00	1,982,200	
アルテック	5,500	214.00	1,177,000	
ベルク	5,500	1,211.00	6,660,500	
大庄	5,200	1,023.00	5,319,600	
タキヒヨー	17,000	454.00	7,718,000	
ファーストリテイリング	26,200	14,680.00	384,616,000	
ソフトバンク	507,200	2,171.00	1,101,131,200	
スズケン	43,000	2,141.00	92,063,000	
サンドラッグ	21,300	2,240.00	47,712,000	
ジェコス	7,800	348.00	2,714,400	
ヤマザワ	2,900	1,378.00	3,996,200	

やまや	1,800	1,184.00	2,131,200	
ベルーナ	13,950	566.00	7,895,700	
合計	171,922,599		116,743,176,880	

②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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	137,332,057	396,033,562
コール・ローン	2,054,319,047	833,987,390
国債証券	231,592,276,664	191,606,132,429
特殊債券	1,902,294,601	1,163,692,155
派生商品評価勘定	59,800	―
未収利息	3,002,463,806	2,354,003,279
前払費用	139,020,007	81,788,987
流動資産合計	238,827,765,982	196,435,637,802
資産合計	238,827,765,982	196,435,637,802
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,960	―
前受収益	8,552	―
未払金	792,132,209	―
未払解約金	523,172,500	124,251,206
流動負債合計	1,315,364,221	124,251,206
負債合計	1,315,364,221	124,251,206
純資産の部		
元本等		
元本	139,068,161,379	115,838,047,298
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	98,444,240,382	80,473,339,298
元本等合計	237,512,401,761	196,311,386,596
純資産合計	237,512,401,761	196,311,386,596
負債純資産合計	238,827,765,982	196,435,637,802

（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、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20日）
1．資産の評価基準及び評価方法	（1）国債証券、特殊債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （2）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。	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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	154,212,069,459円	139,068,161,379円
期中追加設定元本額	16,987,534,598円	12,002,627,974円
期中一部解約元本額	32,131,442,678円	35,232,742,055円
期末元本額	139,068,161,379円	115,838,047,298円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン（毎月決算型）	15,054,036,678円	9,711,720,983円
住信 外国債券オープン（3ケ月決算型）	527,046,880円	394,153,767円
住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	5,370,101,531円	3,472,264,902円
住信 財産四分法ファンド（毎月決算型）	4,288,764,859円	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	264,730,890円	383,910,697円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,960,244円	13,119,507円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	2,113,685,114円	2,798,656,333円
世界経済インデックスファンド	172,387,326円	306,465,337円
すみしん マイセレクション25	27,458,189円	23,267,059円
すみしん マイセレクション50	17,408,940円	16,707,057円
すみしん マイセレクション75	9,995,509円	9,719,497円
すみしん DCマイセレクション25	727,638,299円	929,469,641円

すみしん DCマイセレクション50	744,840,020円	869,471,154円
すみしん DCマイセレクション75	443,248,689円	502,641,233円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	947,879,847円	1,066,084,561円
すみしん DCマイセレクションS25	69,232,105円	236,139,905円
すみしん DCマイセレクションS50	91,603,836円	207,250,570円
すみしん DCマイセレクションS75	45,819,273円	85,242,565円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,975,886円	2,833,675円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	8,441,036円	24,890,600円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	5,376,846円	14,902,234円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,774,480円	4,165,295円
すみしん DCマルチアセット ファンド	180,730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）	3,432,131,250円	5,079,987,760円
STAM 外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	2,600,222,994円	2,194,316,062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	46,777,149円
すみしん マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	16,815,962円	13,846,479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）	644,466,674円	595,804,861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）	1,699,413,594円	1,625,205,910円
すみしん バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,940,285,902円	2,620,373,885円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	36,445,239,840円	32,800,065,587円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,704,994,628円	3,249,478,898円
すみしん バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	10,915,274,881円	10,446,141,417円
すみしん バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,538,089,619円	1,422,169,890円
すみしん バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,531,063,433円	4,746,938,677円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,966,350,947円	5,317,801,187円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	6,290,406,243円	5,725,069,076円
すみしん バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,874,198,047円	1,645,884,331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）	3,877,403,650円	3,625,743,014円
すみしん バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	754,589,298円	672,417,962円

すみしん バランスF（25）VA1 （適格機関投資家専用）	672,992,714円	920,235,952円
住信 FOFs用外国債券オープン （適格機関投資家専用）	15,145,401,292円	7,211,143,473円
住信 グローバル債券ファンド・シリーズ1 （適格機関投資家専用）	2,484,395,688円	1,463,028,632円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	407,659,178円	394,354,256円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	1,126,308,115円	1,064,510,206円
2．計算期間末日における受益権の総数	139,068,161,379口	115,838,047,298口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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

II 金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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.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。 ①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 ②計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち該当日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 2.計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。	a.国債証券、特殊債券 同左

	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。	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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	（平成24年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△5,275,528,421	6,549,489,398
特殊債券	△15,943,118	44,858,760
合　計	△5,291,471,539	6,594,348,158

（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

通貨関連

区分	種 類	（平成23年 1月20日現在）				（平成24年 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評価損益（円）	契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	アメリカドル	279,340,600	―	279,310,000	△30,600	―	―	―	―
	オーストラリアドル	34,367,760	―	34,364,400	△3,360	―	―	―	―
	イギリスポンド	43,267,950	―	43,266,300	△1,650	―	―	―	―
	ポーランドズロチ	29,621,800	―	29,681,600	59,800	―	―	―	―
	ユーロ	339,096,850	―	339,081,500	△15,350	―	―	―	―
合　計		725,694,960	―	725,703,800	8,840	―	―	―	―

（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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.7079円	1口当たり純資産額 ＝ 1.6947円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 10/15/13	16,200,000.00	16,277,203.20	
		T 0.625% 02/28/13	16,700,000.00	16,787,414.14	
		T 0.75% 09/15/13	14,200,000.00	14,324,250.00	
		T 0.75% 12/15/13	15,000,000.00	15,144,726.60	
		T 1% 01/15/14	3,900,000.00	3,957,890.62	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,145,445.32	
		T 1.375% 01/15/13	23,000,000.00	23,278,515.74	
		T 1.375% 05/15/13	5,000,000.00	5,078,320.30	
		T 1.5% 12/31/13	8,650,000.00	8,863,546.87	
		T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	23,285,062.50	
		T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	6,298,964.85	
		T 1.75% 07/31/15	27,000,000.00	28,183,359.51	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	8,063,859.41	
		T 1.875% 04/30/14	25,100,000.00	26,007,914.18	
		T 1.875% 06/30/15	15,900,000.00	16,661,461.01	
		T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,237,937.50	
		T 1.875% 09/30/17	9,000,000.00	9,394,101.54	
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,607,812.50	
		T 2% 11/15/21	1,800,000.00	1,803,515.63	
		T 2% 11/30/13	15,000,000.00	15,490,429.65	
		T 2.125% 02/29/16	14,000,000.00	14,844,921.84	
		T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,201,507.84	

		T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,704,171.90	
		T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,563,179.73	
		T 2.25% 11/30/17	9,000,000.00	9,576,210.96	
		T 2.375% 02/28/15	14,500,000.00	15,387,558.63	
		T 2.375% 03/31/16	9,600,000.00	10,276,125.02	
		T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,274,062.52	
		T 2.375% 06/30/18	10,250,000.00	10,948,281.25	
		T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	13,163,574.25	
		T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,336,328.14	
		T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,128,648.40	
		T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,080,039.06	
		T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,839,375.00	
		T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,423,828.15	
		T 2.625% 06/30/14	14,400,000.00	15,215,625.07	
		T 2.625% 08/15/20	18,400,000.00	19,712,437.59	
		T 2.625% 11/15/20	17,500,000.00	18,708,593.75	
		T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,784,910.17	
		T 2.75% 02/15/19	5,300,000.00	5,779,484.37	
		T 2.75% 02/28/13	6,000,000.00	6,172,031.28	
		T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,153,875.00	
		T 2.75% 05/31/17	16,000,000.00	17,485,000.00	
		T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,566,972.66	
		T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,270,390.66	
		T 2.875% 01/31/13	15,800,000.00	16,243,757.85	
		T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,292,132.83	
		T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,491,562.50	
		T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,576,457.05	
		T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,885,410.16	
		T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,225,664.09	
		T 3.125% 05/15/19	9,000,000.00	10,041,328.17	
		T 3.125% 05/15/21	11,250,000.00	12,458,496.15	
		T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,663,652.33	
		T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,417,734.37	
		T 3.125% 11/15/41	5,500,000.00	5,588,945.34	
		T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,771,476.59	
		T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,779,296.91	
		T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,904,414.08	
		T 3.375% 06/30/13	11,200,000.00	11,713,187.47	
		T 3.375% 07/31/13	21,000,000.00	22,015,546.97	
		T 3.375% 11/15/19	8,300,000.00	9,410,125.00	
		T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,479,742.21	

T 3.5% 02/15/39	7,200,000.00	7,891,875.00	
T 3.5% 05/15/20	10,200,000.00	11,663,859.42	
T 3.5% 05/31/13	2,400,000.00	2,507,906.25	
T 3.625% 02/15/20	4,400,000.00	5,074,093.77	
T 3.625% 02/15/21	18,000,000.00	20,735,156.34	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,101,474.59	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,492,007.83	
T 3.625% 12/31/12	3,100,000.00	3,202,082.03	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	7,999,140.65	
T 3.75% 11/15/18	10,000,000.00	11,573,437.50	
T 3.875% 02/15/13	3,900,000.00	4,055,085.95	
T 3.875% 05/15/18	5,000,000.00	5,810,546.90	
T 3.875% 08/15/40	12,300,000.00	14,344,875.00	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,871,097.68	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,992,562.53	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,869,765.62	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,510,542.95	
T 4.25% 05/15/39	2,500,000.00	3,100,390.62	
T 4.25% 08/15/13	8,000,000.00	8,505,625.04	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	13,205,156.27	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	14,155,273.50	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,470,546.87	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,540,984.37	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,421,890.64	
T 4.25% 11/15/40	14,300,000.00	17,747,640.62	
T 4.375% 02/15/38	2,800,000.00	3,533,687.50	
T 4.375% 05/15/40	5,900,000.00	7,464,421.87	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,534,843.76	
T 4.375% 11/15/39	10,000,000.00	12,648,437.50	
T 4.5% 02/15/16	3,200,000.00	3,696,624.99	
T 4.5% 02/15/36	3,900,000.00	4,988,953.12	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,905,601.57	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,573,437.50	
T 4.5% 08/15/39	8,600,000.00	11,084,593.75	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,560,277.33	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,924,414.05	
T 4.625% 02/15/40	2,850,000.00	3,745,523.43	
T 4.75% 02/15/37	4,000,000.00	5,309,062.52	
T 4.75% 02/15/41	2,100,000.00	2,817,937.50	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,838,164.07	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,562,792.97	

		T 5.0% 05/15/37	2,000,000.00	2,748,906.26	
		T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,890,218.75	
		T 5.25% 02/15/29	1,900,000.00	2,578,953.12	
		T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,573,757.82	
		T 5.375% 02/15/31	2,610,000.00	3,649,717.98	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,664,812.50	
		T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	3,126,578.13	
		T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,084,031.25	
		T 6.125% 11/15/27	3,220,000.00	4,707,237.50	
		T 6.25% 05/15/30	2,680,000.00	4,069,831.25	
		T 6.25% 08/15/23	3,490,000.00	4,948,438.29	
		T 6.375% 08/15/27	1,200,000.00	1,789,781.25	
		T 6.5% 11/15/26	1,310,000.00	1,957,528.91	
		T 6.625% 02/15/27	1,150,000.00	1,742,160.16	
		T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,520,390.63	
		T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	8,128,248.03	
		T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,902,031.25	
		T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,713,472.66	
		T 7.625% 02/15/25	2,500,000.00	3,994,531.25	
		T 8.0% 11/15/21	2,560,000.00	3,970,400.00	
		T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,109,476.57	
		T 8.75% 05/15/17	4,800,000.00	6,754,125.02	
		T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,392,062.50	
	小計		937,220,000.00	1,036,496,276.83 (79,955,322,794)	
	カナダドル	CAN 1.5% 11/01/13	500,000.00	504,210.00	
		CAN 1.75% 03/01/13	4,350,000.00	4,385,931.00	
		CAN 2% 03/01/14	1,300,000.00	1,326,273.00	
		CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,440,292.00	
		CAN 2% 12/01/14	2,800,000.00	2,870,560.00	
		CAN 2.5% 06/01/15	2,000,000.00	2,087,140.00	
		CAN 2.5% 09/01/13	1,800,000.00	1,842,282.00	
		CAN 2.75% 06/01/22	400,000.00	423,776.00	
		CAN 2.75% 09/01/16	400,000.00	424,796.00	
		CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,065,820.00	
		CAN 3.0% 06/01/14	5,150,000.00	5,383,243.50	
		CAN 3.25% 06/01/21	2,300,000.00	2,543,087.00	
		CAN 3.5% 06/01/13	3,000,000.00	3,100,050.00	
		CAN 3.5% 06/01/20	2,600,000.00	2,921,282.00	
		CAN 3.5% 12/01/45	500,000.00	602,770.00	
		CAN 3.75% 06/01/19	3,400,000.00	3,872,124.00	

	CAN 4% 06/01/16	4,000,000.00	4,452,520.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,700,000.00	3,053,565.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,850,000.00	3,686,617.50	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,350,000.00	2,729,290.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,327,720.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,838,680.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,950,000.00	4,251,658.00	
	CAN 5.25% 06/01/13	5,120,000.00	5,411,430.40	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,460,000.00	3,597,577.80	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,710,000.00	4,120,094.30	
	CAN 8.0% 06/01/23	900,000.00	1,429,002.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,250,000.00	2,156,450.00	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	621,208.00	
小計		66,140,000.00	76,469,449.50 (5,830,795,524)	
オーストラリアドル	ACGB 4.5% 04/15/20	3,500,000.00	3,706,920.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	800,000.00	854,864.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	400,000.00	420,788.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,450,000.00	2,705,878.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	250,000.00	277,125.00	
	ACGB 5.5% 12/15/13	700,000.00	729,176.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,890,925.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,500,000.00	2,904,450.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	1,550,000.00	1,693,654.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,283,508.00	
	ACGB 6.5% 05/15/13	3,800,000.00	3,953,216.00	
小計		19,650,000.00	21,420,504.00 (1,721,351,701)	
イギリスポンド	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,362,244.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,800,000.00	4,990,896.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	4,150,000.00	4,426,805.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	350,000.00	403,322.50	
	UKT 3.75% 09/07/19	4,000,000.00	4,602,600.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,350,000.00	3,853,505.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,400,000.00	2,754,720.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,450,000.00	3,028,518.50	
	UKT 4% 03/07/22	2,000,000.00	2,341,960.00	
	UKT 4% 09/07/16	6,800,000.00	7,754,244.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,650,000.00	5,689,740.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,410,000.00	4,148,708.30	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,750,000.00	2,150,487.50	

	UKT 4.25% 12/07/27	3,500,000.00	4,250,330.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,450,000.00	4,247,640.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	3,500,000.00	4,389,700.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	3,000,000.00	3,791,550.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,400,000.00	4,365,158.00	
	UKT 4.5% 03/07/13	5,300,000.00	5,543,694.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,800,000.00	4,566,650.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,200,000.00	2,770,966.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,700,000.00	4,775,516.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,650,000.00	5,704,620.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,600,000.00	6,435,352.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,800,000.00	3,615,080.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	4,350,000.00	5,762,445.00	
	UKT 5% 03/07/18	3,300,000.00	4,026,660.00	
	UKT 5% 03/07/25	3,470,000.00	4,487,057.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,010,000.00	5,613,204.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,460,000.00	3,603,112.80	
	UKT 8% 06/07/21	4,040,000.00	6,147,668.00	
	UKT 8% 09/27/13	1,500,000.00	1,690,980.00	
	UKT 8% 12/07/15	3,345,000.00	4,286,182.65	
	UKT 8.75% 08/25/17	2,050,000.00	2,902,431.00	
小計		115,835,000.00	140,483,747.25 (16,787,807,796)	
スイスフラン	SWISS 3% 01/08/18	2,150,000.00	2,485,615.00	
	SWISS 4% 02/11/13	3,000,000.00	3,124,830.00	
	SWISS 4% 02/11/23	3,700,000.00	4,943,533.00	
小計		8,850,000.00	10,553,978.00 (873,130,599)	
シンガポールドル	SIGB 1.125% 04/01/16	700,000.00	717,948.00	
	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	812,856.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	500,000.00	528,660.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,550,000.00	1,594,283.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	550,000.00	597,025.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	900,000.00	974,169.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	500,000.00	547,355.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	1,016,946.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	900,000.00	1,024,902.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,200,000.00	1,397,988.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,403,610.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	900,000.00	1,027,800.00	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,068,696.00	

小計		11,600,000.00	12,712,238.50 (771,124,387)	
マレーシアリンギット	MGS 3.21% 05/31/13	4,400,000.00	4,427,016.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	1,000,000.00	1,010,300.00	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,951,891.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,276,215.20	
	MGS 3.58% 09/28/18	800,000.00	809,160.00	
	MGS 3.702% 02/25/13	500,000.00	505,370.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	1,800,000.00	1,832,616.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,500,000.00	2,564,200.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,900,000.00	1,987,324.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	419,448.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	9,600,000.00	10,033,440.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,100,000.00	3,301,531.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,685,568.00	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,000,000.00	3,141,870.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	2,900,000.00	3,344,976.00	
小計		40,800,000.00	42,290,925.20 (1,053,044,037)	
スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	11,500,000.00	12,447,945.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,000,000.00	10,223,760.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	5,700,000.00	6,674,985.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	14,350,000.00	16,241,904.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	15,200,000.00	18,065,808.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	4,900,000.00	5,495,056.00	
	SGB 5% 12/01/20	14,800,000.00	18,937,044.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	15,900,000.00	17,988,465.00	
小計		90,350,000.00	106,074,967.00 (1,210,315,373)	
ノルウェークローネ	NGB 3.75% 05/25/21	5,650,000.00	6,432,129.50	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,100,000.00	9,160,290.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	5,150,000.00	6,065,052.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,600,000.00	11,874,438.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	11,300,000.00	12,056,309.00	
小計		40,800,000.00	45,588,218.50 (594,470,369)	
デンマーククローネ	DGB 2% 11/15/14	800,000.00	837,984.00	
	DGB 3% 11/15/21	6,200,000.00	6,899,670.00	
	DGB 4% 11/15/15	20,400,000.00	23,122,992.00	
	DGB 4% 11/15/17	12,000,000.00	14,046,360.00	
	DGB 4% 11/15/19	15,600,000.00	18,608,460.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	20,600,000.00	29,950,752.00	

	DGB 5% 11/15/13	20,100,000.00	21,841,665.00	
	DGB 7% 11/10/24	4,590,000.00	7,179,356.70	
小計		100,290,000.00	122,487,239.70 (1,647,453,373)	
メキシコペソ	MBONO 6% 06/18/15	77,300,000.00	79,663,061.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	44,161,344.00	
	MBONO 8% 12/19/13	55,600,000.00	58,895,412.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	61,400,000.00	70,824,286.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,850,000.00	36,595,557.00	
小計		265,850,000.00	290,139,660.00 (1,688,612,821)	
ポーランドズロチ	POLGB 5% 10/24/13	7,900,000.00	7,941,870.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	9,050,000.00	9,123,124.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	7,000,000.00	6,995,310.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,123,136.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,000,000.00	5,087,250.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,400,000.00	6,400,320.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	5,200,000.00	5,307,536.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,100,000.00	1,089,550.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,300,000.00	5,331,429.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,000,000.00	1,005,730.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	9,600,000.00	10,017,600.00	
小計		60,750,000.00	61,422,855.00 (1,426,852,921)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,050,000.00	3,082,787.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	928,395.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	3,500,000.00	3,640,350.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	4,800,000.00	4,746,480.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,396,531.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,200,000.00	2,265,604.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,078,393.00	
	BGB 4.0% 03/28/13	1,450,000.00	1,495,385.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,700,000.00	2,791,395.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,400,000.00	2,453,880.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,800,000.00	1,744,614.00	
	BGB 4.25% 09/28/13	4,100,000.00	4,265,025.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,630,625.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,118,843.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	3,127,012.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,150,000.00	3,557,610.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	2,050,000.00	2,268,940.00	

BGB 8.0% 03/28/15	1,900,000.00	2,212,740.00	
BKO 1.75% 06/14/13	5,500,000.00	5,622,100.00	
BTNS 2% 07/12/15	600,000.00	609,750.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	1,000,000.00	1,020,030.00	
BTNS 2.5% 01/12/14	3,050,000.00	3,148,149.00	
BTNS 2.5% 01/15/15	5,600,000.00	5,792,920.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,500,000.00	6,798,545.00	
BTNS 3.75% 01/12/13	7,650,000.00	7,893,499.50	
BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,056,050.00	
BTPS 2% 06/01/13	1,300,000.00	1,274,429.00	
BTPS 2.25% 11/01/13	3,500,000.00	3,403,400.00	
BTPS 3% 04/01/14	2,500,000.00	2,438,950.00	
BTPS 3% 04/15/15	2,500,000.00	2,375,000.00	
BTPS 3% 06/15/15	500,000.00	473,075.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,627,856.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,300,000.00	3,241,590.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,000,000.00	1,710,400.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,102,100.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	7,250,475.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,900,000.00	7,488,805.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	6,712,640.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	3,900,000.00	3,888,027.00	
BTPS 4% 02/01/17	6,300,000.00	5,960,430.00	
BTPS 4% 02/01/37	5,500,000.00	3,795,000.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	3,062,150.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,249,411.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	6,900,000.00	6,342,135.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	2,653,466.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,800,000.00	1,816,650.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	5,800,000.00	5,843,790.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	8,504,250.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	3,250,000.00	2,942,225.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,250,000.00	3,079,797.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,050,000.00	6,448,494.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	3,900,000.00	3,615,300.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	3,350,000.00	2,694,338.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	5,650,000.00	5,317,384.50	
BTPS 4.75% 02/01/13	6,550,000.00	6,645,826.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,500,000.00	4,758,875.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	3,622,320.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,009,512.50	

BTPS 5% 03/01/22	1,500,000.00	1,360,395.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,850,000.00	3,289,440.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,850,000.00	3,009,468.00	
BTPS 5% 09/01/40	2,950,000.00	2,272,768.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,000,000.00	3,095,200.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	2,640,000.00	2,616,715.20	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,600,000.00	4,644,360.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	2,560,560.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,330,000.00	4,725,737.90	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,500,000.00	5,223,735.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	2,000,000.00	2,071,060.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	913,880.00	
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,877,989.50	
DBR 2.25% 09/04/21	4,000,000.00	4,156,000.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,414,016.00	
DBR 3% 07/04/20	5,000,000.00	5,550,000.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,550,000.00	4,010,612.50	
DBR 3.25% 07/04/15	7,200,000.00	7,878,960.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,384,150.00	
DBR 3.25% 07/04/42	1,600,000.00	1,860,640.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,905,440.00	
DBR 3.5% 07/04/19	7,100,000.00	8,136,742.00	
DBR 3.75% 01/04/15	5,550,000.00	6,096,120.00	
DBR 3.75% 01/04/17	5,000,000.00	5,700,000.00	
DBR 3.75% 01/04/19	2,900,000.00	3,369,162.00	
DBR 3.75% 07/04/13	5,000,000.00	5,259,000.00	
DBR 4% 07/04/16	4,400,000.00	5,029,420.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,251,950.00	
DBR 4.0% 01/04/37	4,400,000.00	5,607,052.00	
DBR 4.25% 01/04/14	4,500,000.00	4,854,060.00	
DBR 4.25% 07/04/14	7,200,000.00	7,895,016.00	
DBR 4.25% 07/04/17	4,200,000.00	4,929,456.00	
DBR 4.25% 07/04/18	5,700,000.00	6,777,186.00	
DBR 4.25% 07/04/39	3,100,000.00	4,168,415.00	
DBR 4.5% 01/04/13	7,800,000.00	8,126,664.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,800,000.00	4,955,010.00	
DBR 4.75% 07/04/34	4,500,000.00	6,189,885.00	
DBR 4.75% 07/04/40	3,600,000.00	5,231,808.00	
DBR 5.5% 01/04/31	3,600,000.00	5,196,708.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,270,000.00	1,799,590.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	685,916.00	

