

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成21年7月27日

【計算期間】 第21期（自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日）

【ファンド名】 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）

【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

【連絡場所】 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

【電話番号】 03(5156)5000

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、ドイチェ・世界株式インデックス・マザー（以下、「マザーファンド」という場合があります。）への投資を通じて主として日本を除く世界主要各国の株式に積極的に分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

信託金の限度額

各ファンドについて2,000億円を限度とします。

ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

基本的性格

当ファンドの商品分類および属性区分は以下の通りです。

<商品分類表>

Aコース/Bコース共通

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) | 独立区分 | 補足分類 |
|-------------|--------|---------------------------|-------------------|---------|
| 単位型投信 | 国内 | 株式 | MMF MRF ETF | インデックス型 |
| | 海外 | 債券 | | |
| 追加型投信 | 内外 | 不動産投信 その他資産() 資産複合 | | |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

<商品分類の定義について>

社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づく定義は以下の通りです。

1. 「単位型投信・追加型投信」の区分のうち、「追加型投信」とは、一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
2. 「投資対象地域」の区分のうち、「海外」とは、目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
3. 「投資対象資産（収益の源泉）」の区分のうち、「株式」とは、目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
4. 「補足分類」の区分のうち、「インデックス型」とは、目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

なお、上記は当ファンドに該当する分類について記載したものです。上記以外の商品分類の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

<属性区分表>

Aコース

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ | 対象インデックス | 特殊型 |
|--------|------|--------|------|-------|----------|-----|
|--------|------|--------|------|-------|----------|-----|

4. 「投資形態」の区分のうち、「ファミリーファンド」とは、目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
5. 「為替ヘッジ」の区分のうち、「あり」とは、目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいい、「なし」とは、目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
6. 「対象インデックス」の区分のうち、「その他」とは、日経225、T O P I Xにあてはまらないすべてのものをいいます。

なお、上記は当ファンドに該当する属性について記載したものです。上記以外の属性区分の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

ファンドの特色（以下は、ファンドが主として投資を行うマザーファンドの特色を含みます。）

1. ドイチェ・世界株式インデックス・マザーへの投資を通して、主に日本を除く世界主要各国の株式に投資し、Aコース（為替ヘッジ付き）についてはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）に連動した投資成果を、Bコース（為替ヘッジなし）についてはMSCIコクサイ指数（円ノーヘッジ・ベース）に連動した投資成果を目指すインデックス・ファンドです。
2. Aコース（為替ヘッジ付き）については実質外貨建資産 に対して、原則として対円での為替ヘッジを行います。

「実質外貨建資産」とは、ファンドに属する外貨建資産とマザーファンドに属する外貨建資産のうちファンドに属するとみなした額（ファンドに属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額をいいます。以下同じ。

 - ・MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）に連動した運用成果を目指します。
 - ・為替変動リスクの低減を図りますので、為替変動による基準価額への影響は軽減されます。ただし、ヘッジコストを考慮し、他通貨による為替ヘッジの手法等を用いる場合があり、この場合は為替リスクが一部残ります。
 - ・為替ヘッジを行う通貨の国の金利が日本の金利に比べて高い場合は、その金利差相当分のヘッジコストがかかりますので、そのコスト分が株式の投資成果から差し引かれることとなります。
3. Bコース（為替ヘッジなし）については実質外貨建資産に対して、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
 - ・MSCIコクサイ指数（円ノーヘッジ・ベース）に連動した運用成果を目指します。
 - ・原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動により基準価額が大きく変動することがあります。
 - ・解約時や償還時の為替水準が、買付時と比較して円安であれば、株式の投資成果に加えて為替差益を享受していただけます。
 - ・一方、解約時や償還時の為替水準が、買付時と比較して円高であれば、株式の投資成果から為替差損が差し引かれることとなります。

MSCIコクサイ指数 とは？

MSCIコクサイ指数とは、MSCIインク（以下「MSCI」といいます。）が開発した株価指数です。

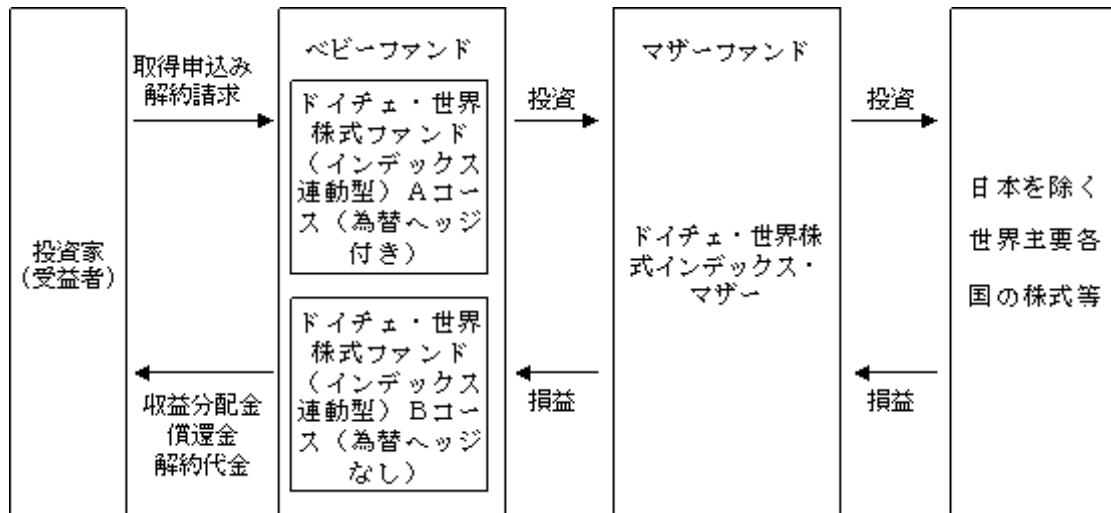
MSCIコクサイ指数は、日本を除く世界主要国22カ国（平成21年5月末日現在）から構成されています。ただし、投資対象国については、定期的に見直しが行われますので、変動することがあります。

MSCIコクサイ指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。

また、MSCIは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4. 運用にあたっては、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Aコースの為替ヘッジに関する運用指図ならびにマザーファンドの運用指図の権限を委託します。
5. 当ファンドはファミリーファンド方式により運用を行います。

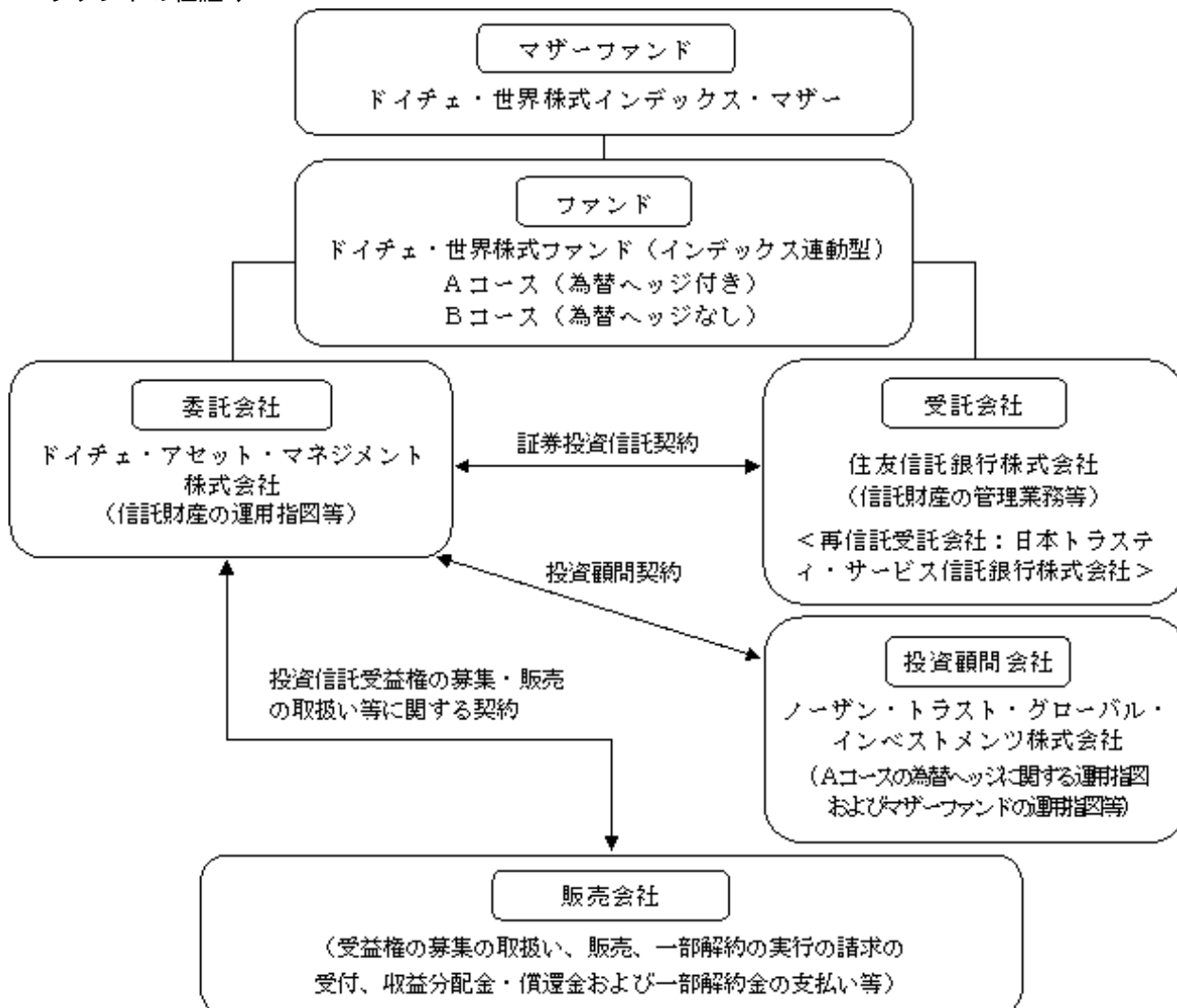
ファミリーファンド方式とは、運用および管理面の合理化・効率化をはかるため、取得申込者から集めた資金をまとめてベビーファンド（Aコース（為替ヘッジ付き）およびBコース（為替ヘッジなし））とし、その資金をマザーファンド（ドイチェ・世界株式インデックス・マザー）に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。



市況動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



委託会社およびファンドの関係法人

委託会社およ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。

1) ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社(「委託会社」)

当ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、受託会社との信託契約の締結、目論見書・運用報告書の作成等を行います。

2) 住友信託銀行株式会社(「受託会社」)

(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

委託会社との間で「証券投資信託契約」を締結し、これに基づき、当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理、基準価額の計算、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指図等を行います。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

3) 「販売会社」

委託会社との間で「投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」を締結し、これに基づき、当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金および一部解約金の支払い等を行います。

4) 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およびマザーファンドの運用指図等を行います。

なお、委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

委託会社の概況

1) 資本金の額(2009年5月末日現在)

3,078百万円

2) 沿革

| | |
|-------|---|
| 1985年 | モルガン グレンフェル インターナショナル アセット マネジメント(株)設立 |
| 1987年 | 投資顧問業登録、投資一任業務認可取得 |
| 1990年 | ドイツ銀投資顧問(株)と合併し、ディービー モルガン グレンフェル アセット マネジメント(株)に社名を変更 |
| 1995年 | ディービー モルガン グレンフェル投信投資顧問(株)に社名を変更 証券投資信託委託会社免許取得 |
| 1996年 | ドイチェ・モルガン・グレンフェル投信投資顧問(株)に社名を変更 |
| 1999年 | バンカース・トラスト投信投資顧問(株)と合併し、ドイチェ・アセット・マネジメント(株)に社名を変更 |
| 2002年 | チューリッヒ・スカダー投資顧問(株)と合併 |
| 2005年 | ドイチェ・アセット・マネジメント(株)とドイチェ信託銀行(株)の資産運用サービス業務を統合 資産運用部門はドイチェ・アセット・マネジメント(株)に一本化 |

3) 大株主の状況(2009年5月末日現在)

| | |
|-------|--|
| 名称： | ドイチェ・アジア・パシフィック・ホールディングス・ピーティーイー・リミテッド |
| 住所： | シンガポール 048583 ワン ラフルズ クウェイ #17-10 |
| 所有株式： | 61,560株 |
| 所有比率： | 100% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

(a) 投資対象

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ます。なお、直接株式に投資することもあります。

(b) 投資態度

- 1) 主に、ドイチェ・世界株式インデックス・マザー受益証券への投資を通して、日本を除く世界主要各国の株式に積極的に分散投資を行うことによって、長期的な収益の向上を目指します。
- 2) Aコース（為替ヘッジ付き）は、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）に連動した投資成果を目指します。実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。Bコース（為替ヘッジなし）は、MSCIコクサイ指数（円ノーヘッジ・ベース）に連動した投資成果を目指します。実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 3) マザーファンド受益証券の組入れ率を高位に保つことを基本としますが、市況動向・資金動向などによってはコール・ローン等による現金運用部分を増加させることがあります。
- 4) ただし、市況動向や資金動向によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、外国為替予約、有価証券の貸付、信用取引、公社債の空売り、公社債の借入れおよび資金の借入れを行うことがあります。

<マザーファンドの投資方針>

基本方針

マザーファンドは、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

(a) 投資対象

日本を除く世界主要各国の株式を主要投資対象とします。

(b) 投資態度

- 1) 日本を除く世界主要各国の株式に積極的に分散投資を行うことによって、長期的な収益の向上を目指します。
- 2) MSCIコクサイ指数（円ノーヘッジ・ベース）に連動した投資成果を目指します。
- 3) 実質的な株式の組入れ率を高位に保つことを基本としますが、市況動向・資金動向などによってはコール・ローン等による現金運用部分を増加させることがあります。
- 4) ただし、市況動向や資金動向によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、外国為替予約、有価証券の貸付、信用取引、公社債の空売りおよび公社債の借入れを行うことがあります。

(2)【投資対象】

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。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.から7.までの証券の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で上記15.の有価証券の性質を有するもの
17. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
18. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、上記1.の証券または証書および上記8.ならびに13.の証券または証書のうち上記1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から上記5.までの証券および上記8.ならびに上記13.の証券または証書のうち上記2.から上記5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記9.の証券および上記10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

委託会社は、法令・規則等で認められる範囲で信託金を委託会社の関係会社が発行する有価証券により運用することを指図することができます。また、委託会社は信託金による有価証券その他の資産の取得を委託会社の関係会社から行うことを指図することができます。

上記 にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

<マザーファンドの投資対象>

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。))に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
6. コマーシャル・ペーパー

7. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.から7.の証券の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で上記15.の権利の性質を有するもの
17. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
18. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、上記1.の証券または証書および上記8.ならびに上記13.の証券または証書のうち上記1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から上記5.までの証券および上記8.ならびに上記13.の証券または証書のうち上記2.から上記5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記9.の証券および上記10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

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

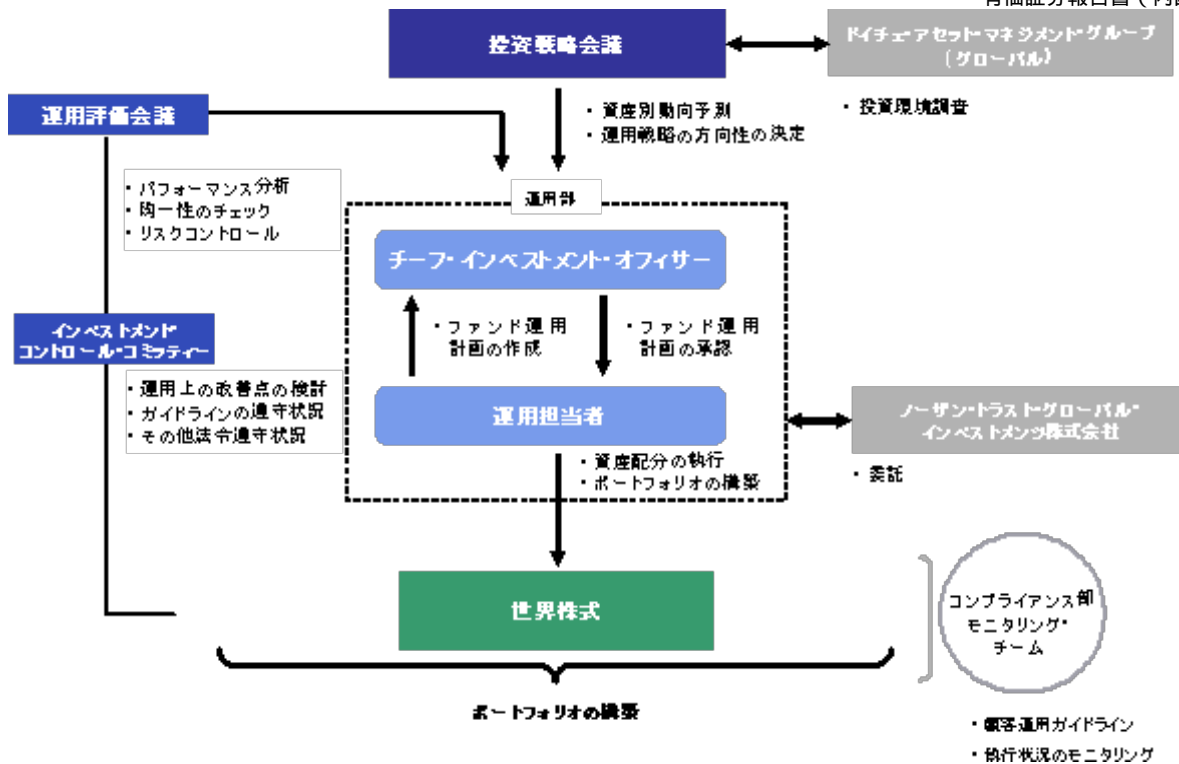
委託会社は、法令・規則等で認められる範囲で信託金を委託会社の関係会社が発行する有価証券により運用することを指図することができます。また、委託会社は、信託金による有価証券その他の資産の取得を委託会社の関係会社から行うことを指図することができます。

