

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成24年 7 月25日
【発行者名】	ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 関崎 司
【本店の所在の場所】	東京都千代田区永田町二丁目11番 1 号 山王パークタワー
【事務連絡者氏名】	藤原 規晃
【電話番号】	03(5156)5000
【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】	ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）A コース （為替ヘッジ付き）  ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）B コース （為替ヘッジなし）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	各ファンドについて2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書の提出に伴い、平成24年1月25日付をもって提出した有価証券届出書の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、記載事項の一部訂正を行うため本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

下線部\_\_は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

<訂正前>

（前略）

当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

<訂正後>

（前略）

各ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

## 第二部【ファンド情報】

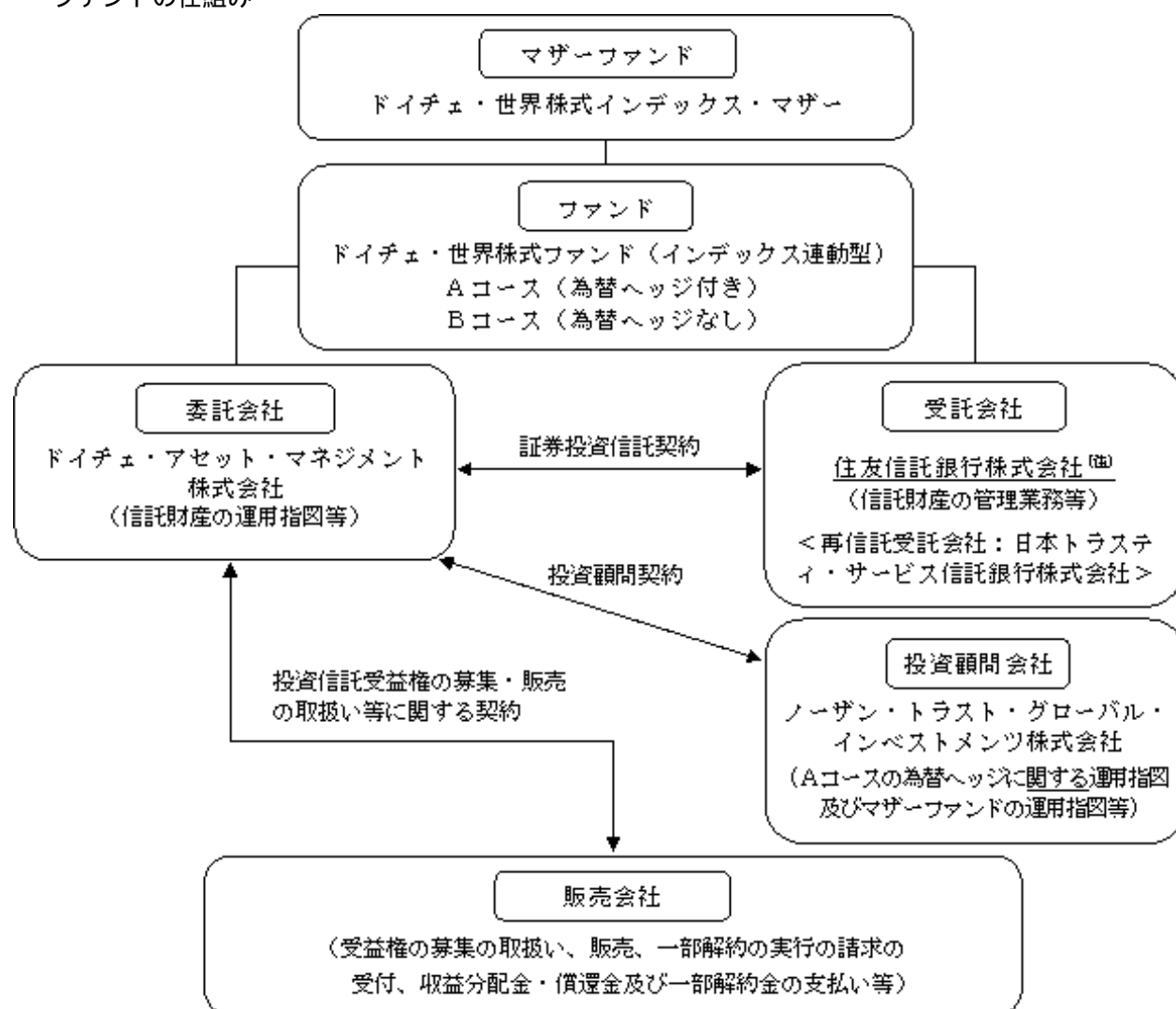
### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み



（注）住友信託銀行株式会社は、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社及び中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。以下同じ。

委託会社及びファンドの関係法人

委託会社及びファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割は次の通りです。

（中略）

b. 住友信託銀行株式会社（「受託会社」）

（中略）

d. ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（「投資顧問会社」）

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、Aコースの為替ヘッジに関する運用指図及びマザーファンドの運用指図等を行います。

（中略）

委託会社の概況

a. 資本金の額（2011年11月末現在）

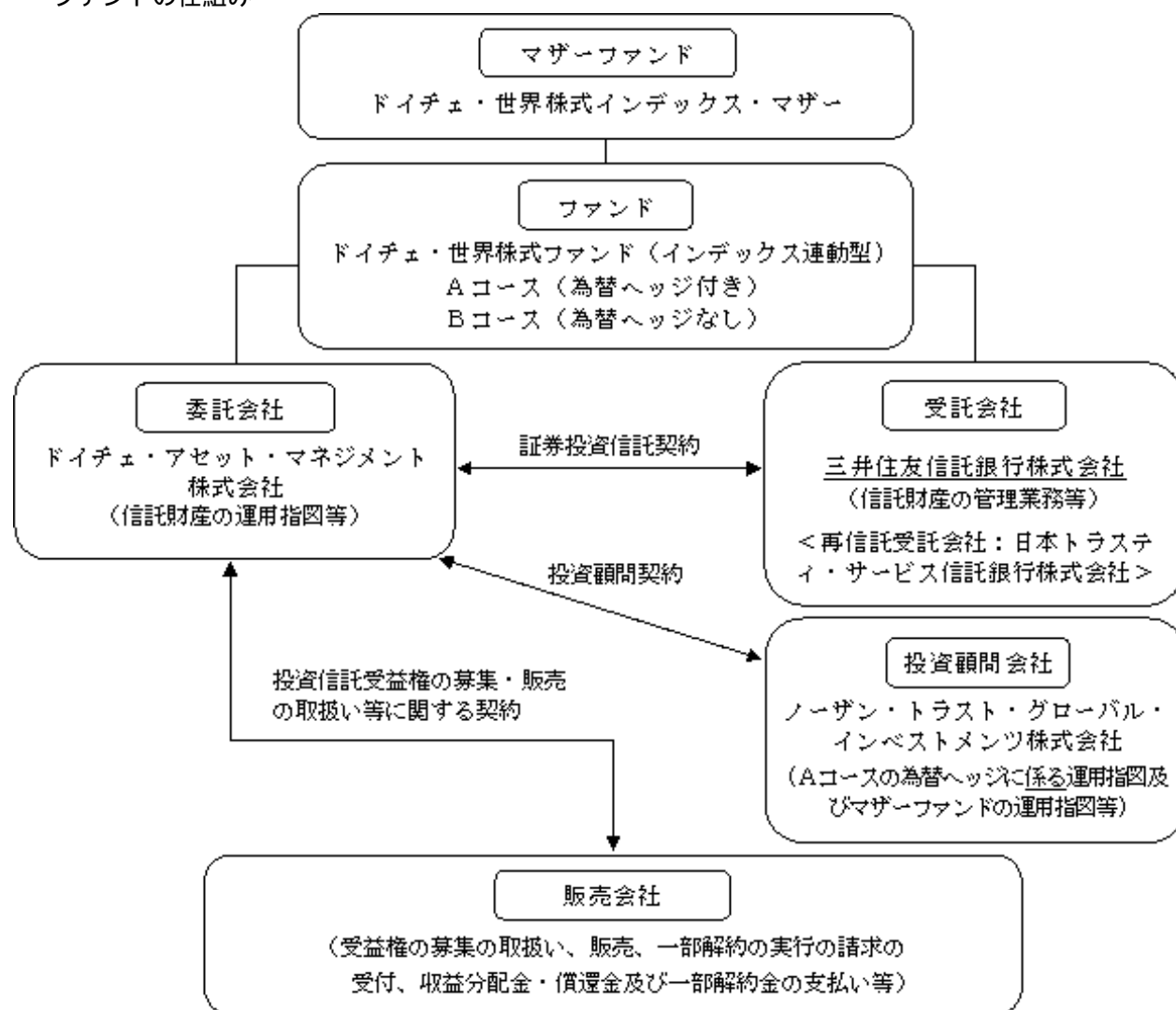
（中略）

c. 大株主の状況（2011年11月末現在）

（以下略）

&lt;訂正後&gt;

ファンドの仕組み



委託会社及びファンドの関係法人

委託会社及びファンドの関係法人の名称、ファンドの運営上の役割は次の通りです。

（中略）

b．三井住友信託銀行株式会社（「受託会社」）

（中略）

d．ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（「投資顧問会社」）

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、Aコースの為替ヘッジに係る運用指図及びマザーファンドの運用指図等を行います。

（中略）

委託会社の概況

a．資本金の額（2012年5月末現在）

（中略）

c．大株主の状況（2012年5月末現在）

（以下略）

## 2【投資方針】

### (2)【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

委託会社は、信託金を、主としてドイチェ・アセット・マネジメント株式会社を委託会社とし、住友信託銀行株式会社を受託会社として締結されたドイチェ・世界株式インデックス・マザー受益証券のほか、以下の有価証券（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。

（以下略）

<訂正後>

委託会社は、信託金を、主としてドイチェ・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会社として締結されたドイチェ・世界株式インデックス・マザー受益証券のほか、以下の有価証券（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。

（以下略）

### (3)【運用体制】

<訂正前>

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

<運用体制>

（中略）

委託会社は、Aコースの為替ヘッジに関する運用指図及びマザーファンドの運用指図に関する権限をノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（所在地：東京都港区）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価及びリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関としては、投資戦略会議、運用評価会議、インベストメント・コントロール・コミッティーの3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者及び必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

（以下略）

<訂正後>

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

<運用体制>

（中略）

委託会社は、Aコースの為替ヘッジに係る運用指図及びマザーファンドの運用指図に関する権限をノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（所在地：東京都港区）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価及びリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関としては、投資戦略会議、運用評価会議、インベストメント・コントロール・コミッティーの3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者及び必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

（以下略）

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(1) 当ファンドの主なリスク及び留意点

（中略）

その他の留意点

（中略）

- ・ 分配金は純資産総額から支払われるため、分配金支払い後は純資産総額が減少し、基準価額が下落する要因となります。分配金は計算期間中に得られた収益を超えて支払われる場合があるため、分配金の水準は必ずしも当該計算期間における運用成果等を示すものではありません。投資者のファンドの取得価額によっては、支払われた分配金が実質的には元本の払い戻しとなる場合があります。

（以下略）

<訂正後>

(1) 当ファンドの主なリスク及び留意点

（中略）

その他の留意点

（中略）

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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を超えて支払われる場合があり、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。分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。また、投資者のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド取得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。

（以下略）

#### 4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

（前略）

Aコースの為替ヘッジに関する運用の指図及びマザーファンドの運用の指図を行うノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社に対する投資顧問報酬は、上記に基づいて委託会社が受ける報酬から毎計算期末または信託終了のとき支弁するものとし、その報酬額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.19%以内を乗じて得た金額とします。

<訂正後>

（前略）

Aコースの為替ヘッジに係る運用指図及びマザーファンドの運用指図を行うノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社に対する投資顧問報酬は、上記に基づいて委託会社が受ける報酬から毎計算期末または信託終了のとき支弁するものとし、その報酬額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1995%（税抜0.19%）以内の率を乗じて得た金額とします。

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

当ファンドは、以下の費用を受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

（中略）

上記において諸費用の固定率または固定金額を定める場合、かかる諸費用の額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計上されます。かかる諸費用は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支弁します。

（以下略）

<訂正後>

各ファンドは、以下の費用を受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

（中略）

上記 において諸費用の固定率または固定金額を定める場合、かかる諸費用の額は、各ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計上されます。かかる諸費用は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支弁します。

（以下略）

## (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下の取扱いとなります。

なお、確定拠出年金制度に基づく申込みの場合は、当該制度に係る税制が適用されます。

個別元本方式について

（中略）

受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については下記「収益分配金について」をご参照下さい。）

収益分配金について

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「特別分配金」（受益者の元本の一部払戻しに相当する部分）の区別があります。受益者が収益分配金を受け取る際、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

課税の取扱いについて

以下の内容は平成23年11月末現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には内容が変更されることがあります。

### a．個人の受益者に対する課税

（中略）

収益分配金のうち、所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。また、配当金控除の適用はありません。

### b．法人の受益者に対する課税

（中略）

収益分配金のうち、所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。また、益金不算入制度は適用されません。

1 税率は平成26年1月1日から20%（所得税15%及び地方税5%）となる予定です。

2 税率は平成26年1月1日から15%（所得税のみ）となる予定です。

（以下略）

<訂正後>

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下の取扱いとなります。

なお、確定拠出年金制度に基づく申込みの場合は、当該制度に係る税制が適用されます。

個別元本方式について

（中略）

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「収益分配金について」をご参照下さい。）

収益分配金について



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）」（受益者の元本の一部払戻しに相当する部分）の区別があります。受益者が収益分配金を受け取る際、（ ）当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、（ ）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。

課税の取扱いについて

以下の内容は平成24年5月末現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には内容が変更されることがあります。

a．個人の受益者に対する課税

（中略）

収益分配金のうち、所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。また、配当金控除の適用はありません。

b．法人の受益者に対する課税

（中略）

収益分配金のうち、所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。また、益金不算入制度は適用されません。

- 1 税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは10.147%（所得税7.147%及び地方税3%）、平成26年1月1日から平成49年12月31日までは20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）となる予定です。
- 2 税率は、平成25年1月1日から平成25年12月31日までは7.147%（所得税のみ）、平成26年1月1日から平成49年12月31日までは15.315%（所得税のみ）となる予定です。

（以下略）

## 5【運用状況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

### (1)【投資状況】

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

（平成24年5月31日現在）

資産の種類	地域別(国名)	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	265,158,499	94.94
コール・ローン・その他の資産 (負債控除後)	-	14,127,855	5.06
合計(純資産総額)	-	279,286,354	100.00

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

（平成24年5月31日現在）

資産の種類	地域別(国名)	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	679,123,344	100.19
コール・ローン・その他の資産 (負債控除後)	-	1,266,420	0.19
合計(純資産総額)	-	677,856,924	100.00

（注）投資比率は、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）

「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」

（平成24年5月31日現在）

資産の種類	地域別(国名)	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	506,475,197	53.63
	カナダ	47,670,428	5.05
	ドイツ	31,910,281	3.38
	イタリア	7,878,378	0.83
	フランス	32,148,502	3.40
	オーストラリア	31,143,985	3.30
	イギリス	88,194,736	9.34
	スイス	38,215,224	4.05
	バミューダ	3,199,129	0.34
	香港	9,562,241	1.01
	シンガポール	6,822,607	0.72
	ニュージーランド	223,210	0.02
	オランダ	10,211,816	1.08
	スペイン	9,166,345	0.97
	ベルギー	4,317,975	0.46
	スウェーデン	12,206,067	1.29
	ノルウェー	2,937,997	0.31

	オーストリア	922,889	0.10
	ルクセンブルグ	1,733,086	0.18
	フィンランド	3,215,881	0.34
	デンマーク	4,634,744	0.49
	アイルランド	6,129,856	0.65
	ギリシャ	282,573	0.03
	イスラエル	2,553,285	0.27
	ポルトガル	582,799	0.06
	ケイマン	1,049,974	0.11
	モーリシャス	210,004	0.02
	リベリア	189,881	0.02
	パナマ	604,590	0.06
	キュラソー	3,677,252	0.39
	ジャージー	3,089,128	0.33
	ガーンジー	205,873	0.02
	マン島	293,712	0.03
	小計	871,659,645	92.31
新株予約権証券	アメリカ	48,881	0.01
	小計	48,881	0.01
投資信託受益証券	カナダ	204,575	0.02
	小計	204,575	0.02
投資証券	アメリカ	12,953,507	1.37
	フランス	976,637	0.10
	オーストラリア	3,199,749	0.34
	イギリス	902,132	0.10
	香港	324,745	0.03
	シンガポール	403,825	0.04
	オランダ	169,073	0.02
	小計	18,929,668	2.00
コール・ローン・その他の資産 (負債控除後)	-	53,476,372	5.66
合計(純資産総額)	-	944,319,141	100.00