DBR 6.25% 01/04/24	2,200,000.00	3,158,760.00	
DBR 6.25% 01/04/30	2,000,000.00	3,068,360.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,600,000.00	2,445,040.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,050,000.00	4,849,262.50	
FRTR 3% 10/25/15	5,800,000.00	6,083,620.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	11,100,000.00	11,747,463.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	3,700,000.00	3,736,445.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,416,660.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	5,826,800.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,650,000.00	4,617,682.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,600,000.00	4,964,918.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,600,000.00	6,932,310.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,600,000.00	7,015,272.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,440,068.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,400,000.00	6,968,832.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	2,948,430.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,700,000.00	1,729,461.00	
FRTR 4% 10/25/13	5,900,000.00	6,228,335.00	
FRTR 4% 10/25/14	2,900,000.00	3,118,892.00	
FRTR 4% 10/25/38	5,200,000.00	5,343,000.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	6,800,000.00	7,093,284.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,200,000.00	5,716,776.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,100,000.00	3,422,555.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,050,000.00	3,360,490.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	8,100,000.00	8,815,878.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,000,000.00	3,341,490.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,000,000.00	3,425,490.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,210,000.00	7,060,645.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,530,000.00	5,528,412.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,600,000.00	5,874,568.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,550,204.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,479,400.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,561,425.60	
IRISH 4% 01/15/14	750,000.00	728,977.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,700,000.00	1,438,676.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,200,000.00	3,542,406.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,200,000.00	1,039,116.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,200,000.00	2,079,836.00	
IRISH 5% 04/18/13	2,500,000.00	2,490,875.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	1,648,101.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	600,000.00	556,158.00	

NETHER 1% 01/15/14	800,000.00	810,080.00	
NETHER 1.75% 01/15/13	2,200,000.00	2,234,584.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,274,316.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	5,100,000.00	5,530,695.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,750,000.00	3,007,262.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,050,000.00	3,399,225.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,650,000.00	1,876,347.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,050,000.00	2,559,999.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,324,800.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,200,000.00	2,770,460.00	
NETHER 4% 07/15/16	2,600,000.00	2,930,590.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,900,000.00	3,330,012.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,750,000.00	3,144,762.50	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,350,000.00	4,606,780.50	
NETHER 4.5% 07/15/17	3,800,000.00	4,415,410.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,300,000.00	3,179,819.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,050,000.00	1,575,735.00	
OBL 1.75% 10/09/15	2,100,000.00	2,193,618.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,701,180.00	
OBL 2.25% 04/11/14	6,000,000.00	6,274,620.00	
OBL 2.5% 02/27/15	2,200,000.00	2,340,360.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	4,024,580.00	
OBL 2.75% 04/08/16	1,000,000.00	1,086,530.00	
OBL 3.5% 04/12/13	6,450,000.00	6,715,611.00	
OBL 4% 10/11/13	2,900,000.00	3,088,935.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	300,000.00	313,350.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	637,818.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,400,000.00	3,626,610.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,000,000.00	3,096,750.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	2,900,000.00	3,055,092.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	3,077,277.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,650,000.00	2,882,219.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,300,000.00	2,473,604.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,376,660.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	850,000.00	930,665.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,300,000.00	1,421,134.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,950,000.00	4,390,030.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,600,000.00	1,824,672.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,800,000.00	2,353,194.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,500,000.00	1,604,250.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,373,562.50	

		RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	443,540.00	
		RFGB 3.875% 09/15/17	2,000,000.00	2,246,200.00	
		RFGB 4% 07/04/25	1,500,000.00	1,738,620.00	
		RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,560,020.00	
		RFGB 4.375% 07/04/19	1,500,000.00	1,748,670.00	
		RFGB 5.375% 07/04/13	1,300,000.00	1,395,784.00	
		SPGB 2.3% 04/30/13	800,000.00	796,160.00	
		SPGB 2.5% 10/31/13	2,300,000.00	2,278,104.00	
		SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,795,385.00	
		SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	973,570.00	
		SPGB 3.3% 10/31/14	1,600,000.00	1,596,688.00	
		SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,251,600.00	
		SPGB 3.8% 01/31/17	3,050,000.00	2,997,174.00	
		SPGB 4% 04/30/20	4,300,000.00	4,064,489.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,376,446.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	3,100,000.00	2,340,810.00	
		SPGB 4.2% 07/30/13	4,100,000.00	4,181,057.00	
		SPGB 4.25% 01/31/14	2,300,000.00	2,344,735.00	
		SPGB 4.25% 10/31/16	700,000.00	703,885.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	1,300,000.00	1,264,224.00	
		SPGB 4.4% 01/31/15	8,500,000.00	8,741,655.00	
		SPGB 4.6% 07/30/19	4,200,000.00	4,180,470.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,100,000.00	973,225.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,605,300.00	
		SPGB 4.75% 07/30/14	4,900,000.00	5,058,417.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,700,000.00	3,391,901.00	
		SPGB 4.85% 10/31/20	3,200,000.00	3,164,096.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,300,000.00	1,893,245.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,475,412.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	2,800,000.00	2,958,144.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	3,050,000.00	2,903,295.00	
		SPGB 5.85% 01/31/22	850,000.00	873,672.50	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,284,179.00	
		SPGB 6.0% 01/31/29	4,150,000.00	4,080,487.50	
		SPGB 6.15% 01/31/13	4,300,000.00	4,454,284.00	
	小計		749,010,000.00	780,536,561.00 (78,045,850,734)	
国債証券計				(191,606,132,429)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	2,700,000.00	2,871,288.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,430,872.00	

		QTC 6% 06/14/21	400,000.00	438,620.00	
		QTC 6% 08/14/13	1,900,000.00	1,961,712.00	
		QTC 6% 09/14/17	5,350,000.00	5,778,495.50	
	小計		13,650,000.00	14,480,987.50 (1,163,692,155)	
特殊債券計				(1,163,692,155)	
合計				(192,769,824,584)	

(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	127銘柄	100.0%	41.5%
カナダドル	国債証券	29銘柄	100.0%	3.0%
オーストラリアドル	国債証券	11銘柄	59.7%	
	特殊債券	5銘柄	40.3%	1.5%
イギリスポンド	国債証券	34銘柄	100.0%	8.7%
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%
マレーシアリンギット	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	8銘柄	100.0%	0.9%
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	216銘柄	100.0%	40.5%

2)信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

3)デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,708,334,207	2,457,280,476
コール・ローン	113,407,696	46,430,562
株式	119,193,374,631	117,544,610,602
投資信託受益証券	115,712,969	45,142,083
投資証券	1,881,233,777	2,288,577,045
派生商品評価勘定	69,061,750	255,210,783
未収入金	1,984,291,675	19,116,937
未収配当金	109,983,726	135,891,101
未収利息	178	75
差入委託証拠金	996,114,749	1,256,047,509
流動資産合計	126,171,515,358	124,048,307,173
資産合計	126,171,515,358	124,048,307,173
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,131,147	139,130
未払金	—	59,783,992
未払解約金	38,751,132	41,949,502
流動負債合計	47,882,279	101,872,624
負債合計	47,882,279	101,872,624
純資産の部		
元本等		
元本	134,233,271,149	143,247,104,068
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△8,109,638,070	△19,300,669,519
元本等合計	126,123,633,079	123,946,434,549
純資産合計	126,123,633,079	123,946,434,549
負債純資産合計	126,171,515,358	124,048,307,173

（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、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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。	（1）株式 同左
	（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。	（2）投資信託受益証券 同左
	（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。	（3）投資証券 同左
	（4）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	（4）先物取引 同左
	（5）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。	（5）外国為替予約 同左
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。	同左

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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	132,366,042,510円	134,233,271,149円
期中追加設定元本額	24,063,349,345円	33,594,160,937円
期中一部解約元本額	22,196,120,706円	24,580,328,018円
期末元本額	134,233,271,149円	143,247,104,068円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	628,469,186円	862,547,911円
SBI資産設計オープン（分配型）	31,750,285円	28,144,981円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	12,731,245,931円	15,480,152,699円
世界経済インデックスファンド	333,649,574円	623,836,884円
すみしん マイセレクション25	31,525,675円	24,023,343円
すみしん マイセレクション50	108,640,479円	102,252,507円
すみしん マイセレクション75	109,848,046円	99,605,140円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,384,037,455円	1,427,776,042円
すみしん DCマイセレクション25	800,619,735円	1,044,716,797円
すみしん DCマイセレクション50	4,773,470,316円	5,483,917,566円
すみしん DCマイセレクション75	4,933,538,467円	5,407,418,667円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	4,299,305,124円	4,982,278,932円
すみしん DCマイセレクションS25	74,212,117円	265,895,067円
すみしん DCマイセレクションS50	586,347,785円	1,303,497,429円
すみしん DCマイセレクションS75	489,581,751円	904,328,474円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,536,478円	11,993,200円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	45,004,045円	133,688,372円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	40,370,558円	113,256,678円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	16,843,951円	40,821,294円
すみしん DCマルチアセット ファンド	391,828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）	6,467,662,483円	8,572,732,926円
すみしん マイセレクション50ＶＡ1 （適格機関投資家専用）	322,285,230円	293,152,401円
すみしん マイセレクション75ＶＡ1 （適格機関投資家専用）	155,429,577円	139,012,804円
すみしん 外国株式インデックス・オープンVA1 （適格機関投資家専用）	622,111,383円	581,796,603円

すみしん マイセレクション50ＶＡ２（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30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,539,692,069円	1,479,781,274円
すみしん バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,388,981,052円	5,200,157,316円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,916,935,379円	14,119,836,944円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	4,245,261,284円	4,196,909,218円
すみしん バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,533,339,088円	6,625,519,618円
すみしん バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,712,234,091円	1,650,454,287円
すみしん バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	9,974,251,845円	9,420,961,720円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	21,888,706,945円	22,190,968,258円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,890,050,283円	10,239,081,973円
すみしん バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,912,290,327円	1,770,584,381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）	1,586,256,101円	1,614,677,442円
すみしん バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	696,282,660円	608,615,994円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,536,838,755円	1,722,065,853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）	8,003,850,017円	8,243,941,835円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	6,411,558,631円	6,234,885,825円
2．元本の欠損	純資産額は、元本を8,109,638,070円下回っております。	純資産額は、元本を19,300,669,519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	134,233,271,149口	143,247,104,068口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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。 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

Ⅱ金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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.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。	a.株式、投資信託受益証券、投資証券 同左

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

	d.コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	d.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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	（平成24年 1月20日現在） 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株　式	16,460,304,745	△4,679,958,223
投資信託受益証券	25,713,993	△9,324,323
投資証券	207,913,343	△58,403,497
合　計	16,693,932,081	△4,747,686,043

（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23年 1月20日現在） 契 約 額 等（円）	うち1年超	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	2,608,415,667	―	2,652,299,390	43,883,723
	S&P/TSE 60	277,236,814	―	279,055,220	1,818,406
	SPI 200 FUTU	323,138,839	―	326,096,397	2,957,558
	FTSE 100	535,149,223	―	537,317,937	2,168,714
	SWISS MKT IX	195,402,757	―	195,136,526	△266,231
	DJ EURO STOX	874,413,498	―	884,071,011	9,657,513
合　計		4,813,756,798	―	4,873,976,481	60,219,683

（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24年 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	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	2,200,217,938	—	2,350,208,952	149,991,014
	S&P/TSE 60	214,128,300	—	225,968,400	11,840,100
	SPI 200 FUTU	251,347,999	—	252,953,190	1,605,191
	FTSE 100	404,357,526	—	429,387,996	25,030,470
	SWISS MKT IX	150,869,735	—	161,991,957	11,122,222
	DJ EURO STOX	578,806,112	—	634,427,548	55,621,436
合 計		3,799,727,610	—	4,054,938,043	255,210,433

（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 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	28,084,000	—	27,931,000	△153,000
	カナダドル	4,167,600	—	4,121,000	△46,600
	オーストラリアドル	1,649,880	—	1,637,000	△12,880
	イギリスポンド	6,600,650	—	6,555,500	△45,150
	ユーロ	25,448,120	—	25,403,500	△44,620
	売建				
	アメリカドル	30,395,500	—	30,395,500	0
	カナダドル	3,296,600	—	3,296,800	△200
	オーストラリアドル	2,454,600	—	2,454,600	0
	イギリスポンド	6,555,100	—	6,555,500	△400
	ニュージーランドドル	1,273,600	—	1,258,400	15,200
	ノルウェークローネ	706,050	—	704,500	1,550
	デンマーククローネ	740,750	—	740,500	250
	ユーロ	20,982,270	—	20,985,500	△3,230
合 計		132,354,720	—	132,039,300	△289,080

（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24年 1月20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				
	売建				
	アメリカドル	7,694,750	―	7,713,000	△18,250
	イギリスポンド	7,138,470	―	7,169,400	△30,930
	ノルウェークローネ	2,569,200	―	2,606,000	△36,800
	ユーロ	3,946,400	―	3,999,200	△52,800
合 計		21,348,820	―	21,487,600	△138,780

（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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 0.9396円	1口当たり純資産額 ＝ 0.8653円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

通貨	銘柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	3 M COMPANY	49,051	85.80	4,208,575.80	
	ABBOTT LABORATORIES	113,270	55.43	6,278,556.10	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,225	47.08	293,073.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	46,894	54.80	2,569,791.20	

ACE LTD	24,594	70.93	1,744,452.42	
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,980	12.34	456,333.20	
ADOBE SYSTEMS INC	35,666	30.24	1,078,539.84	
ADVANCE AUTO PARTS	5,434	75.15	408,365.10	
ADVANCED MICRO DEVICES	42,704	6.22	265,618.88	
AES CORP	46,996	12.92	607,188.32	
AETNA INC	26,831	44.13	1,184,052.03	
AFLAC	33,995	47.13	1,602,184.35	
AGCO CORP	6,928	51.48	356,653.44	
AGILENT TECHNOLOGIES	25,327	41.85	1,059,934.95	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	15,509	91.84	1,424,346.56	
AIRGAS INC	5,228	80.82	422,526.96	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,417	32.69	438,601.73	
ALCOA	77,439	10.18	788,329.02	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,428	75.62	1,015,425.36	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,367	51.62	380,284.54	
ALLERGAN INC	22,377	87.16	1,950,379.32	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,728	109.85	409,520.80	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,107	42.61	345,439.27	
ALLSTATE CORP	36,922	29.49	1,088,829.78	
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	16,554	19.64	325,120.56	
ALTERA CORPORATION	23,577	40.88	963,827.76	
ALTRIA GROUP INC	150,722	28.61	4,312,156.42	
AMAZON.COM	26,492	194.45	5,151,369.40	
AMEREN CORPORATION	17,050	31.56	538,098.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	35,095	41.10	1,442,404.50	
AMERICAN EXPRESS	78,182	50.95	3,983,372.90	
AMERICAN INT'L GROUP	34,528	25.55	882,190.40	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,813	32.93	421,932.09	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,130	53.65	919,024.50	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,369	39.40	763,138.60	
AMETEK INC	11,370	46.14	524,611.80	
AMGEN	57,645	69.14	3,985,575.30	
AMPHENOL CORPORATION	12,454	54.89	683,600.06	
ANADARKO PETROLEUM CORP	36,225	79.79	2,890,392.75	
ANALOG DEVICES	21,790	39.67	864,409.30	
AON CORP	21,033	47.50	999,067.50	
APACHE CORP	27,938	97.16	2,714,456.08	
APOLLO GROUP INC-CLA	9,013	53.50	482,195.50	
APPLE INC	67,463	427.75	28,857,298.25	
APPLIED MATERIALS	95,875	12.31	1,180,221.25	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,851	36.89	363,403.39	
ARCH COAL INC	15,406	14.01	215,838.06	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	49,177	29.42	1,446,787.34	
ARROW ELECTRONICS INC	8,481	41.32	350,434.92	
ASSURANT INC	6,946	39.23	272,491.58	
AT&T INC	434,464	30.42	13,216,394.88	
AUTODESK INC	16,247	35.43	575,631.21	
AUTOLIV INC	6,534	61.53	402,037.02	
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,330	56.90	2,010,277.00	
AUTOZONE INC	1,832	346.50	634,788.00	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,103	33.62	541,382.86	
AVERY DENNISON CORP	7,057	29.34	207,052.38	
AVNET INC	11,164	34.09	380,580.76	
AVON PRODUCTS INC	30,415	18.22	554,161.30	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,984	31.24	280,660.16	
BAKER HUGHES	31,742	48.77	1,548,057.34	
BALL CORP	11,306	38.15	431,323.90	
BANK NEW YORK CO	89,702	20.91	1,875,668.82	
BANK OF AMERICA CORP	737,470	6.96	5,132,791.20	
BARD C R INC	6,305	89.36	563,414.80	
BAXTER INTERNATIONAL	41,351	52.62	2,175,889.62	
BB&T CORP	50,723	27.12	1,375,607.76	
BEAM INC	9,810	52.56	515,613.60	
BECTON DICKINSON & CO	15,823	77.91	1,232,769.93	
BED BATH & BEYOND INC	18,184	63.19	1,149,046.96	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	65,995	79.59	5,252,542.05	
BEST BUY COMPANY INC	23,186	25.10	581,968.60	
BIOGEN IDEC INC	16,767	116.78	1,958,050.26	
BLACKROCK INC	6,879	187.54	1,290,087.66	
BLOCK H & R INC	22,367	16.25	363,463.75	
BMC SOFTWARE	12,923	33.39	431,498.97	
BOEING CO	51,232	75.56	3,871,089.92	
BORGWARNER INC	7,764	75.30	584,629.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,046	5.87	634,230.02	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,120	32.71	4,059,965.20	
BROADCOM CORP-CL A	35,002	34.99	1,224,719.98	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,151	82.00	504,382.00	
BUNGE LIMITED	10,729	58.32	625,715.28	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,000	68.87	826,440.00	
CA INC	28,626	22.28	637,787.28	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,403	14.24	219,338.72	

CABOT OIL & GAS CORP	7,386	63.09	465,982.74	
CALPINE CORP	22,805	15.17	345,951.85	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,834	54.25	967,494.50	
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,911	32.26	448,768.86	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,428	48.77	1,630,283.56	
CARDINAL HEALTH	24,787	42.71	1,058,652.77	
CAREFUSION CORP	16,327	23.30	380,419.10	
CARMAX INC	16,014	33.25	532,465.50	
CARNIVAL CORPORATION	33,285	31.91	1,062,124.35	
CATERPILLAR	47,014	105.75	4,971,730.50	
CBRE GROUP INC-A	21,372	17.61	376,360.92	
CBS CORP-CL B	45,700	28.83	1,317,531.00	
CELANESE CORP-SERIES A	11,045	48.80	538,996.00	
CELGENE CORP	33,387	72.21	2,410,875.27	
CENTERPOINT ENERGY INC	28,573	18.43	526,600.39	
CENTURYLINK INC	45,195	37.47	1,693,456.65	
CERNER CORP	10,457	61.51	643,210.07	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,221	171.18	893,730.78	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	48,089	20.68	994,480.52	
CHEVRON CORP	145,755	106.93	15,585,582.15	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,287	358.09	818,951.83	
CHUBB CORPORATION	20,683	70.30	1,454,014.90	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,420	46.74	487,030.80	
CIGNA CORP	20,773	46.28	961,374.44	
CIMAREX ENERGY CO	6,250	59.28	370,500.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,315	32.02	362,306.30	
CINTAS CORP	8,593	37.92	325,846.56	
CISCO SYSTEMS	400,243	19.79	7,920,808.97	
CIT GROUP INC	13,468	37.61	506,531.48	
CITIGROUP	212,336	29.33	6,227,814.88	
CITRIX SYSTEMS INC	13,701	69.38	950,575.38	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,626	72.03	765,390.78	
CLOROX COMPANY	9,565	70.24	671,845.60	
CME GROUP INC	4,622	237.55	1,097,956.10	
COACH INC	20,818	65.00	1,353,170.00	
COCA-COLA CO	150,376	67.45	10,142,861.20	
COCA-COLA ENTERPRISES	22,979	26.74	614,458.46	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,097	69.82	1,542,812.54	
COLGATE-PALMOLIVE CO	35,402	89.97	3,185,117.94	
COMCAST CORP-CL A	152,442	25.87	3,943,674.54	
COMCAST CORP-SPECIAL A	47,675	25.23	1,202,840.25	

COMERICA INC	14,682	28.68	421,079.76	
COMPUTER SCIENCES CORP	11,333	26.09	295,677.97	
CONAGRA	30,169	27.18	819,993.42	
CONCHO RESOURCES INC	7,166	100.74	721,902.84	
CONOCOPHILLIPS	94,940	71.27	6,766,373.80	
CONSOL ENERGY INC	16,024	33.73	540,489.52	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,312	58.74	1,251,866.88	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,841	21.02	290,937.82	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	13,480	36.15	487,302.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	76.24	237,945.04	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	11,667	59.39	692,903.13	
CORNING	114,329	14.45	1,652,054.05	
COSTCO WHOLESALE CORP	31,859	81.21	2,587,269.39	
COVANCE INC	4,199	46.31	194,455.69	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,831	30.42	329,479.02	
COVIDIEN PLC	35,907	48.05	1,725,331.35	
CREE INC	7,602	25.85	196,511.70	
CROWN CASTLE INTL CORP	20,742	46.40	962,428.80	
CROWN HOLDINGS INC	10,998	34.93	384,160.14	
CSX CORP	79,703	23.05	1,837,154.15	
CUMMINS INC	13,460	105.51	1,420,164.60	
CVS CAREMARK CORPORATION	97,863	42.88	4,196,365.44	
DANAHER CORP	42,404	51.52	2,184,654.08	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,674	46.11	446,068.14	
DAVITA INC	6,752	79.75	538,472.00	
DEERE&CO	30,121	86.94	2,618,719.74	
DELL INC	119,484	16.57	1,979,849.88	
DELTA AIR LINES INC	15,452	9.33	144,167.16	
DENBURY RESOURCES INC	29,366	17.67	518,897.22	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,287	37.99	390,803.13	
DEVON ENERGY CORPORATION	28,793	64.15	1,847,070.95	
DEVRY INC	4,788	40.94	196,020.72	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,079	62.05	315,151.95	
DIRECTV	53,859	42.72	2,300,856.48	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	39,708	27.13	1,077,278.04	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,193	44.71	455,729.03	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,218	40.67	374,896.06	
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,117	29.99	453,358.83	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	34.68	123,911.64	
DOLLAR GENERAL CORP	12,308	41.22	507,335.76	
DOLLAR TREE INC	8,670	85.84	744,232.80	

DOMINION RESOURCES	41,421	50.30	2,083,476.30	
DONNELLEY (RR) & SONS	13,666	11.94	163,172.04	
DOVER CORP	13,191	60.85	802,672.35	
DOW CHEMICAL CO	85,956	32.98	2,834,828.88	
DR HORTON INC	21,061	14.05	295,907.05	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,651	37.33	584,251.83	
DTE ENERGY COMPANY	11,973	52.99	634,449.27	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	67,857	49.40	3,352,135.80	
DUKE ENERGY CORP	96,880	21.24	2,057,731.20	
DUN & BRADSTREET CORP	3,610	81.57	294,467.70	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,217	46.50	475,090.50	
EATON CORP	23,580	50.03	1,179,707.40	
EATON VANCE CORP	8,676	25.92	224,881.92	
EBAY	84,403	31.51	2,659,538.53	
ECOLAB INC	21,779	60.15	1,310,006.85	
EDISON INTL	22,523	39.98	900,469.54	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,108	77.89	631,532.12	
EL PASO CORP	56,050	27.01	1,513,910.50	
ELECTRONIC ARTS INC	23,504	17.54	412,260.16	
EMC CORP	150,264	23.16	3,480,114.24	
EMERSON ELECTRIC CO	54,191	49.80	2,698,711.80	
ENERGEN CORP	5,267	51.07	268,985.69	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,004	78.45	392,563.80	
ENTERGY CORP	12,864	70.66	908,970.24	
EOG RESOURCES INC	19,548	105.08	2,054,103.84	
EQT CORPORATION	10,037	47.64	478,162.68	
EQUIFAX INC	8,993	39.83	358,191.19	
ESTEE LAUDER CO-CL A	8,508	116.18	988,459.44	
EVEREST RE GROUP LTD	3,967	85.24	338,147.08	
EXELON CORP	48,223	39.50	1,904,808.50	
EXPEDIA INC	7,261	31.33	227,487.13	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,015	44.43	667,116.45	
EXPRESS SCRIPTS INC	33,750	50.96	1,719,900.00	
EXXON MOBIL	353,811	87.03	30,792,171.33	
F5 NETWORKS INC	5,735	120.00	688,200.00	
FAMILY DOLLAR STORES	8,812	55.06	485,188.72	
FASTENAL CO	20,402	45.74	933,187.48	
FEDEX CORP	21,928	93.04	2,040,181.12	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,773	17.50	258,527.50	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,296	27.60	477,369.60	