上記 にかかわらず、マザーファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

<運用体制>

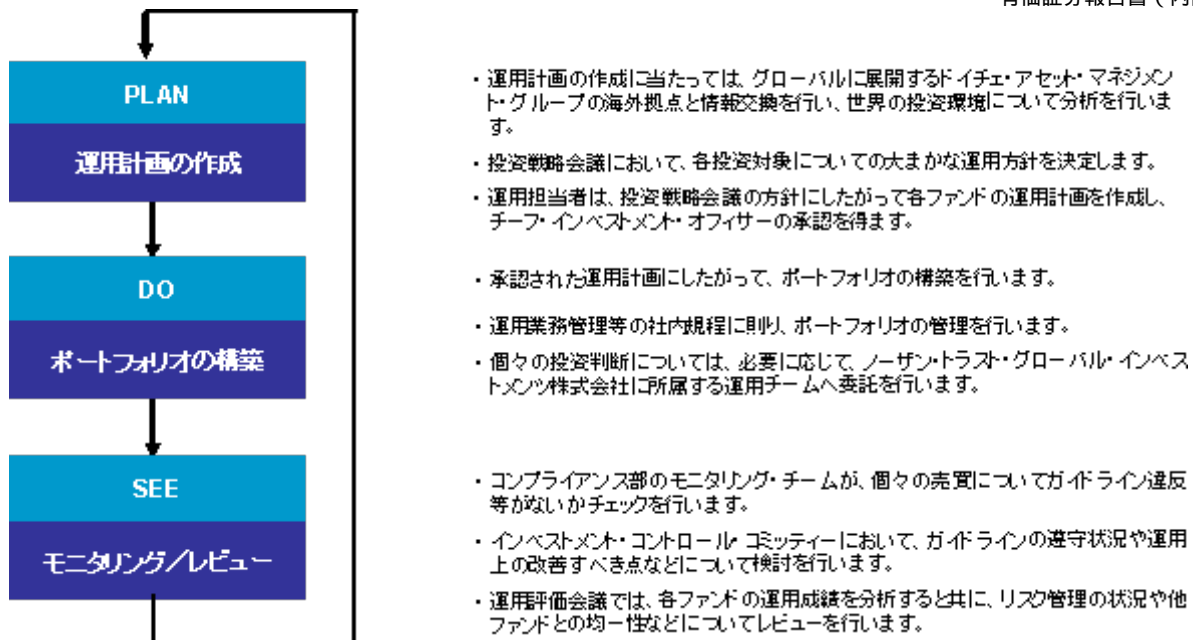


委託会社は、Aコースの為替ヘッジに関する運用指図およびマザーファンドに係る運用指図に関する権限をノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社（所在地：東京都港区六本木一丁目6番1号）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価およびリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関としては、投資戦略会議、インベストメント・コントロール・コミッティー、運用評価会議の3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者および必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

投資戦略会議では、投資環境予測や運用戦略の方向性の決定など、運用計画の作成に必要な基本的な事項を審議します。インベストメント・コントロール・コミッティーでは、顧客勘定における運用リスクに係る諸問題等を把握し、必要な意思決定を行います。運用評価会議では、超過収益率の要因分析や投資行動、均一性等を含めて審議します。これらの運用体制については、社内規程および運用部部内規程により定められています。

運用委託先の管理体制については、当該委託先との継続的な情報交換および定期的な訪問などを通じて、運用面、法令遵守面、業務執行面から評価を行います。評価結果は上述のインベストメント・コントロール・コミッティーに報告され、同コミッティーは必要に応じて適切な措置を行います。

< 運用の流れ >



< 内部管理およびファンドに係る意思決定を監督する組織 >

インベストメント・コントロール・コミッティーは、その活動内容等をエグゼクティブ・コミッティーに報告します。エグゼクティブ・コミッティーは代表取締役が議長を務め、委託会社の業務運営、リスク管理および内部統制に係る諸問題を把握し、取締役会決議事項については取締役会に対する諮問機関であるとともに、それ以外の事項については代表取締役が行う意思決定を補佐する機関としての役割を担います。さらに、コンプライアンス部は、運用部から独立した立場でガイドライン遵守状況および利益相反取引等の検証を行います。また、独立したモニタリング活動として、すべての部門から独立した監査部が内部統制の有効性および業務プロセスの効率性を検証し、経営陣に対して問題点の指摘、改善点の提案を行います。上記各組織については、その内部管理機能の有効性の観点から十分な人員を確保しております。

< 委託会社等によるファンドの関係法人に対する管理体制 >

当ファンドの受託会社に対する管理については、証券投資信託契約に基づく受託会社としての業務の適切な遂行および全体的なサービスレベルを委託会社の業務部においてモニターしております。

運用委託先に対しては、運用委託に関する社内規程に基づき管理します。委託会社は、資産運用能力（運用パフォーマンス実績）、信用力、リスク管理能力（運用ガイドラインの遵守状況含む。）および内部統制の状況（または内部監査の実施状況）の観点から、定期的に運用委託先を定量的・定性的に評価します。評価結果はインベストメント・コントロール・コミッティーに報告され、同コミッティーは評価結果を踏まえて運用委託先の契約継続の可否等を検討します。また重要な契約違反、エラーまたは問題点などが判明した場合、直ちに運用委託先に報告および是正を求めるものとします。

（注）運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

年2回の毎決算時（毎年4月、10月の各25日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入と売買益等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき元本部分と同一の運用を行います。

(5)【投資制限】

< 信託約款で定める投資制限 >

a. 株式への投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。実質投資割合とは、ファンドに属する当該資産とマザーファンドに属する当該資産のうちファンドに属するとみなした額（ファンドに属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の信託財産の純資産総額に占める割合をいいます。以下同じ。

b. 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c. 投資信託証券への投資制限

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

d. 投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

e. 信用取引の指図範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の信用取引の指図は、当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

f. 公社債の空売りの指図範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

g. 公社債の借入れ

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

上記の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。

上記の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

h. 先物取引等の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

i. スワップ取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

j. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

k. 有価証券の貸付の指図および範囲

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

上記に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

委託会社は、有価証券の貸付にあたり担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

l. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

m. 外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

上記の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

上記の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

n. 資金の借入れ

委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、信託財産において一部解約金の支払資金に不足が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

上記の資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当のために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内。
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内。

上記の借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

借入金の利息は信託財産中より支弁します。

< マザーファンドの信託約款に定める投資制限 >

a. 株式への投資制限

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

b. 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c. 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

d. 投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

e. 信用取引の指図範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の信用取引の指図は、当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

f. 公社債の空売りの指図範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

上記の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

g. 公社債の借入れ

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとし

ます。

上記の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、上記の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとします。

上記の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

h. 先物取引等の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

i. スワップ取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。

ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

j. 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

k. 有価証券の貸付の指図および範囲

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

上記に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

委託会社は、有価証券の貸付にあたり担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

1. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

m. 外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

上記の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

上記の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

< 法令で定める投資制限 >

同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第9条）

委託会社は、同一法人の発行する株式について、次のa.の数がb.の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

a. 委託会社が運用の指図を行うすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数

b. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

デリバティブ取引に係る投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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

3【投資リスク】

(1) 当ファンドの主なリスクおよび留意点

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、株式などの値動きのある証券（外貨建資産には、この他に為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金が保証されているものではありません。当ファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属することとなります。

当ファンドの基準価額は、主に以下のリスクにより変動し、損失を生じるおそれがあります。

(a) 株価変動リスク

当ファンドは主に株式に投資しますので、ファンドの基準価額は組入れている株式の価格変動の影響を受けます。株式の価格は政治経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動し、短期的または長期的に大きく下落することがあります。また、株式の発行者に経営不振もしくは債務不履行等が生じた場合、またはそれらが予想される局面となった場合には、当該株式の価格は大きく下落することがあります（価格がゼロになることもあります。）。このような場合には、ファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。

(b) ベンチマークからの乖離リスク

当ファンドは、MSCIコクサイ指数に連動した投資成果を目指して運用を行いますが、資金の流出入、実際に株式を売買する間の時間の差、株式売買委託手数料や信託報酬等の負担、基準価額算定とMSCIコクサイ指数算定で使用する為替レートの相違などの要因によって、基準価額がMSCIコクサイ指数から乖離することがあります。このため、MSCIコクサイ指数が下落した場合には、基準価額がMSCIコクサイ指数よりも大きく下落し、より大きな損失を被ることがあります。

(c) 為替変動リスク

当ファンドは主に外国の株式に投資しますので、ファンドの基準価額は、当該外貨建資産の通貨と日本円との間の為替変動の影響を受けます。為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産の価格は、通常、当該外国通貨に対し円安になれば上昇しますが、円高

になれば下落します。したがって、外貨建資産の価格が下落した場合には、ファンドの基準価額が影響を受け損失を被ることがあります。

Aコース(為替ヘッジ付き)については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りますので、為替変動による基準価額への影響は軽減されますが、影響がすべて排除されるわけではありません。また、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合、当該通貨と円との金利差相当分のヘッジコストがかかります。Bコース(為替ヘッジなし)については、原則として対円での為替ヘッジを行いませんので、基準価額は為替変動による影響を直接受けます。

(d) ファンドの資金流入に伴うリスク

当ファンドの追加設定(ファンドへの資金流入)および一部解約(ファンドからの資金流出)による資金の流入に伴い、基準価額が影響を受ける場合があります。大量の追加設定があった場合、マザーファンドにおいても原則として迅速に有価証券の組入れを行います。買付け予定銘柄によっては流動性などの観点から買付け終了までに時間がかかることがあります。同様に大量の解約があった場合にも解約資金を手当てするため保有証券を大量に売却しなければならないことがあります。その際には、市況動向や取引量等の状況によって、基準価額が大きく変動する可能性があります。

また、マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・一部解約等により、当該マザーファンドにおいて売買が生じた場合等には、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

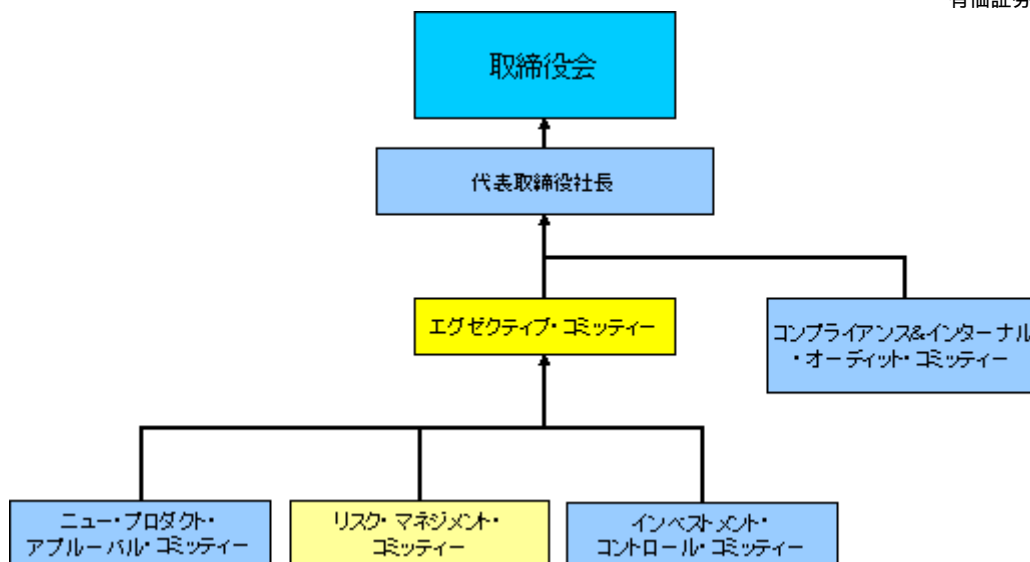
(e) その他の留意点

- 1) 当ファンドは、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合等に必要な手続き等を経て繰上償還されることがあります。
- 2) 当ファンドの資産規模によっては、運用の基本方針に基づく運用が効率的にできない場合があります。その場合には、適切な資産規模の場合と比較して収益性が劣る可能性があります。
- 3) 投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の証券への投資が悪影響を被る可能性があります。
- 4) 資金動向、市況動向その他の要因により、運用の基本方針にしたがった運用ができない場合があります。
- 5) 委託会社は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情(投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、取得申込み・解約請求の受付を中止することおよび既に受付けた取得申込み・解約請求の受付を取消することができます。
- 6) 当ファンドは、以下の日は取得申込みおよび解約請求の受付を行いません。
 - ・ ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日
- 7) 法令・税制・会計制度等は今後変更される可能性もあります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

リスク管理体制について

委託会社のリスク管理体制は以下の通りです。



各コミッティー等の概要

エグゼクティブ・コミッティー

- ・業務運営、リスク管理および内部統制等に係る諸問題を把握し、取締役会決議事項については取締役会に対する諮問機関であるとともに、それ以外の事項については、代表取締役が行う意思決定を補佐する機関としての役割を担います。
- ・毎月開催

リスク・マネジメント・コミッティー

- ・リスク管理（主として自己勘定および委託会社全体に係るリスク）および内部統制に係る事項について決議する機関です。
- ・毎月開催

インベストメント・コントロール・コミッティー

- ・顧客勘定における運用リスクに係る諸問題等を把握し、意思決定を行う決議機関です。
- ・毎月開催

ニュー・プロダクト・アプルーバル・コミッティー

- ・新商品の導入にあたり、付随する諸問題等を導入前に検討し、導入の承認を決議するとともに、既存商品の変更についても、同様に検討し、当該変更の承認を決議する機関です。
- ・随時開催

コンプライアンス&インターナル・オーディット・コミッティー

- ・法務、コンプライアンスおよび監査に係る諸問題等（役職員の表彰・懲戒に係る事項を含む。）を把握し、必要な意思決定を行う決議機関です。
- ・3ヵ月毎に開催

コンプライアンス部

- ・法令および諸規則の遵守状況・運用業務等の適正な執行の管理を行います。
- ・違反等の是正・改善および未然防止のための助言、チェック、取締役会への報告を行います。
- ・資産運用は、運用部による内部管理のほかに、コンプライアンス部モニタリング・チームが顧客投資ガイドラインの遵守等、運用部から独立した立場で以下の項目をチェックします。
 - ・運用ガイドラインのモニター
 - ・取引の妥当性のチェック
 - ・利益相反取引のチェック

監査部

- ・監査部は、内部監査の立案、実施等を行い、委託会社における内部管理態勢、リスク管理態勢の適切性、有効性の検証を行います。

（注）投資リスクに対する管理体制は、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】**(1)【申込手数料】**

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.1%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社または委託会社の下記照会先にお問合せ下さい。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は、無手数料とします。

また、Aコース（為替ヘッジ付き）およびBコース（為替ヘッジなし）の間でスイッチングを行う場合の申込手数料は、無手数料とします。

「スイッチング」とは、「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）」を構成する各ファンドを一部解約した場合、当該解約請求受付日当日に「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）」を構成する他のファンドの取得申込みを行うことをいいます。以下同じ。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）に係る手数料はありません。

ただし、換金（解約）時に、一部解約の実行の請求を受付けた日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.3%を乗じて得た額）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、引続き受益権を保有する受益者と解約者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.9765%（税抜0.93%）を乗じて得た額とし、その配分は以下の通りとします。

（年率）

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | 合計 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 0.3990% | 0.4725% | 0.1050% | 0.9765% |
| （税抜0.38%） | （税抜0.45%） | （税抜0.10%） | （税抜0.93%） |

（注）委託会社および受託会社の報酬は、ファンドから支払われます。信託報酬の販売会社への配分は、販売会社が行うファンドの募集の取扱い等に関する業務に対する代行手数料であり、ファンドから委託会社に支払われた後、委託会社より販売会社に対して支払われます。

信託報酬ならびに当該信託報酬に係る消費税および地方消費税に相当する額（以下「消費税等相当額」といいます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

Aコースの為替ヘッジに関する運用指図およびマザーファンドの運用指図に関する権限の委託を受けたノーザン・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取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。

(4)【その他の手数料等】

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。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（監査費用、法律顧問・税務顧問への報酬、印刷費用、郵送

費用、公告費用、格付費用等を含みます。)および受託会社の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

委託会社は、上記 に定める信託事務の処理等に要する諸費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。この場合、委託会社は、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受けの際に、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。また、委託会社は、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、かかる諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、実際の費用額にかかわらず固定率または固定金額にて信託財産からその支弁を受けることもできます。

上記 において諸費用の上限、固定率または固定金額を定める場合、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、期中に、あらかじめ委託会社が定めた範囲内でかかる上限、固定率または固定金額を変更することができます。

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。

なお、有価証券届出書提出日現在、上記 により定める上限は、信託財産の純資産総額に年率0.10%を乗じて得た額とします。

信託財産における組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等の証券取引に伴う手数料・税金は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料等に係る消費税等相当額、資産を外国で保管する場合の費用および先物取引・オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

(5)【課税上の取扱い】

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

追加型株式投資信託については、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、原則として、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数口座で同一ファンドを取得する場合は当該口座毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。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21年5月末日現在施行されている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

収益分配金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、原則として10%(所得税7%および地方税3%)¹の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、総合課税

または申告分離課税を選択することもできます。

一部解約金、償還金の取扱い

一部解約時および償還時の差益については譲渡所得となり、原則として10%（所得税7%および地方税3%）¹の税率による申告分離課税が適用されます。

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

収益分配金、一部解約金、償還金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税のみ）²の税率で源泉徴収され、法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。

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24年1月1日から20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

2 税率は平成24年1月1日から15%（所得税のみ）となる予定です。

（注1）上記のほか、販売会社によっては受益権を買い取る場合があります。買取請求時の課税の取扱いについて、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

（注2）課税上の取扱いの詳細については、税務専門家または税務署にご確認下さい。

5【運用状況】

(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21年 5月29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 | 241,649,204 | 101.35 |
| コール・ローン・その他の資産 (負債控除後) | - | 3,225,798 | 1.35 |
| 合計(純資産総額) | - | 238,423,406 | 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21年 5月29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 | 592,534,244 | 100.09 |
| コール・ローン・その他の資産 (負債控除後) | - | 536,307 | 0.09 |
| 合計(純資産総額) | - | 591,997,937 | 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21年 5月29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 | 397,173,105 | 47.61 |
| | カナダ | 42,301,993 | 5.07 |
| | ドイツ | 32,444,361 | 3.89 |
| | イタリア | 14,501,496 | 1.74 |
| | フランス | 39,575,793 | 4.74 |
| | オーストラリア | 25,401,701 | 3.05 |

| | | | |
|----------|----------|-------------|-------|
| | イギリス | 83,074,926 | 9.96 |
| | スイス | 34,970,481 | 4.19 |
| | バミューダ | 4,328,276 | 0.52 |
| | 香港 | 9,535,992 | 1.14 |
| | シンガポール | 5,552,012 | 0.67 |
| | ニュージーランド | 275,071 | 0.03 |
| | オランダ | 10,035,346 | 1.20 |
| | スペイン | 17,973,828 | 2.15 |
| | ベルギー | 3,803,972 | 0.46 |
| | スウェーデン | 8,587,532 | 1.03 |
| | ノルウェー | 2,719,837 | 0.33 |
| | オーストリア | 1,343,400 | 0.16 |
| | ルクセンブルグ | 2,188,363 | 0.26 |
| | フィンランド | 5,524,831 | 0.66 |
| | デンマーク | 3,546,681 | 0.43 |
| | アイルランド | 1,202,114 | 0.14 |
| | ギリシャ | 2,468,527 | 0.30 |
| | ポルトガル | 1,250,159 | 0.15 |
| | ケイマン | 99,277 | 0.01 |
| | モーリシャス | 139,922 | 0.02 |
| | パナマ | 688,751 | 0.08 |
| | ジャージー | 1,019,379 | 0.12 |
| | アンティル | 3,533,821 | 0.42 |
| | 小計 | 755,260,947 | 90.54 |
| 新株予約権証券 | イタリア | 0 | 0.00 |
| | 小計 | 0 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | カナダ | 481,545 | 0.06 |
| | 小計 | 481,545 | 0.06 |

| | | | |
|---------------------------|---------|-------------|--------|
| 投資証券 | アメリカ | 4,801,263 | 0.58 |
| | フランス | 710,949 | 0.09 |
| | オーストラリア | 766,728 | 0.09 |
| | イギリス | 796,137 | 0.10 |
| | 小計 | 7,075,077 | 0.85 |
| コール・ローン・その他の資産 (負債控除後) | - | 71,386,586 | 8.56 |
| 合計(純資産総額) | - | 834,204,155 | 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21年 5月29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 | 292,235,100 | 0.7618 0.8269 | 222,631,832 241,649,204 | 101.35 |