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

< 評価額(全銘柄) >

(平成24年5月31日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	数量(口)	簿価単価 評価単価 (円)	簿価金額 評価金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	ドイチェ・世界株式 インデックス・マ ザー	290,584,657	1.0075 0.9125	292,772,010 265,158,499	94.94

## &lt; 種類別投資比率 &gt;

(平成24年5月31日現在)

種類	国内 / 外国	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内	94.94
合計	-	94.94

## 「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

## &lt; 評価額(全銘柄) &gt;

(平成24年5月31日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	数量(口)	簿価単価 評価単価 (円)	簿価金額 評価金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	ドイチェ・世界株式 インデックス・マ ザー	744,244,761	1.0073 0.9125	749,746,488 679,123,344	100.19

## &lt; 種類別投資比率 &gt;

(平成24年5月31日現在)

種類	国内 / 外国	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内	100.19
合計	-	100.19

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄及び種類別の評価金額の比率をいいます。

## (参考情報)

## 「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」

## &lt; 評価額(上位30銘柄) &gt;

(平成24年5月31日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量 (株数)	簿価単価 評価単価 (円)	簿価金額 評価金額 (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	530	44,217.29 45,708.09	23,435,167 24,225,291	2.57
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,654	6,811.58 6,297.02	18,077,947 16,712,309	1.77
アメリカ	株式	M I C R O S O F T CORPORATION	ソフトウェア・サービ ス	4,220	2,519.12 2,315.51	10,630,713 9,771,464	1.03
アメリカ	株式	I N T E R N A T I O N A L BUSINESS MACHINES CORP.	ソフトウェア・サービ ス	620	15,784.00 15,352.30	9,786,080 9,518,430	1.01
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	3,302	2,503.34 2,670.65	8,266,036 8,818,495	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	5,723	1,542.09 1,502.63	8,825,419 8,599,590	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,829	4,511.03 4,502.91	8,250,692 8,235,826	0.87
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,067	8,131.12 7,704.95	8,675,913 8,221,191	0.87
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	1,540	5,032.72 4,909.61	7,750,401 7,560,804	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル 用品	1,537	5,287.63 4,918.29	8,127,102 7,559,418	0.80
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	4,289	1,785.95 1,739.39	7,659,980 7,460,272	0.79
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	2,840	2,609.88 2,501.76	7,412,071 7,105,009	0.75
アメリカ	株式	THE COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	1,160	5,849.55 5,923.73	6,785,478 6,871,532	0.73

アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	980	6,800.53 6,698.72	6,664,525 6,564,755	0.70
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	140	47,452.22 46,423.10	6,643,311 6,499,235	0.69
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	9,507	675.87 614.82	6,425,579 5,845,129	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	2,770	2,155.30 2,062.17	5,970,195 5,712,237	0.60
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	27,044	209.84 209.84	5,675,075 5,675,075	0.60
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC.	食品・生活必需品小売り	1,070	4,559.20 5,164.52	4,878,352 5,526,041	0.59
アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE&CO	各種金融	2,030	3,415.65 2,601.20	6,933,784 5,280,442	0.56
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,269	4,076.19 4,108.70	5,172,687 5,213,945	0.55
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	1,590	3,117.33 3,268.86	4,956,570 5,197,497	0.55
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	10,531	533.13 486.36	5,614,415 5,121,900	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,709	3,020.26 2,951.60	5,161,638 5,044,298	0.53
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK	エネルギー	2,038	2,600.94 2,428.15	5,300,721 4,948,584	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	388	13,533.11 12,362.68	5,250,850 4,796,722	0.51
イギリス	株式	GLAXO SMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,722	1,779.75 1,720.52	4,844,488 4,683,282	0.50
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	2,185	2,264.21 2,065.33	4,947,309 4,512,760	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC.	食品・飲料・タバコ	827	5,248.96 5,383.92	4,340,897 4,452,503	0.47
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	600	7,465.04 7,111.48	4,479,025 4,266,888	0.45

（注）投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

#### < 種類別及び業種別投資比率 >

（平成24年5月31日現在）

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.83
		素材	6.51
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	1.17
		耐久消費財・アパレル	1.28
		消費者サービス	1.70
		メディア	2.57
		小売	2.83
		食品・生活必需品小売り	2.29
		食品・飲料・タバコ	6.97
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	2.65

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		7.57
	銀行		6.63
	各種金融		4.06
	保険		3.59
	不動産		0.64
	ソフトウェア・サービス		5.70
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		4.92
	電気通信サービス		3.85
	公益事業		3.65
	半導体・半導体製造装置		1.61
	小計		92.31
新株予約権証券	外国	エネルギー	0.01
	小計		0.01
投資信託受益証券	外国	不動産	0.02
	小計		0.02
投資証券	外国	運輸	0.05
		不動産	1.95
	小計		2.00
合計			94.34

（注）投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該種類別及び業種別の評価金額の比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

計算期間末 または各月末	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 8期計算期間末(平成14年10月25日)	1,404	1,404	0.6355	0.6355
第 9期計算期間末(平成15年 4月25日)	664	664	0.6313	0.6313
第10期計算期間末(平成15年10月27日)	714	714	0.7027	0.7027
第11期計算期間末(平成16年 4月26日)	780	780	0.7778	0.7778
第12期計算期間末(平成16年10月25日)	649	649	0.7495	0.7495
第13期計算期間末(平成17年 4月25日)	634	634	0.7896	0.7896
第14期計算期間末(平成17年10月25日)	483	483	0.8322	0.8322
第15期計算期間末(平成18年 4月25日)	450	450	0.9278	0.9278
第16期計算期間末(平成18年10月25日)	416	416	0.9539	0.9539
第17期計算期間末(平成19年 4月25日)	433	433	1.0194	1.0194
第18期計算期間末(平成19年10月25日)	390	390	1.0173	1.0173

第19期計算期間末(平成20年 4月25日)	352	352	0.9143	0.9143
第20期計算期間末(平成20年10月27日)	233	233	0.6054	0.6054
第21期計算期間末(平成21年 4月27日)	225	225	0.5920	0.5920
第22期計算期間末(平成21年10月26日)	283	283	0.7432	0.7432
第23期計算期間末(平成22年 4月26日)	307	307	0.8141	0.8141
第24期計算期間末(平成22年10月25日)	303	303	0.8093	0.8093
第25期計算期間末(平成23年 4月25日)	337	337	0.8865	0.8865
第26期計算期間末(平成23年10月25日)	297	297	0.8041	0.8041
第27期計算期間末(平成24年 4月25日)	289	289	0.8583	0.8583
平成23年 5月末	334	-	0.8785	-
平成23年 6月末	318	-	0.8601	-
平成23年 7月末	319	-	0.8501	-
平成23年 8月末	287	-	0.7795	-
平成23年 9月末	277	-	0.7506	-
平成23年10月末	303	-	0.8265	-
平成23年11月末	284	-	0.7669	-
平成23年12月末	299	-	0.8003	-
平成24年 1月末	301	-	0.8329	-
平成24年 2月末	298	-	0.8730	-
平成24年 3月末	300	-	0.8788	-
平成24年 4月末	294	-	0.8726	-
平成24年 5月末	279	-	0.8205	-

## 「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

計算期間末 または各月末	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 8期計算期間末(平成14年10月25日)	500	500	0.7126	0.7126
第 9期計算期間末(平成15年 4月25日)	534	534	0.7127	0.7127
第10期計算期間末(平成15年10月27日)	590	590	0.7452	0.7452
第11期計算期間末(平成16年 4月26日)	658	658	0.8381	0.8381
第12期計算期間末(平成16年10月25日)	638	638	0.8209	0.8209
第13期計算期間末(平成17年 4月25日)	637	637	0.8749	0.8749
第14期計算期間末(平成17年10月25日)	616	616	0.9932	0.9932
第15期計算期間末(平成18年 4月25日)	632	632	1.1261	1.1261
第16期計算期間末(平成18年10月25日)	687	687	1.2440	1.2440
第17期計算期間末(平成19年 4月25日)	771	771	1.3879	1.3879
第18期計算期間末(平成19年10月25日)	852	852	1.3905	1.3905
第19期計算期間末(平成20年 4月25日)	786	786	1.1804	1.1804
第20期計算期間末(平成20年10月27日)	457	457	0.6201	0.6201
第21期計算期間末(平成21年 4月27日)	545	545	0.6504	0.6504
第22期計算期間末(平成21年10月26日)	732	732	0.8247	0.8247
第23期計算期間末(平成22年 4月26日)	816	816	0.9016	0.9016

第24期計算期間末(平成22年10月25日)	730	730	0.7814	0.7814
第25期計算期間末(平成23年 4月25日)	808	808	0.8909	0.8909
第26期計算期間末(平成23年10月25日)	664	664	0.7384	0.7384
第27期計算期間末(平成24年 4月25日)	746	746	0.8362	0.8362
平成23年 5月末	784	-	0.8675	-
平成23年 6月末	759	-	0.8475	-
平成23年 7月末	727	-	0.8110	-
平成23年 8月末	657	-	0.7303	-
平成23年 9月末	612	-	0.6849	-
平成23年10月末	700	-	0.7776	-
平成23年11月末	643	-	0.7122	-
平成23年12月末	666	-	0.7368	-
平成24年 1月末	684	-	0.7605	-
平成24年 2月末	764	-	0.8456	-
平成24年 3月末	770	-	0.8649	-
平成24年 4月末	757	-	0.8485	-
平成24年 5月末	677	-	0.7561	-

（注）純資産総額は、百万円未満切捨て。

#### 【分配の推移】

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

	1口当たりの分配金(円)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	0.0000
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	0.0000
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	0.0000
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	0.0000
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	0.0000
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	0.0000
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	0.0000
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	0.0000
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	0.0000
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	0.0000
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	0.0000
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	0.0000
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	0.0000
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	0.0000
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	0.0000
第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	0.0000
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	0.0000
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	0.0000
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	0.0000
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	0.0000



## 「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Ｂコース（為替ヘッジなし）」

	1口当たりの分配金(円)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	0.0000
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	0.0000
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	0.0000
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	0.0000
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	0.0000
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	0.0000
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	0.0000
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	0.0000
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	0.0000
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	0.0000
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	0.0000
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	0.0000
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	0.0000
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	0.0000
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	0.0000
第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	0.0000
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	0.0000
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	0.0000
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	0.0000
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	0.0000

## 【収益率の推移】

## 「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Ａコース（為替ヘッジ付き）」

	収益率(%)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	22.0
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	0.7
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	11.3
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	10.7
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	3.6
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	5.4
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	5.4
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	11.5
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	2.8
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	6.9
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	0.2
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	10.1
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	33.8
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	2.2
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	25.5

第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	9.5
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	0.6
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	9.5
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	9.3
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	6.7

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

	収益率(%)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	22.2
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	0.0
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	4.6
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	12.5
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	2.1
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	6.6
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	13.5
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	13.4
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	10.5
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	11.6
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	0.2
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	15.1
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	47.5
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	4.9
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	26.8
第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	9.3
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	13.3
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	14.0
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	17.1
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	13.2

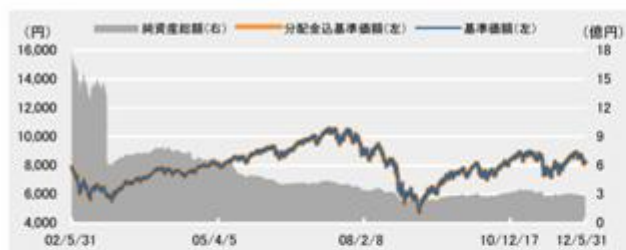
（注）収益率は、小数第2位を四捨五入しております。

(参考情報)

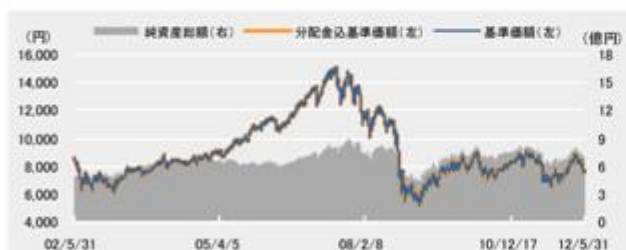
基準日：2012年5月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2002/5/31～2012/5/31)

## Aコース



## Bコース



※1 基準価額の推移は、信託報酬控除後の価額を表示しております。

※2 分配金込基準価額の推移は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

なお、分配金込基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しております。

## 分配の推移

## Aコース

1万口当たり、税引前	
2012年 4月	0 円
2011年10月	0 円
2011年 4月	0 円
2010年10月	0 円
2010年 4月	0 円
設定来累計	100 円

## Bコース

1万口当たり、税引前	
2012年 4月	0 円
2011年10月	0 円
2011年 4月	0 円
2010年10月	0 円
2010年 4月	0 円
設定来累計	50 円

## 主要な資産の状況

## マザーファンドにおける組入上位 10 銘柄

	銘柄	国	比率(%)
1	APPLE INC	アメリカ	2.6
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	1.8
3	MICROSOFT CORPORATION	アメリカ	1.0
4	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP.	アメリカ	1.0
5	AT&T INC	アメリカ	0.9
6	GENERAL ELECTRIC CO.	アメリカ	0.9
7	NESTLE SA-REG	スイス	0.9
8	CHEVRON CORP	アメリカ	0.9
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	0.8

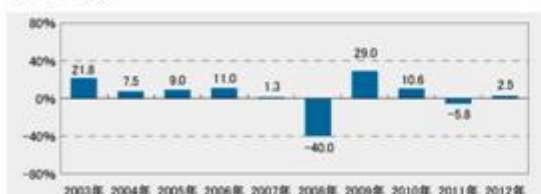
マザーファンドにおける  
国別構成比（上位 5 カ国）

国	比率(%)
アメリカ	55.0
イギリス	9.4
カナダ	5.1
スイス	4.0
オーストラリア	3.6

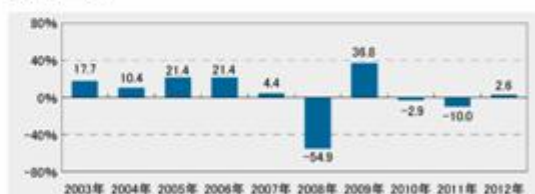
※ 比率はマザーファンドにおける組入比率です。

## 年間収益率の推移

## Aコース



## Bコース



※1 年間収益率の推移は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※2 2012年は5月末までの騰落率を表示しております。

(注1) 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証もしくは示唆するものではありません。

(注2) 最新の運用実績は、委託会社のホームページで開示されております。

**(4)【設定及び解約の実績】**

下記期間中の設定及び解約の実績は次の通りです。

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	249,363,562	81,382,035
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	66,295,127	1,223,636,308
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	62,851,879	98,751,605
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	52,175,888	66,517,862
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	35,331,917	172,098,908
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	30,460,201	93,453,948
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	21,045,184	243,559,545
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	15,253,700	110,994,424
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	12,749,495	61,085,261
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	27,042,786	38,954,600
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	16,992,080	57,504,904
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	10,654,548	9,496,955
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	15,665,874	15,360,726
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	20,161,446	24,257,442
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	30,445,401	30,677,723
第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	26,751,746	30,401,450
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	39,773,577	42,025,100
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	49,136,170	44,188,332
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	44,035,004	54,684,839
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	26,203,650	58,521,425

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 8期計算期間(平成14年 4月26日～平成14年10月25日)	193,044,366	31,422,049
第 9期計算期間(平成14年10月26日～平成15年 4月25日)	79,637,936	32,826,480
第10期計算期間(平成15年 4月26日～平成15年10月27日)	123,293,363	81,397,667
第11期計算期間(平成15年10月28日～平成16年 4月26日)	80,081,020	86,319,255
第12期計算期間(平成16年 4月27日～平成16年10月25日)	56,297,197	63,962,133
第13期計算期間(平成16年10月26日～平成17年 4月25日)	60,071,413	109,708,768
第14期計算期間(平成17年 4月26日～平成17年10月25日)	40,911,109	148,116,966
第15期計算期間(平成17年10月26日～平成18年 4月25日)	34,624,316	93,869,623
第16期計算期間(平成18年 4月26日～平成18年10月25日)	37,480,828	46,942,447
第17期計算期間(平成18年10月26日～平成19年 4月25日)	47,239,914	43,631,022
第18期計算期間(平成19年 4月26日～平成19年10月25日)	160,997,739	103,566,704
第19期計算期間(平成19年10月26日～平成20年 4月25日)	109,705,184	56,760,291
第20期計算期間(平成20年 4月26日～平成20年10月27日)	112,960,067	41,041,094
第21期計算期間(平成20年10月28日～平成21年 4月27日)	118,216,656	17,566,959
第22期計算期間(平成21年 4月28日～平成21年10月26日)	100,126,897	51,320,161