FIFTH THIRD BANCORP	66,934	13.56	907,625.04	
FIRST SOLAR INC	4,092	38.70	158,360.40	
FIRSTENERGY CORP	30,433	41.14	1,252,013.62	
FISERV INC	10,153	62.56	635,171.68	
FLEXTRONICS INTL LTD	53,230	6.72	357,705.60	
FLIR SYSTEMS INC	11,668	26.66	311,068.88	
FLOWSERVE CORP	4,079	108.29	441,714.91	
FLUOR CORP	12,322	56.63	697,794.86	
FMC CORP	5,242	91.80	481,215.60	
FMC TECHNOLOGIES INC	17,477	53.70	938,514.90	
FORD MOTOR COMPANY	258,433	12.61	3,258,840.13	
FOREST LABORATORIES INC	19,979	32.23	643,923.17	
FOSSIL INC	3,941	90.93	358,355.13	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,234	101.32	1,138,228.88	
FREEPORT-MCMOR-B	68,976	44.37	3,060,465.12	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	72,722	4.87	354,156.14	
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,555	24.84	262,186.20	
GAP	28,108	19.37	544,451.96	
GARMIN LTD	8,530	42.22	360,136.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,356	72.21	1,614,326.76	
GENERAL ELECTRIC CO	771,375	19.15	14,771,831.25	
GENERAL MILLS INC	47,052	40.95	1,926,779.40	
GENERAL MOTORS CO	56,967	24.82	1,413,920.94	
GENUINE PARTS CO	11,155	64.88	723,736.40	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	35,846	8.17	292,861.82	
GILEAD SCIENCES INC	56,138	47.21	2,650,274.98	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	34,774	107.68	3,744,464.32	
GOODRICH CORP	9,096	124.18	1,129,541.28	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,889	13.76	246,152.64	
GOOGLE INC-CL A	18,499	639.57	11,831,405.43	
GRAINGER (WW) INC	4,323	202.10	873,678.30	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,469	52.17	493,997.73	
HALLIBURTON CO	66,921	36.25	2,425,886.25	
HARLEY-DAVIDSON	16,753	42.05	704,463.65	
HARRIS CORP	8,747	39.32	343,932.04	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,907	18.34	548,494.38	
HASBRO INC	8,984	32.75	294,226.00	
HCA HOLDINGS INC	12,703	24.51	311,350.53	
HEINZ (H.J) CO	23,362	53.46	1,248,932.52	
HELMERICH & PAYNE	7,816	60.89	475,916.24	
HENRY SCHEIN INC	6,522	68.86	449,104.92	

HERBALIFE LTD	8,612	57.92	498,807.04	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,138	61.65	748,307.70	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	13.03	244,273.41	
HESS CORP	22,260	61.19	1,362,089.40	
HEWLETT-PACKARD CO	150,934	27.15	4,097,858.10	
HOLLYFRONTIER CORP	14,780	28.07	414,874.60	
HOLOGIC INC	19,110	19.64	375,320.40	
HOME DEPOT	114,118	45.41	5,182,098.38	
HONEYWELL INTL INC	54,089	58.50	3,164,206.50	
HORMEL FOODS CORP	10,732	29.29	314,340.28	
HOSPIRA INC	11,997	33.93	407,058.21	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	6.82	224,725.82	
HUMANA INC	12,140	94.94	1,152,571.60	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,028	48.87	343,458.36	
IHS INC-CLASS A	3,080	93.66	288,472.80	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,819	51.22	1,629,769.18	
ILLUMINA INC	8,871	36.75	326,009.25	
INGERSOLL-RAND PLC	24,085	34.30	826,115.50	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,721	51.24	293,144.04	
INTEL CORP	382,110	25.63	9,793,479.30	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,198	118.03	613,519.94	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	34,909	10.67	372,479.03	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	86,906	180.52	15,688,271.12	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,874	56.02	329,061.48	
INT'L GAME TECHNOLOGY	21,975	16.96	372,696.00	
INT'L PAPER CO	30,217	32.43	979,937.31	
INTUIT INC	21,016	57.10	1,200,013.60	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,844	474.65	1,349,904.60	
INVESCO PLC	32,669	22.17	724,271.73	
IRON MOUNTAIN INC	13,198	32.01	422,467.98	
J.C. PENNEY CO INC	11,717	35.53	416,305.01	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,266	45.16	418,452.56	
JM SMUCKER CO	8,200	81.04	664,528.00	
JOHNSON & JOHNSON	199,413	65.19	12,999,733.47	
JOHNSON CONTROLS INC	49,588	32.46	1,609,626.48	
JOY GLOBAL INC	7,644	85.75	655,473.00	
JPMORGAN CHASE & CO	283,730	36.93	10,478,148.90	
JUNIPER NETWORKS INC	38,784	23.88	926,161.92	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,991	73.76	589,416.16	
KBR INC	11,074	32.16	356,139.84	
KELLOGG CO	18,440	51.19	943,943.60	

KEY CORP	67,224	8.30	557,959.20	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,511	74.16	2,114,375.76	
KINDER MORGAN INC	7,631	33.03	252,051.93	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,370	77.90	496,223.00	
KLA-TENCOR CORP	11,871	51.03	605,777.13	
KOHLS CORP	19,562	48.47	948,170.14	
KRAFT FOODS INC-A	122,092	38.70	4,724,960.40	
KROGER CO	41,832	24.06	1,006,477.92	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,503	70.63	529,936.89	
LABORATORY CRP OF AMER	7,367	88.83	654,410.61	
LAM RESEARCH CORP	9,097	42.32	384,985.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	26,634	46.85	1,247,802.90	
LEGG MASON INC	10,328	27.55	284,536.40	
LEGGETT & PLATT INC	9,883	23.60	233,238.80	
LEUCADIA NATIONAL CORP	15,190	27.23	413,623.70	
LIBERTY GLOBAL INC-A	10,466	45.13	472,330.58	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,207	43.40	356,183.80	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	41,778	17.16	716,910.48	
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	7,925	84.96	673,308.00	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,639	46.90	592,769.10	
LILLY (ELI) & CO	75,819	40.17	3,045,649.23	
LIMITED	18,499	41.57	769,003.43	
LINCOLN NATIONAL CORP	22,438	22.28	499,918.64	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,101	33.40	537,773.40	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,759	83.71	1,737,735.89	
LOEWS CORP	23,123	38.53	890,929.19	
LORILLARD INC	10,074	110.34	1,111,565.16	
LOWES COMPANIES	91,958	27.33	2,513,212.14	
LSI CORP	42,820	6.99	299,311.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,311	60.14	439,683.54	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,797	40.00	831,880.00	
M & T BANK CORP	8,226	81.79	672,804.54	
MACY'S INC	31,133	35.82	1,115,184.06	
MANPOWER GROUP	6,006	41.61	249,909.66	
MARATHON OIL CORP	51,958	31.97	1,661,097.26	
MARATHON PETROLEUM CORP	25,942	35.85	930,020.70	
MARRIOTT INTL A	20,385	34.66	706,544.10	
MARSH & MCLENNAN COS	39,416	31.49	1,241,209.84	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,325	80.65	268,161.25	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	36,738	15.46	567,969.48	
MASCO CORP	25,016	12.85	321,455.60	

MASTERCARD INC-CLASS A	7,904	352.90	2,789,321.60	
MATTEL INC	24,646	28.67	706,600.82	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,883	27.68	578,041.44	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,767	52.07	456,497.69	
MCDONALD'S CORP	75,268	101.26	7,621,637.68	
MCGRAW-HILL COS	21,605	46.39	1,002,255.95	
MCKESSON CORP	17,825	75.89	1,352,739.25	
MDU RESOURCES GROUP INC	13,795	21.54	297,144.30	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,841	73.59	1,092,149.19	
MEADWESTVACO CORP	12,399	31.90	395,528.10	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	28,055	62.00	1,739,410.00	
MEDTRONIC	77,204	39.14	3,021,764.56	
MERCK & CO	224,186	39.26	8,801,542.36	
METLIFE INC	76,953	35.82	2,756,456.46	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	18,351	8.93	163,874.43	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,467	37.89	510,264.63	
MICRON TECHNOLOGY	65,861	7.88	518,984.68	
MICROSOFT CORP	548,710	28.12	15,429,725.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,281	65.18	279,035.58	
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,545	43.54	502,669.30	
MONSANTO CO	38,912	80.35	3,126,579.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	5,312	100.96	536,299.52	
MOODY'S CORP	14,495	36.55	529,792.25	
MORGAN STANLEY	105,219	18.28	1,923,403.32	
MOSAIC CO/THE	22,260	53.85	1,198,701.00	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS	20,602	38.78	798,945.56	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,473	48.04	1,079,602.92	
MURPHY OIL CORP	13,378	60.39	807,897.42	
MYLAN INC	31,056	21.87	679,194.72	
NABORS INDUSTRIES LTD	20,998	16.88	354,446.24	
NASDAQ OMX GROUP	8,573	25.15	215,610.95	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,831	75.80	2,336,989.80	
NETAPP INC	26,809	37.51	1,005,605.59	
NETFLIX INC	3,654	103.46	378,042.84	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,958	13.01	415,773.58	
NEWELL RUBBERMAID	21,337	17.46	372,544.02	
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,826	39.26	385,768.76	
NEWMONT MINING CORP	35,961	59.60	2,143,275.60	
NEWS CORP -CLASS A	133,383	19.73	2,631,646.59	
NEWS CORP -CLASS B	31,140	20.05	624,357.00	
NEXTERA ENERGY INC	29,197	58.79	1,716,491.63	

NIELSEN HOLDINGS NV	6,225	28.70	178,657.50	
NII HOLDINGS INC	12,436	20.50	254,938.00	
NIKE B	26,126	101.58	2,653,879.08	
NISOURCE INC	20,429	22.82	466,189.78	
NOBLE CORP	19,011	34.61	657,970.71	
NOBLE ENERGY INC	12,845	97.49	1,252,259.05	
NORDSTROM INC	12,468	50.37	628,013.16	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,307	77.94	1,972,427.58	
NORTHEAST UTILITIES	12,917	33.53	433,107.01	
NORTHERN TRUST CORP	15,386	42.12	648,058.32	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,222	61.31	1,178,500.82	
NRG ENERGY INC	17,206	16.42	282,522.52	
NSTAR	7,569	43.22	327,132.18	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,121	28.96	495,824.16	
NUCOR CORP	23,032	42.90	988,072.80	
NVIDIA CORP	43,933	14.35	630,438.55	
NYSE EURONEXT	18,510	27.21	503,657.10	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,144	99.86	5,906,119.84	
OMNICARE INC	8,472	34.14	289,234.08	
OMNICOM GROUP	19,933	47.69	950,604.77	
ONEOK INC	7,195	88.48	636,613.60	
ORACLE CORP	294,494	28.56	8,410,748.64	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,776	84.78	828,809.28	
OWENS-ILLINOIS INC	11,984	23.37	280,066.08	
PACCAR INC	23,938	43.91	1,051,117.58	
PALL CORP	8,485	60.22	510,966.70	
PARKER HANNIFIN CORP	11,284	84.97	958,801.48	
PARTNERRE LTD	4,687	63.57	297,952.59	
PATTERSON COMPANIES INC	6,826	31.08	212,152.08	
PAYCHEX INC	23,753	32.33	767,934.49	
PEABODY ENERGY CORP	19,708	37.74	743,779.92	
PENTAIR INC	6,840	37.63	257,389.20	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,512	13.39	368,385.68	
PEPCO HOLDINGS INC	16,497	19.68	324,660.96	
PEPSICO INC	115,165	65.91	7,590,525.15	
PERRIGO CO	5,900	99.43	586,637.00	
PETSMART INC	8,199	54.67	448,239.33	
PFIZER	567,753	21.84	12,399,725.52	
PG&E CORP	29,271	41.20	1,205,965.20	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	127,819	73.78	9,430,485.82	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,966	47.49	378,305.34	

PIONEER NATURAL RESOURCES	7,429	100.89	749,511.81	
PITNEY BOWES INC	14,896	19.49	290,323.04	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	10,303	38.07	392,235.21	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,294	59.40	2,274,663.60	
PPG INDUSTRIES INC	11,462	87.76	1,005,905.12	
PPL CORPORATION	42,042	27.80	1,168,767.60	
PRAXAIR INC	21,988	110.67	2,433,411.96	
PRECISION CASTPARTS CORP	10,481	177.31	1,858,386.11	
PRICE T ROWE GROUP INC	18,365	60.06	1,103,001.90	
PRICELINE.COM INC	3,631	526.07	1,910,160.17	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,718	26.99	613,158.82	
PROCTER & GAMBLE CO	199,970	66.08	13,214,017.60	
PROGRESS ENERGY INC	21,438	54.10	1,159,795.80	
PROGRESSIVE CORP	43,906	20.76	911,488.56	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,220	56.94	2,005,426.80	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	36,814	30.25	1,113,623.50	
QEP RESOURCES INC	12,916	27.45	354,544.20	
QUALCOMM	122,034	58.00	7,077,972.00	
QUANTA SERVICES INC	15,094	21.69	327,388.86	
QUEST DIAGNOSTICS	11,518	57.67	664,243.06	
RALCORP HOLDINGS INC	4,022	87.06	350,155.32	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,520	146.67	662,948.40	
RANGE RESOURCES CORP	11,720	54.06	633,583.20	
RAYTHEON COMPANY	25,732	49.98	1,286,085.36	
RED HAT INC	13,647	46.90	640,044.30	
REGIONS FINL CORP	91,811	4.94	453,546.34	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	73.10	268,423.20	
REPUBLIC SERVICES INC	21,451	27.96	599,769.96	
REYNOLDS AMERICAN INC	25,451	40.22	1,023,639.22	
ROBERT HALF INTL INC	10,193	29.99	305,688.07	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,061	66.49	336,505.89	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,203	81.75	834,095.25	
ROCKWELL COLLIN	10,892	59.96	653,084.32	
ROPER INDUSTRIES INC	6,780	94.78	642,608.40	
ROSS STORES INC	16,664	51.13	852,030.32	
ROWAN COMPANIES INC	9,313	34.68	322,974.84	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,334	27.95	288,835.30	
SAFEWAY INC	25,593	21.83	558,695.19	
SAIC INC	19,851	13.26	263,224.26	
SALESFORCE.COM INC	9,257	114.51	1,060,019.07	
SANDISK CORP	17,408	52.68	917,053.44	

SARA LEE CORP	40,707	19.40	789,715.80	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,282	45.39	375,919.98	
SCANA CORP	8,915	44.64	397,965.60	
SCHLUMBERGER	98,192	72.86	7,154,269.12	
SCHWAB (CHARLES) CORP	78,406	12.46	976,938.76	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,506	45.21	294,136.26	
SEAGATE TECHNOLOGY	30,408	19.84	603,294.72	
SEALED AIR CORP	11,100	19.33	214,563.00	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,037	43.35	131,653.95	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	18.61	192,594.89	
SEMPRA ENERGY	16,560	55.64	921,398.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,398	97.27	622,333.46	
SIGMA-ALDRICH	8,612	66.62	573,731.44	
SIRIUS XM RADIO INC	265,063	2.15	571,210.76	
SLM CORP	37,289	14.55	542,554.95	
SOUTHERN CO	62,411	44.98	2,807,246.78	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	9.30	120,779.10	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	25,323	29.06	735,886.38	
SPECTRA ENERGY CORP	47,320	31.41	1,486,321.20	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	218,606	2.34	511,538.04	
SPX CORP	3,727	67.73	252,429.71	
ST JUDE MEDICAL INC	23,978	38.56	924,591.68	
STANLEY BLACK&DECKER	11,639	71.18	828,464.02	
STAPLES INC	50,566	15.95	806,527.70	
STARBUCKS CORP	54,429	48.02	2,613,680.58	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,261	53.30	760,111.30	
STATE STREET CORP	36,678	41.06	1,505,998.68	
STERICYCLE INC	5,766	83.56	481,806.96	
STRYKER CORP	21,194	52.80	1,119,043.20	
SUNCOKE ENERGY INC	4,694	12.79	60,036.26	
SUNOCO INC	8,849	37.00	327,413.00	
SUNTRUST BANKS	39,068	20.24	790,736.32	
SYMANTEC CORP	53,418	16.59	886,204.62	
SYNOPSYS INC	10,454	28.82	301,284.28	
SYSCO CORP	43,130	30.00	1,293,900.00	
TARGET (DAYTON HUDSON)	46,796	50.90	2,381,916.40	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,700	16.78	280,226.00	
TE CONNECTIVITY LTD	31,090	36.64	1,139,137.60	
TERADATA CORP	11,934	52.61	627,847.74	
TEXAS INSTRUMENTS	84,072	33.82	2,843,315.04	
TEXTRON	20,179	21.64	436,673.56	

THE WALT DISNEY CO	128,629	39.44	5,073,127.76	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,788	51.84	1,440,529.92	
TIFFANY & CO	8,603	63.08	542,677.24	
TIME WARNER CABLE-A	23,723	68.35	1,621,467.05	
TIME WARNER INC	75,926	37.73	2,864,687.98	
TJX COMPANIES INC	27,793	66.92	1,859,907.56	
TOLL BROTHERS INC	10,462	22.90	239,579.80	
TORCHMARK CORP	7,647	44.88	343,197.36	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	20.94	239,281.38	
TRAVELERS COS INC/THE	30,471	60.30	1,837,401.30	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,697	37.39	287,790.83	
TYCO INTERNATIONAL LTD	33,791	49.19	1,662,179.29	
TYSON FOODS INC	22,213	19.50	433,153.50	
ULTRA PETROLEUM CORP	11,175	23.74	265,294.50	
UNION PACIFIC CORP	35,518	112.18	3,984,409.24	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	19.15	103,237.65	
UNITED HEALTHCARE CORP	78,311	52.32	4,097,231.52	
UNITED PARCEL SERVICE B	53,600	75.31	4,036,616.00	
UNITED STATES STEEL CORP	10,505	28.28	297,081.40	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	62,820	77.19	4,849,075.80	
UNUM GROUP	21,762	22.74	494,867.88	
URBAN OUTFITTERS INC	9,150	25.91	237,076.50	
URS CORP	5,746	40.38	232,023.48	
US BANCORP	139,784	28.56	3,992,231.04	
VALERO ENERGY CORP	41,634	23.00	957,582.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,285	71.70	594,034.50	
VERISIGN INC	11,357	35.75	406,012.75	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,317	40.48	377,152.16	
VERIZON COMMUNICATIONS	207,554	39.00	8,094,606.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,564	36.97	538,431.08	
VF CORP	6,403	133.09	852,175.27	
VIACOM INC-CLASS B	38,040	48.58	1,847,983.20	
VIRGIN MEDIA INC	21,310	24.10	513,571.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	37,933	102.37	3,883,201.21	
VMWARE INC-CLASS A	6,230	87.81	547,056.30	
VULCAN MATERIALS CO	9,434	41.64	392,831.76	
WALGREEN CO	65,886	33.50	2,207,181.00	
WAL-MART STORES	137,944	60.61	8,360,785.84	
WALTER ENERGY INC	4,552	62.61	285,000.72	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	10,203	17.44	177,940.32	
WASHINGTON POST -CL B	351	394.55	138,487.05	

	WASTE MANAGEMENT INC	32,633	33.85	1,104,627.05	
	WATERS CORP	6,479	79.38	514,303.02	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	9,760	60.26	588,137.60	
	WEATHERFORD INTL LTD	55,191	16.38	904,028.58	
	WELLPOINT INC	25,959	71.93	1,867,230.87	
	WELLS FARGO & CO	364,998	30.15	11,004,689.70	
	WESTERN DIGITAL CORP	16,982	33.95	576,538.90	
	WESTERN UNION CO	44,702	19.15	856,043.30	
	WEYERHAEUSER CO	38,078	21.01	800,018.78	
	WHIRLPOOL CORP	5,585	55.43	309,576.55	
	WHITING PETROLEUM CORP	8,576	50.72	434,974.72	
	WHOLE FOODS MKT INC	10,960	77.33	847,536.80	
	WILLIAMS COS	42,853	28.74	1,231,595.22	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,942	38.56	460,483.52	
	WINDSTREAM CORP	42,664	12.24	522,207.36	
	WISCONSIN ENERGY CORP	16,526	34.10	563,536.60	
	WR BERKLEY CORP	8,797	34.79	306,047.63	
	WYNN RESORTS LTD	5,925	117.35	695,298.75	
	XCEL ENERGY INC	35,261	26.59	937,589.99	
	XEROX CORP	102,129	8.71	889,543.59	
	XILINX INC	18,780	35.64	669,319.20	
	XL GROUP PLC	21,876	19.91	435,551.16	
	XYLEM INC	12,780	26.62	340,203.60	
	YAHOO	87,513	16.12	1,410,709.56	
	YUM BRANDS INC	33,880	62.47	2,116,483.60	
	ZIMMER HOLDINGS INC	13,572	56.14	761,932.08	
小計		21,879,889		879,768,484.64 (67,865,340,905)	
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES	12,308	36.33	447,149.64	
	AGRIUM INC	11,476	80.64	925,424.64	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,017	30.28	273,034.76	
	ARC RESOURCES LTD	20,878	23.31	486,666.18	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	21,957	11.31	248,333.67	
	BANK MONTREAL	46,294	59.70	2,763,751.80	
	BANK NOVA SCOTIA	79,010	53.98	4,264,959.80	
	BARRICK GOLD CORP	72,728	46.97	3,416,034.16	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,466	57.01	482,646.66	
	BCE INC	18,811	42.04	790,814.44	
	BELL ALIANT INC	5,225	27.95	146,038.75	
	BOMBARDIER B	101,601	4.50	457,204.50	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,440	22.85	238,554.00	

BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	40,703	31.00	1,261,793.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	18,367	17.19	315,728.73	
CAE INC	18,777	10.96	205,795.92	
CAMECO CORP	27,906	23.23	648,256.38	
CANADIAN IMPERIAL BANK	29,024	76.30	2,214,531.20	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,788	79.51	2,606,973.88	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,842	39.32	3,139,387.44	
CANADIAN OIL SANDS LTD	35,256	24.66	869,412.96	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,717	63.88	365,201.96	
CANADIAN UTILITIES LTD A	6,157	60.00	369,420.00	
CENOVUS ENERGY INC	54,878	36.05	1,978,351.90	
CENTERRA GOLD INC	12,066	17.99	217,067.34	
CGI GROUP INC - CL A	16,894	19.65	331,967.10	
CI FINANCIAL CORP	11,592	20.75	240,534.00	
CP RAILWAY LIMITED	12,330	72.60	895,158.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	17,967	45.91	824,864.97	
ELDORADO GOLD CORP	39,973	13.89	555,224.97	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	56.00	117,152.00	
ENBRIDGE	53,542	36.58	1,958,566.36	
ENCANA CORP	53,580	17.62	944,079.60	
ENERPLUS CORP	12,675	23.41	296,721.75	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,446	419.00	605,874.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	12,534	27.16	340,423.44	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	34,660	23.90	828,374.00	
FORTIS INC	13,557	33.21	450,227.97	
FRANCO-NEVADA CORP	8,927	40.95	365,560.65	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,462	22.49	190,310.38	
GOLDCORP INC	58,788	44.89	2,638,993.32	
GREAT-WEST LIFECO INC	20,134	22.15	445,968.10	
HUSKY ENERGY INC	24,166	24.19	584,575.54	
IAMGOLD CORP	27,309	15.72	429,297.48	
IGM FINANCIAL INC	8,221	44.63	366,903.23	
IMPERIAL OIL	21,588	46.18	996,933.84	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	26.41	162,342.27	
INMET MINING CORPORATION	3,823	65.74	251,324.02	
INTACT FINANCIAL CORP	9,428	57.45	541,638.60	
IVANHOE MINES LTD	20,684	19.54	404,165.36	
KINROSS GOLD CORP	82,700	10.17	841,059.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,241	37.45	308,625.45	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,894	42.45	674,700.30	

MANULIFE FINANCIAL CORP	130,098	12.33	1,604,108.34	
MEG ENERGY CORP	8,799	43.89	386,188.11	
METRO INC -A	7,253	51.29	372,006.37	
NATIONAL BANK OF CANADA	11,803	75.98	896,791.94	
NEW GOLD INC	30,224	10.09	304,960.16	
NEXEN INC	38,350	18.06	692,601.00	
NIKO RESOURCES LTD	3,389	50.70	171,822.30	
ONEX CORP	6,914	34.52	238,671.28	
OPEN TEXT CORP	4,182	50.71	212,069.22	
OSISKO MINING CORP	25,136	11.43	287,304.48	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	18,028	23.70	427,263.60	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,491	24.87	186,301.17	
PEMBINA PIPELINE CORP	12,199	27.36	333,764.64	
PENGROWTH ENERGY CORP	26,124	10.50	274,302.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	34,162	21.82	745,414.84	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	62,279	46.10	2,871,061.90	
POWER CORP OF CANADA	25,420	25.11	638,296.20	
POWER FINANCIAL CORP	17,519	26.67	467,231.73	
PRECISION DRILLING CORP	17,134	9.86	168,941.24	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	13,474	10.46	140,938.04	
RESEARCH IN MOTION	34,326	17.79	610,659.54	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,975	22.80	159,030.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,235	39.33	1,189,142.55	
ROYAL BANK OF CANADA	104,551	53.10	5,551,658.10	
SAPUTO INC	10,087	40.28	406,304.36	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,162	20.13	546,771.06	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,826	41.70	659,944.20	
SILVER WHEATON CORP	25,709	31.06	798,521.54	
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,981	54.54	598,903.74	
SUN LIFE FINANCIAL INC	42,235	20.69	873,842.15	
SUNCOR ENERGY	114,538	33.96	3,889,710.48	
TALTSMAN ENERGY INC	75,036	12.03	902,683.08	
TECK RESOURCES LTD-CL B	42,313	42.22	1,786,454.86	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	15,427	53.16	820,099.32	
THOMSON REUTERS CORP	27,471	29.16	801,054.36	
TIM HORTONS INC	11,633	48.72	566,759.76	
TMX GROUP INC	5,451	41.56	226,543.56	
TORONTO-DOMINION BANK	64,677	78.22	5,059,034.94	
TOURMALINE OIL CORP	8,840	22.60	199,784.00	
TRANSALTA CORP	15,411	20.23	311,764.53	
TRANSCANADA CORP	51,131	41.70	2,132,162.70	