< 種類別投資比率 >

(平成21年 5月29日現在)

| 種類 | 国内/外国 | 投資比率(%) |
|-----------|-------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 国内 | 101.35 |
| 合計 | - | 101.35 |

「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)」

< 評価額(全銘柄) >

(平成21年 5月29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 | 716,573,037 | 0.7624 0.8269 | 546,361,595 592,534,244 | 100.09 |

< 種類別投資比率 >

(平成21年 5月29日現在)

| 種類 | 国内 / 外国 | 投資比率 (%) |
|-----------|---------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 国内 | 100.09 |
| 合計 | - | 100.09 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該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」

< 評価額(上位30銘柄) >

(平成21年 5月29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 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 2,564 | 6,422.67 6,679.31 | 16,467,735 17,125,751 | 2.05 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORPORATION | ソフトウェア・サービス | 4,220 | 2,015.40 1,973.01 | 8,505,022 8,326,127 | 1.00 |
| イギリス | 株式 | BP PLC | エネルギー | 9,846 | 737.59 781.73 | 7,262,325 7,697,004 | 0.92 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 1,507 | 4,776.72 5,073.88 | 7,198,524 7,646,341 | 0.92 |
| 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 | 1,440 | 4,912.76 5,261.05 | 7,074,376 7,575,918 | 0.91 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC | 銀行 | 8,997 | 732.13 838.64 | 6,587,023 7,545,324 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 3,122 | 2,424.06 2,376.30 | 7,567,946 7,418,816 | 0.89 |
| アメリカ | 株式 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 710 | 9,670.52 10,100.49 | 6,866,071 7,171,348 | 0.86 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO. | 資本財 | 5,543 | 1,168.37 1,272.57 | 6,476,290 7,053,862 | 0.85 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 2,003 | 3,366.57 3,502.02 | 6,743,251 7,014,552 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | JP MORGAN CHASE&CO | 各種金融 | 1,920 | 3,220.50 3,535.99 | 6,183,364 6,789,104 | 0.81 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 1,057 | 6,425.56 6,349.34 | 6,791,825 6,711,261 | 0.80 |
| フランス | 株式 | TOTAL SA | エネルギー | 1,109 | 5,163.15 5,395.42 | 5,725,937 5,983,526 | 0.72 |
| 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 | 450 | 11,953.87 13,031.55 | 5,379,242 5,864,199 | 0.70 |

| | | | | | | | |
|---------|----|-------------------------------|------------------------|--------|------------------------|------------------------|------|
| アメリカ | 株式 | WAL-MART STORES INC. | 食品・生活必需品小売り | 1,190 | 4,618.49 4,780.58 | 5,496,012 5,688,894 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2,970 | 1,777.16 1,785.84 | 5,278,169 5,303,959 | 0.64 |
| オーストラリア | 株式 | BHP BILLITON LIMITED | 素材 | 1,984 | 2,431.95 2,581.43 | 4,824,996 5,121,572 | 0.61 |
| 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 | 3,500 | 1,270.64 1,417.29 | 4,447,245 4,960,519 | 0.59 |
| イギリス | 株式 | VODAFONE GROUP PLC | 電気通信サービス | 27,508 | 188.25 180.26 | 5,178,402 4,958,737 | 0.59 |
| 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 | 385 | 12,439.75 12,822.92 | 4,789,306 4,936,827 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | THE COCA-COLA COMPANY | 食品・飲料・タバコ | 1,090 | 4,128.37 4,524.91 | 4,499,933 4,932,154 | 0.59 |
| 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 | 1,258 | 3,783.61 3,822.81 | 4,759,782 4,809,106 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY | 銀行 | 2,007 | 2,064.67 2,389.80 | 4,143,796 4,796,347 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 120 | 37,577.99 39,611.79 | 4,509,359 4,753,415 | 0.57 |
| イギリス | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK | エネルギー | 1,860 | 2,410.20 2,530.17 | 4,482,977 4,706,124 | 0.56 |
| スペイン | 株式 | TELEFONICA S.A | 電気通信サービス | 2,241 | 2,013.01 2,056.10 | 4,511,172 4,607,732 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 3,000 | 1,506.51 1,516.66 | 4,519,539 4,549,996 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 各種金融 | 4,127 | 899.18 1,090.22 | 3,710,951 4,499,354 | 0.54 |
| スペイン | 株式 | BANCO SANTANDER SA | 銀行 | 4,423 | 904.84 1,011.22 | 4,002,142 4,472,632 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 食品・飲料・タバコ | 1,080 | 3,611.24 4,104.25 | 3,900,146 4,432,599 | 0.53 |

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

< 種類別および業種別投資比率 >

(平成21年 5月29日現在)

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|---------|-------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 12.16 |
| | | 素材 | 6.07 |
| | | 資本財 | 6.45 |

| | | | |
|----------|----|------------------------|-------|
| | | 商業・専門サービス | 0.64 |
| | | 運輸 | 1.44 |
| | | 自動車・自動車部品 | 0.90 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 0.85 |
| | | 消費者サービス | 1.17 |
| | | メディア | 2.21 |
| | | 小売 | 2.06 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.79 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 5.66 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.77 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 2.33 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.65 |
| | | 銀行 | 7.84 |
| | | 各種金融 | 4.76 |
| | | 保険 | 3.97 |
| | | 不動産 | 0.73 |
| | | ソフトウェア・サービス | 4.00 |
| | | 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 | 4.42 |
| | | 公益事業 | 4.44 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 1.31 |
| | | 小計 | 90.54 |
| 新株予約権証券 | 外国 | 銀行 | 0.00 |
| | | 小計 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | 外国 | 投資信託受益証券 | 0.06 |
| | | 小計 | 0.06 |
| 投資証券 | 外国 | 投資証券 | 0.85 |
| | | 小計 | 0.85 |

| | |
|----|-------|
| 合計 | 91.44 |
|----|-------|

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該種類別およ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) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第2期 (平成11年10月25日) | 1,380 | 1,384 | 1.0548 | 1.0573 |
| 第3期 (平成12年4月25日) | 1,549 | 1,552 | 1.1698 | 1.1723 |
| 第4期 (平成12年10月25日) | 1,500 | 1,500 | 1.1151 | 1.1151 |
| 第5期 (平成13年4月25日) | 1,376 | 1,376 | 0.9403 | 0.9403 |
| 第6期 (平成13年10月25日) | 1,371 | 1,371 | 0.8172 | 0.8172 |
| 第7期 (平成14年4月25日) | 1,664 | 1,664 | 0.8148 | 0.8148 |
| 第8期 (平成14年10月25日) | 1,404 | 1,404 | 0.6355 | 0.6355 |
| 第9期 (平成15年4月25日) | 664 | 664 | 0.6313 | 0.6313 |
| 第10期 (平成15年10月27日) | 714 | 714 | 0.7027 | 0.7027 |
| 第11期 (平成16年4月26日) | 780 | 780 | 0.7778 | 0.7778 |
| 第12期 (平成16年10月25日) | 649 | 649 | 0.7495 | 0.7495 |
| 第13期 (平成17年4月25日) | 634 | 634 | 0.7896 | 0.7896 |

| | | | | |
|-----------------------|-----|-----|--------|--------|
| 第14期 (平成17年10月25日) | 483 | 483 | 0.8322 | 0.8322 |
| 第15期 (平成18年 4月25日) | 450 | 450 | 0.9278 | 0.9278 |
| 第16期 (平成18年10月25日) | 416 | 416 | 0.9539 | 0.9539 |
| 第17期 (平成19年 4月25日) | 433 | 433 | 1.0194 | 1.0194 |
| 第18期 (平成19年10月25日) | 390 | 390 | 1.0173 | 1.0173 |
| 第19期 (平成20年 4月25日) | 352 | 352 | 0.9143 | 0.9143 |
| 第20期 (平成20年10月27日) | 233 | 233 | 0.6054 | 0.6054 |
| 第21期 (平成21年 4月27日) | 225 | 225 | 0.5920 | 0.5920 |
| 平成20年 5月末日 | 359 | - | 0.9254 | - |
| 平成20年 6月末日 | 323 | - | 0.8402 | - |
| 平成20年 7月末日 | 323 | - | 0.8333 | - |
| 平成20年 8月末日 | 324 | - | 0.8420 | - |
| 平成20年 9月末日 | 280 | - | 0.7273 | - |
| 平成20年10月末日 | 248 | - | 0.6415 | - |
| 平成20年11月末日 | 235 | - | 0.6041 | - |
| 平成20年12月末日 | 229 | - | 0.5958 | - |
| 平成21年 1月末日 | 222 | - | 0.5775 | - |
| 平成21年 2月末日 | 195 | - | 0.5188 | - |
| 平成21年 3月末日 | 202 | - | 0.5344 | - |
| 平成21年 4月末日 | 228 | - | 0.5961 | - |
| 平成21年 5月末日 | 238 | - | 0.6269 | - |

「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) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第 2期 (平成11年10月25日) | 87 | 87 | 0.9057 | 0.9057 |
| 第 3期 (平成12年 4月25日) | 105 | 105 | 0.9961 | 0.9961 |
| 第 4期 (平成12年10月25日) | 122 | 122 | 0.9619 | 0.9619 |

| | | | | |
|-----------------------|-----|-----|--------|--------|
| 第 5期 (平成13年 4月25日) | 165 | 165 | 0.9623 | 0.9623 |
| 第 6期 (平成13年10月25日) | 247 | 247 | 0.8577 | 0.8577 |
| 第 7期 (平成14年 4月25日) | 495 | 495 | 0.9154 | 0.9154 |
| 第 8期 (平成14年10月25日) | 500 | 500 | 0.7126 | 0.7126 |
| 第 9期 (平成15年 4月25日) | 534 | 534 | 0.7127 | 0.7127 |
| 第10期 (平成15年10月27日) | 590 | 590 | 0.7452 | 0.7452 |
| 第11期 (平成16年 4月26日) | 658 | 658 | 0.8381 | 0.8381 |
| 第12期 (平成16年10月25日) | 638 | 638 | 0.8209 | 0.8209 |
| 第13期 (平成17年 4月25日) | 637 | 637 | 0.8749 | 0.8749 |
| 第14期 (平成17年10月25日) | 616 | 616 | 0.9932 | 0.9932 |
| 第15期 (平成18年 4月25日) | 632 | 632 | 1.1261 | 1.1261 |
| 第16期 (平成18年10月25日) | 687 | 687 | 1.2440 | 1.2440 |
| 第17期 (平成19年 4月25日) | 771 | 771 | 1.3879 | 1.3879 |
| 第18期 (平成19年10月25日) | 852 | 852 | 1.3905 | 1.3905 |
| 第19期 (平成20年 4月25日) | 786 | 786 | 1.1804 | 1.1804 |
| 第20期 (平成20年10月27日) | 457 | 457 | 0.6201 | 0.6201 |
| 第21期 (平成21年 4月27日) | 545 | 545 | 0.6504 | 0.6504 |
| 平成20年 5月末日 | 826 | - | 1.2120 | - |
| 平成20年 6月末日 | 775 | - | 1.1192 | - |
| 平成20年 7月末日 | 794 | - | 1.1234 | - |
| 平成20年 8月末日 | 802 | - | 1.1213 | - |
| 平成20年 9月末日 | 652 | - | 0.9089 | - |
| 平成20年10月末日 | 525 | - | 0.7092 | - |
| 平成20年11月末日 | 492 | - | 0.6438 | - |
| 平成20年12月末日 | 482 | - | 0.6162 | - |
| 平成21年 1月末日 | 459 | - | 0.5748 | - |

| | | | | |
|------------|-----|---|--------|---|
| 平成21年 2月末日 | 460 | - | 0.5657 | - |
| 平成21年 3月末日 | 485 | - | 0.5900 | - |
| 平成21年 4月末日 | 557 | - | 0.6629 | - |
| 平成21年 5月末日 | 591 | - | 0.7053 | - |

(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)」

| 計算期間 | 計算期間末 | 1口当たりの分配金(円) |
|------|-------------|--------------|
| 第 2期 | 平成11年10月25日 | 0.0025 |
| 第 3期 | 平成12年 4月25日 | 0.0025 |
| 第 4期 | 平成12年10月25日 | 0.0000 |
| 第 5期 | 平成13年 4月25日 | 0.0000 |
| 第 6期 | 平成13年10月25日 | 0.0000 |
| 第 7期 | 平成14年 4月25日 | 0.0000 |
| 第 8期 | 平成14年10月25日 | 0.0000 |
| 第 9期 | 平成15年 4月25日 | 0.0000 |
| 第10期 | 平成15年10月27日 | 0.0000 |
| 第11期 | 平成16年 4月26日 | 0.0000 |
| 第12期 | 平成16年10月25日 | 0.0000 |
| 第13期 | 平成17年 4月25日 | 0.0000 |
| 第14期 | 平成17年10月25日 | 0.0000 |
| 第15期 | 平成18年 4月25日 | 0.0000 |
| 第16期 | 平成18年10月25日 | 0.0000 |
| 第17期 | 平成19年 4月25日 | 0.0000 |
| 第18期 | 平成19年10月25日 | 0.0000 |
| 第19期 | 平成20年 4月25日 | 0.0000 |
| 第20期 | 平成20年10月27日 | 0.0000 |

| | | |
|------|-------------|--------|
| 第21期 | 平成21年 4月27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)」

| 計算期間 | 計算期間末 | 1口当たりの分配金(円) |
|------|-------------|--------------|
| 第 2期 | 平成11年10月25日 | 0.0000 |
| 第 3期 | 平成12年 4月25日 | 0.0000 |
| 第 4期 | 平成12年10月25日 | 0.0000 |
| 第 5期 | 平成13年 4月25日 | 0.0000 |
| 第 6期 | 平成13年10月25日 | 0.0000 |
| 第 7期 | 平成14年 4月25日 | 0.0000 |
| 第 8期 | 平成14年10月25日 | 0.0000 |
| 第 9期 | 平成15年 4月25日 | 0.0000 |
| 第10期 | 平成15年10月27日 | 0.0000 |
| 第11期 | 平成16年 4月26日 | 0.0000 |
| 第12期 | 平成16年10月25日 | 0.0000 |
| 第13期 | 平成17年 4月25日 | 0.0000 |
| 第14期 | 平成17年10月25日 | 0.0000 |
| 第15期 | 平成18年 4月25日 | 0.0000 |
| 第16期 | 平成18年10月25日 | 0.0000 |
| 第17期 | 平成19年 4月25日 | 0.0000 |
| 第18期 | 平成19年10月25日 | 0.0000 |
| 第19期 | 平成20年 4月25日 | 0.0000 |
| 第20期 | 平成20年10月27日 | 0.0000 |
| 第21期 | 平成21年 4月27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)」

| 計算期間 | 収益率(%) |
|------|--------|
|------|--------|

| | |
|-----------------------------------|------|
| 第 2期 (平成11年 4月27日～平成11年10月25日) | 5.2 |
| 第 3期 (平成11年10月26日～平成12年 4月25日) | 11.1 |
| 第 4期 (平成12年 4月26日～平成12年10月25日) | 4.7 |
| 第 5期 (平成12年10月26日～平成13年 4月25日) | 15.7 |
| 第 6期 (平成13年 4月26日～平成13年10月25日) | 13.1 |
| 第 7期 (平成13年10月26日～平成14年 4月25日) | 0.3 |
| 第 8期 (平成14年 4月26日～平成14年10月25日) | 22.0 |
| 第 9期 (平成14年10月26日～平成15年 4月25日) | 0.7 |
| 第10期 (平成15年 4月26日～平成15年10月27日) | 11.3 |
| 第11期 (平成15年10月28日～平成16年 4月26日) | 10.7 |
| 第12期 (平成16年 4月27日～平成16年10月25日) | 3.6 |
| 第13期 (平成16年10月26日～平成17年 4月25日) | 5.4 |
| 第14期 (平成17年 4月26日～平成17年10月25日) | 5.4 |
| 第15期 (平成17年10月26日～平成18年 4月25日) | 11.5 |
| 第16期 (平成18年 4月26日～平成18年10月25日) | 2.8 |
| 第17期 (平成18年10月26日～平成19年 4月25日) | 6.9 |
| 第18期 (平成19年 4月26日～平成19年10月25日) | 0.2 |
| 第19期 (平成19年10月26日～平成20年 4月25日) | 10.1 |
| 第20期 (平成20年 4月26日～平成20年10月27日) | 33.8 |
| 第21期 (平成20年10月28日～平成21年 4月27日) | 2.2 |

「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 | 収益率(%) |
|------|--------|
|------|--------|

| | |
|----------------------------------|------|
| 第2期 (平成11年4月27日～平成11年10月25日) | 13.0 |
| 第3期 (平成11年10月26日～平成12年4月25日) | 10.0 |
| 第4期 (平成12年4月26日～平成12年10月25日) | 3.4 |
| 第5期 (平成12年10月26日～平成13年4月25日) | 0.0 |
| 第6期 (平成13年4月26日～平成13年10月25日) | 10.9 |
| 第7期 (平成13年10月26日～平成14年4月25日) | 6.7 |
| 第8期 (平成14年4月26日～平成14年10月25日) | 22.2 |
| 第9期 (平成14年10月26日～平成15年4月25日) | 0.0 |
| 第10期 (平成15年4月26日～平成15年10月27日) | 4.6 |
| 第11期 (平成15年10月28日～平成16年4月26日) | 12.5 |
| 第12期 (平成16年4月27日～平成16年10月25日) | 2.1 |
| 第13期 (平成16年10月26日～平成17年4月25日) | 6.6 |
| 第14期 (平成17年4月26日～平成17年10月25日) | 13.5 |
| 第15期 (平成17年10月26日～平成18年4月25日) | 13.4 |
| 第16期 (平成18年4月26日～平成18年10月25日) | 10.5 |
| 第17期 (平成18年10月26日～平成19年4月25日) | 11.6 |
| 第18期 (平成19年4月26日～平成19年10月25日) | 0.2 |
| 第19期 (平成19年10月26日～平成20年4月25日) | 15.1 |
| 第20期 (平成20年4月26日～平成20年10月27日) | 47.5 |
| 第21期 (平成20年10月28日～平成21年4月27日) | 4.9 |

(注) 収益率は、小数第2位を四捨五入しています。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成10年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

平成12年12月1日 ファンド名称の変更（「BT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）／Bコース（為替ヘッジなし）」より「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）／Bコース（為替ヘッジなし）」へ変更）

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

取得申込みの受付は、原則として販売会社の営業日（ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日にあたる日を除きます。）の午後3時（半日営業日は午前11時）までに取得申込みが行われ、かつ、当該取得申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分として取扱います。なお、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付分として取扱います。