第23期計算期間(平成21年10月27日～平成22年 4月26日)	73,712,378	55,612,692
第24期計算期間(平成22年 4月27日～平成22年10月25日)	63,556,261	34,437,016
第25期計算期間(平成22年10月26日～平成23年 4月25日)	49,113,987	76,336,587
第26期計算期間(平成23年 4月26日～平成23年10月25日)	47,332,093	54,505,382
第27期計算期間(平成23年10月26日～平成24年 4月25日)	38,109,294	45,905,553

### 第3【ファンドの経理状況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期計算期間（平成23年10月26日から平成24年4月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）】

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,000	38,795
親投資信託受益証券	301,868,044	288,615,210
派生商品評価勘定	820,383	2,949,932
流動資産合計	302,691,427	291,603,937
資産合計	302,691,427	291,603,937
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,800,186	40,503
未払解約金	834,715	253,260
未払受託者報酬	160,611	156,425
未払委託者報酬	1,333,041	1,298,278
その他未払費用	152,897	148,917
流動負債合計	5,281,450	1,897,383
負債合計	5,281,450	1,897,383
純資産の部		
元本等		
元本	369,861,769	337,543,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	72,451,792	47,837,440
（分配準備積立金）	39,642,612	36,829,441
元本等合計	297,409,977	289,706,554
純資産合計	297,409,977	289,706,554
負債純資産合計	302,691,427	291,603,937

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
営業収益		
受取利息	23	2
有価証券売買等損益	57,017,784	40,696,343
為替差損益	27,431,345	19,123,481
営業収益合計	29,586,416	21,572,864
営業費用		
受託者報酬	160,611	156,425
委託者報酬	1,333,041	1,298,278
その他費用	152,897	148,917
営業費用合計	1,646,549	1,603,620
営業利益又は営業損失（ ）	31,232,965	19,969,244
経常利益又は経常損失（ ）	31,232,965	19,969,244
当期純利益又は当期純損失（ ）	31,232,965	19,969,244
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	3,167,325	2,346,431
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	43,182,696	72,451,792
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,381,417	11,543,804
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,381,417	11,543,804
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,584,873	4,552,265
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,584,873	4,552,265
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	72,451,792	47,837,440



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約の評価は、個別法に基づき、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物相場が発表されていない通貨については、対顧客相場の仲値によって計算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
1. 受益権の総数	369,861,769口	337,543,994口
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	72,451,792円	47,837,440円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8041円 (8,041円)	0.8583円 (8,583円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に対して年率0.19%以内の額	同左
2. 分配金の計算方法	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,389,160円)、収益調整金(71,493,376円)、分配準備積立金(37,253,452円)より、分配対象収益は、111,135,988円(1万口当たり3,004円)であります。今期は分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,109,265円)、収益調整金(67,840,245円)、分配準備積立金(33,720,176円)より、分配対象収益は、104,669,686円(1万口当たり3,100円)であります。今期は分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

項目	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンド及び主要投資対象である親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。 当ファンドが行うデリバティブ取引については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、委託先リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用委託先管理業務を行っております。	同左
-------------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (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。 (3)デリバティブ取引 (デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左
3. 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、市場価格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。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
親投資信託受益証券	52,529,663	34,510,949
合計	52,529,663	34,510,949

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

第26期計算期間(平成23年10月25日現在)					
区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超(円)			

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	159,367,104	-	158,558,400	808,704
	カナダドル	15,498,210	-	15,932,700	434,490
	ユーロ	38,465,163	-	39,223,700	758,537
	イギリスポンド	28,715,952	-	29,241,600	525,648
	スイスフラン	11,091,379	-	11,252,800	161,421
	スウェーデンクローナ	5,156,830	-	5,340,600	183,770
	オーストラリアドル	11,209,680	-	11,946,000	736,320
	香港ドル	3,637,679	-	3,626,000	11,679
	合計	273,141,997	-	275,121,800	1,979,803

区分	種類	第27期計算期間(平成24年4月25日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	179,254,573	-	177,636,620	1,617,953
	カナダドル	16,485,100	-	16,480,000	5,100
	ユーロ	40,360,437	-	39,548,960	811,477
	イギリスポンド	31,106,037	-	31,146,540	40,503
	スイスフラン	11,737,375	-	11,539,050	198,325
	スウェーデンクローナ	5,788,255	-	5,658,120	130,135
	オーストラリアドル	11,817,822	-	11,666,270	151,552
	香港ドル	4,063,550	-	4,028,160	35,390
	合計	300,613,149	-	297,703,720	2,909,429

(注1)時価の算定方法

1. 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。

為替予約の受渡日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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。

- ・当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後2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。
- ・当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 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、対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2)デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
元本の推移		
期首元本額	380,511,604	369,861,769
期中追加設定元本額	44,035,004	26,203,650
期中一部解約元本額	54,684,839	58,521,425

## (4)【附属明細表】

有価証券明細表

(ア)株式

該当事項はありません。

(イ)株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ドイチェ・世界株式インデックス・マザー	286,296,211	288,615,210	
合計		286,296,211	288,615,210	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

(3)注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項で記載しております。

## 【ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）】

## (1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,000	64,998
親投資信託受益証券	669,402,437	750,710,567
流動資産合計	669,455,437	750,775,565
資産合計	669,455,437	750,775,565
負債の部		
流動負債		
未払解約金	769,185	504,300
未払受託者報酬	371,642	369,934
未払委託者報酬	3,084,547	3,070,403
その他未払費用	353,880	352,253
流動負債合計	4,579,254	4,296,890
負債合計	4,579,254	4,296,890
純資産の部		
元本等		
元本	900,470,099	892,673,840
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	235,593,916	146,195,165
（分配準備積立金）	180,482,897	179,676,917
元本等合計	664,876,183	746,478,675
純資産合計	664,876,183	746,478,675
負債純資産合計	669,455,437	750,775,565

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
営業収益		
受取利息	16	24
有価証券売買等損益	133,434,399	92,264,029
営業収益合計	133,434,383	92,264,053
営業費用		
受託者報酬	371,642	369,934
委託者報酬	3,084,547	3,070,403
その他費用	353,880	352,253
営業費用合計	3,810,069	3,792,590
営業利益又は営業損失（ ）	137,244,452	88,471,463
経常利益又は経常損失（ ）	137,244,452	88,471,463
当期純利益又は当期純損失（ ）	137,244,452	88,471,463
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（ ）	5,367,879	2,736,479
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	98,994,471	235,593,916
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,141,737	12,087,354
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,141,737	12,087,354
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,864,609	8,423,587
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,864,609	8,423,587
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	235,593,916	146,195,165

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
1. 受益権の総数	900,470,099口	892,673,840口
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	235,593,916円	146,195,165円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7384円 (7,384円)	0.8362円 (8,362円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に対して年率0.19%以内の額	同左
2. 分配金の計算方法	計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,707,304円)、収益調整金(409,731,103円)、分配準備積立金(174,775,593円)より、分配対象収益は、590,214,000円(1万口当たり6,554円)であります。今期は分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,104,883円)、収益調整金(413,674,050円)、分配準備積立金(171,572,034円)より、分配対象収益は、593,350,967円(1万口当たり6,646円)であります。今期は分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	第26期計算期間 (自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	第27期計算期間 (自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンド及び主要投資対象である親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用業務を行っております。	同左
-------------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左
3. 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、市場価格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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
親投資信託受益証券	128,544,039	90,176,082
合計	128,544,039	90,176,082

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第26期計算期間 (平成23年10月25日現在)	第27期計算期間 (平成24年4月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
元本の推移		
期首元本額	907,643,388	900,470,099
期中追加設定元本額	47,332,093	38,109,294
期中一部解約元本額	54,505,382	45,905,553



**(4)【附属明細表】**

有価証券明細表

(ア)株式

該当事項はありません。

(イ)株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	ドイチェ・世界株式インデックス・マザー	744,678,670	750,710,567	
合計		744,678,670	750,710,567	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考情報）

当ファンドは「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、当ファンドの計算期間末日における同親投資信託の状況は次の通りです。

## 「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## (1)貸借対照表

区分	（平成23年10月25日現在）	（平成24年4月25日現在）
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,885,566	25,402,671
コール・ローン	9,944,116	7,611,709
株式	915,377,288	969,306,617
投資信託受益証券	191,343	221,021
投資証券	16,027,363	20,374,791
派生商品評価勘定	1,711,261	54,558
未収入金	103,394	26,241
未収配当金	1,128,328	2,234,313
未収利息	19	14
差入委託証拠金	7,941,517	15,146,070
流動資産合計	971,310,195	1,040,378,005
資産合計	971,310,195	1,040,378,005
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,078,585
未払金	922	1,265
流動負債合計	922	1,079,850
負債合計	922	1,079,850
純資産の部		
元本等		
元本	1,096,118,363	1,030,974,881
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	124,809,090	8,323,274
元本等合計	971,309,273	1,039,298,155
純資産合計	971,309,273	1,039,298,155
負債純資産合計	971,310,195	1,040,378,005

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券につきましては移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場)で評価しております。</p> <p>計算期間の末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、日本証券業協会の公社債店頭売買参考統計値、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引については、個別法に基づき、原則として、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場を用いております。</p> <p>(2)為替予約の評価は、個別法に基づき、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物相場が発表されていない通貨については、対顧客相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年10月25日現在)	(平成24年4月25日現在)
1. 受益権の総数	1,096,118,363口	1,030,974,881口
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	124,809,090円	-
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8861円 (8,861円)	1.0081円 (10,081円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成23年 4月26日 至 平成23年10月25日)	(自 平成23年10月26日 至 平成24年 4月25日)
1. 金融商品に対する取組方針	当親投資信託は証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。</p> <p>当親投資信託が行うデリバティブ取引については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスク、有価証券の価格変動リスク及び金利変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。</p>	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、委託先リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用委託先管理業務を行っております。	同左
-------------------	---	----

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成23年10月25日現在)	(平成24年4月25日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (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。 (3)デリバティブ取引 (デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左
3. 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、市場価格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。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	(平成23年10月25日現在)	(平成24年4月25日現在)
株式	96,961,060	56,005,089
投資信託受益証券	2,125	13,190
投資証券	1,087,416	1,865,945
合計	98,046,351	57,884,224

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (株式関連)

区分	種類	(平成23年10月25日現在)		
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)
				評価損益(円)

市場取引	株価指数先物取引 買建	29,051,407	-	30,762,667	1,711,261
	合計	29,051,407	-	30,762,667	1,711,261

区分	種類	(平成24年4月25日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	43,549,710	-	42,525,683	1,024,027
	合計	43,549,710	-	42,525,683	1,024,027

(注1)時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
2. 先物取引の評価においては、原則として、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(注2)デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	(平成23年10月25日現在)	(平成24年4月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
1. 元本の推移		
期首元本額	1,084,758,452	1,096,118,363
期中追加設定元本額	83,602,448	48,624,879
期中一部解約元本額	72,242,537	113,768,361
期末元本額	1,096,118,363	1,030,974,881
2. 元本の内訳		
ドイチェ・世界株式ファンド(インデックス連動型)		
Aコース(為替ヘッジ付き)	340,670,403	286,296,211
ドイチェ・世界株式ファンド(インデックス連動型)		
Bコース(為替ヘッジなし)	755,447,960	744,678,670

[次へ](#)

(3) 附属明細表  
有価証券明細表  
(ア) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	100	16.42	1,642.00	
	ANADARCO PETROLEUM CORP	270	72.09	19,464.30	
	APACHE CORP	190	91.26	17,339.40	
	ARCH COAL INC	110	9.64	1,060.40	
	BAKER HUGHES, INC	284	43.04	12,223.36	
	CABOT OIL & GAS CORP	100	29.60	2,960.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	180	49.01	8,821.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	350	17.77	6,219.50	
	CHEVRON CORP	1,067	103.03	109,933.01	
	CIMAREX ENERGY CO	50	65.25	3,262.50	
	CONCHO RESOURCES INC	25	98.70	2,467.50	
	CONOCOPHILLIPS	690	71.88	49,597.20	
	CONSOL ENERGY INC	140	33.55	4,697.00	
	DENBURY RESOURCES INC	200	18.08	3,616.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	230	66.79	15,361.70	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	30	67.91	2,037.30	
	EL PASO CORPORATION	436	28.99	12,639.64	
	ENERGEN CORP	70	46.85	3,279.50	
	EOG RESOURCES INC	130	104.45	13,578.50	
	EQT CORP	90	46.38	4,174.20	
	EXXON MOBIL CORP	2,654	86.31	229,066.74	
	FMC TECHNOLOGIES INC	120	47.62	5,714.40	
	HALLIBURTON CO	512	33.38	17,090.56	
	HELMERICH & PAYNE	50	52.77	2,638.50	
	HESS CORP	190	55.04	10,457.60	
	HOLLYFRONTIER CORP	100	29.78	2,978.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	2	76.30	152.60	
	MARATHON OIL CORP	380	29.39	11,168.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	190	40.26	7,649.40	
	MURPHY OIL CORP	120	52.91	6,349.20	
	NABORS INDUSTRIES LTD	150	15.95	2,392.50	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	194	78.02	15,135.88	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	100	33.71	3,371.00	
	NOBLE CORP	160	37.00	5,920.00	
	NOBLE ENERGY INC	100	93.98	9,398.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	450	88.22	39,699.00	
	PEABODY ENERGY CORP	150	29.95	4,492.50	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10	106.71	1,067.10	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	100	39.96	3,996.00	
	QEP RESOURCES INC	90	30.00	2,700.00	
	RANGE RESOURCES CORP	100	58.54	5,854.00	
	ROWAN COMPANIES INC	60	33.37	2,002.20	
	SCHLUMBERGER LTD.	726	72.71	52,787.46	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	220	28.21	6,206.20	
	SPECTRA ENERGY CORP	420	30.06	12,625.20	
	SUNOCO INC	100	40.02	4,002.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	100	18.18	1,818.00	
	VALERO ENERGY CORP	320	23.93	7,657.60	
	WEATHERFORD INTL LTD	460	14.14	6,504.40	
	WHITING PETROLEUM CORP	62	53.91	3,342.42	
	WILLIAMS COS INC	390	32.31	12,600.90	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	110	84.72	9,319.20	
	AIRGAS INC	50	89.23	4,461.50	
	ALCOA INC	630	9.66	6,085.80	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	30	40.33	1,209.90	
	BALL CORP	100	42.96	4,296.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	100	46.46	4,646.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30	181.40	5,442.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	70	66.42	4,649.40	
	CROWN HOLDINGS INC	100	37.04	3,704.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	620	34.63	21,470.60	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	540	52.68	28,447.20	