	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	20,756	52.00	1,079,312.00	
	VERMILION ENERGY INC	6,631	44.74	296,670.94	
	VITERRA INC	27,159	10.59	287,613.81	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,773	65.95	248,829.35	
	YAMANA GOLD INC	54,254	15.47	839,309.38	
小計		2,739,612		88,986,702.28 (6,785,236,048)	
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	32,615	14.65	477,809.75	
	ALUMINA LIMITED	178,308	1.26	225,559.62	
	AMCOR	89,329	7.02	627,089.58	
	AMP LTD	204,604	4.25	869,567.00	
	ASCIANO GROUP	71,271	4.64	330,697.44	
	ASX LTD	12,382	30.60	378,889.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	191,303	20.82	3,982,928.46	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,842	8.11	217,688.62	
	BHP BILLITON LTD	233,697	37.34	8,726,245.98	
	BORAL LIMITED	53,336	3.90	208,010.40	
	BRAMBLES LTD	107,709	7.34	790,584.06	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	11.81	116,505.65	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	4,912	49.28	242,063.36	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	40,193	11.65	468,248.45	
	COCHLEAR LIMITED	4,146	60.70	251,662.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	113,426	49.80	5,648,614.80	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,482	7.82	254,009.24	
	CROWN LTD	33,250	8.14	270,655.00	
	CSL LIMITED	38,193	31.37	1,198,114.41	
	ECHO ENTERTAIMENT GROUP LIMITED	50,048	3.68	184,176.64	
	FAIRFAX MEDIA LTD	155,308	0.77	119,587.16	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,051	5.06	445,538.06	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	2.02	78,400.24	
	ILUKA RESOURCES LTD	29,603	16.83	498,218.49	
	INCITEC PIVOT LTD	115,153	3.19	367,338.07	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	146,990	2.95	433,620.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	31,955	7.45	238,064.75	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	11,065	21.85	241,770.25	
	LYNAS CORP LTD	124,409	1.15	143,070.35	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	25,344	23.74	601,666.56	
	METCASH LTD	56,181	4.05	227,533.05	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	160,175	23.88	3,824,979.00	
	NEWCREST MINING LIMITED	55,668	32.70	1,820,343.60	

	ONESTEEL LIMITED	92,775	0.85	79,322.62	
	ORICA LTD	26,485	25.04	663,184.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	77,497	13.57	1,051,634.29	
	OZ MINERALS LTD	23,664	10.94	258,884.16	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.52	117,266.48	
	QBE INSURANCE GROUP	79,511	11.20	890,523.20	
	QR NATIONAL LTD	120,758	3.72	449,219.76	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,598	19.80	190,040.40	
	RIO TINTO LTD	31,710	66.75	2,116,642.50	
	SANTOS	68,608	13.25	909,056.00	
	SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	12,007	14.08	169,058.56	
	SONIC HEALTHCARE LTD	26,964	11.42	307,928.88	
	SP AUSNET	102,121	0.96	98,546.76	
	SUNCORP GROUP LIMITED	93,625	8.15	763,043.75	
	TABCORP HOLDINGS	47,608	2.85	135,682.80	
	TATTS GROUP LTD	96,358	2.45	236,077.10	
	TELSTRA CORP	316,914	3.30	1,045,816.20	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	49,295	4.47	220,348.65	
	TRANSURBAN GROUP	95,018	5.41	514,047.38	
	WESFARMERS LIMITED	73,190	30.37	2,222,780.30	
	WESTPAC BANKING	220,505	20.60	4,542,403.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,178	33.48	1,546,039.44	
	WOOLWORTHS LTD	88,530	25.13	2,224,758.90	
	WORLEYPARSONS LTD	13,669	27.10	370,429.90	
小計		4,456,362		55,631,985.37 (4,470,586,344)	
イギリスポンド	3I GROUP PLC	70,981	1.81	128,830.51	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,827	8.79	130,329.33	
	AGGREKO PLC	18,806	20.85	392,105.10	
	AMEC PLC	24,255	9.97	241,822.35	
	ANGLO AMERICAN PLC	96,286	26.47	2,549,171.85	
	ANTOFAGASTA PLC	27,880	13.64	380,283.20	
	ARM HOLDINGS PLC	98,146	5.80	569,737.53	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,188	11.59	291,928.92	
	ASTRAZENECA	97,491	30.70	2,992,973.70	
	AVIVA PIC	209,011	3.42	714,817.62	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	26,235	7.58	198,861.30	
	BAE SYSTEMS PLC	241,629	3.13	757,990.17	
	BALFOUR BEATTY PLC	50,164	2.88	144,572.64	
	BARCLAYS	845,531	2.21	1,871,582.86	
	BG GROUP	246,677	14.90	3,675,487.30	

BHP BILLTTON PLC	153,693	21.58	3,317,463.40	
BP PLC	1,378,469	4.82	6,650,423.69	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	143,858	28.97	4,168,285.55	
BRITISH SKY BROADCASTING	82,909	6.66	552,588.48	
BT GROUP PLC	565,672	2.03	1,148,879.83	
BUNZL PLC	24,139	8.65	208,923.04	
BURBERRY GROUP PLC	31,900	13.52	431,288.00	
CAIRN ENERGY PLC	99,039	2.92	289,689.07	
CAPITA PLC	43,355	6.37	276,171.35	
CARNIVAL PLC	12,952	20.17	261,241.84	
CENTRICA PLC	376,330	2.83	1,066,519.22	
COBHAM PLC	80,360	1.92	154,451.92	
COMPASS GROUP PLC	138,052	6.13	846,258.76	
DIAGEO	182,215	13.81	2,516,389.15	
ESSAR ENERGY PLC	22,650	1.20	27,180.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	18,819	7.49	141,048.40	
EXPERIAN PLC	73,032	9.02	659,113.80	
FRESNILLO PLC	13,102	17.68	231,643.36	
G4S PLC	99,732	2.69	268,877.47	
GLAXOSMITHKLINE	369,253	14.37	5,308,011.87	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	58,733	4.30	252,551.90	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,302,860	5.36	6,988,541.04	
ICAP PLC	41,029	3.22	132,359.55	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	73,737	22.21	1,637,698.77	
INMARSAT PLC	33,741	4.06	137,292.12	
INTERCONTINENTAL HOTELS	20,522	13.07	268,222.54	
INTERNATIONAL POWER PLC	108,037	3.27	354,145.28	
INTERTEK GROUP PLC	11,322	21.45	242,856.90	
INVENSYS PLC	59,169	2.00	118,338.00	
INVESTEC PLC	35,352	3.74	132,428.59	
ITV PLC	269,974	0.74	199,780.76	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,178	20.90	317,220.20	
KAZAKHMYS PLC	15,644	11.13	174,117.72	
KINGFISHER PLC	172,039	2.58	444,032.65	
LEGAL & GENERAL GROUP	428,640	1.15	495,079.20	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,010,372	0.32	971,447.04	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,373	8.83	91,645.45	
LONMIN PLC	11,837	10.29	121,802.73	
MAN GROUP PLC	137,864	1.19	164,747.48	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	112,067	3.27	366,459.09	
MEGGITT PLC	56,559	3.74	211,700.33	

MORRISON SUPERMARKETS	157,614	2.91	458,814.35	
NATIONAL GRID PLC	258,999	6.17	1,599,318.82	
NEW GKN	113,486	2.13	241,838.66	
NEXT PLC	12,520	26.29	329,150.80	
OLD MUTUAL PLC	403,559	1.46	592,021.05	
PEARSON	59,276	12.30	729,094.80	
PETROFAC LTD	18,332	15.04	275,713.28	
PRUDENTIAL	185,999	7.00	1,301,993.00	
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,658	71.75	477,711.50	
RECKITT BENCKISER PLC	45,058	33.99	1,531,521.42	
REED ELSEVIER PLC	88,522	5.27	466,953.55	
RESOLUTION LTD	104,082	2.70	281,958.13	
REXAM	64,080	3.74	240,235.92	
RIO TINTO PLC REG	101,797	37.28	3,794,992.16	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	136,240	7.35	1,001,364.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,242,544	0.27	336,232.40	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	263,351	22.82	6,010,986.57	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	195,338	23.67	4,624,627.15	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	250,173	1.08	270,687.18	
SABMILLER PLC	69,362	22.93	1,590,470.66	
SAGE GROUP PLC	93,506	3.06	286,128.36	
SAINSBURY (J) PLC	86,156	2.87	248,043.12	
SCHRODERS PLC	8,264	14.37	118,753.68	
SERCO GROUP PLC	36,053	5.16	186,033.48	
SEVERN TRENT PLC	16,790	15.29	256,719.10	
SHIRE PLC	40,930	21.65	886,134.50	
SMITH & NEPHEW PLC	63,094	5.99	378,248.53	
SMITHS GROUP PLC	27,728	9.98	276,864.08	
SSE PLC	68,181	12.45	848,853.45	
STANDARD CHARTERED PLC	173,687	15.59	2,707,780.33	
STANDARD LIFE PLC	165,261	2.09	345,891.27	
TATE & LYLE	34,011	6.82	231,955.02	
TESCO	583,309	3.27	1,907,420.43	
TUI TRAVEL PLC	34,970	1.90	66,443.00	
TULLOW OIL PLC	65,778	13.83	909,709.74	
UNILEVER PLC	93,396	20.41	1,906,212.36	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	48,197	6.00	289,422.98	
VEDANTA RESOURCES PLC	8,738	10.95	95,681.10	
VODAFONE GROUP PLC	3,698,909	1.74	6,454,596.20	
WEIR GROUP PLC/THE	14,940	20.79	310,602.60	
WHITBREAD PLC	12,946	16.63	215,291.98	

	WOLSELEY LTD	20,138	22.50	453,105.00	
	WPP PLC	91,779	7.48	686,506.92	
	XSTRATA PLC	151,016	10.89	1,645,319.32	
小計		21,402,454		105,254,811.87 (12,577,950,018)	
スイスフラン	ABB LTD	159,518	20.00	3,190,360.00	
	ACTELION LTD-REG	8,086	34.59	279,694.74	
	ADECCO	9,367	45.02	421,702.34	
	ARYZTA AG	6,174	42.05	259,616.70	
	BALOISE HOLDING AG	3,473	69.40	241,026.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	875.00	115,500.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	37,985	53.00	2,013,205.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	83,295	23.90	1,990,750.50	
	GAM HOLDING LTD	14,331	11.55	165,523.05	
	GEBERIT AG-REG	2,849	193.00	549,857.00	
	GIVAUDAN-REG	605	889.50	538,147.50	
	HOLCIM LTD	17,851	54.45	971,986.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,668	38.37	562,811.16	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,818	115.00	439,070.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	65	2,722.00	176,930.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	31,500.00	252,000.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,674	61.70	226,685.80	
	NESTLE SA - REGISTERED	240,138	53.70	12,895,410.60	
	NOVARTIS	169,827	54.20	9,204,623.40	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	65.05	122,294.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	975	163.00	158,925.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	51,125	165.80	8,476,525.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,573	108.60	170,827.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,437	110.70	380,475.90	
	SGS SA	398	1,672.00	665,456.00	
	SIKA AG-BR	149	1,965.00	292,785.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,590	97.65	350,563.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	545	166.50	90,742.50	
	SULZER AG-REG	1,753	116.70	204,575.10	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,244	389.20	873,364.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,172	68.00	215,696.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,227	93.50	208,224.50	
	SWISS RE LTD	25,000	51.60	1,290,000.00	
	SWISSCOM	1,696	366.50	621,584.00	
	SYNGENTA AG	6,884	289.30	1,991,541.20	
	SYNTHES INC	4,751	157.40	747,807.40	

	TRANSOCEAN LTD	25,129	42.10	1,057,930.90	
	UBS AG-REG	265,688	12.57	3,339,698.16	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,632	226.80	2,411,337.60	
小計		1,188,712		58,165,255.30 (4,812,011,570)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	613,600	25.65	15,738,840.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	98.90	1,364,820.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	30.20	3,296,632.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	269,500	20.25	5,457,375.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	14.40	1,180,800.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	101,000	103.50	10,453,500.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	33,000	42.40	1,399,200.00	
	CLP HOLDINGS	140,000	62.30	8,722,000.00	
	FIRST PACIFIC CO	154,000	9.00	1,386,000.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	141,000	5.10	719,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	16.76	1,525,160.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	62,000	49.35	3,059,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	179,000	26.50	4,743,500.00	
	HANG SENG BANK	55,600	97.95	5,446,020.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	66,000	43.50	2,871,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	344,601	18.00	6,202,818.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	74,600	130.70	9,750,220.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	20.10	834,150.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	155,000	72.05	11,167,750.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	46,000	29.85	1,373,100.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	52,500	28.55	1,498,875.00	
	LI & FUNG	412,800	16.90	6,976,320.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	43,000	18.80	808,400.00	
	MTR CORP	105,500	25.05	2,642,775.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	262,500	7.93	2,081,625.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	11.70	1,158,300.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	43.15	625,675.00	
	PCCW LTD	292,000	2.33	680,360.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	101,000	53.55	5,408,550.00	
	SANDS CHINA LTD	170,800	24.90	4,252,920.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	102,000	15.84	1,615,680.00	
	SINO LAND CO	213,400	12.48	2,663,232.00	
	SJM HOLDINGS LTD	121,000	13.06	1,580,260.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	107.90	11,113,700.00	
	SWIRE PACIFIC A	52,500	77.15	4,050,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	36,750	17.16	630,630.00	

	WHARF HOLDINGS	107,000	42.55	4,552,850.00	
	WHEELOCK & CO LTD	67,000	23.20	1,554,400.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	67.60	845,000.00	
	WYNN MACAU LTD	113,600	19.32	2,194,752.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	24.90	1,282,350.00	
小計		5,306,211		154,908,714.00 (1,539,792,617)	
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	181,500	2.49	451,935.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	1.28	127,215.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	35,000	9.32	326,200.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.45	189,950.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	1.05	71,740.00	
	DBS GROUP	128,000	12.89	1,649,920.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	67,000	6.43	430,810.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	444,000	1.53	681,540.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	134,000	1.84	247,230.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	488,000	0.72	353,800.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	50.41	403,280.00	
	KEPPEL CORP LTD	103,300	10.40	1,074,320.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	2.57	128,500.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	1.26	77,165.00	
	NOBLE GROUP LTD	280,363	1.21	340,641.04	
	OCBC BANK	185,000	8.15	1,507,750.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	107,000	2.48	265,360.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	72,000	4.52	325,440.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	61,000	4.53	276,330.00	
	SINGAPORE AIRLINES	39,533	10.73	424,189.09	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	63,000	6.33	398,790.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	108,000	3.64	393,120.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	112,000	2.83	316,960.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	580,243	3.06	1,775,543.58	
	STARHUB LTD	44,000	2.81	123,640.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	92,000	16.85	1,550,200.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	4.09	128,017.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	140,000	5.15	721,000.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.04	138,985.00	
小計		4,046,239		14,899,570.71 (903,807,959)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.50	169,122.50	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	4.86	123,944.58	
	FLETCHER BUILDING LTD	49,584	6.24	309,404.16	

	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.53	148,821.27	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	140,637	2.04	287,602.66	
小計		325,532		1,038,895.17 (64,349,166)	
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	23,871	140.20	3,346,714.20	
	ASSA ABLOY B	22,212	187.70	4,169,192.40	
	ATLAS COPCO A	48,865	161.90	7,911,243.50	
	ATLAS COPCO B	27,589	144.30	3,981,092.70	
	BOLIDEN AB	19,986	117.60	2,350,353.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,558	124.50	2,185,971.00	
	ERICSSON (LM) B	219,151	68.35	14,978,970.85	
	GETINGE AB-B SHS	14,625	176.20	2,576,925.00	
	HENNES & MAURITZ B	74,404	223.60	16,636,734.40	
	HEXAGON AB-B SHS	18,518	119.10	2,205,493.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,671	203.70	747,782.70	
	HUSQVARNA AB-B SHS	30,739	38.34	1,178,533.26	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	95.65	823,355.20	
	INVESTOR AB-B SHS	33,252	136.20	4,528,922.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	15,037	138.00	2,075,106.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,194	152.40	2,467,965.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,556	671.50	3,730,854.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,529	333.30	1,176,215.70	
	NORDEA BANK AB	192,052	56.25	10,802,925.00	
	RATOS AB-B SHS	14,010	87.95	1,232,179.50	
	SANDVIK AB	73,376	98.00	7,190,848.00	
	SCA SV CELLULOSA B	42,042	112.80	4,742,337.60	
	SCANIA AB-B SHS	22,624	116.70	2,640,220.80	
	SECURITAS B	22,880	64.60	1,478,048.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	102,972	42.09	4,334,091.48	
	SKANSKA B	28,274	120.30	3,401,362.20	
	SKF AB-B	28,483	157.00	4,471,831.00	
	SSAB AB-A SHS	10,878	75.00	815,850.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	35,761	200.70	7,177,232.70	
	SWEDBANK AB-A	59,095	98.90	5,844,495.50	
	SWEDISH MATCH AB	15,059	231.70	3,489,170.30	
	TELE2 AB-B SHS	22,414	127.10	2,848,819.40	
	TELIASONERA AB	157,548	45.23	7,125,896.04	
	VOLVO B	101,060	86.90	8,782,114.00	
小計		1,531,893		153,448,847.83 (1,750,851,353)	
ノルウェークローネ	ACERGY S.A.	19,898	121.30	2,413,627.40	

	AKER SOLUTIONS ASA	12,013	72.75	873,945.75	
	DNB ASA	71,345	61.70	4,401,986.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,625	67.80	991,575.00	
	NORSK HYDRO	68,033	31.44	2,138,957.52	
	ORKLA	54,560	46.38	2,530,492.80	
	SEADRILL LTD	23,903	213.60	5,105,680.80	
	STATOIL ASA	81,212	147.60	11,986,891.20	
	TELENOR ASA	52,747	94.20	4,968,767.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,400	251.70	3,372,780.00	
小計		411,736		38,784,704.37 (505,752,544)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	40	37,680.00	1,507,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	96	39,420.00	3,784,320.00	
	CARLSBERG AS-B	7,784	415.60	3,235,030.40	
	COLOPLAST-B	1,664	844.00	1,404,416.00	
	DANSKE BANK A/S	47,614	77.50	3,690,085.00	
	DSV A/S	14,538	117.70	1,711,122.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	30,946	696.00	21,538,416.00	
	NOVOZYMES A/S	16,300	165.40	2,696,020.00	
	TDC A/S	27,128	44.11	1,196,616.08	
	TRYG A/S	1,870	316.60	592,042.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	14,885	64.85	965,292.25	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,705	475.00	809,875.00	
小計		164,570		43,130,435.33 (580,104,355)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOALIM BM	77,463	13.18	1,020,962.34	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	86,200	12.01	1,035,262.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	128,316	6.72	863,053.41	
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,998	59.70	238,680.60	
	DELEK GROUP LTD	299	802.80	240,037.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,551	159.50	247,384.50	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	31,422	39.75	1,249,024.50	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,364.00	380,604.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,988	5.43	299,079.73	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	33.59	275,438.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	131.40	551,223.00	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	5,625	34.45	193,781.25	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	68,434	172.00	11,770,648.00	
小計		470,852		18,365,178.53 (375,016,945)	
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	27,432	12.80	351,129.60	

ACCIONA SA	1,857	62.89	116,786.73	
ACCOR	10,777	22.79	245,661.71	
ACERINOX SA	6,932	10.64	73,791.14	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,011	22.95	229,752.45	
ADIDAS AG	15,224	54.97	836,863.28	
ADP	2,531	57.06	144,418.86	
AEGON	122,005	3.77	460,934.89	
AEM SPA	80,124	0.69	56,006.67	
AGEAS	161,673	1.40	226,988.89	
AHOLD (KON.)	84,549	10.15	858,595.09	
AIR LIQUIDE	20,645	98.87	2,041,171.15	
AKZO NOBEL	16,858	39.66	668,588.28	
ALCATEL-LUCENT	164,046	1.56	256,075.80	
ALLIANZ SE-REG	33,180	83.34	2,765,221.20	
ALSTOM RGPT	14,571	28.15	410,173.65	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,799	12.92	294,563.08	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	58,420	48.09	2,809,417.80	
ARCELORMITTAL	62,472	16.36	1,022,354.28	
ARKEMA	4,044	61.27	247,775.88	
ASML HOLDING NV	31,384	32.64	1,024,373.76	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,243	12.33	1,051,046.19	
ATLANTIA SPA	23,029	11.53	265,524.37	
ATOS	3,615	37.10	134,116.50	
AUTOGRILL SPA	7,704	8.16	62,903.16	
AXA	127,051	11.67	1,482,685.17	
AXEL SPRINGER AG	2,751	36.60	100,686.60	
BANCA CARIGE SPA	47,269	1.52	71,848.88	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	313,662	0.21	66,747.27	
BANCO BILBAO VIZCAYA	334,616	6.75	2,258,658.00	
BANCO DE SABADELL SA	81,312	2.78	226,453.92	
BANCO POPOLARE SPA	128,954	1.02	131,790.98	
BANCO POPULAR ESPANOL	71,010	3.57	253,505.70	
BANCO SANTANDER SA	616,170	5.89	3,630,473.64	
BANCO SANTANDER SA-RIGHTS	616,170	0.12	78,869.76	
BANKIA SAU	63,345	3.60	228,358.72	
BANKINTER SA	15,579	5.21	81,182.16	
BASF SE	66,837	59.01	3,944,051.37	
BAYER	60,176	54.20	3,261,539.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,094	62.96	1,516,958.24	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,814	41.60	158,662.40	
BEIERSDORF AG	7,127	44.02	313,766.17	

BEKAERT NV	2,844	32.96	93,752.46	
BELGACOM	11,115	24.25	269,538.75	
BNP PARIBAS	70,535	34.70	2,447,564.50	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,165	31.27	161,509.55	
BOUYGUES ORD	13,386	24.96	334,114.56	
BRENNTAG AG	2,446	78.42	191,815.32	
BUREAU VERITAS SA	3,992	55.62	222,035.04	
CAIXABANK	54,400	3.90	212,486.40	
CAP GEMINI SA	10,462	27.62	288,960.44	
CARREFOUR	42,019	17.26	725,458.03	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,913	69.31	271,210.03	
CELESIO AG	5,912	14.38	85,044.12	
CHRISTIAN DIOR	3,854	104.10	401,201.40	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	10,539	20.73	218,526.16	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	14,731	5.04	74,258.97	
CNP ASSURANCES	10,861	10.99	119,416.69	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	13,390	14.70	196,833.00	
COLRUYT SA	5,534	29.08	160,928.72	
COMMERZBANK AG	254,024	1.62	411,518.88	
CONTINENTAL AG	5,656	62.07	351,067.92	
CREDIT AGRICOLE SA	72,944	4.83	352,903.07	
CRH	52,136	16.20	844,603.20	
DAIMLER AG	65,914	41.44	2,731,476.16	
DANONE (GROUPE)	42,495	46.95	1,995,140.25	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,273	63.23	270,181.79	
DELHAIZE GROUP	7,180	42.30	303,714.00	
DELTA LLOYD NV	6,994	13.91	97,286.54	
DEUTSCHE BANK NAMEN	67,857	32.47	2,203,656.07	
DEUTSCHE BOERSE AG NEW	14,236	42.46	604,531.74	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,731	10.16	170,070.61	
DEUTSCHE POST AG-REG	61,585	12.67	780,281.95	
DEUTSCHE TELEKOM	204,398	8.93	1,827,113.72	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	40,137	3.60	144,533.33	
E.ON AG	131,050	16.29	2,134,804.50	
EDENRED	11,555	19.16	221,451.57	
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	4.36	63,804.24	
EIFFAGE	2,815	24.32	68,460.80	
ELAN CORPORATION PLC	36,440	10.44	380,433.60	
ELECTRICITE DE FRANCE	17,603	17.42	306,644.26	
ELISA A	10,330	16.56	171,064.80	

ENAGAS	13,083	14.55	190,423.06	
ENEL	478,991	3.08	1,476,250.26	
ENEL GREEN POWER SPA	127,874	1.56	200,122.81	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,459	2.30	320,755.70	
ENI	174,879	17.20	3,007,918.80	
ERSTE GROUP BANK AG	13,827	14.65	202,565.55	
ESSILOR INTERNATIONAL	14,632	57.10	835,487.20	
EURAZEO	2,245	34.20	76,790.22	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	29,836	25.52	761,563.90	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,238	28.86	208,888.68	
EXOR SPA	4,687	17.50	82,022.50	
FERROVIAL SA	26,799	9.24	247,649.55	
FIAT INDUSTRIAL	54,060	7.81	422,208.60	
FIAT ORD	55,890	4.35	243,568.62	
FINMECCANICA SPA	29,572	3.01	89,011.72	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	3,419	19.49	66,636.31	
FORTUM OYJ	32,323	16.45	531,713.35	
FRANCE TELECOM	134,928	11.54	1,557,069.12	
FRAPORT AG	2,685	44.37	119,146.87	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,198	53.62	814,916.76	
FRESENIUS SE&CO KGAA	8,275	74.28	614,667.00	
FUGRO NV-CVA	4,986	49.69	247,754.34	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,905	12.41	209,875.57	
GAS NATURAL SDG SA	25,257	12.84	324,426.16	
GDF SUEZ	90,102	21.39	1,927,732.29	
GEA GROUP AG	12,759	24.41	311,447.19	
GRIFOLS SA	10,120	13.70	138,644.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,727	56.73	324,892.71	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	38,589	6.07	234,582.53	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,409	39.76	175,323.88	
HEIDELBERGCEMENT AG	9,942	38.17	379,535.85	
HEINEKEN HOLDING NV	8,146	31.45	256,191.70	
HEINEKEN NV	18,862	36.07	680,446.65	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	17,908	2.92	52,291.36	
HENKEL AG & CO KGAA	9,184	38.86	356,890.24	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,965	47.21	612,077.65	
HOCHTIEF AG	3,095	50.55	156,452.25	
IBERDROLA SA	279,094	4.63	1,293,042.50	
ILIAD SA	1,399	90.74	126,945.26	
IMERYS SA	2,361	43.11	101,794.51	