当ファンドは収益分配金の受取方法により、収益の分配時に収益分配金を受け取る「一般コース」と、収益分配金が税引き後無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つのコースがあります。当ファンドの取得申込者は、取得申込みをする際に、「一般コース」か「自動けいぞく投資コース」か、どちらかのコースを申し出るものとします。ただし、申込取扱場所によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

「自動けいぞく投資コース」を選択する場合、取得申込者は、当該販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって契約（以下「自動けいぞく投資契約」といいます。）を締結します。なお、収益分配金を再投資せず受取りを希望される場合は、販売会社によっては再投資の停止を申し出ることができます。詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

また、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が、別途、販売会社との間で「定時定額購入サービス」等に関する契約等を取交わした場合、当該契約等で規定する取得申込みの方法によるものとします。

販売会社によっては、当該契約または規定について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。なお、「定時定額購入サービス」等の取扱いの有無については、お申込みの販売会社にお問合せ下さい。

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

Aコース（為替ヘッジ付き）およびBコース（為替ヘッジなし）の間でスイッチングの申込みを受付けます。

「スイッチング」とは、「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）」を構成する各ファンドを一部解約した場合、当該解約請求受付日当日に「ドイチェ・世界株式ファンド（インデックス連動型）」を構成する他のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

申込価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日（決算日）の基準価額とします。

基準価額については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

申込単位は、販売会社が定める単位とします。ただし、収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。申込単位の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.1%（税抜2.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は、無手数料とします。

また、Aコース（為替ヘッジ付き）およびBコース（為替ヘッジなし）の間でスイッチングを行う場合の申込手数料は、無手数料とします。

申込代金については、原則として取得申込受付日から起算して5営業日目までに申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取消し等

- a. 信託財産の効率的な運用に資するため必要があると委託会社が判断する場合、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を制限または停止することができます。
- b. 委託会社は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止することおよび既に受付けた取得申込みの受付を取消すことができます。

委託会社の照会先は以下の通りです。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

一部解約の実行の請求の受付は、原則として販売会社の営業日（ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日にあたる日を除きます。）の午後3時（半日営業日は午前11時）までに一部解約の実行の請求が行われ、かつ、当該請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分として取扱います。なお、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付分として取扱います。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求を受けた日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.3%を乗じて得た額）を差し引いた額とします。

解約価額については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

「信託財産留保額」とは、引続き受益権を保有する受益者と解約者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

解約単位は、販売会社が定める単位とします。解約単位の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

お手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた額となります。

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求には制限があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して5営業日目から販売会社の本・支店、営業所等にて支払われます。

委託会社は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記に準じて計算された価額とします。

上記のほか、販売会社によっては、受益権を買い取る場合があります。詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

委託会社の照会先は以下の通りです。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法等について>

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

受益権1口当たりの純資産額が基準価額です。なお、便宜上1万口当たりには換算した価額で表示されることがあります。基準価額は、原則として委託会社の営業日に日々算出されます。

基準価額については、販売会社または委託会社の下記照会先にお問合せ下さい。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

原則として、日本経済新聞(朝刊)の「オープン基準価格」欄に、「Aコース（為替ヘッジ付き）」は「世インA」、「Bコース（為替ヘッジなし）」は「世インB」として、前日付の基準価額が掲載されます。

<運用資産の評価基準および評価方法>

| | |
|----------|---|
| マザーファンド | 基準価額で評価します。 |
| 株式 | 原則として、証券取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。 |
| 公社債等 | 法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって、時価評価します。 |
| 外貨建資産 | 原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により評価します。 |
| 外国為替予約取引 | 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。 |

(2)【保管】

当ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託契約締結日(平成10年11月30日)から無期限とします。

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年4月26日から10月25日までおよび10月26日から翌年4月25日までとすることを原則とします。

上記にかかわらず、上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託の終了

- (イ) 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合、およびこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、または運用体制等の変更のやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、上記(イ)の信託契約の解約をしません。
- (ホ) 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ヘ) 上記(ハ)から(ホ)までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(ハ)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、上記(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

関係法人との契約の更改等

- (イ) 投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約

当初の契約の有効期間は、1年間とします。ただし、期間満了3ヵ月前までに、委託会社および販売会社いずれからも、何らの意思表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いにつ

いてもこれと同様とします。また、委託会社または販売会社は、他方に対して書面による通知を3カ月前になすことにより当該契約を解約することができます。

(ロ) 投資顧問契約

3カ月以上前の書面による相手方への通知により、どちらの当事者も投資顧問契約を終了することができます。

運用報告書

委託会社は、法令に基づき当該信託財産の計算期間の末日毎および信託終了時に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、これを販売会社を通じて当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

信託契約に関する監督官庁の命令

(イ) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

(ロ) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消し等に伴う取扱い

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

(ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、上記(二)に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

(イ) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

(ロ) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

(イ) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記の規定にしたがい、新受託会社を選任します。

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

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託約款に関する疑義の取扱い

信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託会社と受託会社との協議により定めます。

再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

- a. 受益者は、委託会社が支払いを決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- b. 収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし

す。)に支払いを開始します。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

償還金に対する請求権

- a. 受益者は、ファンドの償還金を持分に応じて請求する権利を有します。
- b. 償還金は、原則として信託終了日(信託終了日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払いを開始します。
- c. 受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

受益権の一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社を通じて、一部解約を委託会社に請求する権利を有します。一部解約金は、原則として一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して5営業日目から受益者に支払われます。

反対者の買取請求権

前記「1 資産管理等の概要(5) その他」の「 信託の終了」または「 信託約款の変更」のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、前記「1 資産管理等の概要(5) その他」の「 信託の終了(口)」または「 信託約款の変更(口)」に規定する公告または書面に付記します。

帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第4【ファンドの経理状況】

1.当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、第20期計算期間（平成20年4月26日から平成20年10月27日まで）及び第21期計算期間（平成20年10月28日から平成21年4月27日まで）について、「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20期計算期間（平成20年4月26日から平成20年10月27日まで）及び第21期計算期間（平成20年10月28日から平成21年4月27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20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | - | 10,000 |
| 親投資信託受益証券 | 186,993,961 | 223,222,736 |
| 派生商品評価勘定 | 48,417,539 | 2,225 |
| 未収入金 | - | 3,989,594 |
| 流動資産合計 | 235,411,500 | 227,224,555 |
| 資産合計 | | |
| | 235,411,500 | 227,224,555 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 41,557 |
| 未払金 | - | 46,300 |
| 未払解約金 | 113,044 | - |
| 未払受託者報酬 | 170,278 | 115,894 |
| 未払委託者報酬 | 1,413,282 | 961,808 |
| その他未払費用 | 162,109 | 110,310 |
| 流動負債合計 | 1,858,713 | 1,275,869 |
| 負債合計 | | |
| | 1,858,713 | 1,275,869 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 385,793,311 | 381,697,315 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 152,240,524 | 155,748,629 |
| （分配準備積立金） | 49,916,186 | 48,877,144 |
| 元本等合計 | 233,552,787 | 225,948,686 |
| 純資産合計 | | |
| | 233,552,787 | 225,948,686 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 235,411,500 | 227,224,555 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第20期計算期間 (自 平成20年 4月26日 至 平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自 平成20年10月28日 至 平成21年 4月27日) |
|-------------------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 164,288,223 | 5,091,553 |
| 為替差損益 | 46,789,023 | 9,327,633 |
| 営業収益合計 | 117,499,200 | 4,236,080 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 170,278 | 115,894 |
| 委託者報酬 | 1,413,282 | 961,808 |
| その他費用 | 162,109 | 110,310 |
| 営業費用合計 | 1,745,669 | 1,188,012 |
| 営業損失() | 119,244,869 | 5,424,092 |
| 経常損失() | 119,244,869 | 5,424,092 |
| 当期純損失() | 119,244,869 | 5,424,092 |
| 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額() | 1,460,984 | 950,397 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 33,018,650 | 152,240,524 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,359,270 | 9,618,239 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,359,270 | 9,618,239 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,797,259 | 8,652,649 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,797,259 | 8,652,649 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 152,240,524 | 155,748,629 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27日) |
|--------------------------------|--|---|
| 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。 | 親投資信託受益証券 同左 |
| 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。 | 同左 |
| 3. その他財務諸表作成のための基 本となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い 平成20年10月25日及び平成20年10 月26日が休日のため、信託約款の規定 により、当計算期間末日を平成20年10 月27日としています。 | 計算期間末日の取扱い 平成21年4月25日及び平成21年4月 26日が休日のため、信託約款の規定 により、当計算期間末日を平成21年4 月27日としています。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|--|--|--|
| 1. 計算期間末日における受益権の総数 | 385,793,311口 | 381,697,315口 |
| 2. 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は152,240,524円です。 | 貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は155,748,629円です。 |
| 3. 計算期間末日における1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.6054円 (6,054円) | 0.5920円 (5,920円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27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(2,854,235円)、収 益調整金(49,306,434円)、分配準 備積立金(47,061,951円)より、分 配対象収益は、99,222,620円(1万 口当たり2,571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(1,984,197円)、収 益調整金(51,336,401円)、分配準 備積立金(46,892,947円)より、分 配対象収益は、100,213,545円(1万 口当たり2,625円)であります。今 期は分配を行っておりません。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第20期計算期間(平成20年10月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|-----------|-------------|-------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 186,993,961 | 162,183,975 |
| 合計 | 186,993,961 | 162,183,975 |

第21期計算期間(平成21年4月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|-----------|-------------|-------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 223,222,736 | 8,501,318 |
| 合計 | 223,222,736 | 8,501,318 |

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

| 項目 | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27日) |
|-------------------------|--|---|
| | 1.取引の内容 | 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約であります。 |
| 2.取引に対する取組方針 | デリバティブ取引は、将来の為替の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。 | 同左 |
| 3.取引の利用目的 | デリバティブ取引は、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 |
| 4.取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動によるリスクであります。 | 同左 |
| 5.取引に係るリスク管理体制 | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルールに従い、資金担当部門が運用部門担当者の承認を得て行っております。 | 同左 |
| 6.取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

| 区分 | 種類 | 第20期計算期間(平成20年10月27日現在) | | | |
|-----------|--------------|-------------------------|--------------|-------------|------------|
| | | 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 | 161,658,270 | - | 144,202,500 | 17,455,770 |
| | カナダドル | 15,347,955 | - | 11,103,000 | 4,244,955 |
| | ユーロ | 54,239,255 | - | 41,573,000 | 12,666,255 |
| | イギリスポンド | 31,127,600 | - | 23,899,200 | 7,228,400 |
| | スイスフラン | 11,706,468 | - | 9,730,800 | 1,975,668 |
| | スウェーデンクローナ | 4,816,792 | - | 3,564,000 | 1,252,792 |
| | オーストラリアドル | 9,707,940 | - | 6,430,600 | 3,277,340 |
| | 香港ドル | 2,989,359 | - | 2,673,000 | 316,359 |
| | 合計 | 291,593,639 | - | 243,176,100 | 48,417,539 |

| 区分 | 種類 | 第21期計算期間(平成21年4月27日現在) | | | |
|-----------|--------------|------------------------|--------------|-------------|---------|
| | | 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 | 125,047,053 | - | 125,052,600 | 5,547 |
| | カナダドル | 10,376,444 | - | 10,381,800 | 5,356 |
| | ユーロ | 37,073,745 | - | 37,073,600 | 145 |
| | イギリスポンド | 22,670,688 | - | 22,691,200 | 20,512 |
| | スイスフラン | 8,492,080 | - | 8,490,000 | 2,080 |
| | スウェーデンクローナ | 3,675,163 | - | 3,679,700 | 4,537 |
| | オーストラリアドル | 7,624,111 | - | 7,629,600 | 5,489 |
| | 香港ドル | 2,626,984 | - | 2,627,100 | 116 |
| | 合計 | 217,586,268 | - | 217,625,600 | 39,332 |

(注)時価の算定方法

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

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

(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20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|-----------|-----------------------------|----------------------------|
| 元本の推移 | | |
| 期首元本額 | 385,488,163円 | 385,793,311円 |
| 期中追加設定元本額 | 15,665,874円 | 20,161,446円 |
| 期中一部解約元本額 | 15,360,726円 | 24,257,442円 |

(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 | 券面総額(円) | 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 | 292,943,224 | 223,222,736 | - |
| 合計 | - | 292,943,224 | 223,222,736 | - |

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20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | - | 519,795 |
| 親投資信託受益証券 | 461,840,832 | 547,680,087 |
| 流動資産合計 | 461,840,832 | 548,199,882 |
| 資産合計 | 461,840,832 | 548,199,882 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,666 | 12,678 |
| 未払受託者報酬 | 398,974 | 252,066 |
| 未払委託者報酬 | 3,311,381 | 2,092,092 |
| その他未払費用 | 379,917 | 239,998 |
| 流動負債合計 | 4,096,938 | 2,596,834 |
| 負債合計 | 4,096,938 | 2,596,834 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 738,190,624 | 838,840,321 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 280,446,730 | 293,237,273 |
| （分配準備積立金） | 201,716,632 | 203,951,469 |
| 元本等合計 | 457,743,894 | 545,603,048 |
| 純資産合計 | 457,743,894 | 545,603,048 |
| 負債純資産合計 | 461,840,832 | 548,199,882 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27日) |
|-------------------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 397,158,789 | 30,411,055 |
| 営業収益合計 | 397,158,789 | 30,411,055 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 398,974 | 252,066 |
| 委託者報酬 | 3,311,381 | 2,092,092 |
| その他費用 | 379,917 | 239,998 |
| 営業費用合計 | 4,090,272 | 2,584,156 |
| 営業利益又は営業損失() | 401,249,061 | 27,826,899 |
| 経常利益又は経常損失() | 401,249,061 | 27,826,899 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 401,249,061 | 27,826,899 |
| 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額() | 4,447,650 | 395,609 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 120,194,014 | 280,446,730 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 3,325,417 | 6,752,202 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 6,752,202 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 3,325,417 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 7,164,750 | 47,765,253 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 7,164,750 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 47,765,253 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 280,446,730 | 293,237,273 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27日) |
|--------------------------------|--|---|
| 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。 | 親投資信託受益証券 同左 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本 となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い 平成20年10月25日及び平成20年10 月26日が休日のため、信託約款の規定 により、当計算期間末日を平成20年10 月27日としています。 | 計算期間末日の取扱い 平成21年4月25日及び平成21年4月 26日が休日のため、信託約款の規定 により、当計算期間末日を平成21年4 月27日としています。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|--|--|--|
| 1. 計算期間末日における受益権の総数 | 738,190,624口 | 838,840,321口 |
| 2. 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が 元本総額を下回っており、その 差額は280,446,730円です。 | 貸借対照表上の純資産額が 元本総額を下回っており、その 差額は293,237,273円です。 |
| 3. 計算期間末日における1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.6201円 (6,201円) | 0.6504円 (6,504円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第20期計算期間 (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | 第21期計算期間 (自平成20年10月28日 至平成21年4月27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(6,785,339円)、収 益調整金(247,812,508円)、分配 準備積立金(194,931,293円)よ り、分配対象収益は、449,529,140円 (1万口当たり6,089円)でありま すが、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(6,577,229円)、収 益調整金(313,645,111円)、分配 準備積立金(197,374,240円)よ り、分配対象収益は、517,596,580円 (1万口当たり6,170円)でありま すが、今期は分配を行っておりませ ん。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第20期計算期間(平成20年10月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|-----------|-------------|-------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 461,840,832 | 393,870,345 |
| 合計 | 461,840,832 | 393,870,345 |

第21期計算期間(平成21年4月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|-----------|-------------|-------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 547,680,087 | 31,099,117 |
| 合計 | 547,680,087 | 31,099,117 |

(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20期計算期間 (平成20年10月27日現在) | 第21期計算期間 (平成21年4月27日現在) |
|-------|-----------------------------|----------------------------|
| 元本の推移 | | |

| | | |
|-----------|--------------|--------------|
| 期首元本額 | 666,271,651円 | 738,190,624円 |
| 期中追加設定元本額 | 112,960,067円 | 118,216,656円 |
| 期中一部解約元本額 | 41,041,094円 | 17,566,959円 |

(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 | 券面総額(円) | 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 | 718,740,272 | 547,680,087 | - |
| 合計 | - | 718,740,272 | 547,680,087 | - |

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20年10月27日現在) | (平成21年4月27日現在) |
|-------------|-----------------|----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 30,265,185 | 34,532,304 |
| コール・ローン | 22,157,118 | 14,550,451 |
| 株式 | 582,456,196 | 693,283,380 |
| 新株予約権証券 | - | 5,603 |
| 投資信託受益証券 | 1,106,749 | 440,298 |
| 投資証券 | 6,113,495 | 6,739,609 |
| 派生商品評価勘定 | - | 6,324,382 |
| 未収配当金 | 904,332 | 1,966,697 |
| 未収利息 | 254 | 23 |
| 差入委託証拠金 | 16,811,284 | 13,103,232 |
| 流動資産合計 | 659,814,613 | 770,945,979 |
| 資産合計 | 659,814,613 | 770,945,979 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 10,959,000 | - |
| 流動負債合計 | 10,959,000 | - |
| 負債合計 | 10,959,000 | - |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 897,420,185 | 1,011,683,496 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 248,564,572 | 240,737,517 |
| 元本等合計 | 648,855,613 | 770,945,979 |
| 純資産合計 | 648,855,613 | 770,945,979 |
| 負債純資産合計 | 659,814,613 | 770,945,979 |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | (自 平成20年 4月26日 至 平成20年10月27日) | (自 平成20年10月28日 至 平成21年 4月27日) |
|----------------------------|---|--|
| 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者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> | <p>株式、新株予約権証券、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 同左</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 同左</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、取引所の発表する計算日の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> | <p>(1)同左</p> <p>(2)同左</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 「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> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成20年10月27日現在) | (平成21年4月27日現在) |
|------------------------------|--|--|
| 1. 受益権の総数 | 897,420,185口 | 1,011,683,496口 |
| 2. 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は248,564,572円です。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は240,737,517円です。 |
| 3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.7230円 (7,230円) | 0.7620円 (7,620円) |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成20年10月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|----|-------------|-------------------------|
| | | |

| | | |
|----------|-------------|-------------|
| 株式 | 582,456,196 | 331,374,740 |
| 投資信託受益証券 | 1,106,749 | 8,737 |
| 投資証券 | 6,113,495 | 4,991,392 |
| 合計 | 589,676,440 | 336,374,869 |

(平成21年4月27日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額(円) | 計算期間の損益に 含まれた評価差額(円) |
|----------|-------------|-------------------------|
| 株式 | 693,283,380 | 2,350,050 |
| 新株予約権証券 | 5,603 | 785 |
| 投資信託受益証券 | 440,298 | 6,870 |
| 投資証券 | 6,739,609 | 583,661 |
| 合計 | 700,468,890 | 1,758,734 |