EASTMAN CHEMICAL CO	100	51.78	5,178.00
ECOLAB INC	160	62.11	9,937.60
FREEPORT-MCMORAN COPRER-B	520	36.99	19,234.80
INTERNATIONAL PAPER	248	32.82	8,139.36
LYONDELLBASELL INDU-CL A	100	44.09	4,409.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	40	81.58	3,263.20
MEADWESTVACO CORP	100	31.56	3,156.00
MONSANTO CO	286	75.57	21,613.02
MOSAIC CO/THE-WI	190	50.48	9,591.20
NEWMONT MINING CORPORATION	290	46.37	13,447.30
NUCOR CORP	180	38.90	7,002.00
OWENS-ILLINOIS INC	150	23.84	3,576.00
PPG INDUSTRIES INC	100	102.00	10,200.00
PRAXAIR INC.	180	112.43	20,237.40
SHERWIN WILLIAMS COMPANY	80	118.16	9,452.80
SIGMA-ALDRICH	60	70.40	4,224.00
UNITED STATES STEEL CORP	70	27.65	1,935.50
VULCAN MATERIALS CO	60	41.11	2,466.60
WALTER ENERGY INC	30	66.35	1,990.50
3M CO	370	88.49	32,741.30
AMETEK INC	50	48.51	2,425.50
BOEING CO	410	73.21	30,016.10
CATERPILLAR, INC	350	108.40	37,940.00
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	80	61.63	4,930.40
CUMMINS INC	120	116.04	13,924.80
DANAHER CORP	280	53.20	14,896.00
DEERE AND CO	160	80.98	12,956.80
DOVER CORPORATION	110	60.87	6,695.70
EATON CORP	180	48.46	8,722.80
EMERSON ELECTRIC CO.	410	50.91	20,873.10
FASTENAL CO	140	46.29	6,480.60
FLOWSERVE CORP	30	111.98	3,359.40
FLUOR CORP	120	57.48	6,897.60
GENERAL DYNAMICS CORPORATION	100	70.06	7,006.00
GENERAL ELECTRIC CO.	5,723	19.54	111,827.42
GOODRICH CORP	60	125.39	7,523.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	410	59.93	24,571.30
ILLINOIS TOOL WORKS, INC.	270	56.68	15,303.60
INGERSOLL-RAND PLC	160	41.46	6,633.60
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	40	42.88	1,715.20
JOY GLOBAL INC	50	71.77	3,588.50
KBR INC	80	33.75	2,700.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	80	69.85	5,588.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	180	91.13	16,403.40
MASCO CORP.	300	12.24	3,672.00
NORTHROP GRUMMAN CORPORATION	170	62.73	10,664.10
PACCAR INC	190	42.23	8,023.70
PARKER HANNIFIN CORP.	105	87.96	9,235.80
PENTAIR INC	100	44.05	4,405.00
PRECISION CASTPARTS CORP	80	172.48	13,798.40
QUANTA SERVICES INC	110	21.07	2,317.70
RAYTHEON COMPANY	220	52.98	11,655.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	90	77.40	6,966.00
ROCKWELL COLLINS	30	55.33	1,659.90
ROPER INDUSTRIES INC	50	98.80	4,940.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	76	72.65	5,521.40
TEXTRON, INC	160	26.64	4,262.40
TYCO INTERNATIONAL LTD	265	54.62	14,474.30
UNITED TECHNOLOGIES CORPORATION	500	79.85	39,925.00
WW GRAINGER INC	30	204.01	6,120.30
XYLEM INC	140	27.10	3,794.00
CINTAS CORPORATION	100	38.92	3,892.00
EQUIFAX INC	90	43.70	3,933.00
IRON MOUNTAIN INC	80	29.91	2,392.80
PITNEY-BOWES	130	16.95	2,203.50
REPUBLIC SERVICES INC	171	30.77	5,261.67
ROBERT HALF INTL INC	60	28.84	1,730.40
STERICYCLE INC	30	87.22	2,616.60

VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	100	47.77	4,777.00
WASTE MANAGEMENT INC	270	35.98	9,714.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	120	65.83	7,899.60
CSX CORPORATION	690	21.81	15,048.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	110	41.25	4,537.50
FEDEX CORP	190	88.94	16,898.60
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	134	14.56	1,951.04
KANSAS CITY SOUTHERN	100	75.09	7,509.00
NORFOLK SOUTHERN CORPORATION	190	70.22	13,341.80
SOUTHWEST AIRLINES CO.	300	8.02	2,406.00
UNION PACIFIC CORP	280	110.52	30,945.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	400	79.46	31,784.00
AUTOLIV INC	17	63.57	1,080.69
FORD MOTOR COMPANY	1,710	11.39	19,476.90
GENERAL MOTORS CO	394	22.89	9,018.66
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	100	11.19	1,119.00
HARLEY-DAVIDSON INC	130	50.36	6,546.80
JOHNSON CONTROLS INC.	400	31.02	12,408.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	49	43.39	2,126.11
COACH INC	190	71.87	13,655.30
DR HORTON INC	200	15.54	3,108.00
FOSSIL INC	27	126.08	3,404.16
GARMIN LTD	50	44.50	2,225.00
HASBRO INC	60	35.13	2,107.80
LEGGETT AND PLATT INC	100	23.36	2,336.00
LULULEMON ATHLETICA INC	48	70.18	3,368.64
MATTEL INC.	200	32.33	6,466.00
NEWELL RUBBERMAID INC	250	17.48	4,370.00
NIKE INC. CLASS B	230	106.75	24,552.50
RALPH LAUREN CORP	30	164.20	4,926.00
TOLL BROTHERS INC	100	23.51	2,351.00
VF CORP	50	147.01	7,350.50
WHIRLPOOL CORP	40	66.33	2,653.20
APOLLO GROUP INC-CL A	100	34.55	3,455.00
BLOCK H AND R INC	200	16.59	3,318.00
CARNIVAL CORP	240	31.96	7,670.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5	402.86	2,014.30
DARDEN RESTAURANTS INC	100	50.39	5,039.00
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	270	15.90	4,293.00
LAS VEGAS SANDS CORP	170	56.40	9,588.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	200	38.40	7,680.00
MCDONALD'S CORP	600	94.59	56,754.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	200	13.06	2,612.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	100	26.06	2,606.00
STARBUCKS CORP	380	58.05	22,059.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	120	56.85	6,822.00
WYNN RESORTS LTD	30	124.71	3,741.30
YUM! BRANDS INC	300	72.24	21,672.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	200	13.78	2,756.00
CBS CORP-CL B	315	32.55	10,253.25
COMCAST CORP CL-A	1,220	29.35	35,807.00
COMCAST CORPORATION SPECIAL CLASS A	410	28.93	11,861.30
DIRECTV-CLASS A	420	47.60	19,992.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	98	51.49	5,046.02
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	98	47.90	4,694.20
DISH NETWORK CORP-A	100	30.97	3,097.00
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES, INC.	300	10.88	3,264.00
LIBERTY GLOBAL INC-A	118	48.55	5,728.90
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	18	46.81	842.58
MCGRAW HILL COMPANIES INC.	190	47.70	9,063.00
NEWS CORP INC-CL A	914	19.23	17,576.22
NEWS CORP-CLASS B	224	19.55	4,379.20
OMNICOM GROUP	180	49.79	8,962.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	100	48.14	4,814.00
SIRIUS XM RADIO INC	2,018	2.19	4,419.42
TIME WARNER CABLE	184	80.94	14,892.96



TIME WARNER INC	456	36.42	16,607.52
VIACOM INC CLASS-B	295	46.13	13,608.35
VIRGIN MEDIA INC	200	23.84	4,768.00
WALT DISNEY CORPORATION	990	42.18	41,758.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	50	88.85	4,442.50
AMAZON COM INC	200	190.33	38,066.00
AUTOZONE INC	20	379.36	7,587.20
BED BATH & BEYOND INC	100	67.71	6,771.00
BEST BUY CO INC	230	21.70	4,991.00
CARMAX INC	150	30.93	4,639.50
DOLLAR GENERAL CORP	100	45.69	4,569.00
DOLLAR TREE INC	75	96.75	7,256.25
EXPEDIA INC	75	31.54	2,365.50
FAMILY DOLLAR STORES	70	66.11	4,627.70
GAMESTOP CORP-CLASS A	100	22.28	2,228.00
GAP INC.	255	27.19	6,933.45
GENUINE PARTS CO	100	62.77	6,277.00
HOME DEPOT INC	870	51.23	44,570.10
J.C. PENNEY CO INC	100	33.81	3,381.00
KOHL'S CORP	110	49.34	5,427.40
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	296	18.46	5,464.16
LIMITED BRANDS INC	160	48.17	7,707.20
LOWE'S COMPANIES	730	31.38	22,907.40
MACY'S INC	244	38.82	9,472.08
NETFLIX INC	30	87.68	2,630.40
NORDSTROM INC	80	53.93	4,314.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	100	95.00	9,500.00
PETSMART INC	100	56.57	5,657.00
PRICELINE.COM INC	20	685.01	13,700.20
ROSS STORES INC	120	59.32	7,118.40
STAPLES INC	395	15.25	6,023.75
TARGET CORP	330	56.73	18,720.90
TIFFANY & CO	30	65.93	1,977.90
TJX COMPANIES INC	420	40.25	16,905.00
URBAN OUTFITTERS INC	100	27.87	2,787.00
COSTCO WHOLESALE CORP	230	86.43	19,878.90
CVS CAREMARK CORP	750	43.42	32,565.00
KROGER COMPANY	300	23.31	6,993.00
SAFeway INC	180	21.63	3,893.40
SYSCO CORPORATION COM.	290	28.59	8,291.10
WAL-MART STORES INC.	1,070	57.77	61,813.90
WALGREEN COMPANY	530	35.24	18,677.20
WHOLE FOODS MARKET INC	100	82.05	8,205.00
ALTRIA GROUP INC	1,090	31.70	34,553.00
ARCHER DANIELS MIDLAND CO	404	30.94	12,499.76
BEAM INC	90	56.02	5,041.80
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	40	84.90	3,396.00
BUNGE LIMITED	80	66.25	5,300.00
CAMPBELL SOUP COMPANY	120	33.62	4,034.40
COCA-COLA ENTERPRISES	160	28.77	4,603.20
CONAGRA FOODS INC	250	25.87	6,467.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	100	21.49	2,149.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	134	40.32	5,402.88
GENERAL MILLS INC	360	38.64	13,910.40
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	69	44.60	3,077.40
HERSHEY FOODS CORP	140	66.00	9,240.00
HJ HEINZ CO	190	52.33	9,942.70
JM SMUCKER CO/THE	60	78.35	4,701.00
KELLOGG CO	170	50.43	8,573.10
KRAFT FOODS INC-A	962	38.36	36,902.32
LORILLARD INC	110	134.82	14,830.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	100	54.88	5,488.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO-A	100	80.90	8,090.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	90	41.52	3,736.80
MONSTER BEVERAGE CORP	100	62.87	6,287.00
PEPSICO INC.	827	66.51	55,003.77
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	980	86.17	84,446.60
REYNOLDS AMERICAN INC	240	39.65	9,516.00

SARA LEE CORP	420	21.71	9,118.20
THE COCA-COLA COMPANY	1,160	74.12	85,979.20
TYSON FOODS INC-CL A	200	17.93	3,586.00
AVON PRODUCTS INC.	220	21.64	4,760.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	100	49.82	4,982.00
CLOROX COMPANY	100	69.43	6,943.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	270	98.43	26,576.10
ESTEE LAUDER COMPANIES CLASS A	120	61.88	7,425.60
HERBALIFE LTD	100	69.10	6,910.00
KIMBERLY CLARK CORP. COM.	230	78.70	18,101.00
PROCTER & GAMBLE CO	1,537	67.00	102,979.00
AETNA INC	260	49.04	12,750.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	160	37.50	6,000.00
BARD (C.R.) INC	60	97.98	5,878.80
BAXTER INTERNATIONAL INC.	260	54.76	14,237.60
BECTON DICKINSON & COMPANY	130	76.06	9,887.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP.	1,055	6.05	6,382.75
CARDINAL HEALTH INC	190	41.24	7,835.60
CAREFUSION CORP	95	25.45	2,417.75
CERNER CORP	60	72.26	4,335.60
CIGNA CORPORATION	180	48.10	8,658.00
COVENTRY HEALTH CARE INC	130	33.17	4,312.10
COVIDIEN PLC	265	54.19	14,360.35
DAVITA INC	50	86.39	4,319.50
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	130	39.98	5,197.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	60	73.33	4,399.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	417	57.22	23,860.74
HCA HOLDINGS INC	100	26.86	2,686.00
HENRY SCHEIN INC	40	74.20	2,968.00
HOLOGIC INC	100	20.33	2,033.00
HUMANA INC	100	88.84	8,884.00
INTUITIVE SURGICAL INC	20	560.11	11,202.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	50	87.38	4,369.00
MCKESSON CORP	148	90.98	13,465.04
MEDTRONIC INC.	620	37.12	23,014.40
OMNICARE INC	100	34.61	3,461.00
QUEST DIAGNOSTICS	30	57.97	1,739.10
ST JUDE MEDICAL INC	210	37.89	7,956.90
STRYKER CORP	150	53.16	7,974.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	560	58.72	32,883.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	60	66.97	4,018.20
WELLPOINT INC	190	70.76	13,444.40
ZIMMER HOLDINGS INC	130	62.39	8,110.70
ABBOTT LABORATORIES	840	60.73	51,013.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	225	39.80	8,955.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	120	88.90	10,668.00
ALLERGAN INC	210	94.18	19,777.80
AMGEN INC	470	68.63	32,256.10
BIOGEN IDEC INC	70	127.74	8,941.80
BRISTOL MYERS SQUIBB CO.	930	33.97	31,592.10
CELGENE CORP	240	77.35	18,564.00
ELI LILLY & CO	540	39.96	21,578.40
FOREST LABORATORIES INC	160	33.54	5,366.40
GILEAD SCIENCES INC	400	52.36	20,944.00
HOSPIRA INC	120	34.54	4,144.80
JOHNSON & JOHNSON	1,540	63.77	98,205.80
LIFE TECHNOLOGIES CORP	90	46.29	4,166.10
MERCK & CO. INC.	1,709	38.27	65,403.43
MYLAN INC	260	21.94	5,704.40
PFIZER INC	4,289	22.63	97,060.07
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	170	52.74	8,965.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	100	36.59	3,659.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	100	16.68	1,668.00
WATERS CORP	70	81.80	5,726.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	100	68.60	6,860.00
BB&T CORPORATION	370	31.95	11,821.50
CIT GROUP INC	120	38.74	4,648.80
COMERICA INC.	100	31.87	3,187.00

FIFTH THIRD BANCORP	530	13.95	7,393.50
HUDSON CITY BANCORP INC	320	6.87	2,198.40
KEYCORP	470	8.03	3,774.10
M & T BANK CORP	50	86.61	4,330.50
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	210	13.19	2,769.90
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	180	12.40	2,232.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	282	65.57	18,490.74
REGIONS FINANCIAL CORP	700	6.45	4,515.00
SUNTRUST BANKS INC.	339	23.68	8,027.52
U.S. BANCORP	1,055	31.62	33,359.10
WELLS FARGO & COMPANY	2,840	33.07	93,918.80
AMERICAN EXPRESS COMPANY	540	57.63	31,120.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	120	52.45	6,294.00
BANK OF AMERICA CORP	5,367	8.21	44,063.07
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	654	23.24	15,198.96
BLACKROCK INC	70	188.57	13,199.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	230	54.36	12,502.80
CHARLES SCHWAB CORPORATION	550	13.85	7,617.50
CITIGROUP INC	1,622	33.42	54,207.24
CME GROUP INC	40	272.57	10,902.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	275	32.78	9,014.50
EATON VANCE CORP	100	26.25	2,625.00
FRANKLIN RESOURCES INC	100	121.16	12,116.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	270	114.11	30,809.70
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	30	130.36	3,910.80
INVESCO LTD	308	24.03	7,401.24
JP MORGAN CHASE&CO	2,030	43.28	87,858.40
LEGG MASON INC	70	25.53	1,787.10
LEUCADIA NATIONAL CORP	100	24.44	2,444.00
MOODY'S CORPORATION	140	41.62	5,826.80
MORGAN STANLEY	760	17.40	13,224.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	100	25.33	2,533.00
NORTHERN TRUST CORPORATION	110	46.42	5,106.20
NYSE EURONEXT	130	26.69	3,469.70
SLM CORP	320	14.97	4,790.40
STATE STREET CORP	300	45.22	13,566.00
T ROWE PRICE GROUP INC	160	61.95	9,912.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	130	18.38	2,389.40
ACE LTD	220	75.24	16,552.80
AFLAC INCORPORATED	290	42.00	12,180.00
ALLSTATE CORPORATION	270	32.81	8,858.70
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	300	32.40	9,720.00
AON PLC	170	50.62	8,605.40
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	100	33.90	3,390.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	420	79.79	33,511.80
CHUBB CORP	100	71.99	7,199.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	150	34.68	5,202.00
EVEREST RE GROUP LTD	30	94.61	2,838.30
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	300	6.04	1,812.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	200	20.37	4,074.00
LINCOLN NATIONAL CORPORATION	140	23.95	3,353.00
LOEWS CORP	200	40.24	8,048.00
MARSH & MCLENNAN COMPANIES	310	32.53	10,084.30
METLIFE INC	560	35.58	19,924.80
PARTNERRE LTD	45	67.07	3,018.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	200	28.26	5,652.00
PROGRESSIVE CORP	400	21.41	8,564.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	290	59.26	17,185.40
THE TRAVELERS COS INC	210	63.37	13,307.70
UNUM GROUP	170	23.44	3,984.80
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	90	36.20	3,258.00
WR BERKLEY CORP	130	37.39	4,860.70
XL GROUP PLC	239	21.26	5,081.14
CBRE GROUP INC	187	18.39	3,438.93
WEYERHAEUSER CO.	312	20.52	6,402.24
ACCENTURE PLC-CL A	320	62.82	20,102.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	300	12.44	3,732.00