IMMOFINANZ AG	68,672	2.38	163,439.36	
INDITEX	15,876	66.17	1,050,514.92	
INDRA SISTEMAS SA	6,845	10.60	72,557.00	
INFINEON TECHNOLOGIES	79,081	6.95	549,692.03	
ING GROEP	279,620	7.17	2,007,112.36	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,787	1.98	134,557.19	
INTESA SANPAOLO	735,572	1.36	1,000,377.92	
INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	1.06	68,765.38	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	0.00	0.00	
JC DECAUX SA	4,621	19.66	90,848.86	
JERONIMO MARTINS	16,094	12.65	203,589.10	
K+S AG	12,535	37.74	473,070.90	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,363	40.60	258,369.61	
KBC GROEP NV	11,778	11.58	136,389.24	
KERRY GROUP PLC-A	9,928	28.70	284,933.60	
KESKO OYJ-B SHS	4,889	27.29	133,420.81	
KONE OYJ-B	11,330	43.00	487,190.00	
KONINKLIJKE DSM NV	11,222	38.50	432,047.00	
KPN (KON.)	107,518	8.63	928,740.48	
LAFARGE (FRANCE)	14,177	31.00	439,487.00	
LAGADERE S.C.A	8,624	22.31	192,444.56	
LANXESS	6,080	49.00	297,920.00	
LEGRAND SA	16,285	27.32	444,906.20	
LINDE AG	12,426	119.50	1,484,907.00	
LOREAL	17,493	82.35	1,440,548.55	
LUXOTTICA GROUP SPA	8,527	23.96	204,306.92	
LVMH	18,492	120.20	2,222,738.40	
MAN SE	4,485	79.52	356,647.20	
MAPFRE SA	55,064	2.47	136,173.27	
MEDIASET	51,788	2.20	114,140.75	
MEDIOBANCA	37,781	4.79	181,197.67	
MERCK KGAA	4,722	77.70	366,899.40	
METRO STAMM	9,166	28.76	263,659.99	
METSO OYJ	9,035	31.97	288,848.95	
MICHELIN	13,098	51.84	679,000.32	
MOBISTAR SA	2,086	38.85	81,041.10	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,093	98.05	1,283,768.65	
NATIXIS	63,795	2.25	143,538.75	
NEOPOST SA	2,357	55.85	131,638.45	
NESTE OIL OYJ	8,623	8.95	77,175.85	
NOKIA CORP	272,517	4.38	1,195,259.56	

NOKIAN RENKAAT OYJ	8,042	27.76	223,245.92	
OKO BANK-A	9,611	8.52	81,885.72	
OMV AG	11,569	24.33	281,473.77	
OPAP SA	16,317	6.40	104,428.80	
ORION OYJ-CLASS B	6,894	15.05	103,754.70	
PERNOD-RICARD	14,448	73.53	1,062,361.44	
PEUGEOT SA	11,116	14.40	160,070.40	
PHILIPS ELECTRS (KON.)	73,422	14.97	1,099,127.34	
PIRELLI & CO	17,381	7.06	122,796.76	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,143	47.10	524,835.30	
PORTUGAL TELECOM	49,132	4.15	203,897.80	
PPR	5,538	118.30	655,145.40	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	5,151	16.72	86,124.72	
PRYSMIAN SPA	14,881	11.49	170,982.69	
PUBLICIS GROUPE	10,468	38.89	407,100.52	
QIAGEN N.V.	17,075	12.20	208,315.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	21.00	71,400.00	
RANDSTAD HOLDING NV	8,741	24.21	211,619.61	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,651	34.25	262,085.00	
REED ELSEVIER NV	50,054	9.13	457,393.45	
RENAULT SA	13,590	32.42	440,655.75	
REPSOL YPF	57,747	22.14	1,278,518.58	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	26.05	68,342.26	
RWE STAMM	35,545	27.66	983,174.70	
SAFRAN SA	11,794	23.90	281,876.60	
SAINT-GOBAIN	29,229	34.57	1,010,592.67	
SAIPEM	19,267	35.88	691,299.96	
SALZGITTER AG	2,854	46.00	131,284.00	
SAMPO OYJ-A SHS	30,666	19.64	602,280.24	
SANOFI	83,401	55.97	4,667,953.97	
SANOMA OYJ	5,948	10.54	62,691.92	
SAP AG	66,956	44.03	2,948,407.46	
SBM OFFSHORE NV	12,325	15.00	184,936.62	
SCHNEIDER ELECTRIC	35,622	48.56	1,729,982.43	
SCOR SE	12,355	19.21	237,339.55	
SES	21,808	18.22	397,450.80	
SIEMENS	59,873	78.35	4,691,049.55	
SNAM SPA	113,618	3.31	376,075.58	
SOCIETE BIC SA	2,129	67.68	144,090.72	
SOCIETE GENERALE	48,158	20.09	967,735.01	
SODEXO	6,666	57.76	385,028.16	

	SOLVAY SA	4,192	72.96	305,848.32	
	STMICROELECTRONICS	46,564	5.62	261,969.06	
	STORA ENSO OYJ R	42,511	5.65	240,399.70	
	SUEDZUCKER AG	4,843	22.56	109,258.08	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	19,681	9.09	179,038.05	
	TECHNIP S.A.	7,220	70.24	507,132.80	
	TELECOM ITALIA ORD	683,431	0.82	562,805.42	
	TELECOM ITALIA RNC	426,054	0.70	299,515.96	
	TELEFONICA	298,906	13.48	4,030,747.41	
	TELEKOM AUSTRIA AG	24,278	9.24	224,328.72	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,577	8.39	72,003.91	
	TENARIS SA	34,363	15.61	536,406.43	
	TERNA SPA	88,123	2.70	238,637.08	
	THALES SA	7,274	25.64	186,541.73	
	THYSSEN KRUPP	28,079	20.95	588,255.05	
	TNT EXPRESS	25,745	6.50	167,342.50	
	TOTAL SA	154,466	40.44	6,246,605.04	
	UCB (GROUPE)	7,369	31.21	230,023.33	
	UMICORE	8,330	35.73	297,630.90	
	UNICREDIT SPA	293,709	3.36	986,862.24	
	UNILEVER NV-CVA	118,540	25.20	2,987,208.00	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	58,086	3.17	184,481.13	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,820	14.35	112,217.00	
	UPM KYMMENE CORP	38,202	10.13	386,986.26	
	VALLOUREC	8,232	55.43	456,299.76	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,467	8.08	213,853.36	
	VERBUND AG	4,976	20.80	103,525.68	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	31.46	88,353.72	
	VINCI S.A.	32,844	36.83	1,209,808.74	
	VIVENDI	90,744	16.08	1,459,163.52	
	VOESTALPINE AG	8,029	26.20	210,359.80	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	10,524	135.55	1,426,528.20	
	VOLKSWAGEN STAMM	2,156	122.05	263,139.80	
	VOPAK	5,138	41.30	212,199.40	
	WACKER CHEMIE AG	1,088	76.50	83,232.00	
	WARTSILA OYJ	11,853	26.08	309,126.24	
	WENDEL	2,399	58.75	140,941.25	
	WOLTERS KLUWER	21,116	13.87	292,984.50	
	ZARDOYA OTIS SA	10,201	10.92	111,394.92	

小計	12,927,375		153,153,423.13 (15,313,810,778)	
合計	76,851,437		(117,544,610,602)	

(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 562銘柄	100.0%	57.7%
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 57銘柄	100.0%	3.8%
イギリスポンド	株式 100銘柄	100.0%	10.7%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式 41銘柄	100.0%	1.3%
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 34銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 12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 243銘柄	100.0%	13.0%

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	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	382,000.00	276,950.00	
	小計		382,000.00	276,950.00 (21,363,923)	
	オーストラリアドル	LEND LEASE GROUP	39,632.00	292,087.84	
	小計		39,632.00	292,087.84 (23,472,178)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	6,347.00	30,782.95	
	小計		6,347.00	30,782.95 (305,982)	
投資信託受益証券計				(45,142,083)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	29,015.00	1,804,733.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,518.00	1,160,021.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,843.00	869,676.87	
		BOSTON PROPERTIES	10,690.00	1,066,434.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,231.00	488,381.74	
		DUKE REALTY CORP	17,553.00	233,103.84	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,575.00	1,197,628.25	

	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,548.00	417,142.56	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	30,759.00	464,153.31	
	HCP INC	29,630.00	1,226,089.40	
	HEALTH CARE REIT INC	13,810.00	761,483.40	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	51,385.00	814,966.10	
	KIMCO REALTY CORP	28,770.00	508,653.60	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,421.00	277,050.90	
	MACERICH CO/THE	9,255.00	492,643.65	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,833.00	471,663.38	
	PROLOGIS INC	33,401.00	1,045,451.30	
	PUBLIC STORAGE	10,556.00	1,432,026.96	
	RAYONIER INC	8,893.00	422,417.50	
	REGENCY CENTERS CORP	6,569.00	264,467.94	
	ROUSE PROPERTIES INC	1,153.00	12,717.59	
	SIMON PROPERTY GROUP	21,364.00	2,803,384.08	
	VENTAS INC	19,904.00	1,115,022.08	
	VORNADO REALTY TRUST	12,079.00	967,286.32	
小計		465,755.00	20,316,599.27 (1,567,222,467)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	5,613.00	131,961.63	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,313.00	247,446.41	
小計		14,926.00	379,408.04 (28,929,863)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	134,870.00	227,930.30	
	DEXUS PROPERTY GROUP	353,593.00	311,161.84	
	GOODMAN GROUP	513,315.00	325,955.02	
	GPT GROUP	124,629.00	383,857.32	
	MIRVAC GROUP	249,678.00	317,091.06	
	STOCKLAND	173,411.00	575,724.52	
	WESTFIELD GROUP	159,622.00	1,329,651.26	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	211,136.00	523,617.28	
小計		1,920,254.00	3,994,988.60 (321,037,283)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	59,832.00	293,176.80	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	40,840.00	132,403.28	
	HAMMERSON PLC	52,079.00	200,139.59	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	54,856.00	372,746.52	
	SEGRO PLC	54,233.00	115,082.42	
小計		261,840.00	1,113,548.61 (133,069,058)	

	香港ドル	LINK REIT	163,500.00	4,782,375.00	
	小計		163,500.00	4,782,375.00 (47,536,807)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	129,000.00	251,550.00	
		CAPITAMALL TRUST	157,000.00	272,395.00	
	小計		286,000.00	523,945.00 (31,782,503)	
	ユーロ	CORIO NV	4,387.00	150,254.75	
		FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	90,629.17	
		GECINA SA	1,603.00	112,594.72	
		ICADE	1,705.00	97,253.20	
		KLEPIERRE	7,627.00	173,704.92	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	6,711.00	965,712.90	
	小計		23,944.00	1,590,149.66 (158,999,064)	
投資証券計				(2,288,577,045)	
合計				(2,333,719,128)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における(　)内の金額は、邦貨換算額であります。
(注2)合計欄における(　)内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。
(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券	1銘柄	1.3%	—	68.0%
	投資証券	24銘柄	—	98.7%	
カナダドル	投資証券	2銘柄	—	100.0%	1.2%
オーストラリアドル	投資信託受益証券	1銘柄	6.8%	—	14.8%
	投資証券	8銘柄	—	93.2%	
イギリスポンド	投資証券	5銘柄	—	100.0%	5.7%
香港ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.6%	—	2.1%
	投資証券	1銘柄	—	99.4%	
シンガポールドル	投資証券	2銘柄	—	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券	6銘柄	—	100.0%	6.8%

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 新興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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	32,369,482	27,385,342
コール・ローン	56,243,042	26,765,447
国債証券	2,002,429,429	4,806,927,554
特殊債券	131,546,818	288,158,129
未収利息	36,232,067	66,091,301
前払費用	6,970,430	27,318,684
流動資産合計	2,265,791,268	5,242,646,457
資産合計	2,265,791,268	5,242,646,457
負債の部		
流動負債		
未払金	―	5,144,592
未払解約金	706,753	362,418
流動負債合計	706,753	5,507,010
負債合計	706,753	5,507,010
純資産の部		
元本等		
元本	1,783,101,826	4,321,191,098
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	481,982,689	915,948,349
元本等合計	2,265,084,515	5,237,139,447
純資産合計	2,265,084,515	5,237,139,447
負債純資産合計	2,265,791,268	5,242,646,457

（注）「住信 新興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11月11日から翌年11月10日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1．期首元本額	941,731,409円	1,783,101,826円
期中追加設定元本額	1,202,362,010円	3,278,609,134円
期中一部解約元本額	360,991,593円	740,519,862円
期末元本額	1,783,101,826円	4,321,191,098円
元本額の内訳		
STAM 新興国債券インデックス・オープン	1,625,049,118円	2,223,520,702円
世界経済インデックスファンド	117,660,901円	215,342,922円
すみしん DC新興国債券インデックス・オープン	40,391,807円	768,833,624円
DC世界経済インデックスファンド	―	124,265円
新興国債券ファンド（米ドル売り円買い為替予約付）（適格機関投資家専用）	―	1,112,556,079円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	―	813,506円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,783,101,826口	4,321,191,098口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。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 ・カントリーリスク	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

II 金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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。	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 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。	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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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	△58,889,293	12,795,049
特殊債券	△2,089,029	599,832
合　計	△60,978,322	13,394,881

（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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）

1口当たり純資産額 ＝ 1.2703円	1口当たり純資産額 ＝ 1.2120円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	マレーシアリンギット	MGS 3.461% 07/31/13	700,000.00	707,413.00	
		MGS 3.58% 09/28/18	600,000.00	606,870.00	
		MGS 3.702% 02/25/13	1,200,000.00	1,212,888.00	
		MGS 3.741% 02/27/15	1,950,000.00	1,985,334.00	
		MGS 3.814% 02/15/17	1,350,000.00	1,384,668.00	
		MGS 3.835% 08/12/15	1,550,000.00	1,585,247.00	
		MGS 4.012% 09/15/17	2,100,000.00	2,174,991.00	
		MGS 4.16% 07/15/21	1,450,000.00	1,516,642.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	800,000.00	821,208.00	
		MGS 4.24% 02/07/18	700,000.00	734,034.00	
		MGS 4.262% 09/15/16	1,050,000.00	1,097,407.50	
		MGS 4.378% 11/29/19	1,950,000.00	2,076,769.50	
		MGS 4.392% 04/15/26	500,000.00	529,025.00	
		MGS 5.094% 04/30/14	3,910,000.00	4,094,903.90	
	小計		19,810,000.00	20,527,400.90 (511,132,282)	
	タイバーツ	THAIGB 2.8% 10/10/17	13,500,000.00	13,272,390.00	
		THAIGB 3.625% 05/22/15	11,500,000.00	11,720,455.00	
		THAIGB 3.65% 12/17/21	23,000,000.00	23,910,570.00	
		THAIGB 3.875% 06/13/19	12,500,000.00	13,062,250.00	
		THAIGB 4.125% 11/18/16	8,400,000.00	8,789,004.00	
		THAIGB 4.25% 03/13/13	13,400,000.00	13,586,796.00	
		THAIGB 4.75% 12/20/24	10,262,000.00	11,626,630.49	
		THAIGB 5.125% 03/13/18	16,700,000.00	18,521,135.00	
		THAIGB 5.25% 05/12/14	23,000,000.00	24,146,550.00	
		THAIGB 5.4% 07/27/16	16,500,000.00	18,088,686.00	
		THAIGB 5.85% 03/31/21	14,600,000.00	17,527,694.20	
		THAIGB 6.15% 07/07/26	2,000,000.00	2,591,160.00	
	小計		165,362,000.00	176,843,320.69 (431,497,702)	
	インドネシアルピア	INDOGB 10% 07/15/17	2,850,000,000.00	3,508,920,000.00	
		INDOGB 10% 09/15/24	2,850,000,000.00	3,808,113,000.00	

	INDOGB 10.25% 07/15/27	5,570,000,000.00	7,704,535,400.00	
	INDOGB 10.5% 07/15/38	3,200,000,000.00	4,553,472,000.00	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	3,740,000,000.00	5,278,336,800.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	3,750,000,000.00	5,371,687,500.00	
	INDOGB 11% 10/15/14	900,000,000.00	1,044,099,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	1,800,000,000.00	2,482,740,000.00	
	INDOGB 11.5% 09/15/19	2,500,000,000.00	3,441,800,000.00	
	INDOGB 12.5% 03/15/13	1,800,000,000.00	1,966,356,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	3,600,000,000.00	5,479,344,000.00	
	INDOGB 7.375% 09/15/16	1,000,000,000.00	1,103,200,000.00	
	INDOGB 9.0% 09/15/18	900,000,000.00	1,082,754,000.00	
	INDOGB 9.5% 05/15/41	3,600,000,000.00	4,715,100,000.00	
	INDOGB 9.5% 06/15/15	3,420,000,000.00	3,919,388,400.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/23	4,300,000,000.00	5,539,561,000.00	
小計		45,780,000,000.00	60,999,407,100.00 (530,694,841)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	7,500,000.00	9,604,650.00	
	MBONO 10% 12/05/24	7,000,000.00	9,276,820.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	5,200,000.00	5,347,940.00	
	MBONO 7% 06/19/14	1,100,000.00	1,153,812.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	5,000,000.00	5,447,450.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	6,700,000.00	7,144,009.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	2,300,000.00	2,432,871.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	850,000.00	954,346.00	
	MBONO 8% 06/11/20	4,600,000.00	5,249,152.00	
	MBONO 8% 12/17/15	7,400,000.00	8,158,574.00	
	MBONO 8% 12/19/13	14,100,000.00	14,935,707.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	3,000,000.00	3,342,060.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	8,000,000.00	9,399,520.00	
	MBONO 9% 12/20/12	300,000.00	311,793.00	
	MBONO 9.5% 12/18/14	7,000,000.00	7,865,620.00	
小計		80,050,000.00	90,624,324.00 (527,433,565)	
ブラジルレアル	BNTNF 10% 01/01/13	2,000,000.00	2,001,222.81	
	BNTNF 10% 01/01/14	5,600,000.00	5,552,659.88	
	BNTNF 10% 01/01/17	300,000.00	287,069.82	
	BNTNF 10% 01/01/21	800,000.00	735,859.52	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	750,000.00	842,640.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/16	1,550,000.00	1,817,421.50	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	250,000.00	314,062.50	

小計		11,250,000.00	11,550,936.03 (504,660,395)	
コロンビアペソ	COLOM 12% 10/22/15	2,510,000,000.00	3,193,096,500.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	1,420,000,000.00	1,697,681,000.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	100,000,000.00	142,950,000.00	
小計		4,030,000,000.00	5,033,727,500.00 (212,423,300)	
ハンガリーフォリント	HGB 5.5% 02/12/14	190,500,000.00	177,605,055.00	
	HGB 5.5% 02/12/16	143,000,000.00	125,380,970.00	
	HGB 6% 10/24/12	24,000,000.00	23,649,360.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	93,500,000.00	72,089,435.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	55,000,000.00	47,016,200.00	
	HGB 6.75% 02/12/13	95,000,000.00	93,193,100.00	
	HGB 6.75% 02/24/17	152,000,000.00	136,964,160.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	88,000,000.00	78,804,880.00	
	HGB 8% 02/12/15	84,000,000.00	81,233,880.00	
小計		925,000,000.00	835,937,040.00 (275,692,035)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 6.9% 08/12/37	750,000.00	773,610.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,200,000.00	1,371,924.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	1,150,000.00	1,370,696.50	
	PERUGB 9.91% 05/05/15	310,000.00	361,162.40	
小計		3,410,000.00	3,877,392.90 (111,126,080)	
ポーランドズロチ	POLGB 5% 04/25/16	2,600,000.00	2,595,788.00	
	POLGB 5% 10/24/13	2,660,000.00	2,674,098.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	1,700,000.00	1,713,736.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	2,200,000.00	2,198,526.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	900,000.00	878,382.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	2,050,000.00	2,085,772.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,700,000.00	2,700,135.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	3,150,000.00	3,215,142.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,700,000.00	2,716,011.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	1,860,000.00	1,940,910.00	
小計		22,520,000.00	22,718,500.50 (527,750,766)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	7,300,000.00	8,597,429.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	5,660,000.00	6,891,219.80	
	SAGB 6.25% 03/31/36	7,000,000.00	5,246,570.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	7,100,000.00	6,566,861.00	
	SAGB 7% 02/28/31	600,000.00	503,880.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,100,000.00	6,847,240.00	

		SAGB 7.5% 01/15/14	2,250,000.00	2,310,952.50	
		SAGB 8% 12/21/18	6,900,000.00	7,028,616.00	
		SAGB 8.25% 09/15/17	4,900,000.00	5,100,067.00	
		SAGB 8.75% 12/21/14	3,700,000.00	3,947,345.00	
	小計		52,510,000.00	53,040,180.30 (515,550,552)	
	ロシアルーブル	RUSSIA 7.85% 03/10/18	60,000,000.00	62,206,800.00	
	小計		60,000,000.00	62,206,800.00 (153,650,796)	
	トルコリラ	TURKGB 10% 01/09/13	1,000,000.00	997,000.00	
		TURKGB 10% 06/17/15	1,350,000.00	1,343,979.00	
		TURKGB 10.5% 01/15/20	1,500,000.00	1,585,515.00	
		TURKGB 11% 08/06/14	2,750,000.00	2,789,572.50	
		TURKGB 14% 09/26/12	900,000.00	920,214.00	
		TURKGB 8% 01/29/14	2,000,000.00	1,918,400.00	
		TURKGB 8% 10/09/13	2,500,000.00	2,408,275.00	
	小計		12,000,000.00	11,962,955.50 (505,315,240)	
国債証券計				(4,806,927,554)	
特殊債券	ブラジルレアル	IADB 9% 08/28/12	250,000.00	250,770.00	
	小計		250,000.00	250,770.00 (10,956,141)	
	ロシアルーブル	EIB 6% 01/28/14	13,000,000.00	12,770,160.00	
		EIB 6.5% 09/30/16	24,900,000.00	23,838,762.00	
		EIB 6.5% 12/15/15	25,000,000.00	24,228,500.00	
		EIB 6.75% 06/13/17	11,000,000.00	10,714,990.00	
		IBRD 6.25% 12/11/13	18,000,000.00	17,930,880.00	
		KFW 6% 02/14/12	20,000,000.00	19,996,200.00	
	小計		111,900,000.00	109,479,492.00 (270,414,345)	
	トルコリラ	KFW 16.5% 02/21/12	160,000.00	160,692.32	
	小計		160,000.00	160,692.32 (6,787,643)	
特殊債券計				(288,158,129)	
合計				(5,095,085,683)	

(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
マレーシアリンギット	国債証券　14銘柄	100.0%	10.0%

タイバーツ	国債証券	12銘柄	100.0%	8.5%
インドネシアルピア	国債証券	16銘柄	100.0%	10.3%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	10.4%
ブラジルレアル	国債証券	7銘柄	97.9%	
	特殊債券	1銘柄	2.1%	10.1%
コロンビアペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	4.2%
ハンガリーフォリント	国債証券	9銘柄	100.0%	5.4%
ペルーヌエボソル	国債証券	4銘柄	100.0%	2.2%
ポーランドズロチ	国債証券	10銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券	10銘柄	100.0%	10.1%
ロシアルーブル	国債証券	1銘柄	36.2%	
	特殊債券	6銘柄	63.8%	8.3%
トルコリラ	国債証券	7銘柄	98.7%	
	特殊債券	1銘柄	1.3%	10.1%

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 新興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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	165,382,180	470,540,209
コール・ローン	60,347,718	93,066,029
株式	7,482,279,528	11,160,939,389
投資信託受益証券	14,400,046	53,627,757
派生商品評価勘定	6,706,072	12,686,560
未収入金	21,120	―
未収配当金	10,836,043	11,885,802
未収利息	95	150
差入委託証拠金	506,358,510	34,994,504
流動資産合計	8,246,331,312	11,837,740,400
資産合計	8,246,331,312	11,837,740,400
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,191,573	46,213
未払金	―	459,009,243
未払解約金	804,436	3,128,070
流動負債合計	5,996,009	462,183,526
負債合計	5,996,009	462,183,526
純資産の部		
元本等		
元本	4,276,966,338	7,250,432,676
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,963,368,965	4,125,124,198
元本等合計	8,240,335,303	11,375,556,874
純資産合計	8,240,335,303	11,375,556,874
負債純資産合計	8,246,331,312	11,837,740,400