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

| 項目 | (自平成20年4月26日 至平成20年10月27日) | (自平成20年10月28日 至平成21年4月27日) |
|-------------------------|--|-------------------------------|
| 1.取引の内容 | 当親投資信託の利用しているデリバティブ取引は、為替予約及び株価指数先物取引であります。 | 同左 |
| 2.取引に対する取組方針 | デリバティブ取引は、将来の為替の変動、有価証券の価格変動リスクの回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。 | 同左 |
| 3.取引の利用目的 | デリバティブ取引は、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 |
| 4.取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動によるリスクであります。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、価格変動リスクであります。 | 同左 |
| 5.取引に係るリスク管理体制 | デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルールに従い、資金担当部門が運用部門担当者の承認を得て行っております。 | 同左 |
| 6.取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

| 区分 | 種類 | (平成20年10月27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 | 53,582,208 | - | 42,623,208 | 10,959,000 |
| | 合計 | 53,582,208 | - | 42,623,208 | 10,959,000 |

| 区分 | 種類 | (平成21年4月27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 | 57,385,390 | - | 63,709,772 | 6,324,382 |
| | 合計 | 57,385,390 | - | 63,709,772 | 6,324,382 |

(注) 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、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。

(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20年10月27日現在) | (平成21年4月27日現在) |
|--------------------------|-----------------|----------------|
| 1. 元本の推移 | | |
| 期首元本額 | 859,020,748円 | 897,420,185円 |
| 期中追加設定元本額 | 99,365,785円 | 185,325,112円 |
| 期中一部解約元本額 | 60,966,348円 | 71,061,801円 |
| 期末元本額 | 897,420,185円 | 1,011,683,496円 |
| 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) | 258,636,184円 | 292,943,224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) | 638,784,001円 | 718,740,272円 |

(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 | ANADARCO PETROLEUM CORP | 230 | 44.06 | 10,133.80 | |
| | APACHE CORP | 190 | 69.08 | 13,125.20 | |
| | ARCH COAL INC | 110 | 13.59 | 1,494.90 | |
| | BAKER HUGHES, INC | 200 | 35.46 | 7,092.00 | |
| | BJ SERVICES CO | 210 | 14.51 | 3,047.10 | |
| | CAMERON INTERNATIONAL CORP | 180 | 26.59 | 4,786.20 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 350 | 20.80 | 7,280.00 | |
| | CHEVRON CORP | 1,057 | 66.60 | 70,396.20 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 760 | 41.21 | 31,319.60 | |
| | CONSOL ENERGY INC | 170 | 30.46 | 5,178.20 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 230 | 52.36 | 12,042.80 | |
| | EL PASO CORPORATION | 436 | 6.92 | 3,017.12 | |
| | ENSCO INTERNATIONAL INC | 120 | 32.58 | 3,909.60 | |
| | EOG RESOURCES INC | 130 | 63.17 | 8,212.10 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 2,584 | 66.57 | 172,016.88 | |
| | HALLIBURTON CO | 512 | 20.62 | 10,557.44 | |
| | HESS CORP | 150 | 56.17 | 8,425.50 | |
| | MARATHON OIL CORP | 380 | 31.08 | 11,810.40 | |
| | MURPHY OIL CORP | 40 | 47.05 | 1,882.00 | |
| | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 294 | 31.50 | 9,261.00 | |
| | NOBLE CORP | 160 | 28.98 | 4,636.80 | |
| | NOBLE ENERGY INC | 100 | 60.69 | 6,069.00 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 430 | 55.87 | 24,024.10 | |
| | PATTERSON-UTI ENERGY INC | 160 | 14.00 | 2,240.00 | |
| | PEABODY ENERGY CORP | 150 | 27.16 | 4,074.00 | |
| | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 110 | 22.51 | 2,476.10 | |
| | SCHLUMBERGER LTD. | 650 | 49.73 | 32,324.50 | |
| | SOUTHWESTERN ENERGY CO | 220 | 34.43 | 7,574.60 | |
| | SPECTRA ENERGY CORP | 420 | 14.50 | 6,090.00 | |
| | TRANSOCEAN LTD | 179 | 68.20 | 12,207.80 | |
| | ULTRA PETROLEUM CORP | 100 | 42.81 | 4,281.00 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 320 | 21.68 | 6,937.60 | |
| | WEATHERFORD INTL LTD | 360 | 17.41 | 6,267.60 | |
| | WILLIAMS COS INC | 290 | 13.77 | 3,993.30 | |
| | XTO ENERGY INC | 297 | 34.09 | 10,124.73 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 110 | 62.60 | 6,886.00 | |
| | ALCOA INC | 430 | 9.14 | 3,930.20 | |
| | DOW CHEMICAL COMPANY | 570 | 12.99 | 7,404.30 | |
| | DU PONT (E. I.) DE NEMOURS | 460 | 28.78 | 13,238.80 | |
| | ECOLAB INC | 160 | 37.91 | 6,065.60 | |
| | FREEMONT-MCMORAN COPPER-B | 210 | 40.93 | 8,595.30 | |
| | INTERNATIONAL PAPER | 248 | 10.86 | 2,693.28 | |
| | MARTIN MARIETTA MATERIALS | 40 | 92.66 | 3,706.40 | |
| | MEADWESTVACO CORP | 200 | 15.55 | 3,110.00 | |
| | MONSANTO CO | 286 | 81.12 | 23,200.32 | |
| | MOSAIC CO/THE | 70 | 40.96 | 2,867.20 | |
| | NEWMONT MINING CORPORATION | 230 | 41.29 | 9,496.70 | |
| | NUCOR CORP | 180 | 40.54 | 7,297.20 | |

| | | | |
|--|-------|-------|-----------|
| OWENS-ILLINOIS INC | 150 | 19.49 | 2,923.50 |
| PPG INDUSTRIES INC | 100 | 45.46 | 4,546.00 |
| PRAXAIR INC. | 180 | 72.57 | 13,062.60 |
| UNITED STATES STEEL CORP | 70 | 29.03 | 2,032.10 |
| VULCAN MATERIALS CO | 40 | 51.49 | 2,059.60 |
| WEYERHAEUSER CO. | 128 | 37.64 | 4,817.92 |
| 3M CO | 380 | 57.00 | 21,660.00 |
| BOEING CO | 410 | 38.72 | 15,875.20 |
| CATERPILLAR, INC | 350 | 33.63 | 11,770.50 |
| CUMMINS INC | 120 | 33.38 | 4,005.60 |
| DANAHER CORP | 140 | 60.43 | 8,460.20 |
| DEERE AND CO | 260 | 40.52 | 10,535.20 |
| DOVER CORPORATION | 170 | 31.84 | 5,412.80 |
| EATON CORP | 90 | 44.00 | 3,960.00 |
| EMERSON ELECTRIC CO. | 410 | 33.60 | 13,776.00 |
| FLUOR CORP | 120 | 40.96 | 4,915.20 |
| GENERAL DYNAMICS CORPORATION | 200 | 49.18 | 9,836.00 |
| GENERAL ELECTRIC CO. | 5,543 | 12.11 | 67,125.73 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 410 | 31.45 | 12,894.50 |
| ILLINOIS TOOL WORKS, INC. | 270 | 33.87 | 9,144.90 |
| INGERSOLL-RAND CO LTD-CL A | 110 | 21.86 | 2,404.60 |
| ITT CORP | 140 | 41.55 | 5,817.00 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 40 | 45.66 | 1,826.40 |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | 80 | 75.93 | 6,074.40 |
| LOCKHEED MARTIN CORPORATION | 180 | 77.08 | 13,874.40 |
| MASCO CORP. | 300 | 10.09 | 3,027.00 |
| MCDERMOTT INTL INC | 60 | 16.51 | 990.60 |
| NORTHROP GRUMMAN CORPORATION | 170 | 48.86 | 8,306.20 |
| PACCAR INC | 190 | 34.93 | 6,636.70 |
| PARKER HANNIFIN CORP. | 105 | 43.90 | 4,609.50 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 80 | 73.10 | 5,848.00 |
| QUANTA SERVICES INC | 110 | 24.03 | 2,643.30 |
| RAYTHEON COMPANY | 220 | 43.82 | 9,640.40 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 90 | 31.31 | 2,817.90 |
| ROCKWELL COLLINS | 130 | 36.54 | 4,750.20 |
| TEXTRON, INC | 160 | 12.35 | 1,976.00 |
| TYCO INTERNATIONAL LTD | 265 | 23.24 | 6,158.60 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORPORATION | 500 | 49.37 | 24,685.00 |
| CINTAS CORPORATION | 100 | 26.83 | 2,683.00 |
| EQUIFAX INC | 90 | 28.81 | 2,592.90 |
| PITNEY-BOWES | 130 | 24.47 | 3,181.10 |
| R.R. DONNELLEY & SONS COMPANY | 130 | 11.12 | 1,445.60 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 271 | 19.51 | 5,287.21 |
| ROBERT HALF INTL INC | 160 | 23.46 | 3,753.60 |
| STERICYCLE INC | 30 | 48.40 | 1,452.00 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 270 | 26.89 | 7,260.30 |
| BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION | 190 | 67.14 | 12,756.60 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 120 | 53.35 | 6,402.00 |
| CSX CORPORATION | 230 | 30.97 | 7,123.10 |
| FEDEX CORP | 190 | 56.06 | 10,651.40 |
| NORFOLK SOUTHERN CORPORATION | 190 | 37.79 | 7,180.10 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO. | 300 | 7.59 | 2,277.00 |
| UNION PACIFIC CORP | 230 | 49.13 | 11,299.90 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 360 | 53.28 | 19,180.80 |
| FORD MOTOR COMPANY | 850 | 5.00 | 4,250.00 |
| GENERAL MOTORS CORPORATION COM. | 235 | 1.69 | 397.15 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 130 | 20.44 | 2,657.20 |
| JOHNSON CONTROLS INC. | 400 | 19.54 | 7,816.00 |
| BLACK + DECKER CORP COM | 60 | 37.23 | 2,233.80 |
| COACH INC | 190 | 22.52 | 4,278.80 |
| DR HORTON INC | 200 | 12.99 | 2,598.00 |
| EASTMAN KODAK CO. | 110 | 4.09 | 449.90 |
| FORTUNE BRANDS INC. | 90 | 37.41 | 3,366.90 |
| GARMIN LTD | 50 | 23.66 | 1,183.00 |
| LEGGETT AND PLATT INC | 200 | 14.92 | 2,984.00 |
| MATTEL INC. | 300 | 15.09 | 4,527.00 |
| NEWELL RUBBERMAID INC | 250 | 8.30 | 2,075.00 |

| | | | |
|--|-------|--------|-----------|
| NIKE INC. CLASS B | 230 | 54.73 | 12,587.90 |
| VF CORP | 50 | 68.92 | 3,446.00 |
| APOLLO GROUP INC-CL A | 100 | 61.16 | 6,116.00 |
| BLOCK H AND R INC | 200 | 15.24 | 3,048.00 |
| CARNIVAL CORP | 240 | 28.43 | 6,823.20 |
| INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY | 130 | 11.44 | 1,487.20 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 200 | 22.30 | 4,460.00 |
| MCDONALD'S CORP | 600 | 54.31 | 32,586.00 |
| MGM MIRAGE | 60 | 6.08 | 364.80 |
| STARBUCKS CORP | 380 | 13.51 | 5,133.80 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 120 | 20.82 | 2,498.40 |
| YUM! BRANDS INC | 300 | 34.87 | 10,461.00 |
| CBS CORP-CL B | 235 | 6.22 | 1,461.70 |
| COMCAST CORP CL-A | 990 | 13.89 | 13,751.10 |
| COMCAST CORPORATION SPECIAL CLASS A | 510 | 12.99 | 6,624.90 |
| DIRECTV GROUP INC/THE | 285 | 24.98 | 7,119.30 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 98 | 18.22 | 1,785.56 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 98 | 16.82 | 1,648.36 |
| GANNETT INC. COM. | 100 | 3.45 | 345.00 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES, INC. | 400 | 5.54 | 2,216.00 |
| LIBERTY GLOBAL INC-A | 118 | 16.10 | 1,899.80 |
| LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C | 118 | 15.84 | 1,869.12 |
| LIBERTY MEDIA CORP-ENT SER A | 236 | 24.21 | 5,713.56 |
| MCGRAW HILL COMPANIES INC. | 190 | 29.07 | 5,523.30 |
| NEWS CORP CLASS B WHEN ISSUE | 224 | 8.92 | 1,998.08 |
| NEWS CORP INC-CL A | 1,114 | 7.94 | 8,845.16 |
| OMNICOM GROUP | 180 | 29.37 | 5,286.60 |
| TIME WARNER CABLE | 164 | 27.27 | 4,472.28 |
| TIME WARNER INC | 656 | 22.33 | 14,648.48 |
| VIACOM INC CLASS-B | 295 | 19.45 | 5,737.75 |
| WALT DISNEY CORPORATION | 1,020 | 20.26 | 20,665.20 |
| AMAZON COM INC | 200 | 84.46 | 16,892.00 |
| AUTOZONE INC | 20 | 161.68 | 3,233.60 |
| BED BATH & BEYOND INC | 200 | 30.36 | 6,072.00 |
| BEST BUY CO INC | 230 | 39.27 | 9,032.10 |
| EXPEDIA INC | 150 | 11.24 | 1,686.00 |
| GAP INC. | 355 | 15.28 | 5,424.40 |
| GENUINE PARTS CO | 100 | 34.91 | 3,491.00 |
| HOME DEPOT INC | 970 | 26.31 | 25,520.70 |
| J.C PENNEY COMPANY | 100 | 28.15 | 2,815.00 |
| KOHL'S CORP | 210 | 45.43 | 9,540.30 |
| LIBERTY MEDIA INTERACTIVE A LIMITED BRANDS INC | 296 | 5.07 | 1,500.72 |
| LIBERTY MEDIA INTERACTIVE A LIMITED BRANDS INC | 260 | 11.05 | 2,873.00 |
| LOWE'S COMPANIES | 830 | 21.09 | 17,504.70 |
| MACY'S INC | 244 | 13.23 | 3,228.12 |
| SHERWIN WILLIAMS COMPANY | 80 | 58.50 | 4,680.00 |
| STAPLES INC | 365 | 21.91 | 7,997.15 |
| TARGET CORP | 430 | 40.08 | 17,234.40 |
| TIFFANY & CO NEW | 130 | 28.71 | 3,732.30 |
| TJX COMPANIES INC | 260 | 28.13 | 7,313.80 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 230 | 48.17 | 11,079.10 |
| CVS CAREMARK CORP | 750 | 29.73 | 22,297.50 |
| KROGER COMPANY | 310 | 21.42 | 6,640.20 |
| SAFeway INC | 280 | 20.15 | 5,642.00 |
| SUPERVALU INC | 59 | 16.40 | 967.60 |
| SYSCO CORPORATION COM. | 390 | 22.80 | 8,892.00 |
| WAL-MART STORES INC. | 1,190 | 47.87 | 56,965.30 |
| WALGREEN COMPANY | 490 | 29.59 | 14,499.10 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,190 | 16.92 | 20,134.80 |
| ARCHER DANIELS MIDLAND CO | 304 | 23.77 | 7,226.08 |
| BUNGE LIMITED | 80 | 48.08 | 3,846.40 |
| CAMPBELL SOUP COMPANY | 200 | 24.87 | 4,974.00 |
| CONAGRA FOODS INC | 350 | 17.89 | 6,261.50 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I | 134 | 19.00 | 2,546.00 |
| GENERAL MILLS INC | 180 | 48.73 | 8,771.40 |
| HERSHEY FOODS CORP | 140 | 36.18 | 5,065.20 |

| | | | |
|------------------------------|-------|-------|-----------|
| HJ HEINZ CO | 190 | 33.38 | 6,342.20 |
| KELLOGG CO | 170 | 38.94 | 6,619.80 |
| KRAFT FOODS INC-A | 828 | 22.26 | 18,431.28 |
| LORILLARD INC | 110 | 62.60 | 6,886.00 |
| PEPSICO INC. | 820 | 48.52 | 39,786.40 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,080 | 37.43 | 40,424.40 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 120 | 39.29 | 4,714.80 |
| SARA LEE CORP | 420 | 8.20 | 3,444.00 |
| THE COCA-COLA COMPANY | 1,090 | 42.79 | 46,641.10 |
| AVON PRODUCTS INC. | 320 | 22.63 | 7,241.60 |
| CLOROX COMPANY | 100 | 56.03 | 5,603.00 |
| COLGATE-PALMOLIVECO | 270 | 59.16 | 15,973.20 |
| KIMBERLY CLARK CORP. COM. | 230 | 49.31 | 11,341.30 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,507 | 49.51 | 74,611.57 |
| AETNA INC | 260 | 23.96 | 6,229.60 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 130 | 34.58 | 4,495.40 |
| BARD (C.R.) INC | 60 | 71.20 | 4,272.00 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 310 | 48.07 | 14,901.70 |
| BECTON DICKINSON & COMPANY | 130 | 62.47 | 8,121.10 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP. | 755 | 8.39 | 6,334.45 |
| CARDINAL HEALTH INC | 190 | 33.84 | 6,429.60 |
| CIGNA CORPORATION | 180 | 19.58 | 3,524.40 |
| COVENTRY HEALTH CARE INC | 130 | 13.72 | 1,783.60 |
| COVIDIEN LTD | 265 | 33.09 | 8,768.85 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 130 | 27.01 | 3,511.30 |
| EXPRESS SCRIPTS INC | 140 | 58.45 | 8,183.00 |
| HOSPIRA INC | 120 | 31.60 | 3,792.00 |
| IMS HEALTH INCORPORATED | 200 | 12.33 | 2,466.00 |
| MCKESSON CORP | 148 | 35.85 | 5,305.80 |
| MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC | 270 | 41.63 | 11,240.10 |
| MEDTRONIC INC. | 620 | 29.58 | 18,339.60 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 130 | 50.23 | 6,529.90 |
| ST JUDE MEDICAL INC | 210 | 34.72 | 7,291.20 |
| STRYKER CORP | 150 | 38.53 | 5,779.50 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 660 | 23.06 | 15,219.60 |
| WELLPOINT INC | 310 | 40.94 | 12,691.40 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 130 | 44.62 | 5,800.60 |
| ABBOTT LABORATORIES | 790 | 43.09 | 34,041.10 |
| ALLERGAN INC | 150 | 47.08 | 7,062.00 |
| AMGEN INC | 570 | 49.83 | 28,403.10 |
| BIOGEN IDEC INC | 170 | 46.08 | 7,833.60 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO. | 1,080 | 20.10 | 21,708.00 |
| CELGENE CORP | 240 | 39.86 | 9,566.40 |
| CEPHALON INC | 10 | 65.54 | 655.40 |
| ELI LILLY & CO | 540 | 33.01 | 17,825.40 |
| FOREST LABORATORIES INC | 70 | 21.28 | 1,489.60 |
| GENZYME CORP-GENL DIVISION | 140 | 53.20 | 7,448.00 |
| GILEAD SCIENCES INC | 500 | 45.80 | 22,900.00 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,440 | 50.92 | 73,324.80 |
| MERCK AND CO. INC. | 1,140 | 23.45 | 26,733.00 |
| PFIZER INC | 3,500 | 13.17 | 46,095.00 |
| SCHERING-PLOUGH CORP | 900 | 22.17 | 19,953.00 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 270 | 33.15 | 8,950.50 |
| WATERS CORP | 70 | 37.52 | 2,626.40 |
| WYETH | 700 | 42.10 | 29,470.00 |
| BB&T CORPORATION | 330 | 23.42 | 7,728.60 |
| COMERICA INC. | 100 | 22.08 | 2,208.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 430 | 3.71 | 1,595.30 |
| HUDSON CITY BANCORP INC | 320 | 12.81 | 4,099.20 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 300 | 3.24 | 972.00 |
| KEYCORP | 240 | 7.00 | 1,680.00 |
| M & T BANK CORP | 50 | 53.56 | 2,678.00 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 282 | 43.22 | 12,188.04 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 300 | 5.56 | 1,668.00 |
| SUNTRUST BANKS INC. | 169 | 15.96 | 2,697.24 |
| U.S. BANCORP | 1,055 | 18.97 | 20,013.35 |
| WELLS FARGO & COMPANY | 2,007 | 21.40 | 42,949.80 |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 640 | 25.30 | 16,192.00 |