ADOBE SYSTEMS INC	290	32.40	9,396.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	90	37.74	3,396.60
AUTODESK INC	100	38.71	3,871.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	270	54.73	14,777.10
BMC SOFTWARE INC	70	40.47	2,832.90
CA INC	300	26.31	7,893.00
CITRIX SYSTEMS INC	100	74.52	7,452.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	180	72.39	13,030.20
COMPUTER SCIENCES CORP	130	27.11	3,524.30
EBAY INC	630	39.30	24,759.00
ELECTRONIC ARTS INC	200	14.88	2,976.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	180	32.63	5,873.40
FISERV INC	30	69.05	2,071.50
GOOGLE INC-CL A	140	601.27	84,177.80
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP.	620	200.00	124,000.00
INTUIT INC	200	56.29	11,258.00
MASTERCARD INC-CLASS A	60	430.30	25,818.00
MICROSOFT CORPORATION	4,220	31.92	134,702.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	100	22.16	2,216.00
ORACLE CORP	2,185	28.69	62,687.65
PAYCHEX INC.	210	30.49	6,402.90
RED HAT INC	110	57.11	6,282.10
SAIC INC	200	12.03	2,406.00
SALESFORCE.COM INC	50	149.98	7,499.00
SYMANTEC CORP	480	16.01	7,684.80
TERADATA CORP	100	66.81	6,681.00
VERISIGN INC	100	41.26	4,126.00
VISA INC-CLASS A SHARES	250	118.93	29,732.50
VMWARE INC-CLASS A	30	103.48	3,104.40
WESTERN UNION CO	469	18.06	8,470.14
YAHOO INC	760	15.43	11,726.80
AMPHENOL CORP-CL A	90	56.52	5,086.80
APPLE INC	530	560.28	296,948.40
ARROW ELECTRONICS INC	100	39.99	3,999.00
AVNET INC	100	34.86	3,486.00
CISCO SYSTEMS INC	2,910	19.42	56,512.20
CORNING INC	950	13.35	12,682.50
DELL INC	970	16.18	15,694.60
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	50	37.53	1,876.50
EMC CORP/MASS	1,180	27.50	32,450.00
F5 NETWORKS INC	40	129.28	5,171.20
FLEXTRONICS INTL LTD	547	6.60	3,610.20
FLIR SYSTEMS INC	100	23.27	2,327.00
HARRIS CORPORATION	70	43.83	3,068.10
HEWLETT-PACKARD COMPANY	1,000	24.44	24,440.00
JUNIPER NETWORKS INC	360	21.63	7,786.80
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	176	38.14	6,712.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	201	48.66	9,780.66
NETAPP INC	240	38.68	9,283.20
QUALCOMM INC	930	61.86	57,529.80
SANDISK CORP	120	36.49	4,378.80
SEAGATE TECHNOLOGY	270	29.84	8,056.80
TE CONNECTIVITY LTD	275	34.50	9,487.50
WESTERN DIGITAL CORP	100	41.44	4,144.00
XEROX CORPORATION	730	7.92	5,781.60
AT&T INC	3,302	31.72	104,739.44
CENTURYLINK INC	333	37.94	12,634.02
CROWN CASTLE INTL CORP	130	55.00	7,150.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	567	4.12	2,336.04
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	100	22.41	2,241.00
METROPCS COMMUNICATIONS INC	100	7.96	796.00
NII HOLDINGS INC	90	18.85	1,696.50
SBA COMMUNICATIONS CORP CL A	100	51.53	5,153.00
SPRINT NEXTEL CORP	1,707	2.47	4,216.29
VERIZON COMMUNICATIONS	1,590	39.50	62,805.00
WINDSTREAM CORP	250	11.17	2,792.50
AES CORPORATION	390	12.14	4,734.60

	ALLIANT ENERGY CORP	100	44.68	4,468.00	
--	---------------------	-----	-------	----------	--

[次へ](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	AMEREN CORPORATION	170	31.93	5,428.10	
	AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	230	38.27	8,802.10	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	100	33.67	3,367.00	
	CALPINE CORP	200	18.07	3,614.00	
	CENTERPOINT ENERGY INC	300	19.53	5,859.00	
	CONSOLIDATED EDISON CO N.Y. INC.	190	58.73	11,158.70	
	DOMINION RESOURCES	332	50.81	16,868.92	
	DTE ENERGY COMPANY COM.	130	55.98	7,277.40	
	DUKE ENERGY CORP	710	21.18	15,037.80	
	EDISON INTERNATIONAL COMMON STOCK	220	43.10	9,482.00	
	ENTERGY CORP.	100	65.94	6,594.00	
	EXELON CORPORATION	501	37.94	19,007.94	
	FIRSTENERGY CORP	260	45.93	11,941.80	
	NEXTERA ENERGY INC	210	63.90	13,419.00	
	NISOURCE INC	100	24.33	2,433.00	
	NORTHEAST UTILITIES	100	36.41	3,641.00	
	NRG ENERGY INC	100	15.90	1,590.00	
	ONEOK INC	100	82.69	8,269.00	
	PG&E CORP	210	43.48	9,130.80	
	PINNACLE WEST CAPITAL	100	48.11	4,811.00	
	PPL CORPORATION	360	27.27	9,817.20	
	PROGRESS ENERGY INC	200	52.24	10,448.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	330	30.40	10,032.00	
	SCANA CORP	100	45.59	4,559.00	
	SEMPRA ENERGY	170	64.09	10,895.30	
	SOUTHERN COMPANY	460	45.87	21,100.20	
	WISCONSIN ENERGY CORP	120	35.84	4,300.80	
	XCEL ENERGY INC	270	26.71	7,211.70	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC COM.	261	7.31	1,907.91	
	ALTERA CORPORATION	160	34.01	5,441.60	
	ANALOG DEVICES	160	37.46	5,993.60	
	APPLIED MATERIALS INC	800	11.49	9,192.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	100	32.68	3,268.00	
	BROADCOM CORP-CL A	325	34.42	11,186.50	
	CREE INC	50	29.78	1,489.00	
	FIRST SOLAR INC	20	18.64	372.80	
	INTEL CORP	2,770	27.31	75,648.70	
	KLA-TENCOR CORP	100	51.63	5,163.00	
	LAM RESEARCH CORP	70	40.00	2,800.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	110	31.90	3,509.00	
	LSI CORP	300	8.03	2,409.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	400	14.72	5,888.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	200	26.73	5,346.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	100	34.57	3,457.00	
	MICRON TECHNOLOGY	550	6.51	3,580.50	
	NVIDIA CORP	300	12.82	3,846.00	
	TEXAS INSTRUMENTS, INC.	660	31.36	20,697.60	
	XILINX INC	170	33.53	5,700.10	
小計				6,944,694.09	
				(565,506,439)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	201	18.74	3,766.74	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	200	10.08	2,016.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	100	50.70	5,070.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	100	16.73	1,673.00	
	CAMECO CORP	200	21.16	4,232.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	650	31.30	20,345.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	300	20.78	6,234.00	
	CENOVUS ENERGY INC	400	34.13	13,652.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	100	42.38	4,238.00	
	ENBRIDGE INC	405	39.07	15,823.35	
	ENCANA CORP	400	17.65	7,060.00	
	ENERPLUS CORP	110	17.42	1,916.20	
	HUSKY ENERGY INC	123	24.04	2,956.92	

IMPERIAL OIL LTD.	200	44.94	8,988.00
MEG ENERGY CORP	100	37.65	3,765.00
NEXEN INC	282	19.00	5,358.00
NIKO RESOURCES LTD	20	38.63	772.60
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	200	27.90	5,580.00
PEMBINA PIPELINE CORP	100	29.52	2,952.00
PENGROWTH ENERGY CORP	202	8.51	1,719.02
PENN WEST PETROLEUM LTD	309	16.54	5,110.86
PRECISION DRILLING CORP	147	9.10	1,337.70
SUNCOR ENERGY INC	908	31.05	28,193.40
TALISMAN ENERGY INC	600	12.27	7,362.00
TOURMALINE OIL CORP	100	20.12	2,012.00
TRANSCANADA CORP	354	43.63	15,445.02
VERMILION ENERGY INC	100	45.40	4,540.00
AGNICO-EAGLE MINES	100	32.44	3,244.00
AGRIUM INC	100	84.14	8,414.00
BARRICK GOLD CORP	507	39.14	19,843.98
CENTERRA GOLD INC	146	11.80	1,722.80
ELDORADO GOLD CORP	280	13.15	3,682.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	300	19.94	5,982.00
FRANCO-NEVADA CORP	110	41.11	4,522.10
GOLDCORP INC	400	39.95	15,980.00
IAMGOLD CORP	180	11.81	2,125.80
IVANHOE MINES LTD	210	11.63	2,442.30
KINROSS GOLD CORP	655	8.72	5,711.60
NEW GOLD INC	207	9.06	1,875.42
OSISKO MINING CORP	256	9.52	2,437.12
PAN AMERICAN SILVER CORP	100	18.28	1,828.00
POTASH CORPORATION OF SASKATCHEWAN, INC.	464	42.03	19,501.92
SILVER WHEATON CORP	240	28.15	6,756.00
SINO-FOREST CORPORATION	100	4.81	481.00
TECK RESOURCES LTD-CL B	291	35.85	10,432.35
YAMANA GOLD INC	441	13.80	6,085.80
BOMBARDIER INC CLASS B	900	4.03	3,627.00
CAE INC	160	10.56	1,689.60
FINNING INTERNATIONAL INC	100	27.00	2,700.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	80	36.59	2,927.20
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	100	20.01	2,001.00
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	253	81.24	20,553.72
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	85	75.78	6,441.30
MAGNA INTERNATIONAL INC	100	43.89	4,389.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	50	26.64	1,332.00
TIM HORTONS INC	100	53.77	5,377.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	207	19.62	4,061.34
THOMSON REUTERS CORP	215	28.60	6,149.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	60	41.10	2,466.00
LOBLAW COMPANIES LTD	100	32.97	3,297.00
METRO INC	60	53.38	3,202.80
SHOPPERS DRUG MART CORP	147	42.03	6,178.41
WESTON (GEORGE) LTD	30	62.21	1,866.30
SAPUTO INC	70	45.49	3,184.30
VITERRA INC	300	15.91	4,773.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	100	55.26	5,526.00
BANK OF MONTREAL	325	59.10	19,207.50
BANK OF NOVA SCOTIA	621	54.17	33,639.57
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	203	73.43	14,906.29
NATIONAL BANK OF CANADA	100	77.28	7,728.00
ROYAL BANK OF CANADA	836	56.54	47,267.44
TORONTO-DOMINION BANK	450	82.46	37,107.00
IGM FINANCIAL INC	43	46.14	1,984.02
ONEX CORPORATION	50	37.22	1,861.00
TMX GROUP INC	100	44.34	4,434.00
GREAT WEST LIFECO INC	132	24.90	3,286.80
INTACT FINANCIAL CORP	100	61.40	6,140.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	990	13.16	13,028.40
POWER CORP OF CANADA	200	27.06	5,412.00

	POWER FINANCIAL CORP	200	29.59	5,918.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	300	24.36	7,308.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	300	31.94	9,582.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	200	17.86	3,572.00	
	CGI GROUP INC - CL A	130	20.54	2,670.20	
	RESEARCH IN MOTION	298	13.08	3,897.84	
	BCE INC	201	39.76	7,991.76	
	ROGERS COMMUNICATIONS CL B	200	39.02	7,804.00	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	70	57.78	4,044.60	
	FORTIS INC	100	33.27	3,327.00	
	TRANSALTA CORP	161	16.34	2,630.74	
小計				651,677.13	
				(53,724,262)	
ユーロ	COMPAGNIE GENERALE DE				
	GEOPHYSIQUE-VERITA	77	20.55	1,582.35	
	ENI SPA	1,225	16.32	19,992.00	
	FUGRO NV-CVA	23	52.36	1,204.28	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	120	10.85	1,302.60	
	OMV AG	90	24.53	2,207.70	
	REPSOL YPF S.A	437	14.15	6,183.55	
	SAIPEM	169	36.45	6,160.05	
	SBM OFFSHORE NV	176	13.20	2,323.20	
	TECHNIP S.A.	59	86.68	5,114.12	
	TENARIS SA	255	13.48	3,437.40	
	TOTAL SA	1,206	35.91	43,307.46	
	ACERINOX SA	83	8.96	743.68	
	AKZO NOBEL N.V	134	40.28	5,397.52	
	ARCELORMITTAL	504	12.61	6,355.44	
	ARKEMA	31	66.08	2,048.48	
	BASF SE	516	63.93	32,987.88	
	CRH PLC	404	15.02	6,068.08	
	HEIDELBERGCEMENT AG	75	40.70	3,052.50	
	K+S AG	95	36.01	3,420.95	
	KONINKLIJKE DSM NV	83	42.11	3,495.13	
	L'AIR LIQUIDE	166	95.71	15,887.86	
	LAFARGE	124	28.48	3,531.52	
	LANXESS AG	49	58.37	2,860.13	
	LINDE AG	104	122.40	12,729.60	
	SALZGITTER AG	24	37.65	903.72	
	SOLVAY SA	39	89.00	3,471.00	
	STORA ENSO OYJ-R	461	5.29	2,440.99	
	THYSSEN KRUPP AG	192	17.22	3,306.43	
	UMICORE	74	39.77	2,943.35	
	UPM-KEMMENE	310	8.89	2,757.45	
	VOESTALPINE AG	60	23.46	1,407.90	
	WACKER CHEMIE AG	12	57.33	687.96	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	125	13.55	1,693.75	
	ALSTOM	124	26.60	3,299.02	
	BEKAERT NV	27	21.00	567.00	
	BOSKALIS WESTMINSTER	63	27.14	1,709.82	
	BOUYGUES SA	107	20.85	2,230.95	
	BRENTAG AG	21	90.50	1,900.50	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	209	30.74	6,424.66	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	221	29.74	6,573.64	
	FERROVIAL SA	159	8.48	1,348.32	
	FIAT INDUSTRIAL	441	7.76	3,424.36	
	FINMECCANICA SPA	260	3.12	811.72	
	FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	65	12.51	813.15	
	GEA GROUP AG	132	24.60	3,247.20	
	HOCHTIEF AG	24	42.54	1,020.96	
	KONE OYJ-B	86	44.59	3,834.74	
	KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS				
	NV	550	14.94	8,217.00	
	LEGRAND SA	106	25.25	2,677.03	
	MAN SE	25	94.28	2,357.12	
	METSO OYJ	79	32.52	2,569.08	
	PRYSMIAN SPA	219	12.45	2,726.55	
	SAFRAN SA	120	25.91	3,109.20	



SCHNEIDER ELECTRIC SA	292	46.44	13,560.48
SIEMENS AG	420	69.80	29,316.00
THALES	48	25.54	1,226.16
VALLOUREC	68	43.25	2,941.34
VINCI SA	271	33.33	9,033.78
WARTSILA OYJ-B SHARES	106	29.70	3,148.20
WENDEL	20	55.27	1,105.40
ZARDOYA OTIS SA	97	9.28	900.16
BUREAU VERITAS SA	42	66.12	2,777.04
EDENRED	80	23.49	1,879.60
RANDSTAD HOLDING NV	51	24.99	1,274.49
SOCIETE BIC SA	26	73.95	1,922.70
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	302	11.14	3,365.79
ATLANTIA SPA	185	10.97	2,029.45
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	191	9.56	1,827.67
DEUTSCHE POST AG-REG	530	13.74	7,285.91
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	265	6.19	1,640.61
INTL CONSOLIDATED AIRLINES	541	2.06	1,117.70
RYANAIR HOLDINGS PLC	53	4.22	224.13
TNT EXPRESS NV - W/I	208	9.19	1,912.97
VOPAK	52	47.53	2,471.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	184	67.60	12,438.40
CONTINENTAL AG	44	68.95	3,033.80
DAIMLER AG	509	40.09	20,410.39
FIAT SPA	441	3.80	1,679.32
MICHELIN (CGDE)-B	105	53.75	5,643.75
NOKIAN RENKAAT OYJ	90	34.91	3,141.90
PEUGEOT SA	99	8.92	883.87
PIRELLI & C	282	8.88	2,505.57
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	87	40.84	3,553.51
RENAULT SA	120	34.58	4,150.20
VOLKSWAGEN AG	20	112.50	2,250.00
VOLKSWAGEN AG PREFERRED STOCK	90	123.78	11,140.20
ADIDAS AG	117	57.45	6,721.65
CHRISTIAN DIOR	30	108.70	3,261.00
LUXOTTICA GROUP SPA	114	26.23	2,990.22
LVMH MOET-HENNESSY LOUIS VUITTON	150	122.25	18,337.50
ACCOR	80	25.18	2,014.80
OPAP SA	160	6.83	1,092.80
SODEXO	50	60.27	3,013.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	51	26.35	1,343.85
JC DECAUX SA	72	20.58	1,481.76
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	43	46.06	1,980.79
LAGARDERE S.C.A.	55	21.46	1,180.30
MEDIASET SPA	596	1.67	1,000.68
PUBLICIS GROUPE	55	38.08	2,094.67
REED ELSEVIER NV	343	9.13	3,131.93
SES	168	17.70	2,973.60
WOLTERS KLUWER	179	13.17	2,357.43
INDITEX	134	68.63	9,196.42
PPR	42	116.05	4,874.10
CARREFOUR SA	326	14.94	4,872.07
CASINO GUICHARD PERRACHON	22	71.75	1,578.50
COLRUYT SA	11	29.52	324.72
DELHAIZE GROUP	62	35.94	2,228.28
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	326	3.53	1,151.43
JERONIMO MARTINS	125	15.09	1,886.25
KESKO OYJ-B SHS	62	23.34	1,447.08
KONINKLIJKE AHOLD NV	634	9.38	5,952.62
METRO AG	84	24.14	2,028.18
ANHEUSER-BUSCH INBEV	446	55.22	24,628.12
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	107	14.70	1,572.90
DANONE	286	53.94	15,426.84
HEINEKEN HOLDING NV	38	35.32	1,342.16
HEINEKEN NV	136	41.99	5,711.32
KERRY GROUP PLC-A	82	33.51	2,747.82
PERNOD-RICARD	105	78.87	8,281.35