（注）「住信 新興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11月11日から翌年11月10日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成23年1月20日及び平成24年1月20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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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。	（1）株式 同左
	（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。	（2）投資信託受益証券 同左
	（3）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	（3）先物取引 同左
	（4）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。	（4）外国為替予約 同左
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。	同左
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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）

1．期首元本額	2,880,711,083円	4,276,966,338円
期中追加設定元本額	1,849,072,216円	3,947,410,862円
期中一部解約元本額	452,816,961円	973,944,524円
期末元本額	4,276,966,338円	7,250,432,676円
元本額の内訳		
STAM 新興国株式インデックス・オープン	3,598,749,639円	4,913,929,352円
世界経済インデックスファンド	85,721,265円	160,181,254円
すみしん DC新興国株式インデックス・オープン	78,601,955円	731,503,135円
DC世界経済インデックスファンド	―	102,243円
STAM 新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	30,774,367円	1,056,251,088円
住信 新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	483,119,112円	388,465,604円
2．計算期間末日における受益権の総数	4,276,966,338口	7,250,432,676口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	（自 平成22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 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 ・カントリーリスク	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

II 金融商品の時価に関する事項

項目	（平成23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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.株式、投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.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。 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。	a.株式、投資信託受益証券 同左 b.先物取引 同左

	c.外国為替予約 1.計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。 ①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。 ②計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち該当日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、該当日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。 2.計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。	c.外国為替予約 同左
	d.コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	d.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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20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	109,119,585	174,698,637
投資信託受益証券	△265,761	3,004,303
合　計	108,853,824	177,702,940

（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23年 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評 価 損 益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 MSCI EMERG	754,649,870	―	756,529,280	1,879,410
合　計		754,649,870	―	756,529,280	1,879,410

（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24年 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評 価 損 益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 MSCI EMERG M	158,433,983	―	170,488,650	12,054,667
合　計		158,433,983	―	170,488,650	12,054,667

（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 1月20日現在）			
		契 約 額 等（円）	うち1年超	時 価（円）	評価損益（円）

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	70,105,311	―	69,827,500	△277,811
	新台湾ドル	82,238,200	―	82,070,000	△168,200
	売建				
	アメリカドル	82,231,100	―	82,150,000	81,100
合　計		234,574,611	―	234,047,500	△364,911

（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24年 1月20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				
	アメリカドル	47,253,586	―	47,469,678	216,092
	マレーシアリンギット	14,864,400	―	14,940,000	75,600
	タイバーツ	2,633,008	―	2,636,959	3,951
	フィリピンペソ	7,022,356	―	7,050,164	27,808
	メキシコペソ	6,914,400	―	6,972,000	57,600
	ポーランドズロチ	7,500,900	―	7,662,600	161,700
	南アフリカランド	16,418,600	―	16,507,000	88,400
	売建				
	アメリカドル	9,655,364	―	9,700,642	△45,278
	ブラジルレアル	35,046	―	35,239	△193
合　計		112,297,660	―	112,974,282	585,680

（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22年 1月21日 至 平成23年 1月20日）	（自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20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23年 1月20日現在）	（平成24年 1月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.9267円	1口当たり純資産額 ＝ 1.5689円

(3)附属明細表（平成24年1月20日現在）

1)有価証券明細表

①株式

通貨	銘柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	15,791	58.21	919,194.11	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	8,254	38.30	316,128.20	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	51,541	3.27	168,539.07	
	CREDICORP LTD	2,490	110.60	275,394.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	8,183	49.93	408,577.19	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	58,726	3.39	199,081.14	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	222,442	11.88	2,642,610.96	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	34,800	4.98	173,582.40	
	LSR GROUP OJSC-GDR REGS	15,764	3.98	62,740.72	
	LUKOIL-SPON ADR	22,057	57.60	1,270,483.20	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	10,474	24.52	256,822.48	
	MECHEL-SPONSORED ADR	6,751	10.53	71,088.03	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	24,576	17.58	432,046.08	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	23,496	16.49	387,449.04	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	3,914	130.00	508,820.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3,296	23.80	78,444.80	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	5,600	37.00	207,200.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	71,200	7.40	526,880.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	20,629	11.04	227,744.16	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	78,069	11.00	858,759.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,625	14.00	148,750.00	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	4,587	18.26	83,758.62	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,353	35.72	226,929.16	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	41,972	8.83	370,612.76	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	11,984	33.40	400,265.60	
	TMK-GDR REG S	6,088	11.50	70,012.00	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	12,742	35.51	452,468.42	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	63,955	4.18	267,715.63	
小計		846,359		12,012,096.77 (926,613,144)	
香港ドル	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	44,000	8.79	386,760.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	762,000	3.78	2,880,360.00	

AIR CHINA LIMITED-H	92,000	6.12	563,040.00	
ALIBABA.COM LTD	43,500	8.64	375,840.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	180,000	4.02	723,600.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	48,000	6.63	318,240.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	50,000	26.35	1,317,500.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	31,000	8.50	263,500.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	96,000	3.53	338,880.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,757,200	3.30	9,098,760.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	298,475	6.00	1,790,850.00	
BBMG CORPORATION - H	57,000	6.10	347,700.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	60,000	3.89	233,400.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	18,000	43.95	791,100.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	198,000	12.40	2,455,200.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	86,000	2.40	206,400.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	90,000	8.00	720,000.00	
BYD CO LTD-H	18,500	22.20	410,700.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	1.10	74,800.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	71,000	6.26	444,460.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	84,000	5.87	493,080.00	
CHINA CITIC BANK-H	301,200	4.88	1,469,856.00	
CHINA COAL ENERGY CO - H	173,000	9.92	1,716,160.00	
CHINA COMMUICATIONS CONST-H	184,000	6.89	1,267,760.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES-H-RT	10,000	0.16	1,650.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	114,000	3.36	383,040.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,485,620	6.08	15,112,569.60	
CHINA COSCO HOLDONGS-H	73,500	4.39	322,665.00	
CHINA DONGXIANG GROUP CO	87,000	1.42	123,540.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	50,000	12.60	630,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	148,000	3.54	523,920.00	
CHINA INTL MARINE CONTAINE-B	18,200	9.38	170,716.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	309,000	21.70	6,705,300.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	85,000	5.86	498,100.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	53,000	20.75	1,099,750.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	161,289	17.60	2,838,686.40	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	41,513	25.05	1,039,900.65	
CHINA MINSHENG BANKING-H	147,000	7.34	1,078,980.00	
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	249,000	76.20	18,973,800.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	74,000	3.68	272,320.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	124,000	9.59	1,189,160.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	60,000	12.50	750,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	199,040	14.84	2,953,753.60	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	67,600	24.35	1,646,060.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	690,000	9.10	6,279,000.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	102,500	4.89	501,225.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	97,000	2.54	246,380.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	5.76	449,280.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	46,000	27.60	1,269,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	80,000	13.74	1,099,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	75,400	15.00	1,131,000.00	
CHINA RONGSHENG HEAVY INDUST	44,500	2.39	106,355.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	96,000	5.99	575,040.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	139,000	34.95	4,858,050.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	103,000	1.78	183,340.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	64,000	5.00	320,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	62,000	4.00	248,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	60,000	5.96	357,600.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	32,600	13.72	447,272.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	618,000	4.10	2,533,800.00	
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	246,000	14.50	3,567,000.00	
CHINA VANKE CO LTD-B	42,900	8.11	347,919.00	
CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	54,000	12.80	691,200.00	
CHINA ZHENGTONG AUTO SERVICE	32,000	7.97	255,040.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	28,000	2.97	83,160.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	90,000	4.73	425,700.00	
CITIC PACIFIC LIMITED -R	48,000	14.18	680,640.00	
CNOOC LTD-R	732,000	15.46	11,316,720.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	70,000	10.76	753,200.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	128,000	3.54	453,120.00	
CSG HOLDING CO LTD - B	50,500	5.90	297,950.00	
CSR CORP LTD-H	100,000	5.10	510,000.00	
DAH CHONG HONG	28,000	9.19	257,320.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	30,000	9.36	280,800.00	
DATANG INTL POWER GENERATION CO. LTD.-H	74,000	2.56	189,440.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	10,800	25.10	271,080.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	122,000	14.32	1,747,040.00	
DONGYUE GROUP	35,000	6.44	225,400.00	

ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	28,000	22.50	630,000.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	228,000	3.78	861,840.00	
FAR EAST HORIZON LTD	34,000	6.95	236,300.00	
FOSUN INTERNATIONAL	46,000	4.71	216,660.00	
FRANSHION PROPERTIES	150,000	1.65	247,500.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	279,000	2.69	750,510.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	155,000	2.07	320,850.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	24,000	17.40	417,600.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	411,000	2.03	834,330.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	51,250	13.90	712,375.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	70,000	4.50	315,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	102,246	7.73	790,361.58	
GUANGZHOU INVESTMENT-R	186,000	1.24	230,640.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	45,600	7.15	326,040.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	28,000	8.31	232,680.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	37,500	71.35	2,675,625.00	
HENGDELI HOLDINGS LTD	108,000	2.99	322,920.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	84,000	4.76	399,840.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	104,000	4.57	475,280.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	2,511,515	5.43	13,637,526.45	
INTIME DEPARTMENT STORE	37,000	9.30	344,100.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	48,000	7.57	363,360.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	50,000	19.46	973,000.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	24,000	24.25	582,000.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	104,000	12.36	1,285,440.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	42,000	2.97	124,740.00	
LENOVO GROUP LTD	286,000	6.33	1,810,380.00	
LONGFOR PROPERTIES	46,000	9.90	455,400.00	
LONKING HOLDINGS LTD	50,000	2.92	146,000.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	39,000	1.76	68,640.00	
MINMETALS RESOURCES LTD	88,000	3.57	314,160.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	48,000	5.35	256,800.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	83,500	10.12	845,020.00	
PETROCHINA CO LTD-H	858,000	11.32	9,712,560.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	101,200	10.16	1,028,192.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	74,000	59.60	4,410,400.00	
POLY HONG KONG INVESTMENT LT	75,000	3.78	283,500.00	
RENHE COMMERCIAL HOLDINGS	628,000	0.94	590,320.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	54,000	7.09	382,860.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	534,000	0.39	208,260.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	6.89	496,080.00	

	SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	94,000	4.18	392,920.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	23,000	24.35	560,050.00	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,700	13.28	221,776.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	54,000	7.88	425,520.00	
	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LIMITED	94,000	2.91	273,540.00	
	SHUI ON LAND LTD	156,959	2.74	430,067.66	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	100,000	2.89	289,000.00	
	SINOFERT HOLDINGS LTD	62,000	2.23	138,260.00	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS-R	154,926	3.85	596,465.10	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	66,000	2.83	186,780.00	
	SINOPHARM GROUP CO-H	43,200	18.14	783,648.00	
	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	69,070	3.41	235,528.70	
	SOHO CHINA LTD	90,500	5.79	523,995.00	
	SUN ART RETAIL GROUP LTD	79,000	9.96	786,840.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	41,200	179.50	7,395,400.00	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	92,000	23.60	2,171,200.00	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	12,000	42.45	509,400.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	240,000	7.75	1,860,000.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	14,000	38.55	539,700.00	
	WUMART STORES INC-H	15,000	17.52	262,800.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	76,000	18.76	1,425,760.00	
	YINGDE GASES GROUP COMPANY	29,500	8.27	243,965.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	49,000	12.84	629,160.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	5.22	302,760.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	21,000	15.16	318,360.00	
	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	21,000	17.54	368,340.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	273,000	3.40	928,200.00	
	ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	44,980	10.88	489,382.40	
	ZTE CORP-H	29,424	22.05	648,799.20	
小計		24,821,107		201,212,435.34 (2,000,051,607)	
マレーシアリンギット	AIRASIA BHD	91,700	3.63	332,871.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	36,900	3.87	142,803.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	90,500	5.80	524,900.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	92,975	4.84	449,999.00	
	BERJAYA CORP BHD	74,000	0.92	68,450.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	67,442	4.43	298,768.06	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	3,700	49.80	184,260.00	
	BUMI ARMADA BERHAD	21,300	4.14	88,182.00	

	BURSA MALAYSIA BHD	57,600	6.90	397,440.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	186,700	7.11	1,327,437.00	
	DIGI.COM BERHAD	104,600	3.88	405,848.00	
	GAMUDA BHD	60,000	3.63	217,800.00	
	GENTING BHD	76,500	10.82	827,730.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	110,000	3.87	425,700.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.15	128,100.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,280	11.00	179,080.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,100	11.70	106,470.00	
	IJM CORP BHD	44,500	5.47	243,415.00	
	IOI CORPORATION BHD	138,940	5.39	748,886.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	19,300	24.78	478,254.00	
	LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	12,800	6.73	86,144.00	
	MALAYAN BANKING BHD	117,496	8.20	963,467.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	29,600	5.75	170,200.00	
	MALAYSIA MARINE AND HEAVY EN	26,400	5.35	141,240.00	
	MAXIS BHD	59,300	5.63	333,859.00	
	MISC BHD	34,740	5.88	204,271.20	
	MMC CORP BHD	53,800	2.77	149,026.00	
	PARKSON HOLDINGS BHD	50,285	5.70	286,624.50	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	109,200	6.68	729,456.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	9,300	17.50	162,750.00	
	PETRONAS GAS BHD	25,100	15.30	384,030.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,400	17.00	346,800.00	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	31,900	13.22	421,718.00	
	RHB CAPITAL BHD	7,111	7.30	51,910.30	
	SIME DARBY BERHAD	97,300	9.10	885,430.00	
	SP SETIA BHD	107,900	3.88	418,652.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	66,300	4.82	319,566.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	96,075	6.10	586,057.50	
	UEM LAND HOLDINGS BHD	68,900	2.28	157,092.00	
	UMW HOLDINGS BHD	34,600	6.90	238,740.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	138,410	1.51	208,999.10	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	116,500	1.86	216,690.00	
小計		2,629,454		15,039,116.46 (374,473,999)	
タイバーツ	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	42,200	153.00	6,456,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	44,700	161.00	7,196,700.00	
	BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	67,200	20.80	1,397,760.00	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	9,750	568.00	5,538,000.00	

	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	42.25	2,370,225.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	137,900	35.00	4,826,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	91,800	55.75	5,117,850.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	18,600	54.50	1,013,700.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	34,900	31.00	1,081,900.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	4.48	2,566,144.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	58,600	122.50	7,178,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	99,200	14.90	1,478,080.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	52,700	176.50	9,301,550.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	59,534	63.50	3,780,409.00	
	PTT PCL-NVDR	39,700	333.00	13,220,100.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	11,000	375.00	4,125,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	60,500	119.50	7,229,750.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	36,600	61.25	2,241,750.00	
小計		1,493,784		86,120,518.00 (210,134,063)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	49,200	41.40	2,036,880.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	30.00	2,685,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	179,600	11.40	2,047,440.00	
	AYALA CORPORATION	9,900	345.20	3,417,480.00	
	AYALA LAND INC	239,000	17.50	4,182,500.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	47,476	59.20	2,810,579.20	
	BDO UNIBANK INC	30,200	59.00	1,781,800.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	271,000	6.18	1,674,780.00	
	GLOBE TELECOM INC	640	1,249.00	799,360.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	21,630	56.00	1,211,280.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	89.50	2,277,775.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	11,400	274.60	3,130,440.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	40,245	76.50	3,078,742.50	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	1,730	2,850.00	4,930,500.00	
	SAN MIGUEL CORP	12,570	117.30	1,474,461.00	
	SM INVESTMENTS CORP	5,600	624.00	3,494,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	247,800	15.20	3,766,560.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	23,630	51.90	1,226,397.00	
小計		1,306,571		46,026,374.70 (81,926,946)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	561,500	1,830.00	1,027,545,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	230,500	1,730.00	398,765,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	22,000.00	440,000,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	84,500	78,800.00	6,658,600,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	433,500	8,000.00	3,468,000,000.00	

	BANK DANAMON INDONESIA TBK	93,000	4,700.00	437,100,000.00	
	BANK MANDIRI	418,698	7,100.00	2,972,755,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	299,500	3,700.00	1,108,150,000.00	
	BUMI RESOURCES TBK PT	601,500	2,575.00	1,548,862,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	328,000	2,475.00	811,800,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	22,500	58,100.00	1,307,250,000.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	17,000	38,950.00	662,150,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	66,000	18,800.00	1,240,800,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	175,500	4,850.00	851,175,000.00	
	INDOSAT TBK PT	126,000	5,600.00	705,600,000.00	
	INTERNATIONAL NICKEL INDONES	99,000	3,575.00	353,925,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	198,000	3,525.00	697,950,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	419,500	3,350.00	1,405,325,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	487,000	7,150.00	3,482,050,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	180,000	12,450.00	2,241,000,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	37,500	19,750.00	740,625,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	381,000	6,900.00	2,628,900,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	66,500	20,250.00	1,346,625,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	65,000	28,250.00	1,836,250,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	84,500	5,000.00	422,500,000.00	
小計		5,495,698		38,793,703,300.00 (337,505,218)	
メキシコペソ	ALFA S.A.B.-A	17,200	168.61	2,900,092.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,647,340	15.69	25,846,764.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	13,275	60.23	799,553.25	
	CEMEX SAB-SPONS	420,580	8.50	3,574,930.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	20,100	129.48	2,602,548.00	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	59,900	16.29	975,771.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,200	99.00	415,800.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	76,840	92.15	7,080,806.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	36,880	48.10	1,773,928.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	55,500	29.83	1,655,565.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	21,800	34.97	762,346.00	
	GRUPO ELEKTRA SA	2,765	1,223.82	3,383,862.30	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	61,100	51.38	3,139,318.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	81,600	26.82	2,188,512.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	153,192	40.05	6,135,339.60	
	GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	27,800	84.40	2,346,320.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	102,790	56.94	5,852,862.60	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,425	619.11	3,358,671.75	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	25,300	75.71	1,915,463.00	

	MEXICHEM SAB DE CV-*	31,300	45.04	1,409,752.00	
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	24,000	54.95	1,318,800.00	
	URBI DESARROLLOS URBANOS SAB	27,400	19.02	521,148.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	250,880	38.66	9,699,020.80	
小計		3,167,167		89,657,173.90 (521,804,752)	
ブラジルレアル	AES TIETE SA-PREF	6,100	25.32	154,452.00	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	17,700	10.10	178,770.00	
	AMIL PARTICIPACOES SA	3,000	17.67	53,010.00	
	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	4,300	23.81	102,383.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	78,100	32.15	2,510,915.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	23,600	25.80	608,880.00	
	BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	7,700	19.79	152,383.00	
	BM&FBOVESPA SA	80,100	10.35	829,035.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	12,500	19.02	237,750.00	
	BRADESPAR SA -PREF	7,400	33.55	248,270.00	
	BRASIL TELECOM SA-PREFERENCE	42,048	10.90	458,323.20	
	BRASKEM SA-PREF A	3,900	14.35	55,965.00	
	BRF - BRASIL FOODS SA	25,800	35.23	908,934.00	
	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	8,900	5.83	51,887.00	
	CCR SA	36,100	11.50	415,150.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	17.59	286,717.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	25.56	145,692.00	
	CETIP SA-BALCAO ORGANIZADO	6,700	26.80	179,560.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	4,200	71.00	298,200.00	
	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	30,500	65.60	2,000,800.00	
	CIA DE TRANSMISSAO DE ENE-PF	2,600	55.84	145,184.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	6,800	32.88	223,584.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	16,100	33.80	544,180.00	
	CIA HERING	3,800	40.20	152,760.00	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	37.55	206,525.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	4,900	53.90	264,110.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	28,400	17.35	492,740.00	
	CIELO SA	9,600	51.40	493,440.00	
	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	4,400	27.50	121,000.00	
	CPFL ENERGIA SA	38,868	25.12	976,364.16	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	9,300	15.61	145,173.00	
	DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	7,800	16.32	127,296.00	
	DURATEX SA	5,500	9.65	53,075.00	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,900	12.29	97,091.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	4,300	39.63	170,409.00	

ELETROPAULO METROPOLI-PREF	4,200	35.90	150,780.00	
EMBRAER SA	18,800	12.20	229,360.00	
FIBRIA CELULOSE SA	6,000	15.03	90,180.00	
GERDAU SA-PREF	33,800	16.55	559,390.00	
HRT PARTICIPACOES EM PETROLE	200	457.00	91,400.00	
HYPERMARCAS SA	9,400	11.31	106,314.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	92,900	36.95	3,432,655.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	90,800	12.05	1,094,140.00	
JBS SA	28,000	5.95	166,600.00	
KLABIN SA-PREF	12,900	7.89	101,781.00	
LIGHT SA	1,700	29.43	50,031.00	
LOCALIZA RENT A CAR	3,900	28.02	109,278.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	10,300	15.80	162,740.00	
LOJAS RENNER S.A.	4,400	57.15	251,460.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	9,600	20.80	199,680.00	
MMX MINERACAO E METALICOS SA	7,100	7.40	52,540.00	
MRV ENGENHARIA	9,500	13.64	129,580.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	1,400	36.50	51,100.00	
NATURA COSMETICOS SA	7,300	39.00	284,700.00	
ODONTOPREV S.A.	2,300	28.79	66,217.00	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	50,964	15.54	791,980.56	
PDG REALTY SA	45,700	6.93	316,701.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	123,000	26.39	3,245,970.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	171,640	24.21	4,155,404.40	
PORTO SEGURO SA	5,900	21.12	124,608.00	
RAIA DROGASIL SA	6,000	13.50	81,000.00	
REDECARD SA	13,000	31.50	409,500.00	
ROSSI RESIDENCIAL SA	5,800	9.30	53,940.00	
SOUZA CRUZ SA	16,100	22.31	359,191.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	7,000	7.28	50,960.00	
TAM SA-PREF	3,500	37.71	131,985.00	
TELE NORTE LESTE PART	2,300	21.16	48,668.00	
TELE NORTE LESTE PART-PREF	8,400	16.98	142,632.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	12,200	52.20	636,840.00	
TELEMAR NORTE LESTE SA-PR A	1,000	49.48	49,480.00	
TIM PARTICIPACOES SA	33,200	9.83	326,356.00	
TOTVS SA	4,200	31.48	132,216.00	
TRACTEBEL ENERGIA SA	7,200	30.94	222,768.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	12,500	35.60	445,000.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	42,979	11.03	474,058.37	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	5,600	17.26	96,656.00	

	VALE SA	56,800	42.98	2,441,264.00	
	VALE SA-PREF A	77,915	41.05	3,198,410.75	
小計		1,643,814		39,405,522.44 (1,721,627,275)	
チリペソ	AES GENER SA	98,627	285.58	28,165,898.66	
	BANCO DE CHILE	705,044	73.17	51,588,069.48	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,045	31,097.00	32,496,365.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,295,915	39.71	91,170,784.65	
	CAP SA	3,824	20,901.00	79,925,424.00	
	CENCOSUD SA	34,857	2,945.70	102,678,264.90	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,648	6,242.80	22,773,734.40	
	COLBUN SA	303,690	129.37	39,288,375.30	
	CORPBANCA	10,147,500	7.06	71,702,235.00	
	E.CL SA	22,096	1,410.00	31,155,360.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	147,172	742.62	109,292,870.64	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	9,550.80	58,202,575.20	
	EMPRESAS CMPC SA	39,495	1,980.40	78,215,898.00	
	EMPRESAS COPEC SA	17,535	7,158.60	125,526,051.00	
	ENERSIS SA	545,192	177.78	96,924,233.76	
	LAN AIRLINES SA	6,277	12,348.00	77,508,396.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	14,640	4,211.90	61,662,216.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,591	28,056.00	100,749,096.00	
	VINA CONCHA Y TORO SA	17,318	1,056.50	18,296,467.00	
小計		14,413,560		1,277,322,314.99 (200,922,800)	
韓国ウォン	AMOREPACIFIC CORP	143	1,018,000.00	145,574,000.00	
	BS FINANCIAL GROUP INC	7,870	12,600.00	99,162,000.00	
	CELLTRION INC	3,558	36,900.00	131,290,200.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	1,914	100,500.00	192,357,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	299	296,000.00	88,504,000.00	
	CJ CORP	430	76,300.00	32,809,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,082	102,000.00	110,364,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,210	11,450.00	48,204,500.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,492	29,400.00	43,864,800.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	7,448	12,300.00	91,610,400.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,110	26,950.00	110,764,500.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	5,430	14,200.00	77,106,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	2,860	48,950.00	139,997,000.00	
	DONGKUK STEEL MILL CO LTD	1,550	22,750.00	35,262,500.00	
	DOOSAN CORP	304	150,000.00	45,600,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,675	67,700.00	113,397,500.00	