| | | | |
|-----------------------------------|-------|----------|-----------|
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 120 | 26.44 | 3,172.80 |
| BANK OF AMERICA CORP | 3,627 | 9.10 | 33,005.70 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 614 | 26.88 | 16,504.32 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 200 | 19.02 | 3,804.00 |
| CHARLES SCHWAB CORPORATION | 550 | 17.84 | 9,812.00 |
| CITIGROUP INC | 2,890 | 3.19 | 9,219.10 |
| CME GROUP INC | 30 | 239.80 | 7,194.00 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 195 | 9.09 | 1,772.55 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 100 | 61.66 | 6,166.00 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 210 | 121.30 | 25,473.00 |
| INVESCO LTD | 308 | 14.68 | 4,521.44 |
| JP MORGAN CHASE&CO | 1,920 | 33.38 | 64,089.60 |
| LEGG MASON INC | 70 | 20.27 | 1,418.90 |
| MOODY'S CORPORATION | 140 | 28.84 | 4,037.60 |
| MORGAN STANLEY | 580 | 21.96 | 12,736.80 |
| NYSE EURONEXT | 80 | 22.81 | 1,824.80 |
| SLM CORP | 220 | 4.84 | 1,064.80 |
| STATE STREET CORP | 230 | 37.18 | 8,551.40 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 160 | 39.21 | 6,273.60 |
| ACE LTD | 220 | 44.00 | 9,680.00 |
| AFLAC INCORPORATED | 290 | 28.62 | 8,299.80 |
| ALLSTATE CORPORATION | 270 | 22.31 | 6,023.70 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 1,609 | 1.46 | 2,349.14 |
| AON CORPORATION | 170 | 40.64 | 6,908.80 |
| ASSURANT INC | 30 | 28.18 | 845.40 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 10 | 2,910.00 | 29,100.00 |
| CHUBB CORP | 200 | 40.36 | 8,072.00 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 150 | 24.61 | 3,691.50 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 30 | 71.47 | 2,144.10 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP | 160 | 9.59 | 1,534.40 |
| LINCOLN NATIONAL CORPORATION | 140 | 10.16 | 1,422.40 |
| LOEWS CORP | 200 | 25.02 | 5,004.00 |
| MARSH & MCLENNAN COMPANIES | 310 | 20.38 | 6,317.80 |
| METLIFE INC | 430 | 29.25 | 12,577.50 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 130 | 15.31 | 1,990.30 |
| PROGRESSIVE CORP | 400 | 15.46 | 6,184.00 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 290 | 28.33 | 8,215.70 |
| THE TRAVELERS COS INC | 310 | 39.50 | 12,245.00 |
| UNUM GROUP | 70 | 15.04 | 1,052.80 |
| WR BERKLEY CORP | 130 | 23.06 | 2,997.80 |
| ACCENTURE LTD-CL A | 320 | 29.27 | 9,366.40 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 290 | 26.42 | 7,661.80 |
| AUTODESK INC | 100 | 19.68 | 1,968.00 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 270 | 35.35 | 9,544.50 |
| BMC SOFTWARE INC | 70 | 34.65 | 2,425.50 |
| CA INC | 300 | 18.13 | 5,439.00 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 180 | 23.01 | 4,141.80 |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 130 | 37.07 | 4,819.10 |
| EBAY INC | 630 | 16.78 | 10,571.40 |
| ELECTRONIC ARTS INC. | 200 | 19.97 | 3,994.00 |
| FISERV INC | 130 | 36.67 | 4,767.10 |
| GOOGLE INC-CL A | 120 | 389.49 | 46,738.80 |
| INTUIT INC | 200 | 24.37 | 4,874.00 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 60 | 173.09 | 10,385.40 |
| MICROSOFT CORPORATION | 4,070 | 20.91 | 85,103.70 |
| ORACLE CORP | 2,185 | 19.79 | 43,241.15 |
| PAYCHEX INC. | 210 | 27.46 | 5,766.60 |
| SYMANTEC CORP | 580 | 17.70 | 10,266.00 |
| VERISIGN INC | 200 | 19.36 | 3,872.00 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 250 | 60.38 | 15,095.00 |
| WESTERN UNION CO | 469 | 17.47 | 8,193.43 |
| YAHOO INC | 860 | 14.73 | 12,667.80 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 225 | 16.90 | 3,802.50 |
| APPLE INC | 450 | 123.90 | 55,755.00 |
| CISCO SYSTEMS INC | 2,970 | 18.42 | 54,707.40 |
| CORNING INC | 1,020 | 15.33 | 15,636.60 |
| DELL INC | 970 | 11.05 | 10,718.50 |
| EMC CORP/MASS | 1,180 | 11.96 | 14,112.80 |

| | | | |
|--|-------|--------|-----------|
| FLEXTRONICS INTL LTD | 547 | 3.85 | 2,105.95 |
| HEWLETT-PACKARD COMPANY | 1,300 | 35.80 | 46,540.00 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP. | 680 | 100.08 | 68,054.40 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 360 | 22.33 | 8,038.80 |
| LEXMARK INTERNATIONAL INC | 100 | 18.55 | 1,855.00 |
| MOTOROLA INC. | 1,610 | 5.81 | 9,354.10 |
| NETAPP INC | 240 | 18.63 | 4,471.20 |
| QUALCOMM INC | 890 | 41.36 | 36,810.40 |
| SUN MICROSYSTEMS INC | 447 | 9.20 | 4,112.40 |
| TYCO ELECTRONICS LTD | 275 | 17.05 | 4,688.75 |
| XEROX CORPORATION | 600 | 5.95 | 3,570.00 |
| AMERICAN TOWER CORP-CL A | 230 | 32.79 | 7,541.70 |
| AT&T INC | 3,002 | 25.16 | 75,530.32 |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 130 | 23.34 | 3,034.20 |
| EMBARQ CORP | 93 | 35.66 | 3,316.38 |
| NII HOLDINGS INC | 90 | 16.63 | 1,496.70 |
| QWEST COMM INTL | 1,360 | 3.51 | 4,773.60 |
| SPRINT NEXTEL CORP | 1,507 | 4.18 | 6,299.26 |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 1,440 | 31.00 | 44,640.00 |
| AES CORPORATION | 390 | 6.92 | 2,698.80 |
| ALLEGHENY ENERGY INC | 90 | 25.41 | 2,286.90 |
| AMEREN CORPORATION | 170 | 22.15 | 3,765.50 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY | 200 | 26.16 | 5,232.00 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 300 | 10.31 | 3,093.00 |
| CONSOLIDATED EDISON CO N.Y. INC. | 190 | 37.45 | 7,115.50 |
| CONSTELLATION ENERGY GROUP | 120 | 23.01 | 2,761.20 |
| DOMINION RESOURCES | 312 | 29.29 | 9,138.48 |
| DTE ENERGY COMPANY COM. | 130 | 27.95 | 3,633.50 |
| DUKE ENERGY CORP | 710 | 13.75 | 9,762.50 |
| EDISON INTERNATIONAL COMMON STOCK | 220 | 28.16 | 6,195.20 |
| ENERGEN CORP | 70 | 35.02 | 2,451.40 |
| ENTERGY CORP. | 100 | 64.00 | 6,400.00 |
| EQT CORP | 90 | 34.52 | 3,106.80 |
| EXELON CORPORATION | 330 | 44.72 | 14,757.60 |
| FIRSTENERGY CORP | 200 | 40.04 | 8,008.00 |
| FPL GROUP INC | 210 | 50.52 | 10,609.20 |
| PG&E CORP | 210 | 36.95 | 7,759.50 |
| PPL CORPORATION | 200 | 29.30 | 5,860.00 |
| PROGRESS ENERGY INC | 200 | 33.90 | 6,780.00 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 330 | 28.09 | 9,269.70 |
| SEMPRA ENERGY | 170 | 45.03 | 7,655.10 |
| SOUTHERN COMPANY | 390 | 29.46 | 11,489.40 |
| XCEL ENERGY INC | 270 | 18.39 | 4,965.30 |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC COM. | 261 | 3.51 | 916.11 |
| ALTERA CORPORATION | 160 | 16.29 | 2,606.40 |
| ANALOG DEVICES | 260 | 21.16 | 5,501.60 |
| APPLIED MATERIALS INC | 800 | 11.70 | 9,360.00 |
| BROADCOM CORP-CL A | 225 | 24.22 | 5,449.50 |
| INTEL CORP | 2,830 | 15.62 | 44,204.60 |

[次へ](#)

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------------|--|-------|-----------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 小計 | KLA-TENCOR CORP | 100 | 25.83 | 2,583.00 | |
| | LINEAR TECHNOLOGY CORP | 210 | 22.45 | 4,714.50 | |
| | MEMC ELECTRONIC MATERIALS | 110 | 15.44 | 1,698.40 | |
| | MICRON TECHNOLOGY | 550 | 4.86 | 2,673.00 | |
| | NVIDIA CORP | 120 | 11.43 | 1,371.60 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS, INC. | 760 | 17.88 | 13,588.80 | |
| | XILINX INC | 270 | 20.22 | 5,459.40 | |
| | | | | 4,003,161.26 | |
| | | | | (388,226,578) | |
| カナダドル | CAMECO CORP | 200 | 25.22 | 5,044.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 275 | 59.44 | 16,346.00 | |
| | ENBRIDGE INC | 200 | 36.93 | 7,386.00 | |
| | ENCANA CORP | 381 | 55.28 | 21,061.68 | |
| | HUSKY ENERGY INC | 223 | 29.90 | 6,667.70 | |
| | IMPERIAL OIL LTD. | 200 | 43.70 | 8,740.00 | |
| | NEXEN INC | 282 | 24.06 | 6,784.92 | |
| | PETRO-CANADA | 300 | 38.39 | 11,517.00 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 624 | 30.80 | 19,219.20 | |
| | TALISMAN ENERGY INC | 600 | 14.88 | 8,928.00 | |
| | TRANSCANADA CORP | 354 | 29.75 | 10,531.50 | |
| | AGNICO-EAGLE MINES | 100 | 60.26 | 6,026.00 | |
| | AGRIUM INC | 100 | 49.71 | 4,971.00 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 527 | 37.46 | 19,741.42 | |
| | GOLDCORP INC | 400 | 36.00 | 14,400.00 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 400 | 19.51 | 7,804.00 | |
| | POTASH CORPORATION OF SASKATCHEWAN, INC. | 188 | 101.59 | 19,098.92 | |
| | TECK COMINCO LTD-CL B | 224 | 12.36 | 2,768.64 | |
| | YAMANA GOLD INC | 441 | 10.12 | 4,462.92 | |
| | BOMBARDIER INC CLASS B | 1,000 | 3.64 | 3,640.00 | |
| | CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO | 253 | 49.44 | 12,508.32 | |
| | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 155 | 42.85 | 6,641.75 | |
| | SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 307 | 18.25 | 5,602.75 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 200 | 32.68 | 6,536.00 | |
| | LOBLAW COMPANIES LTD | 100 | 32.68 | 3,268.00 | |
| | SHOPPERS DRUG MART CORP | 147 | 43.54 | 6,400.38 | |
| | BIOVAIL CORPORATION | 100 | 13.99 | 1,399.00 | |
| | BANK OF MONTREAL | 282 | 40.09 | 11,305.38 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 599 | 35.17 | 21,066.83 | |
| | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 203 | 53.98 | 10,957.94 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 100 | 43.85 | 4,385.00 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 776 | 42.04 | 32,623.04 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 338 | 48.52 | 16,399.76 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 43 | 34.66 | 1,490.38 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 17 | 308.24 | 5,240.08 | |
| | GREAT WEST LIFECO INC | 132 | 20.85 | 2,752.20 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 790 | 20.69 | 16,345.10 | |
| POWER CORP OF CANADA | 200 | 22.52 | 4,504.00 | | |
| POWER FINANCIAL CORP | 200 | 23.99 | 4,798.00 | | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 300 | 28.67 | 8,601.00 | | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 300 | 18.18 | 5,454.00 | | |
| RESEARCH IN MOTION | 298 | 83.40 | 24,853.20 | | |
| BCE INC | 201 | 26.57 | 5,340.57 | | |
| ROGERS COMMUNICATIONS CL B | 300 | 29.07 | 8,721.00 | | |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 19 | 35.00 | 665.00 | | |
| TRANSALTA CORP | 53 | 19.45 | 1,030.85 | | |
| | | | | 434,028.43 | |
| | | | | (34,670,190) | |
| ユーロ | ENI SPA | 1,347 | 15.45 | 20,811.15 | |
| | FUGRO NV-CVA | 23 | 26.34 | 605.82 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 120 | 9.80 | 1,176.00 | |
| | NESTE OIL OYJ | 70 | 10.39 | 727.30 | |
| | OMV AG | 90 | 24.91 | 2,241.90 | |
| | REPSOL YPF S.A | 437 | 14.39 | 6,288.43 | |

| | | | |
|---------------------------------------|-------|--------|-----------|
| SAIPEM | 195 | 15.37 | 2,997.15 |
| SBM OFFSHORE NV | 22 | 11.89 | 261.69 |
| TENARIS SA | 255 | 9.21 | 2,349.82 |
| TOTAL SA | 1,109 | 38.34 | 42,524.60 |
| AKZO NOBEL N.V | 134 | 32.13 | 4,306.09 |
| ARCELORMITTAL | 476 | 20.60 | 9,807.98 |
| BASF SE | 516 | 27.13 | 13,999.08 |
| CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL | 58 | 4.50 | 261.00 |
| CRH PLC | 354 | 16.82 | 5,954.28 |
| K+S AG | 49 | 44.67 | 2,188.83 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 56 | 22.10 | 1,237.60 |
| L'AIR LIQUIDE | 156 | 65.97 | 10,292.10 |
| LAFARGE | 73 | 41.67 | 3,041.91 |
| LINDE AG | 67 | 58.70 | 3,932.90 |
| SALZGITTER AG | 5 | 56.79 | 283.95 |
| SOLVAY SA | 39 | 64.65 | 2,521.35 |
| STORA ENSO OYJ-R | 461 | 4.33 | 1,996.13 |
| THYSSEN KRUPP AG | 192 | 17.66 | 3,390.72 |
| UMICORE | 41 | 17.06 | 699.66 |
| UPM-KEMMENE | 310 | 6.58 | 2,039.80 |
| VOESTALPINE AG | 60 | 15.17 | 910.20 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 149 | 37.05 | 5,520.45 |
| ALSTOM | 124 | 47.01 | 5,829.24 |
| BOUYGUES | 134 | 33.00 | 4,422.00 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 209 | 27.00 | 5,643.00 |
| EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE | 246 | 11.40 | 2,804.40 |
| FINMECCANICA SPA | 260 | 9.84 | 2,558.40 |
| FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA | 65 | 26.99 | 1,754.35 |
| GAMESA CORP TECNOLOGICA SA | 94 | 13.13 | 1,234.22 |
| GEA GROUP AG | 132 | 9.91 | 1,308.12 |
| KONE OYJ-B | 86 | 19.70 | 1,694.20 |
| KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS NV | 511 | 13.56 | 6,929.16 |
| MAN AG | 62 | 45.10 | 2,796.20 |
| METSO OYJ | 79 | 10.95 | 865.05 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA | 107 | 56.52 | 6,047.64 |
| SIEMENS AG | 466 | 49.14 | 22,899.24 |
| STRABAG SE-BR | 10 | 15.85 | 158.50 |
| THALES | 108 | 31.00 | 3,348.00 |
| VALLOUREC | 8 | 85.05 | 680.40 |
| VINCI SA | 264 | 33.82 | 8,928.48 |
| WARTSILA OYJ-B SHARES | 53 | 23.75 | 1,258.75 |
| WIENERBERGER AG | 60 | 8.26 | 495.60 |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA | 195 | 12.72 | 2,480.40 |
| ATLANTIA SPA | 169 | 12.97 | 2,191.93 |
| BRISA | 159 | 5.38 | 855.42 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 191 | 9.60 | 1,833.60 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 530 | 8.55 | 4,534.15 |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | 358 | 3.45 | 1,235.10 |
| TNT NV | 208 | 13.25 | 2,757.04 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 119 | 27.21 | 3,237.99 |
| DAIMLER AG | 422 | 27.30 | 11,520.60 |
| FIAT SPA | 350 | 7.69 | 2,691.50 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 60 | 37.55 | 2,253.30 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 37 | 11.80 | 436.60 |
| PEUGEOT SA | 99 | 17.75 | 1,757.25 |
| PIRELLI & C | 3,103 | 0.30 | 955.72 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 51 | 53.76 | 2,741.76 |
| RENAULT SA | 92 | 23.30 | 2,144.06 |
| VOLKSWAGEN AG | 50 | 236.30 | 11,815.00 |
| VOLKSWAGEN AG PREFERRED STOCK | 50 | 50.25 | 2,512.50 |
| ADIDAS AG | 117 | 30.58 | 3,577.86 |
| HERMES INTERNATIONAL | 43 | 100.24 | 4,310.53 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 57 | 13.51 | 770.07 |
| LVMH MOET-HENNESSY LOUIS VUITTON | 125 | 57.90 | 7,238.12 |
| ACCOR | 145 | 32.68 | 4,739.32 |
| OPAP SA | 160 | 21.83 | 3,492.80 |
| TUI AG | 140 | 8.03 | 1,124.20 |