UNILEVER NV-CVA	834	25.56	21,317.04
BEIERSDORF AG	61	51.76	3,157.36
HENKEL AG & CO KGAA	70	45.37	3,175.90
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	46	54.95	2,527.70
L'OREAL	137	91.75	12,569.75
ESSILOR INTERNATIONAL	113	65.78	7,433.14
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO	101	52.54	5,307.04
FRESENIUS SE & CO KGAA	64	73.11	4,679.04
BAYER AG	475	51.90	24,652.97
ELAN CORPORATION PLC	242	10.25	2,480.50
MERCK KGAA	46	82.49	3,794.81
ORION OYJ-CLASS B	90	15.02	1,351.80
QIAGEN N.V.	130	12.23	1,589.90
SANOFI	591	56.59	33,444.69
UCB SA	65	35.01	2,275.65
BANCA CARIGE SPA	799	0.80	639.20
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	1,153	0.24	278.79
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	2,475	5.15	12,746.25
BANCO DE SABADELL SA	502	1.75	882.01
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	608	0.56	344.73
BANCO ESPIRITO SANTO-RTS	608	0.28	170.84
BANCO POPOLARE SPA	957	1.06	1,021.11
BANCO POPULAR ESPANOL SA	575	2.31	1,329.97
BANCO SANTANDER SA	4,475	4.80	21,520.27
BANKIA SAU	443	2.52	1,118.13
BNP PARIBAS	559	29.24	16,345.16
CAIXABANK	695	2.51	1,747.92
COMMERZBANK AG	2,083	1.53	3,203.65
CREDIT AGRICOLE SA	632	3.65	2,309.96
ERSTE GROUP BANK AG	100	16.90	1,690.00
INTESA SANPAOLO	5,750	1.11	6,411.25
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	222	0	0
KBC GROUPE	95	13.97	1,327.15
NATIONAL BANK OF GREECE	527	1.64	864.28
NATIXIS	573	2.22	1,274.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	51	23.96	1,221.96
SOCIETE GENERALE-A	383	17.18	6,579.94
UNICREDIT SPA	2,350	2.90	6,824.40
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	416	2.50	1,041.66
DEUTSCHE BANK AG REG	543	33.37	18,119.91
DEUTSCHE BOERSE AG	104	45.76	4,759.04
EURAZEO	24	37.06	889.44
GROUPE BRAUXELLES LAMBERT SA	55	51.69	2,842.95
ING GROEP NV	2,144	5.31	11,393.21
MEDIOBANCA	320	3.58	1,145.60
AEGON NV	847	3.51	2,980.59
AGEAS	1,182	1.40	1,655.98
ALLIANZ SE	262	82.89	21,717.18
ASSICURAZIONI GENERALI	635	10.14	6,438.90
AXA	1,015	10.39	10,550.92
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	40	45.67	1,826.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	114	114.01	12,998.16
SAMPO OYJ-A SHS	238	19.84	4,721.92
SCOR SE	100	19.28	1,928.00
IMMOFINANZ AG	719	2.60	1,869.40
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	143	15.05	2,152.15
ATOS	45	44.18	1,988.10
CAP GEMINI SOGETI SA	90	28.68	2,581.20
DASSAULT SYSTEMES SA	38	68.80	2,614.40
SAP AG	511	49.42	25,254.64
ALCATEL-LUCENT	1,219	1.39	1,702.94
NOKIA OYJ	2,099	2.72	5,721.87
BELGACOM SA	107	22.16	2,371.65
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,620	8.56	13,873.68
ELISA OYJ	77	16.26	1,252.02
FRANCE TELECOM SA	1,063	10.23	10,879.80

	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	209	2.82	589.38	
	KONINKLIJKE KPN NV	714	6.90	4,926.60	
	MOBISTAR SA	25	33.28	832.12	
	PORTUGAL TELECOM, SA-REGISTERED SHARES	345	3.91	1,348.95	
	TELECOM ITALIA SPA	5,688	0.84	4,812.04	
	TELECOM ITALIA-RNC	3,712	0.69	2,561.28	
	TELEFONICA S.A	2,069	11.05	22,862.45	
	TELEKOM AUSTRIA AG	160	8.24	1,319.68	
	VIVENDI SA	753	13.15	9,901.95	
	ACCIONA SA	16	46.67	746.80	
	E.ON AG	1,025	16.88	17,302.00	
	ELECTRICITE DE FRANCE	140	15.44	2,162.30	
	ENAGAS	99	13.60	1,346.40	
	ENEL GREEN POWER SPA	614	1.24	765.04	
	ENEL SPA	3,793	2.47	9,399.05	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	1,011	2.11	2,138.26	
	FORTUM OYJ	247	16.40	4,050.80	
	GAS NATURAL SDG-E	219	10.63	2,327.97	
	GDF SUEZ	717	18.25	13,088.83	
	IBERDROLA SA	2,336	3.54	8,285.79	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	97	32.19	3,122.91	
	RWE AG	235	32.73	7,692.72	
	RWE AG-NON VTG PFD	33	30.72	1,013.76	
	SNAM SPA	862	3.54	3,053.20	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	145	10.27	1,489.15	
	TERNA SPA	705	2.80	1,976.82	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	214	10.45	2,236.30	
	VERBUND AG	50	20.59	1,029.50	
	ASML HOLDING NV	234	36.85	8,622.90	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	668	7.27	4,857.69	
	STMICROELECTRONICS NV	417	4.39	1,831.88	
小計				1,126,462.55	
イギリスポンド				(121,083,459)	
	AMEC PLC	149	11.07	1,649.43	
	BG GROUP PLC	1,930	14.07	27,155.10	
	BP PLC	10,531	4.36	45,978.34	
	PETROFAC LTD	157	17.45	2,739.65	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK	2,038	21.30	43,409.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,510	22.00	33,227.55	
	TULLOW OIL PLC	480	14.82	7,113.60	
	ANGLO AMERICAN PLC	759	23.08	17,517.72	
	ANTOFAGASTA PLC	243	11.69	2,840.67	
	BHP BILLITON PLC	1,161	19.17	22,256.37	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	140	5.47	765.80	
	FRESNILLO PLC	72	15.69	1,129.68	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	473	4.15	1,966.49	
	JOHNSON MATTHEY PLC	162	23.15	3,750.30	
	KAZAKHMYS PLC	114	8.57	977.55	
	LONMIN PLC	80	9.94	795.60	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	48	52.70	2,529.60	
	REXAM PLC	377	4.23	1,597.34	
	RIO TINTO PLC	714	34.15	24,383.10	
	VEDANTA RESOURCES PLC	71	11.75	834.25	
	XSTRATA PLC	1,198	11.49	13,765.02	
	BAE SYSTEMS PLC	1,897	2.91	5,525.96	
	BALFOUR BEATTY PLC	362	2.64	955.68	
	BUNZL PLC	338	10.21	3,450.98	
	COBHAM PLC	559	2.37	1,328.74	
	INVENSYS PLC	799	1.91	1,529.28	
	MEGGITT PLC	528	4.03	2,132.06	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,091	8.20	8,946.20	
	SMITHS GROUP PLC	228	10.48	2,389.44	
	WEIR GROUP PLC/THE	126	16.34	2,058.84	
	WOLSELEY PLC	142	23.12	3,283.04	
	AGGREKO PLC	140	22.46	3,144.40	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	363	8.33	3,023.79	

CAPITA PLC	322	6.82	2,197.65
EXPERIAN PLC	601	9.69	5,826.69
G4S PLC	689	2.80	1,929.20
INTERTEK GROUP PLC	97	25.43	2,466.71
SERCO GROUP PLC	304	5.39	1,638.56
GKN PLC	750	2.02	1,518.00
BURBERRY GROUP PLC	213	14.07	2,996.91
CARNIVAL PLC	118	19.64	2,317.52
COMPASS GROUP	1,138	6.47	7,362.86

[前へ](#) [次へ](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	213	14.45	3,077.85	
	WHITBREAD PLC	84	18.11	1,521.24	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	653	6.72	4,388.16	
	ITV PLC	2,728	0.84	2,299.70	
	PEARSON PLC	450	11.20	5,040.00	
	REED ELSEVIER PLC	600	5.26	3,156.00	
	WPP GROUP PLC	635	8.33	5,289.55	
	KINGFISHER PLC	1,588	2.96	4,714.77	
	MARKS AND SPENCER PLC	764	3.55	2,714.49	
	NEXT PLC	99	29.84	2,954.16	
	SAINSBURY (J) PLC	614	3.08	1,896.64	
	TESCO PLC	4,572	3.25	14,879.57	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	1,273	2.88	3,672.60	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	200	12.39	2,478.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,061	31.57	33,495.77	
	DIAGEO PLC	1,314	15.63	20,537.82	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	566	24.91	14,099.06	
	SABMILLER PLC	531	26.04	13,827.24	
	TATE & LYLE PLC	285	6.77	1,930.87	
	UNILEVER PLC	742	20.78	15,418.76	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	357	36.14	12,901.98	
	SMITH & NEPHEW PLC	434	6.07	2,634.38	
	ASTRAZENECA PLC	740	28.37	20,997.50	
	GLAXO SMITHKLINE	2,722	14.57	39,673.15	
	SHIRE PLC	283	20.12	5,693.96	
	BARCLAYS PLC	6,701	2.11	14,139.11	
	HSBC HOLDINGS PLC	9,507	5.53	52,621.24	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	23,236	0.30	7,052.12	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	9,799	0.23	2,283.16	
	STANDARD CHARTERED PLC	1,219	15.21	18,547.08	
	3I GROUP PLC	476	1.84	876.31	
	ICAP PLC	305	3.67	1,119.96	
	INVESTEC PLC	417	3.51	1,466.17	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	79	10.72	846.88	
	MAN GROUP PLC	1,159	0.97	1,124.23	
	SCHRODERS PLC	109	13.93	1,518.37	
	ADMIRAL GROUP PLC	127	12.12	1,539.24	
	AVIVA PLC	1,864	3.11	5,808.22	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,610	1.17	4,245.36	
	OLD MUTUAL PLC	2,610	1.46	3,826.26	
	PRUDENTIAL PLC	1,496	7.37	11,033.00	
	RESOLUTION LTD	810	2.20	1,786.86	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	1,855	1.02	1,901.37	
	STANDARD LIFE PLC	1,870	2.24	4,188.80	
	SAGE GROUP PLC (THE)	711	2.81	2,001.46	
	BT GROUP PLC	4,280	2.13	9,146.36	
	INMARSAT PLC	243	4.31	1,048.54	
	VODAFONE GROUP PLC	27,044	1.71	46,475.11	
	CENTRICA PLC	3,004	3.22	9,687.90	
	INTERNATIONAL POWER PLC	925	4.16	3,855.40	
	NATIONAL GRID PLC	2,047	6.67	13,663.72	
	SEVERN TRENT PLC	117	16.89	1,976.13	
	SSE PLC	551	13.38	7,372.38	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	326	6.22	2,027.72	
	ARM HOLDINGS PLC	800	5.31	4,252.00	
小計				799,128.75	
				(105,053,465)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	181	44.89	8,125.09	
	GIVAUDAN-REG	6	875.50	5,253.00	
	HOLCIM LTD-REG	128	54.05	6,918.40	
	SIKA AG-BR	2	1,872.00	3,744.00	
	SYNGENTA AG	57	316.40	18,034.80	
	ABB LTD	1,298	18.38	23,857.24	

	GEBERIT AG-REG	21	184.60	3,876.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	27	112.60	3,040.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	34	114.50	3,893.00	
	SULZER AG-REG	14	129.40	1,811.60	
	ADECCO SA REGISTER	72	43.88	3,159.36	
	SGS SA	4	1,737.00	6,948.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	37	108.40	4,010.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	289	55.00	15,895.00	
	THE SWATCH GROUP AG-BR	16	408.50	6,536.00	
	ARYZTA AG	68	45.45	3,090.60	
	NESTLE SA-REG	1,829	55.50	101,509.50	
	SONOVA HOLDING SG-REG	22	98.50	2,167.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	10	144.60	1,446.00	
	SYNTHES INC	19	156.60	2,975.40	
	ACTELION LTD-REG	62	32.15	1,993.30	
	LONZA GROUP AG-REG	37	41.40	1,531.80	
	NOVARTIS AG-REG SHS	1,269	50.15	63,640.35	
	ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN	388	166.50	64,602.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	661	23.55	15,566.55	
	GAM HOLDING LTD	111	11.70	1,298.70	
	JULIUS BAER GROUP LTD	111	34.67	3,848.37	
	UBS AG(REGISTERED)	2,107	11.33	23,872.31	
	BALOISE HOLDING AG	19	69.70	1,324.30	
	SWISS LIFE HOLDING AG	15	93.30	1,399.50	
	SWISS RE LTD	196	55.85	10,946.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	84	220.20	18,496.80	
	SWISSCOM AG	14	340.70	4,769.80	
小計				439,581.97	
スウェーデンクローナ				(39,320,607)	
	LUNDIN PETROLEUM AB	154	134.20	20,666.80	
	BOLIDEN AB	258	101.00	26,058.00	
	SSAB AB-A SHARES	100	58.65	5,865.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	350	102.40	35,840.00	
	ALFA LAVAL AB	200	131.20	26,240.00	
	ASSA ABLOY AB-B	200	195.60	39,120.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	400	162.10	64,840.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	210	143.00	30,030.00	
	SANDVIK AB	613	90.70	55,599.10	
	SCANIA AB-B SHS	220	132.60	29,172.00	
	SKANSKA AB-B SHS	200	108.30	21,660.00	
	SKF AB-B SHARES	200	162.00	32,400.00	
	VOLVO AB-B SHS	745	86.25	64,256.25	
	SECURITAS AB-B SHS	200	60.45	12,090.00	
	ELECTROLUX B-F	135	138.20	18,657.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	494	39.34	19,433.96	
	HENNES AND MAURITZ AB B-F	560	228.80	128,128.00	
	SWEDISH MATCH AB	53	268.00	14,204.00	
	GETINGE AB-B SHS	157	175.80	27,600.60	
	NORDEA BANK AB	1,465	56.60	82,919.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-AB	764	43.44	33,188.16	
	SVENSKA HANDELSBANKEN -A SHS	274	207.20	56,772.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	463	104.10	48,198.30	
	INVESTOR AB-B SHS	238	131.90	31,392.20	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	136	138.80	18,876.80	
	RATOS AB-B SHS	216	77.50	16,740.00	
	ERICSSON LM B-F	1,749	63.60	111,236.40	
	HEXAGON AB-B SHS	122	129.30	15,774.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	41	715.50	29,335.50	
	TELE 2 AB-B SHS	200	122.80	24,560.00	
	TELIASONERA AB	1,291	44.15	56,997.65	
小計				1,197,852.12	
ノルウェークローネ				(14,494,010)	
	AKER SOLUTIONS ASA	159	94.50	15,025.50	
	SEADRILL LTD	150	215.30	32,295.00	
	STATOIL ASA	608	151.80	92,294.40	
	SUBSEA 7 SA	161	146.90	23,650.90	
	NORSK HYDRO ASA	665	28.20	18,753.00	