DOOSAN INFRACORE CO LTD	4,280	19,100.00	81,748,000.00	
EMART	864	272,500.00	235,440,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,360	99,200.00	134,912,000.00	
GS HOLDINGS CORP	2,904	57,600.00	167,270,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	9,750	36,800.00	358,800,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	3,270	47,800.00	156,306,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	3,756	27,800.00	104,416,800.00	
HANWHA CORPORATION	1,835	35,500.00	65,142,500.00	
HONAM PETROCHEMICAL CORP	617	344,000.00	212,248,000.00	
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	22,100	26,300.00	581,230,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	780	58,800.00	45,864,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	573	169,000.00	96,837,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,530	20,400.00	31,212,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,807	70,800.00	198,735,600.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	594	202,500.00	120,285,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,777	303,500.00	539,319,500.00	
HYUNDAI HYSCO	1,460	40,100.00	58,546,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,000	32,200.00	64,400,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	2,070	28,050.00	58,063,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	430	121,500.00	52,245,000.00	
HYUNDAI MOBIS	2,765	308,000.00	851,620,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	6,400	227,500.00	1,456,000,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,110	67,800.00	75,258,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	830	67,100.00	55,693,000.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	4,190	9,680.00	40,559,200.00	
HYUNDAI STEEL CO	2,034	106,500.00	216,621,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	496	131,000.00	64,976,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,470	12,350.00	55,204,500.00	
KANGWON LAND INC	3,780	25,900.00	97,902,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	14,898	40,150.00	598,154,700.00	
KCC CORP	137	323,000.00	44,251,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	10,001	67,500.00	675,067,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,510	33,000.00	49,830,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	10,230	26,700.00	273,141,000.00	
KOREA EXCHANGE BANK	10,120	7,730.00	78,227,600.00	
KOREA GAS CORPORATION	273	42,750.00	11,670,750.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,840	39,750.00	73,140,000.00	
KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	310	155,000.00	48,050,000.00	
KOREA LIFE INSURANCE	7,630	7,620.00	58,140,600.00	
KOREA ZINC CO LTD	384	360,000.00	138,240,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,256	47,100.00	59,157,600.00	

KP CHEMICAL CORP	2,570	15,700.00	40,349,000.00	
KT CORP	2,340	33,750.00	78,975,000.00	
KT&G CORP	4,215	72,100.00	303,901,500.00	
LG CHEM LTD	1,946	378,500.00	736,561,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	163	117,000.00	19,071,000.00	
LG CORP	3,923	67,300.00	264,017,900.00	
LG DISPLAY CO LTD	9,820	27,350.00	268,577,000.00	
LG ELECTRONICS INC	4,386	72,800.00	319,300,800.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	384	504,000.00	193,536,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	392	77,100.00	30,223,200.00	
LG UPLUS CORP	14,670	6,560.00	96,235,200.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	22	1,641,000.00	36,102,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	390	371,000.00	144,690,000.00	
LS CORP	669	85,500.00	57,199,500.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	617	65,700.00	40,536,900.00	
MANDO CORP	560	185,500.00	103,880,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,508	34,800.00	52,478,400.00	
NCSOFT CORPORATION	583	282,000.00	164,406,000.00	
NHN CORP	1,598	229,500.00	366,741,000.00	
OCI COMPANY LTD	620	257,000.00	159,340,000.00	
ORION CORP	119	606,000.00	72,114,000.00	
POSCO	2,674	407,000.00	1,088,318,000.00	
S1 CORPORATION	643	58,400.00	37,551,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	5,615	68,900.00	386,873,500.00	
SAMSUNG CARD CO	1,896	40,850.00	77,451,600.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,517	86,400.00	217,468,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,558	1,072,000.00	4,886,176,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	833	669,000.00	557,277,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,404	219,000.00	307,476,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,357	206,000.00	279,542,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,590	34,600.00	228,014,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	2,080	81,800.00	170,144,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,484	135,500.00	201,082,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,526	55,600.00	140,445,600.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	1,667	54,400.00	90,684,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	17,175	42,950.00	737,666,250.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	261,000.00	108,837,000.00	
SK C&C CO LTD	505	131,500.00	66,407,500.00	
SK HOLDINGS CO LTD	957	134,000.00	128,238,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	2,706	157,000.00	424,842,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,700	10,900.00	51,230,000.00	

	SK TELECOM	945	137,500.00	129,937,500.00	
	S-OIL CORPORATION	1,891	115,500.00	218,410,500.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	5,380	6,570.00	35,346,600.00	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	2,430	38,250.00	92,947,500.00	
	WOORI FINANCE HOLDINGS CO	12,970	10,450.00	135,536,500.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIE	4,852	12,600.00	61,135,200.00	
	YUHAN CORPORATION	366	133,000.00	48,678,000.00	
小計		336,429		24,345,745,600.00 (1,662,814,424)	
新台湾ドル	ACER INC	107,375	37.85	4,064,143.75	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	167,779	28.00	4,697,812.00	
	ADVANTECH CO LTD	6,600	85.80	566,280.00	
	ASIA CEMENT CORP	92,535	35.10	3,247,978.50	
	ASUSTEK COMPUTER INC	27,092	230.00	6,231,160.00	
	AU OPTRONICS CORP	312,090	14.80	4,618,932.00	
	CAPITAL SECURITIES CORP	139,948	11.20	1,567,417.60	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	30,700	167.50	5,142,250.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	270,737	32.15	8,704,194.55	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	220,270	15.90	3,502,293.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	77,850	67.90	5,286,015.00	
	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	17,169	64.00	1,098,816.00	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	26,867	51.20	1,375,590.40	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	191,650	13.00	2,491,450.00	
	CHINA AIRLINES LTD	53,000	13.75	728,750.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	320,231	8.12	2,600,275.72	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	73,447	24.65	1,810,468.55	
	CHINA MOTOR CORP	51,000	29.35	1,496,850.00	
	CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	70,400	32.10	2,259,840.00	
	CHINA STEEL	458,917	28.95	13,285,647.15	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	362,528	17.75	6,434,872.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	153,315	95.90	14,702,908.50	
	CLEVO COMPANY	21,008	48.50	1,018,888.00	
	COMPAL ELECTRONICS	155,760	32.00	4,984,320.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	77,520	79.90	6,193,848.00	
	E INK HOLDINGS INC	36,000	38.55	1,387,800.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	92,461	12.70	1,174,254.70	
	EPISTAR CORP	45,000	67.60	3,042,000.00	
	ETERNAL CHEMICAL CO LTD	27,562	23.95	660,109.90	
	EVA AIRWAYS CORP	44,000	19.45	855,800.00	
	EVERGREEN MARINE	49,499	16.30	806,833.70	

EVERLIGHT ELECTRONICS CO LTD	26,680	53.60	1,430,048.00	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	46,334	38.40	1,779,225.60	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	123,050	36.50	4,491,325.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	55.30	4,479,300.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	52.00	520,000.00	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	25,000	48.10	1,202,500.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	196,067	17.15	3,362,549.05	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	113,050	82.00	9,270,100.00	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,420	413.50	1,000,670.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	39,240	91.00	3,570,840.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	162,870	84.70	13,795,089.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	27.25	1,090,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	29,501	101.50	2,994,351.50	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	187,665	30.95	5,808,231.75	
GIANT MANUFACTURING	11,464	119.50	1,369,948.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	27,000	46.45	1,254,150.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	7,210	239.50	1,726,795.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	369,680	87.70	32,420,936.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	151.50	1,060,500.00	
HTC CORPORATION	30,430	488.50	14,865,055.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	147,691	16.20	2,392,594.20	
INOTERA MEMORIES INC	40,634	5.33	216,579.22	
INVENTEC CO LTD	54,600	11.75	641,550.00	
KGI SECURITIES CO LTD	143,791	11.20	1,610,459.20	
KINSUS INTERCONNECT TECH	12,000	84.00	1,008,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	589.00	2,968,560.00	
LCY CHEMICAL CORP	20,763	45.90	953,021.70	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	77,546	36.40	2,822,674.40	
MACRONIX INTERNATIONAL	118,547	12.20	1,446,273.40	
MEDIATEK INC	42,064	263.00	11,062,832.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	303,100	19.00	5,758,900.00	
MOTECH INDUSTRIES INC	8,129	60.30	490,178.70	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	16,008	175.00	2,801,400.00	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	35,069	46.75	1,639,475.75	
NAN YA PLASTICS CORP	194,250	63.10	12,257,175.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	8,240	68.90	567,736.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	26,045	86.00	2,239,870.00	
PEGATRON CORP	71,474	35.55	2,540,900.70	
PHISON ELECTRONICS CORP	9,599	207.50	1,991,792.50	
POU CHEN	81,780	26.00	2,126,280.00	

POWERTECH TECHNOLOGY INC	22,770	67.50	1,536,975.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,544	162.00	3,490,128.00	
QUANTA COMPUTER INC	94,270	65.30	6,155,831.00	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	13,000	103.00	1,339,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	23,473	52.00	1,220,596.00	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	9,410	159.00	1,496,190.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	84,993	35.80	3,042,749.40	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	21,777	53.80	1,171,602.60	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	324,826	8.53	2,770,765.78	
SILICONWARE PRECISION INDS	131,000	30.65	4,015,150.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	8,140	196.00	1,595,440.00	
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	14,700	54.90	807,030.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	134,547	8.72	1,173,249.84	
STANDARD FOODS CORP	9,000	92.90	836,100.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	54,381	75.60	4,111,203.60	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	166,032	10.15	1,685,224.80	
TAIWAN BUSINESS BANK	55,426	8.97	497,171.22	
TAIWAN CEMENT	140,929	36.25	5,108,676.25	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	93,386	17.90	1,671,609.40	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	72.40	2,461,600.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	29,174	32.10	936,485.40	
TAIWAN MOBILE CO LTD	76,200	91.70	6,987,540.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,009,389	76.70	77,420,136.30	
TATUNG CO LTD	24,436	8.06	196,954.16	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	83,000	18.80	1,560,400.00	
TPK HOLDING CO LTD	4,150	385.50	1,599,825.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	77.00	727,265.00	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	19,100	84.30	1,610,130.00	
TSRC CORP	25,300	74.10	1,874,730.00	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	40,000	26.85	1,074,000.00	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	52,000	44.65	2,321,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	59,000	37.05	2,185,950.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	136,220	45.60	6,211,632.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	473,000	14.25	6,740,250.00	
WALSIN LIHWA CORP	88,000	9.30	818,400.00	
WAN HAI LINES LIMITED	28,350	15.10	428,085.00	
WINTEK CORP	57,196	22.35	1,278,330.60	
WISTRON CORP	94,449	42.00	3,966,858.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	52,187	37.65	1,964,840.55	
YANG MING MARINE TRANSPORT	42,900	12.25	525,525.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	377,944	15.65	5,914,823.60	

	YULON MOTOR COMPANY	56,000	54.70	3,063,200.00	
小計		11,027,385		456,659,119.19 (1,178,180,527)	
インドルピー	ACC LTD	1,680	1,151.35	1,934,268.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	440.50	3,324,453.50	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	11,935	149.40	1,783,089.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	22,832	160.70	3,669,102.40	
	ASIAN PAINTS LTD	1,215	2,732.90	3,320,473.50	
	AXIS BANK LTD	9,000	955.05	8,595,450.00	
	BAJAJ AUTO LTD	3,464	1,467.75	5,084,286.00	
	BANK OF INDIA	14,616	306.30	4,476,880.80	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	24,106	265.25	6,394,116.50	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,830	542.20	1,534,426.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	24,656	340.75	8,401,532.00	
	CANARA BANK	9,842	421.25	4,145,942.50	
	CIPLA LTD	9,987	332.00	3,315,684.00	
	COAL INDIA LTD	21,324	349.90	7,461,267.60	
	DABUR INDIA LTD	19,484	96.60	1,882,154.40	
	DLF LTD	24,294	210.35	5,110,242.90	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	3,343	1,700.30	5,684,102.90	
	GAIL INDIA LTD	16,026	368.90	5,911,991.40	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,523	418.95	1,475,960.85	
	HDFC BANK LTD	61,662	486.80	30,017,061.60	
	HERO MOTOCORP LTD	1,267	1,905.10	2,413,761.70	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	49,471	145.80	7,212,871.80	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	34,952	391.40	13,680,212.80	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	48,057	693.70	33,337,140.90	
	ICICI BANK LTD	16,541	797.20	13,186,485.20	
	IDEA CELLULAR LTD	29,763	84.75	2,522,414.25	
	INFOSYS LTD	17,709	2,594.70	45,949,542.30	
	INFRASTRUCTURE DEV FINANCE	65,183	121.55	7,922,993.65	
	ITC LTD	91,807	209.20	19,206,024.40	
	JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	66,208	66.25	4,386,280.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	14,550	518.00	7,536,900.00	
	JSW STEEL LTD	3,763	668.45	2,515,377.35	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,709	474.30	6,502,178.70	
	LARSEN & TOUBRO LTD	7,998	1,277.15	10,214,645.70	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	19,565	236.95	4,635,926.75	
	LUPIN LTD	6,867	443.15	3,043,111.05	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11,626	672.95	7,823,716.70	

	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,820	1,129.95	3,186,459.00	
	NTPC LTD	25,870	171.45	4,435,411.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,171	271.80	7,385,077.80	
	POWER FINANCE CORPORATION	9,522	163.15	1,553,514.30	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	40,955	99.95	4,093,452.25	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	3,356	464.40	1,558,526.40	
	RELIANCE CAPITAL LTD	4,769	329.90	1,573,293.10	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	32,379	91.55	2,964,297.45	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	52,536	785.65	41,274,908.40	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	485.60	3,604,608.80	
	RELIANCE POWER LTD	26,910	93.65	2,520,121.50	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	26,348	182.10	4,797,970.80	
	SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	46,405	72.05	3,343,480.25	
	SESA GOA LTD	9,832	189.45	1,862,672.40	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,385	547.80	4,045,503.00	
	SIEMENS INDIA LTD	1,983	744.80	1,476,938.40	
	STATE BANK OF INDIA	4,838	1,884.30	9,116,243.40	
	STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	59,174	115.10	6,810,927.40	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,432	527.15	5,499,228.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	19,150	1,075.55	20,596,782.50	
	TATA MOTORS LTD	57,577	218.45	12,577,695.65	
	TATA POWER CO LTD	35,842	103.90	3,723,983.80	
	TATA STEEL LTD	8,768	435.85	3,821,532.80	
	TITAN INDUSTRIES LTD	7,394	182.40	1,348,665.60	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,779	1,199.75	2,134,355.25	
	UNITECH LTD	136,456	26.85	3,663,843.60	
	UNITED SPIRITS LTD	4,068	636.50	2,589,282.00	
	WIPRO LTD	20,503	404.15	8,286,287.45	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	15,699	118.30	1,857,191.70	
小計		1,499,746		477,314,324.40 (739,837,202)	
チェココルナ	CEZ AS	7,250	760.00	5,510,000.00	
	KOMERCNI BANKA AS	754	3,395.00	2,559,830.00	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	6,181	375.00	2,317,875.00	
小計		14,185		10,387,705.00 (41,135,311)	
ハンガリーフォリント	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	28,589	546.00	15,609,594.00	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	1,773	18,750.00	33,243,750.00	
	OTP BANK NYRT	9,388	3,749.00	35,195,612.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	669	36,550.00	24,451,950.00	

小計		40,419		108,500,906.00 (35,783,598)	
ポーランドズロチ	ASSECO POLAND SA	2,746	45.77	125,684.42	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	648	71.35	46,234.80	
	BANK PEKAO SA	5,294	150.00	794,100.00	
	BRE BANK SA	387	263.00	101,781.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	13.10	155,628.00	
	ENEA SA	4,648	18.22	84,686.56	
	GETIN HOLDING SA	6,150	6.81	41,881.50	
	GLOBE TRADE CENTRE SA	7,177	8.84	63,444.68	
	GRUPA LOTOS SA	2,227	24.14	53,759.78	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,157	97.55	112,865.35	
	KERNEL HOLDING SA	1,571	66.85	105,021.35	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	6,346	129.90	824,345.40	
	PKO BANK POLSKI SA	27,258	33.39	910,144.62	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	23,970	20.40	488,988.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	12,456	36.95	460,249.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	64,202	3.91	251,029.82	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,324	321.00	746,004.00	
	SYNTHOS SA	33,750	5.05	170,437.50	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	40,920	5.37	219,740.40	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	29,805	17.65	526,058.25	
	TVN SA	6,537	10.05	65,696.85	
小計		291,453		6,347,781.48 (147,458,963)	
南アフリカランド	ABSA GROUP LTD	7,201	150.50	1,083,750.50	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	40,167	36.69	1,473,727.23	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,416	182.95	442,007.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	2,583	549.99	1,420,624.17	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	17,038	350.99	5,980,167.62	
	ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	5,202	67.00	348,534.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	14,088	100.70	1,418,661.60	
	AVENG LTD	13,701	34.58	473,780.58	
	BARLOWORLD LTD	13,028	80.14	1,044,063.92	
	BIDVEST GROUP LTD	13,943	166.50	2,321,509.50	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	13,066	45.40	593,196.40	
	EXXARO RESOURCES LTD	3,564	186.94	666,254.16	
	FIRSTRAND LTD	109,874	22.69	2,493,041.06	
	GOLD FIELDS LTD	29,339	126.15	3,701,114.85	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	16,719	93.50	1,563,226.50	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	19,828	171.92	3,408,829.76	

	IMPERIAL HOLDINGS LTD	8,743	132.95	1,162,381.85	
	INVESTEC LTD	15,904	47.25	751,464.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,736	528.00	1,444,608.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	3,255	84.95	276,512.25	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	59,443	21.50	1,278,024.50	
	MASSMART HOLDINGS LTD	4,149	185.00	767,565.00	
	MMI HOLDINGS LTD	35,304	18.00	635,472.00	
	MTN GROUP LTD	68,553	135.40	9,282,076.20	
	NASPERS LTD-N SHS	15,935	379.95	6,054,503.25	
	NEDBANK GROUP LTD	5,798	154.75	897,240.50	
	NETCARE LTD	36,951	13.13	485,166.63	
	NORTHAM PLATINUM LTD	13,846	30.96	428,672.16	
	PICK N PAY STORES LTD	10,581	47.40	501,539.40	
	PRETORIA PORTLAND CEMENT CO	30,677	28.00	858,956.00	
	REMGRO LTD	17,391	123.67	2,150,744.97	
	REUNERT LTD	6,863	65.00	446,095.00	
	RMB HOLDINGS LTD	25,420	29.70	754,974.00	
	RMI HOLDINGS	25,420	15.00	381,300.00	
	SANLAM LTD	73,142	30.95	2,263,744.90	
	SAPPI LIMITED	26,526	24.80	657,844.80	
	SASOL LTD	21,446	409.99	8,792,645.54	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	16,425	135.12	2,219,346.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	7,657	113.25	867,155.25	
	STANDARD BANK GROUP LTD	45,569	105.54	4,809,352.26	
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	42,175	24.95	1,052,266.25	
	TELKOM SA LTD	5,683	28.60	162,533.80	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	10,233	111.90	1,145,072.70	
	TIGER BRANDS LTD	6,287	258.49	1,625,126.63	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	18,599	78.70	1,463,741.30	
	VODACOM GROUP	11,979	90.48	1,083,859.92	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	47,470	42.84	2,033,614.80	
小計		1,041,917		85,166,088.91 (827,814,384)	
トルコリラ	AKBANK T.A.S.	48,846	6.60	322,383.60	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	9,571	23.65	226,354.15	
	ARCELIK AS	15,358	7.18	110,270.44	
	ASYA KATILIM BANKASI AS	20,503	1.62	33,214.86	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	3,442	55.50	191,031.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,991	23.50	70,288.50	
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	55,881	2.06	115,114.86	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	8,115	4.86	39,438.90	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	31,844	3.54	112,727.76	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	25,540	5.88	150,175.20	
	KOC HOLDING AS	21,816	6.20	135,259.20	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	12,762	7.66	97,756.92	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	4,962	40.10	198,976.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	15,644	2.17	33,947.48	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	25,964	3.21	83,344.44	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	18,656	7.42	138,427.52	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	31,783	8.92	283,504.36	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	80,446	6.30	506,809.80	
	TURKIYE HALK BANKASI	13,447	10.95	147,244.65	
	TURKIYE IS BANKASI-C	54,343	3.58	194,547.94	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	18,383	2.63	48,347.29	
	YAPI VE KREDI BANKASI	26,190	3.05	79,879.50	
小計		546,487		3,319,044.57 (140,196,442)	
ユーロ	MAROC TELECOM	10,128	12.50	126,600.00	
小計		10,128		126,600.00 (12,658,734)	
合計		70,625,663		(11,160,939,389)	

(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　28銘柄	100.0%	8.3%
香港ドル	株式　148銘柄	100.0%	17.9%
マレーシアリンギット	株式　42銘柄	100.0%	3.4%
タイバーツ	株式　18銘柄	100.0%	1.9%
フィリピンペソ	株式　18銘柄	100.0%	0.7%
インドネシアルピア	株式　25銘柄	100.0%	3.0%
メキシコペソ	株式　23銘柄	100.0%	4.7%
ブラジルレアル	株式　78銘柄	100.0%	15.4%
チリペソ	株式　19銘柄	100.0%	1.8%
韓国ウォン	株式　105銘柄	100.0%	14.9%
新台湾ドル	株式　113銘柄	100.0%	10.6%
インドルピー	株式　66銘柄	100.0%	6.6%
チェココルナ	株式　3銘柄	100.0%	0.4%
ハンガリーフォリント	株式　4銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	株式　21銘柄	100.0%	1.3%
南アフリカランド	株式　47銘柄	100.0%	7.4%

トルコリラ	株式	22銘柄	100.0%	1.3%
ユーロ	株式	1銘柄	100.0%	0.1%

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	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER SA	26,800.00	437,644.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	3,200.00	50,880.00	
	小計		30,000.00	488,524.00 (21,343,613)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	102,508.00	2,048,109.84	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	166,445.00	1,273,304.25	
	小計		268,953.00	3,321,414.09 (32,284,144)	
合計				(53,627,757)	

(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	合計金額に対する比率
ブラジルレアル	投資信託受益証券　2銘柄	100.0%	39.8%
南アフリカランド	投資信託受益証券　2銘柄	100.0%	60.2%

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24年2月29日現在)

Ⅰ 資産総額	1,987,278,968 円
Ⅱ 負債総額	11,449,953 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,975,829,015 円
Ⅳ 発行済口数	1,502,612,209 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3149 円

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	193,009,474,239 円
Ⅱ 負債総額	1,605,352,259 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	191,404,121,980 円
Ⅳ 発行済口数	155,423,357,907 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2315 円

住信 国内株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	128,692,452,421 円
Ⅱ 負債総額	429,473,153 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	128,262,979,268 円
Ⅳ 発行済口数	195,490,497,331 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6561 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	210,640,359,946 円
Ⅱ 負債総額	66,425,816 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	210,573,934,130 円
Ⅳ 発行済口数	114,981,482,099 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8314 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	133,739,686,161 円
Ⅱ 負債総額	314,139,536 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	133,425,546,625 円
Ⅳ 発行済口数	139,560,048,776 口

Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9560 円

住信 新興国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	5,757,638,643 円
Ⅱ 負債総額	36,933,818 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,720,704,825 円
Ⅳ 発行済口数	4,263,546,087 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3418 円

住信 新興国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	13,762,302,442 円
Ⅱ 負債総額	581,334,126 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,180,968,316 円
Ⅳ 発行済口数	7,436,031,349 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7726 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取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又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、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、委託会社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。

②受益権の譲渡

イ．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又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。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．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及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知する

ものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又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、委託会社が必要と認めるとき又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。

③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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

④受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、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。

⑤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又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販売会社の名義で記載又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。

⑥質権口記載又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又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、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従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】

(1)資本金の額（平成24年4月1日現在）

資本金の額	： 3億円
発行可能株式総数	： 12,000株
発行済株式総数	： 3,000株
最近5年間における資本金の額の増減	： 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役1名以上をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、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行い、監査役の解任決議は、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3分の2以上をもって行います。

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終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4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終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づいて、運用各部において資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を策定し、運用各部の長が承認します。

［DO（実行）］

運用各部の運用担当者は、運用ガイドラインや運用計画に沿って、ポートフォリオ構築及びファンド管理、運用の指図を行います。売買の執行は、運用各部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）］

運用各部の長は、運用が運用計画に沿って行われているかの確認を行います。

毎月開催される運用委員会では、パフォーマンスや運用プロセスのモニタリングを通じて、ファンドの品

質管理を行います。
また、運用に関するリスク管理と法令遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理関連部門及びコンプライアンス関連部門が担当し、これを運用部門及び取締役等にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持するよう努めます。
さらに、内部監査部門は、委託会社の業務全般について内部管理体制の妥当性を検証、評価します。その評価結果を取締役等へ報告するとともに、指摘事項の是正状況の事後点検を行います。

委託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会社は、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24年2月29日現在、住信アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次の通りです（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	167	1,334,466
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	167	1,334,466

（ご参考）平成24年2月29日現在、中央三井アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次の通りです（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	133	2,511,956
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	701
単位型公社債投資信託	0	0
合計	138	2,512,657

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 （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）	
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 （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）	
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 （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）
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 （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）
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

期別 項目	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	その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。） 時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。	その他有価証券 時価のあるもの 同 左 時価のないもの 同 左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。 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。	有形固定資産 同 左 無形固定資産 同 左
3 引当金の計上基準	（1）賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。 （2）退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。	（1）賞与引当金 同 左 （2）退職給付引当金 同 左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同 左