| | | | |
|----------------------------------|-------|--------|-----------|
| LAGARDERE S.C.A. | 55 | 24.50 | 1,347.77 |
| MEDIASET SPA | 596 | 4.11 | 2,452.54 |
| PUBLICIS GROUPE | 55 | 22.00 | 1,210.00 |
| REED ELSEVIER NV | 339 | 8.39 | 2,845.22 |
| SES | 168 | 13.80 | 2,318.40 |
| VIVENDI SA | 710 | 19.98 | 14,185.80 |
| WOLTERS KLUWER | 172 | 12.70 | 2,184.40 |
| ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE T | 48 | 4.12 | 197.76 |
| INDITEX | 134 | 32.93 | 4,412.62 |
| PPR | 45 | 60.82 | 2,736.90 |
| CARREFOUR SA | 326 | 29.50 | 9,617.00 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 65 | 47.25 | 3,071.25 |
| COLRUYT SA | 4 | 164.62 | 658.48 |
| DELHAIZE GROUP | 62 | 51.88 | 3,216.87 |
| KESKO OYJ-B SHS | 75 | 17.30 | 1,297.50 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 634 | 8.54 | 5,415.62 |
| METRO AG | 84 | 30.54 | 2,565.36 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | 349 | 22.50 | 7,852.50 |
| COCA-COLA HELLENIC BOTTLING | 150 | 11.53 | 1,729.50 |
| GROUPE DANONE | 248 | 36.84 | 9,136.32 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 17 | 17.25 | 293.33 |
| HEINEKEN NV | 111 | 20.55 | 2,281.05 |
| KERRY GROUP PLC-A | 46 | 14.87 | 684.43 |
| PERNOD-RICARD | 89 | 42.30 | 3,764.70 |
| PERNOD-RICARD SA - RTS | 89 | 2.65 | 235.85 |
| UNILEVER NV-CVA | 863 | 14.66 | 12,655.89 |
| BEIERSDORF AG | 12 | 29.81 | 357.72 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 132 | 19.78 | 2,610.96 |
| L'OREAL | 122 | 52.01 | 6,345.83 |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 37 | 31.78 | 1,175.86 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO | 101 | 28.99 | 2,927.99 |
| FRESENIUS SE-PFD | 21 | 39.21 | 823.41 |
| BAYER AG | 410 | 38.97 | 15,977.70 |
| ELAN CORPORATION PLC | 193 | 4.35 | 839.55 |
| MERCK KGAA | 46 | 66.50 | 3,059.00 |
| SANOFI-AVENTIS | 576 | 40.71 | 23,448.96 |
| UCB SA | 95 | 23.34 | 2,217.77 |
| ALPHA BANK A.E. | 238 | 6.55 | 1,558.90 |
| ANGLO IRISH BANK CORP PLC | 222 | 0.00 | 0.00 |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 1,153 | 1.22 | 1,417.03 |
| BANCA POPOLARE DI MILANO | 217 | 4.02 | 873.42 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | 2,036 | 8.07 | 16,430.52 |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R | 1,393 | 0.70 | 977.88 |
| BANCO DE SABADELL SA | 493 | 4.32 | 2,129.76 |
| BANCO ESPIRITO SANTO-REG | 127 | 3.79 | 482.47 |
| BANCO POPOLARE SPA | 361 | 4.90 | 1,769.80 |
| BANCO POPULAR ESPANOL SA | 545 | 6.29 | 3,428.05 |
| BANCO SANTANDER SA | 4,423 | 6.72 | 29,722.56 |
| BNP PARIBAS | 507 | 38.41 | 19,473.87 |
| COMMERZBANK AG DM50 | 409 | 5.06 | 2,071.58 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 431 | 10.57 | 4,555.67 |
| DEUTSCHE POSTBANK AG | 8 | 15.25 | 122.00 |
| DEXIA | 314 | 3.89 | 1,223.97 |
| EFG EUROBANK ERGASIAS | 130 | 5.62 | 730.60 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 100 | 15.55 | 1,555.00 |
| INTESA SANPAOLO | 4,005 | 2.29 | 9,181.46 |
| INTESA SANPAOLO-RNC | 416 | 1.56 | 650.62 |
| KBC GROUPE | 76 | 16.40 | 1,246.40 |
| NATIONAL BANK OF GREECE | 251 | 14.45 | 3,626.95 |
| PIRAEUS BANK S.A | 170 | 6.16 | 1,047.20 |
| RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING | 20 | 25.19 | 503.80 |
| SOCIETE GENERALE-A | 253 | 38.37 | 9,707.61 |
| UNICREDIT SPA | 6,300 | 1.84 | 11,598.30 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC | 416 | 10.14 | 4,218.24 |
| DEUTSCHE BANK AG REG | 296 | 41.12 | 12,171.52 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 104 | 52.40 | 5,449.60 |
| FORTIS | 882 | 1.88 | 1,660.80 |
| GROUPE BRAUXELLES LAMBERT SA | 55 | 54.88 | 3,018.67 |

| | | | | |
|---------|--|-------|-------|---------------|
| | ING GROEP NV | 1,107 | 6.17 | 6,830.19 |
| | MEDIOBANCA | 305 | 7.79 | 2,375.95 |
| | AEGON NV | 847 | 3.21 | 2,723.95 |
| | ALLEANZA ASSICURAZIONI | 281 | 4.98 | 1,400.78 |
| | ALLIANZ SE | 243 | 70.45 | 17,119.35 |
| | ASSICURAZIONI GENERALI | 545 | 15.27 | 8,322.15 |
| | AXA | 873 | 11.91 | 10,397.43 |
| | MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 114 | 94.47 | 10,769.58 |
| | SAMPO OYJ-A SHS | 238 | 13.59 | 3,234.42 |
| | CAP GEMINI SOGETI SA | 90 | 27.63 | 2,486.70 |
| | SAP AG | 474 | 31.12 | 14,750.88 |
| | ALCATEL-LUCENT | 729 | 1.82 | 1,333.34 |
| | NOKIA OYJ | 1,974 | 10.75 | 21,220.50 |
| | BELGACOM SA | 107 | 22.48 | 2,405.89 |
| | DEUTSCHE TELEKOM AG | 1,531 | 8.97 | 13,733.07 |
| | ELISA OYJ | 77 | 10.05 | 773.85 |
| | FRANCE TELECOM SA | 1,022 | 16.32 | 16,679.04 |
| | HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION | 160 | 11.72 | 1,875.20 |
| | KONINKLIJKE KPN NV | 943 | 9.46 | 8,920.78 |
| | PORTUGAL TELECOM, SA-REGISTERED SHARES | 345 | 5.65 | 1,949.25 |
| | TELECOM ITALIA SPA | 5,688 | 0.92 | 5,244.33 |
| | TELECOM ITALIA-RNC | 3,712 | 0.68 | 2,546.43 |
| | TELEFONICA S.A | 2,241 | 14.95 | 33,502.95 |
| | TELEKOM AUSTRIA AG | 210 | 10.85 | 2,278.50 |
| | A2A SPA | 250 | 1.15 | 289.50 |
| | ACCIONA SA | 16 | 78.80 | 1,260.80 |
| | E.ON AG | 974 | 23.92 | 23,298.08 |
| | EDP RENOVAVEIS SA | 121 | 5.93 | 718.25 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE | 140 | 35.02 | 4,902.80 |
| | ENEL SPA | 2,268 | 3.80 | 8,624.07 |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL | 1,011 | 2.70 | 2,732.73 |
| | FORTUM OYJ | 247 | 14.63 | 3,613.61 |
| | GAS NATURAL SDG-E | 212 | 12.12 | 2,569.44 |
| | GDF SUEZ | 588 | 25.80 | 15,170.40 |
| | IBERDROLA SA | 1,908 | 5.87 | 11,199.96 |
| | OEST ELEKTRIZATSWIRTS-CL A(VERBUND) | 50 | 29.49 | 1,474.50 |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 110 | 30.58 | 3,363.80 |
| | RWE AG | 249 | 53.10 | 13,221.90 |
| | SNAM RETE GAS | 515 | 3.61 | 1,859.15 |
| | SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 24 | 12.00 | 288.00 |
| | TERNA SPA | 355 | 2.38 | 846.67 |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 289 | 19.68 | 5,688.96 |
| | ASML HOLDING NV | 234 | 15.16 | 3,547.44 |
| | STMICROELECTRONICS NV | 417 | 4.98 | 2,077.91 |
| 小計 | | | | 927,608.20 |
| | | | | (118,668,917) |
| イギリスポンド | AMEC PLC | 149 | 6.14 | 914.86 |
| | BG GROUP PLC | 1,791 | 10.85 | 19,432.35 |
| | BP PLC | 9,519 | 4.78 | 45,572.21 |
| | CAIRN ENERGY PLC | 19 | 22.32 | 424.08 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK | 1,860 | 15.67 | 29,146.20 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 1,379 | 15.39 | 21,222.81 |
| | TULLOW OIL PLC | 334 | 8.03 | 2,682.02 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 625 | 14.22 | 8,887.50 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 243 | 5.58 | 1,355.94 |
| | BHP BILLITON PLC | 1,162 | 14.35 | 16,674.70 |
| | EURASIAN NATURAL RESOURC-W/I | 50 | 6.02 | 301.25 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 148 | 12.28 | 1,817.44 |
| | LONMIN PLC | 66 | 13.91 | 918.06 |
| | REXAM PLC | 377 | 2.90 | 1,094.24 |
| | RIO TINTO PLC | 572 | 26.94 | 15,409.68 |
| | VEDANTA RESOURCES PLC | 14 | 9.92 | 138.88 |
| | XSTRATA PLC | 286 | 6.00 | 1,716.00 |
| | BAE SYSTEMS PLC | 1,897 | 3.50 | 6,653.72 |
| | BUNZL PLC | 217 | 5.31 | 1,152.27 |

| | | | |
|-----------------------------------|--------|-------|------------|
| COBHAM PLC | 437 | 1.83 | 802.76 |
| INVENSYS PLC | 590 | 1.80 | 1,064.95 |
| ROLLS-ROYCE GROUP PLC | 1,091 | 3.27 | 3,570.29 |
| ROLLS-ROYCE GROUP-C SHRS ENT | 93,607 | 0.001 | 93.60 |
| SMITHS GROUP PLC | 251 | 7.45 | 1,871.20 |
| WOLSELEY PLC | 41 | 11.88 | 487.08 |
| CAPITA GROUP PLC | 322 | 6.84 | 2,202.48 |
| EXPERIAN PLC | 601 | 4.42 | 2,659.42 |
| HAYS PLC | 1,330 | 0.85 | 1,137.15 |
| SERCO GROUP PLC | 194 | 3.71 | 721.19 |
| BRITISH AIRWAYS | 541 | 1.63 | 886.69 |
| FIRSTGROUP PLC | 212 | 3.14 | 665.68 |
| BURBERRY GROUP PLC | 173 | 4.02 | 695.89 |
| CARNIVAL PLC | 118 | 19.39 | 2,288.02 |
| COMPASS GROUP | 1,138 | 3.35 | 3,820.83 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 265 | 6.72 | 1,780.80 |
| LADBROKES PLC | 506 | 2.25 | 1,142.29 |
| BRITISH SKY BROADCASTING PLC | 653 | 4.47 | 2,918.91 |
| ITV PLC | 1,750 | 0.33 | 577.50 |
| PEARSON PLC | 438 | 6.96 | 3,048.48 |
| REED ELSEVIER PLC | 630 | 5.06 | 3,187.80 |
| THOMSON REUTERS PLC | 115 | 17.04 | 1,959.60 |
| WPP GROUP PLC | 502 | 4.34 | 2,179.93 |
| HOME RETAIL GROUP | 488 | 2.82 | 1,376.16 |
| KINGFISHER PLC | 1,841 | 1.86 | 3,438.98 |
| MARKS AND SPENCER PLC | 764 | 3.41 | 2,610.97 |
| SAINSBURY (J) PLC | 646 | 3.23 | 2,088.19 |
| TESCO PLC | 3,976 | 3.55 | 14,130.70 |
| WM MORRISON SUPERMARKETS | 1,273 | 2.50 | 3,188.86 |
| BRITISH AMERICAN TABACCO PLC | 1,019 | 16.04 | 16,344.76 |
| CADBURY PLC | 718 | 4.96 | 3,561.28 |
| DIAGEO PLC | 1,306 | 7.88 | 10,291.28 |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC | 566 | 15.36 | 8,693.76 |
| SABMILLER PLC | 486 | 10.82 | 5,258.52 |
| UNILEVER PLC | 622 | 12.86 | 7,998.92 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 323 | 26.44 | 8,540.12 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 499 | 4.61 | 2,302.88 |
| ASTRAZENECA PLC | 772 | 23.94 | 18,481.68 |
| GLAXO SMITHKLINE | 2,679 | 10.06 | 26,950.74 |
| SHIRE PLC | 186 | 8.75 | 1,627.50 |
| BARCLAYS PLC | 3,598 | 2.36 | 8,491.28 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 8,997 | 4.76 | 42,825.72 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 3,546 | 1.00 | 3,546.00 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC | 9,368 | 0.33 | 3,119.54 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 1,112 | 9.87 | 10,975.44 |
| 3I GROUP PLC | 283 | 3.71 | 1,052.05 |
| ICAP PLC | 227 | 3.64 | 827.41 |
| INVESTEC PLC | 298 | 3.00 | 894.00 |
| MAN GROUP PLC | 821 | 2.48 | 2,042.23 |
| AVIVA PLC | 1,604 | 2.73 | 4,382.93 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 3,610 | 0.50 | 1,815.83 |
| OLD MUTUAL PLC | 2,209 | 0.60 | 1,327.60 |
| PRUDENTIAL PLC | 1,496 | 3.70 | 5,546.42 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 1,812 | 1.34 | 2,438.95 |
| STANDARD LIFE PLC | 1,034 | 1.88 | 1,952.19 |
| AUTONOMY CORP PLC | 125 | 13.41 | 1,676.25 |
| LOGICA PLC | 512 | 0.77 | 394.24 |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 351 | 1.84 | 647.94 |
| BT GROUP PLC | 4,280 | 0.88 | 3,770.68 |
| CABLE & WIRELESS PLC | 1,050 | 1.57 | 1,652.70 |
| VODAFONE GROUP PLC | 26,669 | 1.22 | 32,669.52 |
| CENTRICA PLC | 2,701 | 2.33 | 6,306.83 |
| INTERNATIONAL POWER PLC | 925 | 2.50 | 2,317.12 |
| NATIONAL GRID PLC | 1,276 | 5.35 | 6,826.60 |
| SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY | 541 | 10.65 | 5,761.65 |
| SEVERN TRENT PLC | 20 | 10.28 | 205.60 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 326 | 4.92 | 1,604.73 |
| 小計 | | | 507,233.50 |

(71,971,361)

4,053.00

5,783.45

13,685.70

22,156.86

3,720.00

3,301.92

5,236.00

8,246.80

1,868.90

75,673.34

2,727.50

1,932.00

526.00

53,414.68

53,746.00

25,261.88

2,444.64

21,616.00

1,355.25

6,615.00

17,290.00

4,203.50

334,858.42

(28,429,479)

スイスフラン

GIVAUDAN-REG 6
HOLCIM LTD-REG 103
SYNGENTA AG 57
ABB LTD 1,298
SULZER AG-REG 60
ADECCO SA REGISTER 72
SGS SA 4
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A 389
THE SWATCH GROUP AG-BR 11
NESTLE SA-REG 2,003
NOBEL BIOCARE HOLDING AG-REG 125
SYNTHES INC 15
LONZA GROUP AG-REG 5
NOVARTIS AG-REG SHS 1,258
ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN 385
CREDIT SUISSE GROUP AG 581
JULIUS BAER HOLDING AG-REG 66
UBS AG(REGISTERED) 1,544
SWISS LIFE HOLDING AG 15
SWISS RE - REG 245
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG 91
SWISSCOM AG 14

675.50
56.15
240.10
17.07
62.00
45.86
1,309.00
21.20
169.90
37.78
21.82
128.80
105.20
42.46
139.60
43.48
37.04
14.00
90.35
27.00
190.00
300.25

小計

スウェーデンクローナ

SSAB SVENSKT STAL AB-SER A 100
SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS 350
ALFA LAVAL AB 200
ASSA ABLOY AB-B 200
ATLAS COPCO AB-A SHS 400
ATLAS COPCO AB-B SHS 100
SANDVIK AB 700
SCANIA AB-B SHS 100
SKANSKA AB-B SHS 200
SKF AB-B SHARES 100
VOLVO AB B 550
SECURITAS AB-B SHS 200
ELECTROLUX B-F 85
HUSQVARNA AB-B SHS 285
HENNES AND MAURITZ AB B-F 250
SWEDISH MATCH AB 200
NORDEA BANK AB 1,170
SKANDINAVISKA ENSKILDA BK-A 222
SVENSKA HANDELSBANKEN -A SHS 244
SWEDBANK AB - A SHARES 200
INVESTOR AB-B SHS 238
ERICSSON LM B-F 1,548
TELE 2 AB-B SHS 200
TELIASONERA AB 1,291

84.75
71.50
74.00
101.50
78.75
71.25
67.50
85.75
85.50
91.75
54.00
70.50
93.75
42.40
356.00
124.50
57.80
35.90
147.75
45.10
121.25
76.50
73.00
38.40

小計

ノルウェークローネ

AKER SOLUTIONS ASA 100
SEADRILL LTD 150
STATOILHYDRO ASA 658
NORSK HYDRO ASA 300
YARA INTERNATIONAL 100
ORKLA ASA 450
RENEWABLE ENERGY CORP AS 100
DNB NOR ASA 250
TELENOR ASA 450

41.45
71.90
121.80
30.50
146.00
46.70
56.70
41.80
39.40

小計

デンマーククローネ

NOVOZYMES A/S-B SHARES 27
FLSMIDTH & CO A/S 31
VESTAS WIND SYSTEMS AS 93
A P MOELLER - MAERSK A/S - B 1
DSV A/S 37

409.00
179.50
328.00
32,500.00
60.00

173,689.40

(2,553,234)