小計	YARA INTERNATIONAL	100	264.90	26,490.00	
	ORKLA ASA	450	41.85	18,832.50	
	DNB ASA	545	69.60	37,932.00	
	TELENOR ASA	450	101.90	45,855.00	
デンマーククローネ				311,128.30	
				(4,424,244)	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	135	161.90	21,856.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	142	51.45	7,305.90	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - B	1	41,240.00	41,240.00	
	DSV A/S	163	120.80	19,690.40	
	CARLSBERG AS-B	55	480.40	26,422.00	
	COLOPLAST-B	15	972.50	14,587.50	
	NOVO-NORDISK A/S-B	235	836.00	196,460.00	
	DANSKE BANK A/S	338	91.20	30,825.60	
小計	TDC A/S	302	39.81	12,022.62	
				370,410.52	
オーストラリアドル				(5,352,432)	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	620	13.37	8,289.40	
	SANTOS LTD	526	13.75	7,232.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	357	34.63	12,362.91	
	WORLEYPARSONS LTD	105	28.27	2,968.35	
	ALUMINA LTD	1,647	1.16	1,918.75	
	AMCOR LTD.	854	7.47	6,379.38	
	BHP BILLITON LIMITED	1,689	35.08	59,250.12	
	BORAL LTD	610	3.75	2,287.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	919	5.81	5,339.39	
	ILUKA RESOURCES LTD	229	17.04	3,902.16	
	INCITEC PIVOT LTD	880	3.24	2,851.20	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	313	7.30	2,284.90	
	LYNAS CORP LTD	952	1.11	1,061.48	
	NEWCREST MINING LIMITED	468	26.60	12,448.80	
	ORICA LIMITED	190	26.62	5,057.80	
	OZ MINERALS LTD	286	9.42	2,694.12	
	RIO TINTO LIMITED	253	65.60	16,596.80	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	139	14.45	2,008.55	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	88	20.18	1,775.84	
	BRAMBLES LTD	1,044	7.14	7,454.16	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	65	67.26	4,371.90	
	ASCIANO LTD	403	4.67	1,882.01	
	QR NATIONAL LTD	921	3.63	3,343.23	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	353	5.80	2,047.40	
	CROWN LTD	260	8.96	2,329.60	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	333	4.53	1,508.49	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	356	2.81	1,000.36	
	FAIRFAX MEDIA LTD	2,207	0.72	1,589.04	
	METCASH LTD	641	3.96	2,538.36	
	WESFARMERS LIMITED	591	29.88	17,659.08	
	WOOLWORTHS LTD	610	25.84	15,762.40	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	298	12.50	3,725.00	
	COCHLEAR LTD	36	63.65	2,291.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	131	20.00	2,620.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	200	12.50	2,500.00	
	CSL LIMITED	301	37.26	11,215.26	
	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND				
	BANKING GROUP	1,417	23.72	33,611.24	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	182	7.49	1,363.18	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	806	51.15	41,226.90	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD.	1,290	25.17	32,469.30	
	WESTPAC BANKING CORP. LTD.	1,745	22.47	39,210.15	
	ASX LTD	82	32.19	2,639.58	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	186	28.40	5,282.40	
	AMP LIMITED	1,832	4.26	7,804.32	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,117	3.48	3,887.16	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	673	13.66	9,193.18	
	SUNCORP GROUP LTD	656	8.20	5,379.20	
	COMPUTERSHARE LTD	240	8.31	1,994.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD.	2,637	3.47	9,150.39	
	AGL ENERGY LTD	278	14.78	4,108.84	

小計				437,867.88	
ニュージーランドドル				(36,802,795)	
	FLETCHER BUILDING LTD	241	6.19	1,491.79	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	882	2.63	2,319.66	
小計				3,811.45	
香港ドル				(252,241)	
	HUTCHISON WHAMPOA	1,000	73.85	73,850.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,000	13.04	13,040.00	
	MTR CORP	1,021	27.05	27,618.05	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	621	22.30	13,848.30	
	SANDS CHINA LTD	1,200	30.90	37,080.00	
	SJM HOLDINGS LTD	1,000	16.82	16,820.00	
	WYNN MACAU LTD	800	23.30	18,640.00	
	LI & FUNG LTD	2,000	16.40	32,800.00	
	BANK OF EAST ASIA	1,253	29.05	36,399.65	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,500	23.10	57,750.00	
	HANG SENG BANK	400	104.10	41,640.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	600	127.70	76,620.00	
	AIA GROUP LTD	4,400	27.30	120,120.00	
	CHEUNG KONG	1,000	99.70	99,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,000	28.65	57,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	6	44.80	268.80	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	34.95	17,475.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	3,022	9.11	27,530.42	
	SINO LAND CO	2,215	13.44	29,769.60	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,032	94.70	97,730.40	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	500	88.40	44,200.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	1,000	45.00	45,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	1,000	66.25	66,250.00	
	HONG KONG AND CHINA GAS	2,930	19.98	58,541.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	500	57.15	28,575.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	200	103.20	20,640.00	
小計				1,159,206.62	
シンガポールドル				(12,160,077)	
	KEPPEL CORP LTD	1,100	11.26	12,386.00	
	NOBLE GROUP LTD	1,545	1.24	1,923.52	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	1,000	5.32	5,320.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD.	1,000	3.06	3,060.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	1,000	1.24	1,240.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	3,200	1.70	5,440.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,000	3.92	3,920.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	1,045	2.32	2,424.40	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	5,200	0.74	3,874.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,000	4.86	4,860.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,041	13.63	14,188.83	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,713	8.90	15,245.70	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,039	18.31	19,024.09	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,000	6.73	6,730.00	
	CAPITALAND LTD	1,500	2.95	4,425.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	1,000	1.57	1,570.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	5,150	3.14	16,171.00	
小計				121,802.54	
イスラエルシェケル				(7,961,014)	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	240	42.30	10,152.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	537	171.10	91,880.70	
	BANK HAPOLIM BM	811	14.05	11,394.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	917	11.80	10,820.60	
	NICE SYSTEMS LTD	70	143.50	10,045.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,417	6.11	8,664.95	
	CELLCOM ISRAEL LTD	70	45.68	3,197.60	
小計				146,155.40	
合計				(3,171,572)	
				969,306,617	
				(969,306,617)	



## (イ)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数/証券数	評価額	備考
投資信託受益証券	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100	2,681.00	
	計			2,681.00 (221,021)	
	小計			221,021 (221,021)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORP	230	14,611.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC.	590	9,540.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	61	8,816.94	
		BOSTON PROPERTIES INC	100	10,616.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	100	7,308.00	
		DUKE REALTY CORP	200	2,960.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	160	9,992.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	50	4,938.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	209	3,598.98	
		HCP INC	270	10,810.80	
		HEALTH CARE REIT INC	60	3,303.60	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	386	6,477.08	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	3,000	2,220.00	
		KIMCO REALTY CORP	215	4,061.35	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	100	3,596.00	
		MACERICH CO/THE	90	5,449.50	
		PLUM CREEK TIMBER CO	90	3,733.20	
		PROLOGIS INC	211	7,150.79	
		PUBLIC STORAGE	70	9,916.20	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	145	21,876.15	
		VENTAS INC	200	11,438.00	
		VORNADO REALTY TRUST	102	8,628.18	
	計			171,042.97 (13,928,029)	
	ユーロ	CORIO NV	51	1,738.08	
		FONCIERE DES REGIONS	17	974.78	
		KLEPIERRE	78	1,851.72	
		UNIBAIL RODAMCO SE	53	7,647.90	
	計			12,212.48 (1,312,719)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND COMPANY PLC	63	305.67	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	458	1,489.87	
		HAMMERSON PLC	258	1,075.86	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	558	4,031.55	
		SEGRO PLC	309	705.44	
	計			7,608.39 (1,000,198)	
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	2,193	4,177.66	
		DEXUS PROPERTY GROUP	2,600	2,392.00	
		GOODMAN GROUP	718	2,613.52	
		GPT GROUP	894	2,887.62	
		LEND LEASE GROUP	541	3,976.35	
		MIRVAC GROUP	1,673	2,133.07	
		STOCKLAND	1,200	3,744.00	
		TRANSURBAN GROUP	630	3,628.80	
		WESTFIELD GROUP	1,221	11,220.99	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	1,928	5,224.88	
	計			41,998.89 (3,530,006)	
	香港ドル	LINK REIT	1,069	33,139.00	
	計			33,139.00 (347,628)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,000	2,060.00	
		CAPITAMALL TRUST	1,000	1,860.00	
	計			3,920.00	

			(256,211)	
	小計		20,374,791 (20,374,791)	
合計			20,595,812 (20,595,812)	

(注)1.通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

3.外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 515銘柄 投資証券 22銘柄	54.4% -	- -	- 1.3%	58.5%
カナダドル	株式 90銘柄 投資信託 1銘柄 受益証券	5.2% -	- 0.0%	- -	5.5%
ユーロ	株式 217銘柄 投資証券 4銘柄	11.7% -	- -	- 0.1%	12.4%
イギリスポンド	株式 97銘柄 投資証券 5銘柄	10.1% -	- -	- 0.1%	10.7%
スイスフラン	株式 33銘柄	3.8%	-	-	4.0%
スウェーデンク ローナ	株式 31銘柄	1.4%	-	-	1.5%
ノルウェーク ローネ	株式 9銘柄	0.4%	-	-	0.4%
デンマークク ローネ	株式 9銘柄	0.5%	-	-	0.5%
オーストラリア ドル	株式 50銘柄 投資証券 10銘柄	3.5% -	- -	- 0.3%	4.1%
ニュージーラン ドドル	株式 2銘柄	0.0%	-	-	0.0%
香港ドル	株式 26銘柄 投資証券 1銘柄	1.2% -	- -	- 0.0%	1.3%
シンガポールド ル	株式 17銘柄 投資証券 2銘柄	0.8% -	- -	- 0.0%	0.8%
イスラエルシュ ケル	株式 7銘柄	0.3%	-	-	0.3%

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 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

(2)注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項で記載しております。

[前へ](#)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）」

（平成24年5月31日現在）

資産総額	279,839,008円
負債総額	552,654円
純資産総額( - )	279,286,354円
発行済数量	340,372,268口
1単位当たり純資産額( / )	0.8205円

「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）」

（平成24年5月31日現在）

資産総額	679,123,344円
負債総額	1,266,420円
純資産総額( - )	677,856,924円
発行済数量	896,568,084口
1単位当たり純資産額( / )	0.7561円

（参考情報）

「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」

（平成24年5月31日現在）

資産総額	947,228,271円
負債総額	2,909,130円
純資産総額( - )	944,319,141円
発行済数量	1,034,829,418口
1単位当たり純資産額( / )	0.9125円

## 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】

<訂正前>

##### (1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円（平成23年11月末現在）

発行する株式の総数

200,000株（平成23年11月末現在）

発行済株式総数

61,560株（平成23年11月末現在）

（以下略）

<訂正後>

##### (1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円（平成24年5月末現在）

発行する株式の総数

200,000株（平成24年5月末現在）

発行済株式総数

61,560株（平成24年5月末現在）

（以下略）

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

投信法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を行っています。

平成24年5月末現在、委託会社の運用するファンドは97本、純資産総額は503,995百万円です（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類別の本数及び純資産総額は下記の通りです。

種類			本数	純資産総額
公募	単位型	株式投資信託	1本	11,526百万円
	追加型	株式投資信託	75本	425,930百万円
私募	追加型	株式投資信託	21本	66,539百万円
合計			97本	503,995百万円

### 3【委託会社等の経理状況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

#### <更新・訂正後>

- 1．当社の財務諸表は、「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8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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により記載しております。

- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31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)【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
預金	2	3,461,482	2	5,405,779
前払費用		16,481		18,343
未収委託者報酬		1,227,958		893,246
未収運用受託報酬		61,588		42,463
未収投資助言報酬		121,273		65,848
未収収益		623,371		483,364
立替金		40,893		42,538
為替予約		7,697		9,613
その他流動資産		11,846		-
流動資産合計		5,572,593		6,961,199
固定資産				
無形固定資産				
ソフトウェア	1	27,652	1	17,303
無形固定資産合計		27,652		17,303
投資その他の資産				
投資有価証券		17,136		16,926
長期差入保証金		200		200
敷金		9,587		10,312
投資その他の資産合計		26,924		27,438
固定資産合計		54,576		44,742
資産合計		5,627,170		7,005,942

（単位:千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	53,383	105,165
未払収益分配金	3	3
未払償還金	1,508	1,508
未払手数料	620,771	449,694
その他未払金	29,195	63,043
未払費用	2 1,430,909	2 1,266,297
未払法人税等	20,480	20,093
未払消費税等	23,746	1,902
賞与引当金	83,172	57,021
為替予約	2,262	17,622
流動負債合計	2,265,433	1,982,354
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	761,885	796,757
長期未払費用	137,754	182,835
固定負債合計	899,640	979,592
負債合計	3,165,074	2,961,946
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	3,078,000	3,078,000
資本剰余金		
資本準備金	1,830,000	1,830,000
資本剰余金合計	1,830,000	1,830,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	2,446,030	863,920
利益剰余金合計	2,446,030	863,920
株主資本合計	2,461,969	4,044,079
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	126	83
評価・換算差額等合計	126	83
純資産合計	2,462,096	4,043,995
負債純資産合計	5,627,170	7,005,942

## (2)【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	6,874,850	6,658,303
運用受託報酬	242,541	206,509
投資助言報酬	144,695	97,851
その他営業収益	1,004,021	2,390,932
営業収益合計	8,266,109	9,353,596
営業費用		
支払手数料	3,418,352	3,479,040
広告宣伝費	130,384	167,121
公告費	1,160	1,160
調査費	88,485	93,973
委託調査費	505,644	439,257
情報機器関連費	215,429	153,277
委託計算費	47,083	181,578
通信費	12,492	8,966
印刷費	95,948	94,129
協会費	5,480	5,869
諸会費	236	998
諸経費	52,566	35,081
営業費用合計	4,573,264	4,660,455
一般管理費		
役員報酬	63,749	60,675
給料・手当	900,881	962,162
賞与	449,304	407,628
交際費	71,999	109,753
寄付金	139	397
旅費交通費	63,225	85,716
租税公課	20,524	27,248
不動産賃借料	197,519	185,062
退職給付費用	103,825	99,947
固定資産減価償却費	10,393	10,348
福利厚生費	253,086	231,130
業務委託費	1 742,189	1 803,486
退職金	2,461	4,256
諸経費	126,865	92,362
一般管理費合計	3,006,166	3,080,177
営業利益	686,678	1,612,964
営業外収益		
その他	9,667	1,628
営業外収益合計	9,667	1,628



営業外費用		
為替差損	7,321	20,698
その他	371	5,973
営業外費用合計	7,693	26,671
経常利益	688,653	1,587,920
特別利益		
前期損益修正益	1 2 91,903	-
特別利益合計	91,903	-
税引前当期純利益	780,556	1,587,920
法人税、住民税及び事業税	5,810	5,810
法人税等調整額	-	-
法人税等合計	5,810	5,810
当期純利益	774,746	1,582,110

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

		前事業年度 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日 )	当事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日 )
株主資本			
資本金			
	当期首残高	3,078,000	3,078,000
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期変動額合計	-	-
	当期末残高	3,078,000	3,078,000
資本剰余金			
資本準備金			
	当期首残高	1,830,000	1,830,000
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期変動額合計	-	-
	当期末残高	1,830,000	1,830,000
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金			
	当期首残高	3,220,776	2,446,030
	当期変動額		
	当期純利益	774,746	1,582,110
	当期変動額合計	774,746	1,582,110
	当期末残高	2,446,030	863,920
株主資本合計			
	当期首残高	1,687,223	2,461,969
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期純利益	774,746	1,582,110
	当期変動額合計	774,746	1,582,110
	当期末残高	2,461,969	4,044,079
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金			
	当期首残高	0	126
	当期変動額		
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	126	210
	当期変動額合計	126	210
	当期末残高	126	83
評価・換算差額等合計			
	当期首残高	0	126
	当期変動額		
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	126	210
	当期変動額合計	126	210
	当期末残高	126	83
純資産合計			
	当期首残高	1,687,223	2,462,096
	当期変動額		
	新株の発行	-	-
	当期純利益	774,746	1,582,110
	株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	126	210
	当期変動額合計	774,872	1,581,899
	当期末残高	2,462,096	4,043,995

## 重要な会計方針

### １．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) その他有価証券

##### 時価のあるもの

当事業年度末の市場価格等に基づく時価法（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）を採用しております。

### ２．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 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、社内における見込利用可能期間（５年）に基づく定額法を採用しております。

### ３．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

### ４．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、貸倒懸念債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。但し、当事業年度の計上額はありません。

#### (2) 賞与引当金

支給見込額の当期負担額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を翌期から費用処理することとしております。

また、役員の退職時に支出が予測される役員退職慰労金支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上し、退職給付引当金に含めて表示しております。