会計方針の変更

前事業年度 （自 平成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	※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　96,447千円 計　134,799千円 ※2　関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金　3,498,856千円 未払手数料　353,462千円 未払費用　119,557千円	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　3,477,508千円 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 ※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	※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

（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

（リース取引関係）

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

①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。

②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。

③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

①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。

②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。

③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 その他有価証券	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 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	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）
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。	1．採用している退職給付制度の概要 同左
2．退職給付債務及びその他に関する事項 退職給付債務　122,901千円 退職給付引当金　122,901千円	2．退職給付債務及びその他に関する事項 退職給付債務　171,115千円 退職給付引当金　171,115千円
（1）当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。	（1）同左
（2）当社の退職給付債務は退職一時金のみです。	（2）同左
3．退職給付費用に関する事項	3．退職給付費用に関する事項

退職給付費用　52,327千円 （1）当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 （2）金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。 4．退職給付債務等の計算基礎 当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。	退職給付費用　63,772千円 （1）同左 （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。 4．退職給付債務等の計算基礎 同左

（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）
1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　15,392千円 賞与引当金損金算入限度超過額　28,726千円 退職給付引当金損金算入限度超過額　50,008千円 有価証券評価差額　4,321千円 その他　1,025千円 繰延税金資産 合計　99,475千円 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。	1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　17,667千円 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　69,626千円 有価証券評価差額　5,832千円 その他　4,558千円 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 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す。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

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す。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

住友信託銀行株式会社（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株当たり当期純利益　72,151円14銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	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　85,292円63銭 同左

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　平成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		2,765,368
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

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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末 （平成23年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額 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）

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　減価償却実施額 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 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

（リース取引関係）

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

ため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第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。

次へ

（参考情報）
中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

（１）委託会社の財務諸表は、「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」といいます。）第２条の規定により、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（平成19年内閣府令第52号）」（以下「業府令」といいます。）に基づいて作成しております。

ただし、第24期事業年度（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しており、第25期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」といいます。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

（２）委託会社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第24期事業年度（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）、第25期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）の財務諸表及び第26期中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査及び中間監査を受けております。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２２年６月１０日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　平 木 達 也　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井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、中央三井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、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。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２３年６月１０日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　平 木 達 也　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井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、中央三井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。

次へ

（１）貸借対照表

科目	第24期 平成22年３月31日 金額（千円）	第25期 平成23年３月31日 金額（千円）
（資産の部）		
Ⅰ 流動資産		
１．現金・預金	1,823,012	2,336,337
２．前払費用	92,464	56,149
３．未収委託者報酬	1,023,412	967,198
４．未収収益	102	53
５．繰延税金資産	30,247	43,658
６．その他	4,463	6,108
流動資産 計	2,973,703	3,409,505
Ⅱ 固定資産		
１．有形固定資産※１		
(1) 建物	24,815	7,448
(2) 器具備品	36,727	23,068
有形固定資産 計	61,543	30,517
２．無形固定資産		
(1) ソフトウェア	114,197	78,445
(2) 電話加入権	1,847	1,847
(3) 電話施設利用権	57	37
無形固定資産 計	116,102	80,330
３．投資その他の資産		
(1) 投資有価証券	74,897	69,135
(2) 長期貸付金	39,988	37,588
(3) 長期差入保証金	88,736	90,141
(4) 長期前払費用	4,915	2,216
(5) 会員権	25,000	25,000
(6) 貸倒引当金	△39,988	△37,588
投資その他の資産 計	193,549	186,494
固定資産 計	371,195	297,342
資 産 合 計	3,344,898	3,706,847

科目	第24期 平成22年３月31日 金額（千円）		第25期 平成23年３月31日 金額（千円）	
（負債の部）				
Ⅰ 流動負債				
１．預り金		3,792		3,682
２．未払金				
(1) 未払手数料	327,341		298,465	
(2) その他未払金	56,890	384,231	109,112	407,578
３．未払費用		279,266		365,151
４．未払法人税等		114,387		82,266
５．賞与引当金		46,407		50,180
６．資産除去債務		－		16,345
流動負債 計		828,085		925,203
Ⅱ 固定負債				
１．退職給付引当金		22,905		18,693
２．役員退職慰労引当金		31,800		－
３．繰延税金負債		－		1,600
４．その他		－		20,700
固定負債 計		54,705		40,993
負 債 合 計		882,791		966,197
（純資産の部）				
Ⅰ 株主資本				
１．資本金		300,000		300,000
２．資本剰余金				
(1) 資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金 計		50,000		50,000
３．利益剰余金				
(1) 利益準備金		25,401		25,401
(2) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		2,086,808		2,364,106
利益剰余金 計		2,112,210		2,389,507
株主資本計		2,462,210		2,739,507
Ⅱ 評価・換算差額等				
１．その他有価証券評価差額金		△103		1,142
評価・換算差額等計		△103		1,142
純資産合計		2,462,107		2,740,649
負債・純資産合計		3,344,898		3,706,847

（２）損益計算書

科目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで) 金額（千円）		第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで) 金額（千円）	
Ⅰ 営業収益				
１．委託者報酬		9,668,856		9,561,211
営業収益 計		9,668,856		9,561,211
Ⅱ 営業費用				
１．支払手数料		3,855,512		3,634,705
２．広告宣伝費		89,996		83,750
３．調査費				
(1) 調査費	234,896		232,183	
(2) 委託調査費	2,921,144	3,156,040	3,098,589	3,330,773
４．営業雑経費				
(1) 通信費	14,562		14,141	
(2) 印刷費	192,040		206,247	
(3) 協会費	11,699		12,069	
(4) 諸会費	389	218,692	507	232,966
営業費用 計		7,320,241		7,282,194
Ⅲ 一般管理費				
１．給料				
(1) 役員報酬	57,119		62,111	
(2) 給料・手当	609,618		633,310	
(3) 賞与	132,613	799,351	158,866	854,287
２．福利厚生費		211,448		232,228
３．交際費		1,056		770
４．旅費交通費		20,394		21,590
５．租税公課		11,448		11,095
６．不動産賃借料		112,953		116,174
７．退職給付費用		6,497		7,250
８．役員退職慰労引当金繰入		12,900		8,250
９．賞与引当金繰入		46,407		50,180
10．減価償却費		56,560		53,926
11．諸経費		520,606		540,822
一般管理費 計		1,799,626		1,896,577
営業利益		548,988		382,439

科目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)		第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)	
	金額（千円）		金額（千円）	
Ⅳ 営業外収益				
１．受取配当金		3,000		63,400
２．受取利息		1,101		787
３．雑収入		333		4,513
営業外収益 計		4,435		68,700
Ⅴ 営業外費用				
１．雑損失※1		5,057		573
営業外費用 計		5,057		573
経常利益		548,366		450,566
Ⅵ 特別利益				
１．投資有価証券売却益		2,918		67,194
２．投資有価証券償還益		―		584
３．貸倒引当金戻入		2,400		2,400
特別利益 計		5,318		70,179
Ⅶ 特別損失				
１．投資有価証券売却損		17		344
２．固定資産除却損		―		980
３．資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		―		12,305
４．減損損失※2		―		17,622
５．統合関連費用※1		9,577		51,394
特別損失 計		9,594		82,648
税引前当期純利益		544,090		438,098
法人税、住民税及び事業税	230,069		173,405	
法人税等調整額	△1,078	228,991	△12,604	160,801
当期純利益		315,099		277,297

（３）株主資本等変動計算書

		第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
株主資本		（単位：千円）	（単位：千円）
資本金	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	前期末残高	25,401	25,401
	当期変動額	－	－
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	前期末残高	1,771,709	2,086,808
	当期変動額　当期純利益	315,099	277,297
	当期末残高	2,086,808	2,364,106
利益剰余金合計	前期末残高	1,797,110	2,112,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,112,210	2,389,507
株主資本合計	前期末残高	2,147,110	2,462,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,462,210	2,739,507
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	－	△103
	当期変動額　（純額）	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
評価・換算差額等合計	前期末残高	－	△103
	当期変動額	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
純資産合計	前期末残高	2,147,110	2,462,107
	当期変動額	314,996	278,542
	当期末残高	2,462,107	2,740,649

重要な会計方針

期別 項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 (1) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。 (2) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額について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）を採用しております。	その他有価証券 (1) 時価のないもの 同左 (2) 時価のあるもの 同左
２．固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として５年～20年であります。	同左
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（５年）を耐用年数としております。	同左
３．引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。	同左
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。	同左
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。	同左
(4) 役員退職慰労引当金	役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。	―
４．その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。	同左

会計方針の変更

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
―	資産除去債務に関する会計基準の適用 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、営業利益及び経常利益は2,056千円、税引前当期純利益は14,362千円減少しております。

追加情報

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
―	当社は、役員への退職慰労金の支払に備えるため、役員に対する退職慰労金の支給見積額のうち、当事業年度末までに発生していると認められる額を「役員退職慰労引当金」として計上しておりましたが、役員に対する退職慰労金制度を廃止し、退職慰労金を打切り支給することとしました。 これに伴い、「役員退職慰労引当金」を全額取崩し、打切り支給額分13,950千円を固定負債の「その他」に含めて表示しております。

注記事項

１．貸借対照表関係

期別 項目	第24期 (平成22年３月31日)	第25期 (平成23年３月31日)
※１．有形固定資産の減価償却累計額	建物　28,053千円 器具備品　177,074千円	建物　33,765千円 器具備品　142,605千円

２．損益計算書関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 雑損失（臨時経営指導料）　4,490千円 統合関連費用　9,577千円	※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 統合関連費用　51,394千円 ※２　当事業年度において、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。 用途：処分予定資産／場所：本社事務所(東京都港区)／種類：建物、器具備品／金額：17,622千円 (経緯) 上記の資産グループについては、当社グループの経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却される可能性が高い資産について、除去予定時の帳簿価額を減損損失として特別損失に計上しました。 (減損損失の金額) 建物　15,615千円 器具備品　2,007千円 合計　17,622千円 (グルーピングの方法) 当社は、基本的に全ての資産が一体となってキャッシュ・フローを生成しておりますが、将来使用見込みがなく処分される可能性が高いものについては、処分予定資産としてグルーピングしております。

３．株主資本等変動計算書関係

<table>
<tr><th>期別
項目</th><th>第24期
(平成21年４月１日から
平成22年３月31日まで)</th></tr>
<tr><td>１．発行済株式に関する事項</td><td><table><tr><th>株式の種類</th><th>前事業年度末</th><th>増加</th><th>減少</th><th>当事業年度末</th></tr><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>－</td><td>－</td><td>5,050</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>２．自己株式に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>３．新株予約権等に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>４．配当に関する事項</td><td>(1) 配当金支払額
該当事項はありません。
(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>期別
項目</th><th>第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)</th></tr>
<tr><td>１．発行済株式に関する事項</td><td><table><tr><th>株式の種類</th><th>前事業年度末</th><th>増加</th><th>減少</th><th>当事業年度末</th></tr><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>－</td><td>－</td><td>5,050</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>２．自己株式に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>３．新株予約権等に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>４．配当に関する事項</td><td>(1) 配当金支払額
該当事項はありません。
(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。</td></tr>
</table>

４．リース取引関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
リース取引は重要性が乏しく、１件当たりの金額が少額なため、注記を省略しております。	当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

５．金融商品関係

第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

２．金融商品の時価等に関する事項

平成22年３月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

	貸借対照表上計上額（＊）	時価（＊）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	1,823,012	1,823,012	―
(2) 未収委託者報酬	1,023,412	1,023,412	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	9,897	9,897	―
(4) 未払金	(384,231)	(384,231)	―

（＊）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

(1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、預入期間が短期間（１年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

上記については、市場価格がなく、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時価開示の対象とはしておりません。

（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。

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

２．金融商品の時価等に関する事項

平成23年３月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

	貸借対照表上計上額（＊）	時価（＊）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,336,337	2,336,337	―
(2) 未収委託者報酬	967,198	967,198	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	59,135	59,135	―
(4) 未払金	(407,578)	(407,578)	―

（＊）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

(1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、預入期間が短期間（１年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

上記については、市場価格がなく、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時価開示の対象とはしておりません。

６．有価証券関係

第24期（平成22年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	9,897	10,000	△103
計	9,897	10,000	△103

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	64,901	2,918	17
計	64,901	2,918	17

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	65,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

第25期（平成23年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949
計	58,149	56,200	1,949

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	986	1,000	△13
計	986	1,000	△13

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344
計	128,650	67,194	344

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

７．デリバティブ関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

８．退職給付関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。	１．採用している退職給付制度の概要 同左
２．退職給付債務に関する事項（平成22年３月31日現在） 退職給付債務　△22,905千円 退職給付引当金　△22,905千円 （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。	２．退職給付債務に関する事項（平成23年３月31日現在） 退職給付債務　△18,693千円 退職給付引当金　△18,693千円 （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。
３．退職給付費用に関する事項 （平成21年４月１日から平成22年３月31日まで） 勤務費用　6,497千円 退職給付費用　6,497千円 （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。	３．退職給付費用に関する事項 （平成22年４月１日から平成23年３月31日まで） 勤務費用　7,250千円 退職給付費用　7,250千円 （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。

９．税効果会計関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 貸倒引当金繰入超過額　16,271千円 賞与引当金繰入超過額　18,883千円 未払事業税　9,168千円 その他　25,501千円 繰延税金資産小計　69,823千円 評価性引当額　△39,576千円 繰延税金資産合計　30,247千円	１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 貸倒引当金繰入超過額　15,294千円 賞与引当金繰入超過額　20,418千円 資産除去債務　6,650千円 移転による除却予定資産減損　7,170千円 未払事業税　6,824千円 その他　19,740千円 繰延税金資産小計　76,099千円 評価性引当額　△32,440千円 繰延税金資産合計　43,658千円 繰延税金負債 その他有価証券評価差額金　△793千円 その他　△806千円 繰延税金負債合計　△1,600千円
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間に重要な差異があるときの当該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、記載を省略しております。	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間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率　40.7% （調整） 受取配当金等永久に益金に算入されない項目　△2.9% 評価性引当額の減少　△1.6% 住民税均等割　0.1% その他　0.4% 税効果会計適用後の法人税等の負担率　36.7%

10. 資産除去債務関係

第25期 平成23年３月31日
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの １．当該資産除去債務の概要 事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。 ２．当該資産除去債務の金額の算定方法 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。 ３．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減 期首残高（注）　5,776千円 時の経過による調整額　79千円 見積りの変更による増加額※　10,489千円 期末残高　16,345千円 ※当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの （注）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）を適用したことによる期首時点における残高であります。

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)

（セグメント情報）

第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

当社は、投資信託委託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。

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

当社は、投資信託委託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）

１．製品及びサービスごとの情報

投資信託委託業の区分の外部顧客へ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) 営業収益

本邦の外部顧客へ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

顧客の名称	営業収益
中央三井高金利ソブリンオープン	1,336,886千円
中央三井ＶＡバランスファンド（株25／100）	1,150,446千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（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）

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託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。

（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 最終改正平成21年３月27日）及び「セグメント情報等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。

12. 関連当事者との取引関係

Ⅰ 第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（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）
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払（注１） 支払代行手数料	3,600,680	未払手数料	300,655
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料（注１） 調査費（支払投資顧問料） 建物の賃借（注２）	2,778,495 ―	未払費用 前払費用 長期差入保証金	235,031 49,803 71,548
同一の親会社を持つ会社	中央三井インフォメーションテクノロジー株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都目黒区	200	情報処理サービス業	該当なし	システムの管理・開発委託	ソフトウェアの購入（注２） ソフトウェア	45,122	―	―

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高（長期差入保証金を除く）には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

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

中央三井トラスト・ホールディングス株式会社（東京、大阪、名古屋証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

Ⅱ 第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（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	中央三井トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	（被所有）直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払 統合関連費用	51,394	未払金	15,680

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（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）
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払（注１） 支払代行手数料	3,100,880	未払手数料	243,621
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料（注１） 調査費（支払投資顧問料） 建物の賃借（注２）	2,425,966 ―	未払費用 前払費用 長期差入保証金	201,863 11,088 72,681

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高（長期差入保証金を除く）には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

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

中央三井トラスト・ホールディングス株式会社（東京、大阪、名古屋証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. １株当たり情報

項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．１株当たり純資産額	487,545円94銭	542,702円95銭
２．１株当たり当期純利益	62,395円92銭 （注）潜在株式調整後１株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	54,910円36銭 （注）潜在株式調整後１株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
当期純利益（千円）	315,099	277,297
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益（千円）	315,099	277,297
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050	5,050

14. 重要な後発事象

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
該当事項はありません。	同左

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２３年１２月１４日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　木 村 充 男　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井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、中央三井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。

次へ

（４）中間貸借対照表

科目	第26期中間会計期間末 平成23年９月30日 金額（千円）	
（資産の部）		
Ⅰ 流動資産		
１．現金・預金		2,380,387
２．前払費用		64,463
３．未収委託者報酬		912,743
４．未収収益		50
５．繰延税金資産		43,804
６．１年内回収予定の差入保証金		91,552
７．その他		1,135
流動資産 計		3,494,136
Ⅱ 固定資産		
１．有形固定資産※１		
(1) 建物		4,874
(2) 器具備品		23,552
有形固定資産 計		28,426
２．無形固定資産		
(1) ソフトウェア		64,361
(2) 電話加入権		1,847
(3) 電話施設利用権		27
無形固定資産 計		66,235
３．投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		58,718
(2) 長期貸付金		36,338
(3) 長期前払費用		1,808
(4) 会員権		25,000
(5) 貸倒引当金		△36,338
投資その他の資産 計		85,526
固定資産 計		180,189
資産合計		3,674,325

科目	第26期中間会計期間末 平成23年９月30日 金額（千円）	
（負債の部）		
Ⅰ 流動負債		
１．預り金		3,425
２．未払金		
（1）未払手数料	310,451	
（2）その他未払金※２	81,207	391,659
３．未払費用		302,029
４．未払法人税等		55,232
５．賞与引当金		52,320
６．役員賞与引当金		2,356
７．資産除去債務		16,385
流動負債 計		823,409
Ⅱ 固定負債		
１．退職給付引当金		19,861
２．繰延税金負債		403
３．その他		15,475
固定負債 計		35,740
負債合計		859,149
（純資産の部）		
Ⅰ 株主資本		
１．資本金		300,000
２．資本剰余金		
（1）資本準備金		50,000
資本剰余金 計		50,000
３．利益剰余金		
（1）利益準備金		25,401
（2）その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,441,256
利益剰余金 計		2,466,658
株主資本 計		2,816,658
Ⅱ 評価・換算差額等		
１．その他有価証券評価差額金		△1,481
評価・換算差額等 計		△1,481
純資産合計		2,815,176
負債・純資産合計		3,674,325

（５）中間損益計算書

科目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで） 金額（千円）	
Ⅰ 営業収益		
１．委託者報酬		5,398,191
営業収益 計		5,398,191
Ⅱ 営業費用		
１．支払手数料		2,281,099
２．広告宣伝費		52,806
３．調査費		
（1）調査費	113,633	
（2）委託調査費	1,699,582	1,813,215
４．営業雑経費		
（1）通信費	5,849	
（2）印刷費	105,715	
（3）協会費	6,167	
（4）諸会費	561	118,293
営業費用 計		4,265,414
Ⅲ 一般管理費		
１．給料		
（1）役員報酬	44,415	
（2）給料・手当	323,432	
（3）賞与	56,367	424,216
２．福利厚生費		127,354
３．交際費		397
４．旅費交通費		9,674
５．租税公課		6,980
６．不動産賃借料		59,038
７．退職給付費用		3,434
８．賞与引当金繰入		52,320
９．役員賞与引当金繰入		2,356
10．減価償却費※１		24,737
11．諸経費		279,843
一般管理費 計		990,353
営業利益		142,423

科目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）	
	金額（千円）	
Ⅳ 営業外収益		
１．受取利息		369
２．貸倒引当金戻入		1,250
３．雑収入		3
営業外収益 計		1,623
Ⅴ 営業外費用		
１．雑損失		85
営業外費用 計		85
経常利益		143,961
Ⅵ 特別利益		
１．投資有価証券売却益		153
特別利益 計		153
Ⅶ 特別損失		
１．投資有価証券売却損		2
２．統合関連費用		15,235
特別損失 計		15,238
税引前中間純利益		128,876
法人税、住民税及び事業税	52,275	
法人税等調整額	△549	51,725
中間純利益		77,150

（６）中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）

（単位：千円）

株主資本			
	資本金	当期首残高	300,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	300,000
	資本剰余金		
	資本準備金	当期首残高	50,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	50,000
	資本剰余金合計	当期首残高	50,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	50,000
	利益剰余金		
	利益準備金	当期首残高	25,401
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	25,401
	その他利益剰余金		
	繰越利益剰余金	当期首残高	2,364,106
		当中間期変動額　中間純利益	77,150
		当中間期末残高	2,441,256
	利益剰余金合計	当期首残高	2,389,507
		当中間期変動額	77,150
		当中間期末残高	2,466,658
	株主資本合計	当期首残高	2,739,507
		当中間期変動額	77,150
		当中間期末残高	2,816,658
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金	当期首残高	1,142
		当中間期変動額（純額）	△2,624
		当中間期末残高	△1,481
	評価・換算差額等合計	当期首残高	1,142
		当中間期変動額	△2,624
		当中間期末残高	△1,481
純資産合計		当期首残高	2,740,649
		当中間期変動額	74,526
		当中間期末残高	2,815,176

重要な会計方針

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 （1）時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額について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）を採用しております。 （2）時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。
２．固定資産の減価償却の方法	
（1）有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として５年～20年であります。
（2）無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（５年）を耐用年数としております。
３．引当金の計上基準	
（1）貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
（2）賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
（3）役員賞与引当金	役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
（4）退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。
４．その他中間財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

追加情報

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用	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。
２．役員賞与引当金	役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第４号 平成17年11月29日）を適用し、当中間会計期間から役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第26期中間会計期間末 （平成23年９月30日）
※１．有形固定資産の減価償却累計額	建物　35,117千円 器具備品　143,248千円
※２．消費税等の取扱い	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「その他未払金」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
※１．減価償却実施額	有形固定資産　8,010千円 無形固定資産　16,727千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．発行済株式に関する事項	株式の種類：普通株式（株） 当事業年度期首：5,050 増加：－ 減少：－ 当中間会計期間末：5,050
２．自己株式に関する事項	該当事項はありません。
３．新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。
４．配当に関する事項	該当事項はありません。

リース取引関係

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
当社はリース取引を全く行っていないため、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
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

金融商品の時価等に関する事項

平成23年９月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

	中間貸借対照表計上額 (*)	時価 (*)	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,380,387	2,380,387	―
(2) 未収委託者報酬	912,743	912,743	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	48,718	48,718	―
(4) 未払金	(391,659)	(391,659)	―

（＊）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

(1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、預入期間が短期間（１年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

内　　容	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

上記については、市場価格がなく、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時価開示の対象とはしておりません。

有価証券関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

１．その他有価証券

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
投資信託受益証券	200	200	0
計	200	200	0

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
投資信託受益証券	48,518	50,000	△1,482
計	48,518	50,000	△1,482

非上場株式（中間貸借対照表計上額 10,000千円）については、市場価格がなく、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。

デリバティブ関係

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

資産除去債務関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

	千円
期首残高	16,345
時の経過による調整額	40
中間期末残高	16,385

セグメント情報等

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

（セグメント情報）

当社は、投資信託委託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）

１．製品及びサービスごとの情報

投資信託委託業の区分の外部顧客へ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) 営業収益

本邦の外部顧客へ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

顧客の名称	営業収益
ＰＩＭＣＯ 米国ハイイールド債券通貨選択型ファンド（ブラジル・レアルコース）	1,201,868千円
中央三井高金利ソブリンオープン	535,464千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

１株当たり情報

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）	
１株当たり純資産額	557,460円63銭
１株当たり中間純利益	15,277円38銭
（注）潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

（注）１株当たり中間純利益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 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）	
中間純利益（千円）	77,150
普通株主に帰属しない金額（千円）	－
普通株式に係る中間純利益（千円）	77,150
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050

重要な後発事象

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社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。以下同じ。）又は子法人等（委託会社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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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】

(1)定款の変更

委託会社は、平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

③事業の内容：銀行法に基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基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成23年9月末日現在）	事業の内容

ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	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。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	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。

なお、上記の他、三井住友信託銀行株式会社は当ファンドの関係法人による自己設定等の取扱いのための指定販売会社です。その資本金の額および事業の内容は上記(1)に記載の通りです。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

（参考）再信託受託会社

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：平成12年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（平成23年9月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基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基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託者へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載さ

れております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、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みます。）を掲載し、これらの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。

(7)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。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)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。

独立監査人の監査報告書

平成24年3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　公認会計士　　石 井 勝 也　㊞
　業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている 世界経済インデックスファンドの平成23年1月21日から平成24年1月20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、世界経済インデックスファンドの平成24年1月20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

※ 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）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にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成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23年2月25日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
指定有限責任
社員 公認会計士 石 井 勝 也 ㊞
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている 世界経済インデックスファンドの平成22年1月21日から平成23年1月20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、世界経済インデックスファンドの平成23年1月20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

※ 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（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
業務執行社員　公認会計士　　壁 谷　惠 嗣　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「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にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成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。