### ５．外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建の金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

### ６．リース取引の処理方法

リース取引開始日が平成20年３月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。

### ７．その他財務諸表のための基本となる重要な事項

#### (1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

## 追加情報

当事業年度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

## （貸借対照表関係）

- 1 無形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
ソフトウェア	61,002 千円	71,351 千円

- 2 各科目に含まれている関係会社に対するものは以下の通りであります。

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
預金	2,068,472 千円	3,699,915 千円
未払費用	212,332 千円	222,626 千円

## （損益計算書関係）

- 1 関係会社に対するものは次の通りであります。

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
業務委託費	165,915 千円	203,756 千円
前期損益修正益	91,903 千円	-

- 2 前事業年度の特別利益は関係会社に対する業務委託費の前期損益修正であります。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	61,560	-	-	61,560

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31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	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	61,560	-	-	61,560

## （リース取引関係）

リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引

（借主側）

## (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

（単位:千円）

	前事業年度（平成23年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
有形固定資産 （器具備品）	249,849	179,300	70,549
有形固定資産 （建物附属設備）	614,523	333,944	280,578
合計	864,372	513,244	351,127

（単位:千円）

	当事業年度（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
有形固定資産 （器具備品）	319,248	266,463	52,785
有形固定資産 （建物附属設備）	653,359	385,875	267,484
合計	972,608	652,339	320,269

## (2) 未経過リース料期末残高相当額

（単位:千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
1年以内	52,816	61,085
1年超	249,145	211,307
合計	301,962	272,392

## (3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位:千円）

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
支払リース料	57,542	71,463
減価償却費相当額	44,423	34,141
支払利息相当額	4,516	4,119

## (4) 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法

減価償却費相当額の算定方法

- ・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

- ・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

## （金融商品関係）

## 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

当社は顧客資産について投資助言・代理及び投資運用業務等を行っており、業務上必要と認められる場合以外は、自己勘定による資金運用は行っておりません。預金については全て決済性の当座預金であります。また、銀行借入や社債等による資金調達を行っておりません。

デリバティブについても、外貨建営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っており

ません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当座預金並びに営業債権である未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬及び未収収益は、取引先の信用リスクに晒されています。預金に関するリスクは、当社の社内規程に従い、取引先の信用リスクのモニタリングを行っており、営業債権に関するリスクは、取引先毎の期日管理及び残高管理を実施し、主要な取引先の信用状況を定期的に把握する体制としております。

投資有価証券は当社設定の投資信託に対するシードマネーであり、業務上の必要性から保有しているもので、主に短期の日本国債やコールローンで運用されており、市場価格の変動リスク、市場の流動性リスクは限定的であります。

外貨建営業債権及び債務は為替変動リスクに晒されており、通貨別に把握された為替の変動リスクに対して先物為替予約によりリスクの回避を実施しております。

デリバティブ取引の執行・管理については、社内規程に基づいて取引、記帳及び取引先との残高照合等を行っております。

営業債務に関する流動性リスクについては、経理部において資金繰りをモニタリングしております。

上記、信用、市場、為替リスクに関する事項は、社内規程に基づいて定期的に社内委員会に報告され、審議、検討を行っております。また、流動性リスクに関する事項につきましても逐次、社内担当役員に報告されております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	3,461,482	3,461,482	-
(2)未収委託者報酬	1,227,958	1,227,958	-
(3)未収運用受託報酬	61,588	61,588	-
(4)未収投資助言報酬	121,273	121,273	-
(5)未収収益	623,371	623,371	-
(6)投資有価証券 その他の有価証券	17,136	17,136	-
資産計	5,512,810	5,512,810	-
(1)未払手数料	620,771	620,771	-
(2)未払費用	1,430,909	1,430,909	-
(3)長期未払費用	137,754	137,754	-
負債計	2,189,436	2,189,436	-
デリバティブ取引（*1） ヘッジ会計が適用されていないもの	5,435	5,435	-
デリバティブ取引計	5,435	5,435	-

（\*1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	5,405,779	5,405,779	-
(2)未収委託者報酬	893,246	893,246	-
(3)未収運用受託報酬	42,463	42,463	-
(4)未収投資助言報酬	65,848	65,848	-
(5)未収収益	483,364	483,364	-
(6)投資有価証券 その他の有価証券	16,926	16,926	-
資産計	6,907,629	6,907,629	-
(1)未払手数料	449,694	449,694	-
(2)未払費用	1,266,297	1,266,297	-
(3)長期未払費用	182,835	182,835	-
負債計	1,898,827	1,898,827	-
デリバティブ取引（*1） ヘッジ会計が適用されていないもの	(8,009)	(8,009)	-

デリバティブ取引計	(8,009)	(8,009)	-
-----------	---------	---------	---

(\*)1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、( )で示しております。

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資 産

(1) 預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収投資助言報酬及び(5) 未収収益

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。

(6) 投資有価証券

投資有価証券は其他有価証券に区分されており、時価については、基準価額によっております。

また、有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照下さい。

#### 負 債

(1) 未払手数料及び(2) 未払費用

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) 長期未払費用

時価については、支払見込額に基づく現在価値によっております。

#### デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照下さい。

(注) 2. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超
預金	3,461,482	-	-
未収委託者報酬	1,227,958	-	-
未収運用受託報酬	61,588	-	-
未収投資助言報酬	121,273	-	-
未収収益	623,371	-	-
投資有価証券			
その他の有価証券	-	10	15,014
合計	5,495,674	10	15,014

当事業年度（平成24年3月31日）

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超
預金	5,405,779	-	-
未収委託者報酬	893,246	-	-
未収運用受託報酬	42,463	-	-
未収投資助言報酬	65,848	-	-
未収収益	483,364	-	-
投資有価証券			
その他の有価証券	-	10	16,916
合計	6,890,703	10	16,916

#### (有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日）

(単位:千円)

	種類	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	17,010	17,136	126

合計	17,010	17,136	126
----	--------	--------	-----

当事業年度（平成24年3月31日）

(単位:千円)

	種類	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	15,010	15,036	26
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	2,000	1,889	110
合計		17,010	16,926	83

## 2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

(単位:千円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	990	0	-
合計	990	0	-

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

ヘッジ会計が適用されていないもの

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物は通貨のみであり、貸借対照表日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

前事業年度（平成23年3月31日）

通貨関連（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

(単位:千円)

区分		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	313,284	-	2,262	2,262
	買建 米ドル	23,055	-	478	478
	ユーロ	299,680	-	7,219	7,219
合計		636,019	-	5,435	5,435

当事業年度（平成24年3月31日）

通貨関連（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

(単位:千円)

区分		契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	694,468	-	7,488	7,488
	買建 米ドル	436,620	-	10,134	10,134
	ユーロ	506,097	-	9,257	9,257
	シンガポールドル	30,080	-	355	355
合計		1,667,267	-	8,009	8,009



## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

当社は、退職一時金制度と確定拠出年金制度を採用しております。加えて、一部の従業員を対象とした特別慰労金制度を採用しております。

## 2．退職給付債務に関する事項

（単位:千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
(1) 退職給付債務	190,482	235,824
(2) 年金資産	-	-
(3) 未積立退職給付債務 (1)+(2)	190,482	235,824
(4) 会計基準変更時差異の未処理額	-	-
(5) 未認識数理計算上の差異	6,364	28,233
(6) 貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5)	184,118	207,590
(7) 特別退職慰労引当金	577,767	589,166
(8) 退職給付引当金 (6)+(7)	761,885	796,757

## 3．退職給付費用に関する事項

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
(1) 勤務費用	38,571	36,912
(2) 利息費用	2,940	3,167
(3) 期待運用収益（減算）	-	-
(4) 会計基準変更時差異の費用処理額	-	-
(5) その他（退職給付債務の対象外の退職費用）	49,178	45,965
(6) 数理計算上の差異の費用処理額	1,185	1,509
退職給付費用小計	91,875	87,556
(7) 割増退職金	11,950	12,391
退職給付費用合計	103,825	99,947

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## (1) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

## (2) 割引率

前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
1.70%	1.40%

## (3) 数理計算上の差異の処理年数

5年

## （税効果会計関係）

## 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

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	33,851 千円	21,674 千円
未払費用	638,446 千円	574,778 千円
未払事業税	5,970 千円	5,429 千円
退職給付引当金	310,087 千円	302,847 千円
税務上の繰越欠損金	762,752 千円	64,911 千円
減価償却超過額	49,109 千円	46,358 千円
その他	975 千円	513 千円
繰延税金資産小計	1,801,193 千円	1,016,512 千円
評価性引当金	1,801,193 千円	1,016,512 千円
繰延税金資産合計	-	-
繰延税金資産の純額	-	-

## 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要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
法定実効税率	40.7 %	40.7 %
(調整)		
交際費否認額	3.8 %	2.8 %
役員賞与否認額	4.2 %	1.4 %
評価性引当金	48.6 %	44.9 %
住民税均等割	0.7 %	0.4 %
その他	0.0 %	0.1 %
税効果会計適用後の法人税の負担率	0.7 %	0.4 %

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は資産運用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

前事業年度（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
- 当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。
- 3．主要な顧客ごとの情報
- 当社の主要な顧客は一般投資家であり、損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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
- 当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。
- 3．主要な顧客ごとの情報
- 当社の主要な顧客は一般投資家であり、損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため、記載を省略しております。

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

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

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

該当事項はありません。

関連当事者情報

- 1．関連当事者との取引
- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

前事業年度（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	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	Deutsche Bank Aktiengesellschaft	ドイツ フランク フルト	2,379,519 千ユーロ	銀行業	(被所有) 間接100%	資金預入、 サービスの提供	*1 資金の預入 *2 マネージメン トサービス *3 IT、管理部門 サービス	- 預金 46,011 未払費用 37,866	2,068,472 212,332
-----	----------------------------------	--------------------	-------------------	-----	-----------------	------------------	--	-------------------------------	----------------------

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等 の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	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	Deutsche Bank Aktiengesellschaft	ドイツ フランク フルト	2,379,519 千ユーロ	銀行業	(被所有) 間接100%	資金預入、 サービスの提供	*1 資金の預入 *3 IT、管理部門 サービス	- 預金 219,712 未払費用	預金 未払費用	3,699,915 222,626

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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

- \*1 当座預金口座を開設しております。
- \*2 当該会社とのサービス契約に基づき、マネージメント部門に関連した費用の計上を行っております。
- \*3 当該会社とのサービス契約ないし、当社のIT環境、総務購買部門等の管理部門業務に関連し支出した費用の計上を行っております。

(2) 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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等 の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	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	ドイツ証券株式会社	東京都 千代田区	72,728 百万円	証券業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*1 IT、管理部門 サービス	400,146 未払費用	未払費用	538,728
同一の親会社を持つ会社	Deutsche Asset Management (UK) Limited	英国 ロンドン	21,000 千ポンド	投資 運用業	なし	投資一任、助言契約 サービスの提供	*2 投資助言報酬	66,974 未収収益	未収収益	85,394
同一の親会社を持つ会社	ドイツ銀不動産 有限会社	東京都 千代田区	46 百万円	不動産 管理業	なし	サービスの提供	*3 不動産賃借料	198,795 未払費用	未払費用	84,214
同一の親会社を持つ会社	Deutsche Investment Management Americas Inc.	米国 ウィルミントン	10 ドル	投資 運用業	なし	投資一任、助言契約 サービスの提供	*3 委託調査	84,750 未払費用	未払費用	71,301
同一の親会社を持つ会社	RREEF America L.L.C.	米国 ウィルミントン	10 千ドル	投資 運用業	なし	サービスの提供	*4 その他営業 収益	615,300 未収収益	未収収益	383,670
同一の親会社を持つ会社	DWS Investment GmbH	ドイツ フランクフルト	115,000 千ユーロ	投資 運用業	なし	投資一任、助言契約 サービスの提供	*4 その他営業 収益 *3 委託調査	234,965 未収収益 296,182 未払費用	未収収益 未払費用	161,186 190,052
同一の親会社を持つ会社	Deutsche Asset Management International GmbH	ドイツ フランクフルト	8,000 千ユーロ	投資 運用業	なし	投資一任、助言契約 サービスの提供	*3 委託調査	83,835 未払費用	未払費用	38,487

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は職業	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	ドイツ証券株式会社	東京都千代田区	72,728 百万円	証券業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*1 IT、管理部門 サービス	409,942	未払費用	553,130
同一の親会社を持つ会社	ドイツ銀不動産 有限会社	東京都千代田区	46 百万円	不動産 管理業	なし	サービスの提供 役員の兼任	*3 不動産賃借料	182,840	未払費用	79,079
同一の親会社を持つ会社	RREEF America L.L.C.	米国 ウィルミントン	10 千ドル	投資 運用業	なし	サービスの提供	*4 その他営業 収益	1,987,975	未収収益	399,469
同一の親会社を持つ会社	DWS Investment GmbH	ドイツ フランクフルト	115,000 千ユーロ	投資 運用業	なし	運用の再委託 サービスの提供	*3 委託調査 *4 その他営業 収益	270,502 176,515	未払費用 未収収益	111,010 45,349
同一の親会社を持つ会社	DWS Investment S.A.	ルクセンブルク	30,677 千ユーロ	投資 運用業	なし	サービスの提供	*4 その他営業 収益 *5 運用受託報酬	102,699 54,782	- -	- -

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。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- \*1 当該会社とのサービス契約ないし、当社のIT環境、総務購買部門等の管理部門業務に関連し支出した費用の計上を行っております。
- \*2 当該会社との契約に基づき、予め定められた料率で計算された投資助言報酬を受け取っております。
- \*3 当該会社とのサービス契約に基づき、発生した費用の計上を行っております。
- \*4 当該会社とのサービス契約に基づき、予め定められた料率で計算された収益の計上を行っております。
- \*5 当該会社との契約に基づき、予め定められた料率で計算された収益の計上を行っております。

## 2. 親会社に関する注記

### (1) 親会社情報

Deutsche Bank Aktiengesellschaft フランクフルト証券取引所に上場

ニューヨーク証券取引所に上場

#### (1株当たり情報)

項目	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	39,995.06 円	65,691.94 円
1株当たり当期純利益金額	12,585.22 円	25,700.29 円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

項目	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益金額(千円)	774,746	1,582,110
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株主に係る当期純利益金額(千円)	774,746	1,582,110
期中平均株式数(株)	61,560	61,560

## 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】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

#### <更新・訂正後>

##### 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### <参考>再信託受託会社の概要

名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 51,000百万円（平成24年3月末現在）

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

関係業務の概要 受託会社より委託を受け、当ファンドの信託事務の一部（信託財産の管理等）を行います。

##### 販売会社

名称	資本金の額	事業の内容
株式会社三井住友銀行 <sup>1</sup>	1,770,996百万円 （平成24年3月末現在）	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社広島銀行 <sup>1</sup>	54,573百万円 （平成24年3月末現在）	
株式会社北海道銀行	93,524百万円 （平成24年3月末現在）	
日本生命保険相互会社	1,200,000百万円 <sup>2</sup> （平成24年3月末現在）	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937百万円 （平成24年3月末現在）	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。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円 （平成24年3月末現在）	
野村證券株式会社 <sup>1</sup>	10,000百万円 （平成24年3月末現在）	
SMBC日興証券株式会社	10,000百万円 （平成24年3月末現在）	
楽天証券株式会社	7,495百万円 （平成24年3月末現在）	

<sup>1</sup> 新規申込みの取扱いを行いません。

<sup>2</sup> 日本生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金及び基金償却積立金の合計額を記載しています。

##### 投資顧問会社

名称 ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社

資本金の額 495百万円（平成24年5月末現在）

事業の内容 金融商品取引法に定める投資運用業、投資助言・代理業及び第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

<訂正前>

（前略）

投資顧問会社

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、Aコースの為替ヘッジに関する運用指図及びマザーファンドの運用指図等を行います。

<訂正後>

（前略）

投資顧問会社

委託会社から運用の指図に関する権限の委託を受け、Aコースの為替ヘッジに係る運用指図及びマザーファンドの運用指図等を行います。

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月6日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫  
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」に掲げられているドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）の平成23年10月26日から平成24年4月25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。

#### 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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

#### 監査意見

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、ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Aコース（為替ヘッジ付き）の平成24年4月25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。

#### 利害関係

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

以上

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

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成24年 6 月 6 日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫  
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」に掲げられているドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）の平成23年10月26日から平成24年4月25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。

#### 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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

#### 監査意見

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、ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）Bコース（為替ヘッジなし）の平成24年4月25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。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月14日

ドイチェ・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      野 島 浩 一 郎  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているドイチェ・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28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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監査を行った。

### 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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

### 監査意見

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、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績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。

### 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、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。

[前へ](#)