11,043.00

5,564.50

30,504.00

32,500.00

2,220.00

| | | | | |
|------------|---|-------|--------|--------------|
| | CARLSBERG AS-B | 100 | 253.50 | 25,350.00 |
| | DANISCO A/S | 29 | 186.25 | 5,401.25 |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 7 | 264.50 | 1,851.50 |
| | NOVO-NORDISK A/S-B | 245 | 270.00 | 66,150.00 |
| | DANSKE BANK A/S | 229 | 62.00 | 14,198.00 |
| | JYSKE BANK-REG | 8 | 157.50 | 1,260.00 |
| | TOPDANMARK A/S | 6 | 675.00 | 4,050.00 |
| 小計 | | | | 200,092.25 |
| | | | | (3,435,583) |
| オーストラリアドル | ORIGIN ENERGY LIMITED | 260 | 16.09 | 4,183.40 |
| | WOODSIDE PETROLEUM LIMITED | 215 | 37.80 | 8,127.00 |
| | ALUMINA LTD | 1,647 | 1.57 | 2,585.79 |
| | AMCOR LTD. | 1,766 | 4.75 | 8,388.50 |
| | BHP BILLITON LIMITED | 1,984 | 32.05 | 63,587.20 |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 767 | 2.58 | 1,978.86 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 919 | 2.52 | 2,315.88 |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 141 | 30.50 | 4,300.50 |
| | ONESTEEL LIMITED | 625 | 2.25 | 1,406.25 |
| | RIO TINTO LIMITED | 152 | 59.88 | 9,101.76 |
| | BRAMBLES LTD | 1,187 | 5.73 | 6,801.51 |
| | WESFARMERS LIMITED | 818 | 21.20 | 17,341.60 |
| | WESFARMERS LTD-PPP | 86 | 21.11 | 1,815.46 |
| | WOOLWORTHS LTD | 813 | 26.34 | 21,414.42 |
| | FOSTER'S GROUP LTD | 1,058 | 5.08 | 5,374.64 |
| | CSL LIMITED | 365 | 32.49 | 11,858.85 |
| | AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP | 1,220 | 16.91 | 20,630.20 |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 776 | 35.96 | 27,904.96 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD. | 1,009 | 22.25 | 22,450.25 |
| | WESTPAC BANKING CORP. LTD. | 1,809 | 20.22 | 36,577.98 |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 261 | 31.84 | 8,310.24 |
| | AMP LIMITED | 1,570 | 5.25 | 8,242.50 |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 787 | 3.35 | 2,636.45 |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 673 | 20.79 | 13,991.67 |
| | SUNCORP-METWAY LTD | 456 | 5.88 | 2,681.28 |
| | LEND LEASE CORPORATION LTD. | 947 | 6.77 | 6,411.19 |
| | TELSTRA CORPORATION LTD. | 3,150 | 3.25 | 10,237.50 |
| | AGL ENERGY LTD | 702 | 14.75 | 10,354.50 |
| 小計 | | | | 341,010.34 |
| | | | | (23,717,269) |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 236 | 6.32 | 1,491.52 |
| | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND | 882 | 2.59 | 2,284.38 |
| | CONTACT ENERGY LTD | 149 | 5.58 | 831.42 |
| 小計 | | | | 4,607.32 |
| | | | | (252,757) |
| 香港ドル | HUTCHISON WHAMPOA | 2,000 | 43.55 | 87,100.00 |
| | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 1,000 | 9.15 | 9,150.00 |
| | LI & FUNG LTD | 2,000 | 20.20 | 40,400.00 |
| | BANK OF EAST ASIA | 1,540 | 18.62 | 28,674.80 |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 3,000 | 10.96 | 32,880.00 |
| | HANG SENG BANK | 400 | 87.65 | 35,060.00 |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 500 | 89.40 | 44,700.00 |
| | CHEUNG KONG | 1,000 | 79.25 | 79,250.00 |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 2,000 | 20.10 | 40,200.00 |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 2,945 | 9.76 | 28,743.20 |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,000 | 81.75 | 81,750.00 |
| | SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 500 | 58.70 | 29,350.00 |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 1,000 | 23.80 | 23,800.00 |
| | PCCW LTD | 4,700 | 3.47 | 16,309.00 |
| | CLP HOLDINGS LTD | 1,000 | 52.40 | 52,400.00 |
| | HONG KONG AND CHINA GAS | 4,422 | 14.28 | 63,146.16 |
| 小計 | | | | 692,913.16 |
| | | | | (8,668,343) |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 1,000 | 5.89 | 5,890.00 |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD. | 2,000 | 2.58 | 5,160.00 |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,000 | 2.90 | 2,900.00 |

| | | | | | |
|----|--------------------------------------|-------|-------|---------------|--|
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 5,200 | 0.38 | 1,976.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,000 | 9.04 | 9,040.00 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,520 | 5.43 | 8,253.60 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,000 | 11.18 | 11,180.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 1,000 | 6.03 | 6,030.00 | |
| | CAPITALAND LTD | 2,500 | 2.59 | 6,475.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 100 | 2.06 | 206.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 4,150 | 2.49 | 10,333.50 | |
| 小計 | | | | 67,444.10 | |
| | | | | (4,383,192) | |
| 合計 | | | | 693,283,380 | |
| | | | | (693,283,380) | |

(イ) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 | |
|--------------------|--------------------------|------------------------------|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 新株予約権証券 | スイスフラン 計 | GIVAUDAN-CW09 | 6.00 | 66.00 | | |
| | | | | 66.00 | | |
| | | | | (5,603) | | |
| | 小計 | | | 5,603 | | |
| | | | | (5,603) | | |
| 投資信託受益証券 | カナダドル 計 | CANADIAN OIL SANDS TRUST | 200 | 5,512.00 | | |
| | | | | 5,512.00 | | |
| | | | | (440,298) | | |
| | 小計 | | | 440,298 | | |
| | | | | (440,298) | | |
| 投資証券 | アメリカドル | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 290 | 4,042.60 | | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 61 | 3,746.01 | | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 100 | 4,984.00 | | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 140 | 3,249.40 | | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 50 | 2,818.50 | | |
| | | HCP INC | 170 | 3,746.80 | | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 191 | 1,489.80 | | |
| | | MACERICH CO/THE | 60 | 976.80 | | |
| | | PLUM CREEK TIMBER CO | 170 | 6,179.50 | | |
| | | PROLOGIS | 150 | 1,248.00 | | |
| | | PUBLIC STORAGE | 70 | 4,694.20 | | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 143 | 7,242.95 | | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 101 | 4,927.79 | | |
| | | 計 | | | 49,346.35 | |
| | | | | | (4,785,609) | |
| | | ユーロ 計 | UNIBAIL RODAMCO | 47 | 5,585.24 | |
| | | | | | 5,585.24 | |
| | | | | (714,519) | | |
| イギリスポンド | BRITISH LAND COMPANY PLC | 301 | 1,296.55 | | | |
| | | | HAMMERSON PLC | 223 | 695.76 | |
| | | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 342 | 1,850.22 | |
| | | | LIBERTY INTERNATIONAL PLC | 32 | 144.32 | |
| 計 | | | 3,986.85 | | | |
| | | | (565,694) | | | |
| オーストラリア ドル 計 | WESTFIELD GROUP | 947 | 9,687.81 | | | |
| | | | 9,687.81 | | | |
| | | | (673,787) | | | |
| | 小計 | | | 6,739,609 | | |
| | | | | (6,739,609) | | |
| 合計 | | | | 7,185,510 | | |
| | | | | (7,185,510) | | |

(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 | 組入新株予約権証券時価比率 | 組入投資信託受益証券時価比率 | 組入投資証券時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|-------------------------|------------|---------------|----------------|------------|------------|
| アメリカドル | 株式 373銘柄 投資証券 13銘柄 | 50.4% - | - - | - - | - 0.6% | 56.1% |
| カナダドル | 株式 46銘柄 投資信託受益証券 1銘柄 | 4.5% - | - - | - 0.1% | - - | 5.0% |
| ユーロ | 株式 185銘柄 投資証券 1銘柄 | 15.4% - | - - | - - | - 0.1% | 17.0% |
| イギリスポンド | 株式 86銘柄 投資証券 4銘柄 | 9.3% - | - - | - - | - 0.1% | 10.4% |
| スイスフラン | 株式 22銘柄 新株予約権証券 1銘柄 | 3.7% - | - 0.0% | - - | - - | 4.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式 24銘柄 | 1.1% | - | - | - | 1.2% |
| ノルウェークローネ | 株式 9銘柄 | 0.3% | - | - | - | 0.4% |
| デンマーククローネ | 株式 12銘柄 | 0.4% | - | - | - | 0.5% |
| オーストラリアドル | 株式 28銘柄 投資証券 1銘柄 | 3.1% - | - - | - - | - 0.1% | 3.5% |
| ニュージーランドドル | 株式 3銘柄 | 0.0% | - | - | - | 0.0% |
| 香港ドル | 株式 16銘柄 | 1.1% | - | - | - | 1.2% |
| シンガポールドル | 株式 11銘柄 | 0.6% | - | - | - | 0.6% |

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。

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21年 5月29日現在)

| | |
|-----------------|--------------|
| 資産総額 | 241,657,271円 |
| 負債総額 | 3,233,865円 |
| 純資産総額(-) | 238,423,406円 |
| 発行済数量 | 380,310,635口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.6269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21年 5月29日現在)

| | |
|-----------------|--------------|
| 資産総額 | 592,534,244円 |
| 負債総額 | 536,307円 |
| 純資産総額(-) | 591,997,937円 |
| 発行済数量 | 839,336,902口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.7053円 |

(参考情報)

「ドイチェ・世界株式インデックス・マザー」

(平成21年 5月29日現在)

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産総額 | 843,649,864円 |
| 負債総額 | 9,445,709円 |
| 純資産総額(-) | 834,204,155円 |
| 発行済数量 | 1,008,808,137口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.8269円 |

第5【設定及び解約の実績】

下記計算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)」

| 計算期間 | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|----------------------------------|-------------|------------|
| 第2期 (平成11年 4月27日～平成11年10月25日) | 94,738,920 | 6,928,750 |
| 第3期 (平成11年10月26日～平成12年 4月25日) | 15,489,364 | 262,562 |
| 第4期 (平成12年 4月26日～平成12年10月25日) | 23,773,330 | 2,400,943 |
| 第5期 (平成12年10月26日～平成13年 4月25日) | 121,464,276 | 3,074,874 |
| 第6期 (平成13年 4月26日～平成13年10月25日) | 227,927,911 | 13,830,186 |
| 第7期 (平成13年10月26日～平成14年 4月25日) | 379,182,716 | 14,780,013 |

| | | |
|-----------------------------------|-------------|---------------|
| 第8期 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (平成20年10月28日～平成21年 4月27日) | 20,161,446 | 24,257,442 |

「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 | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|-----------------------------------|-------------|-------------|
| 第2期 (平成11年 4月27日～平成11年10月25日) | 10,890,045 | 119,319 |
| 第3期 (平成11年10月26日～平成12年 4月25日) | 12,557,746 | 3,377,728 |
| 第4期 (平成12年 4月26日～平成12年10月25日) | 23,003,797 | 1,383,852 |
| 第5期 (平成12年10月26日～平成13年 4月25日) | 60,096,387 | 15,885,977 |
| 第6期 (平成13年 4月26日～平成13年10月25日) | 121,930,703 | 4,963,331 |
| 第7期 (平成13年10月26日～平成14年 4月25日) | 262,427,957 | 9,601,797 |
| 第8期 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (平成20年10月28日 ~ 平成21年 4月27日) | 118,216,656 | 17,566,959 |

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円(平成21年5月末日現在)

発行する株式の総数

200,000株(平成21年5月末日現在)

発行済株式総数

61,560株(平成21年5月末日現在)

最近5年間における資本金の額の増減

平成17年10月31日 資本金を金1,248百万円から金1,998百万円へ増額

平成18年12月20日 資本金を金1,998百万円から金2,328百万円へ増額

平成21年5月29日 資本金を金2,328百万円から金3,078百万円へ増額

(2) 委託会社の機構

委託会社は、取締役会および監査役会をおきます。

取締役および監査役は、株主総会の決議をもって選任され、その員数はそれぞれ3名以上とします。

取締役会は、取締役全員で組織され、経営に関するすべての重要事項および法令または定款によって定められた事項につき意思決定を行います。

取締役の任期は、選任後2年以内に終了する最終の事業年度に関する定時株主総会終結の時までとし、補欠または増員のために選任された取締役の任期は、他の取締役の残存任期と同一とします。

監査役会は、監査役全員で組織され、委託会社の会計監査および業務監査を行います。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する最終の事業年度に関する定時株主総会終結の時までとし、補欠のために選任された監査役の任期は、前任者の任期の残存期間とします。

(投資信託の運用プロセス)

四半期毎に行われる投資戦略会議において、ドイチェ・アセット・マネジメント・グループの海外拠点からの情報を参考にしつつ、各投資対象についての市場見通しならびに大まかな運用方針を決定します。

運用担当者は、投資戦略会議の方針にしたがって各ファンドの運用計画を作成し、チーフ・インベストメント・オフィサーの承認を得ます。その際、必要に応じてグループ内の投資環境調査やモデルポートフォリオを参考にします。

承認された運用計画にしたがって、運用担当者は売買を指示し、ポートフォリオの構築を行います。その際ファンドによっては、外部運用機関と投資助言契約もしくは運用委託契約を結んだ上で運用を行う場合があります。

コンプライアンス部モニタリング・チームが、個々の売買についてガイドライン違反等がないか速やかにチェックを行います。

インベストメント・コントロール・コミッティーにおいて、ガイドラインの遵守状況や運用上の改善すべき点などについて検討を行います。

運用評価会議では、各ファンドの運用成績を分析すると共に、運用に際して取っているアクティブリスクの状況や他ファンドとの均一性についてレビューを行い、今後の運用へのフィードバックを行います。

コンプライアンス部は、運用部から独立した立場で、取引の妥当性のチェックおよび利益相反取引のチェックを行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年5月末日現在、委託会社の運用するファンドは66本、純資産総額は451,888百万円です（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類別の本数およ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 | 46,966百万円 |
| | 追加型 | 株式投資信託 | 40本 | 303,019百万円 |
| 私募 | 追加型 | 株式投資信託 | 25本 | 101,903百万円 |
| 合計 | | | 66本 | 451,888百万円 |

3【委託会社等の経理状況】

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。なお、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。
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、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成20年3月31日) | | 当事業年度 (平成21年3月31日) | |
|------------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 預金 | * 2 | 2,154,472 | * 2 | 1,768,033 |
| 前払費用 | | 42,854 | | 20,809 |
| 未収委託者報酬 | | 3,406,055 | | 1,129,811 |
| 未収運用受託報酬 | | 201,729 | | 87,545 |
| 未収投資助言報酬 | | 197,166 | | 266,854 |
| 未収収益 | | 178,631 | | 85,323 |
| 繰延税金資産 | | 224,664 | | - |
| 立替金 | * 2 | 148,320 | * 2 | 50,428 |
| 未収消費税等 | | - | | 51,466 |
| 為替予約 | | - | | 41,957 |
| その他流動資産 | | 2,624 | | 12,964 |
| 流動資産合計 | | 6,556,518 | | 3,515,195 |
| 固定資産 | | | | |
| 無形固定資産 | | | | |
| ソフトウェア | * 1 | 1,795 | * 1 | 48,623 |
| 無形固定資産合計 | | 1,795 | | 48,623 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 長期差入保証金 | | 25,000 | | 25,200 |
| 敷金 | | 24,696 | | 23,100 |
| 投資その他の資産合計 | | 49,696 | | 48,300 |
| 固定資産合計 | | 51,492 | | 96,924 |
| 資産合計 | | 6,608,010 | | 3,612,119 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成20年3月31日) | 当事業年度 (平成21年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 85,020 | 59,914 |
| 未払収益分配金 | 2,503 | 3 |
| 未払償還金 | 1,508 | 1,508 |
| 未払手数料 | 1,739,478 | 575,892 |
| その他未払金 | 5,146 | 5,928 |
| 未払費用 | * 2 1,585,202 | * 2 1,200,116 |
| 未払法人税等 | 17,782 | 6,340 |
| 賞与引当金 | 69,967 | 79,648 |
| 未払消費税等 | 132,481 | - |
| その他流動負債 | 3,956 | - |
| 流動負債合計 | 3,643,048 | 1,929,352 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 792,135 | 880,823 |
| 長期未払費用 | 310,355 | 189,912 |
| 固定負債合計 | 1,102,491 | 1,070,736 |
| 負債合計 | 4,745,539 | 3,000,088 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,328,000 | 2,328,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 1,080,000 | 1,080,000 |
| 資本剰余金合計 | 1,080,000 | 1,080,000 |
| 利益剰余金 | | |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 1,545,529 | 2,795,968 |
| 利益剰余金合計 | 1,545,529 | 2,795,968 |
| 株主資本合計 | 1,862,470 | 612,031 |
| 純資産合計 | 1,862,470 | 612,031 |
| 負債・純資産合計 | 6,608,010 | 3,612,119 |

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日) | | 当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | |
|-----------------------|--------------------------------------|------------|--------------------------------------|-----------|
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 13,122,698 | | 8,885,526 |
| 運用受託報酬 | | 882,950 | | 414,943 |
| 投資助言報酬 | | 240,231 | | 295,004 |
| その他営業収益 | | 515,253 | | 277,728 |
| 営業収益合計 | | 14,761,134 | | 9,873,202 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | | 6,260,708 | | 4,248,615 |
| 広告宣伝費 | | 719,517 | | 224,220 |
| 公告費 | | 245 | | 1,160 |
| 調査費 | | 145,596 | | 143,673 |
| 委託調査費 | | 1,164,143 | | 944,269 |
| 情報機器関連費 | * 1 | 278,223 | * 1 | 221,823 |
| 委託計算費 | | 47,466 | | 40,729 |
| 通信費 | | 9,025 | | 13,448 |
| 印刷費 | | 235,927 | | 182,917 |
| 協会費 | | 5,974 | | 8,853 |
| 諸会費 | | 1,085 | | 953 |
| 諸経費 | | 9,121 | | 111,304 |
| 営業費用合計 | | 8,877,035 | | 6,141,969 |
| 一般管理費 | | | | |
| 役員報酬 | | 55,289 | | 57,669 |
| 給料・手当 | | 1,131,861 | | 1,274,106 |
| 賞与 | | 861,214 | | 437,874 |
| 交際費 | | 167,754 | | 78,253 |
| 寄附金 | | 10,261 | | 10,500 |
| 旅費交通費 | | 101,673 | | 92,517 |
| 租税公課 | | 22,206 | | 22,696 |
| 不動産賃借料 | | 321,205 | | 341,325 |
| 退職給付費用 | | 370,773 | | 117,819 |
| 固定資産減価償却費 | | 4,876 | | 4,136 |
| 福利厚生費 | * 1 | 300,086 | | 361,650 |
| 業務委託費 | * 1 | 1,501,143 | * 1 | 1,105,512 |
| 退職金 | | 7,703 | | 18,703 |
| 諸経費 | | 155,010 | | 106,289 |
| 一般管理費合計 | | 5,011,062 | | 4,029,053 |
| 営業利益又は営業損失() | | 873,035 | | 297,820 |
| 営業外収益 | | | | |
| その他 | | 1,201 | | 1,380 |
| 営業外収益合計 | | 1,201 | | 1,380 |
| 営業外費用 | | | | |
| 為替差損 | | 61,837 | | 19,360 |
| その他 | | 9,340 | | 1,269 |
| 営業外費用合計 | | 71,177 | | 20,629 |
| 経常利益又は経常損失() | | 803,060 | | 317,069 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | - | | 371,564 |
| 割増退職金 | | - | | 163,860 |
| 確定拠出年金制度移行に伴う損失 | | - | | 89,608 |
| その他の特別損失 | | - | | 78,024 |
| 特別損失合計 | | - | | 703,058 |
| 税引前当期純利益又は税引前当期純損失() | | 803,060 | | 1,020,128 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 4,135 | | 5,647 |
| 法人税等調整額 | | 224,664 | | 224,664 |
| 法人税等合計 | | 228,800 | | 230,311 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 1,023,589 | | 1,250,439 |

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) |
|---------------------|--|--|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 前期末残高 | 2,328,000 | 2,328,000 |
| 当期末残高 | 2,328,000 | 2,328,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 前期末残高 | 1,080,000 | 1,080,000 |
| 当期末残高 | 1,080,000 | 1,080,000 |
| 利益剰余金 | | |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 前期末残高 | 2,569,118 | 1,545,529 |
| 当期変動額 | | |
| 当期純利益又は当期純損失 () | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期変動額合計 | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期末残高 | 1,545,529 | 2,795,968 |
| 株主資本合計 | | |
| 前期末残高 | 838,881 | 1,862,470 |
| 当期変動額 | | |
| 当期純利益又は当期純損失 () | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期変動額合計 | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期末残高 | 1,862,470 | 612,031 |
| 純資産合計 | | |
| 前期末残高 | 838,881 | 1,862,470 |
| 当期変動額 | | |
| 当期純利益又は当期純損失 () | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期変動額合計 | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 当期末残高 | 1,862,470 | 612,031 |

重要な会計方針

| | 前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日) | 当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) |
|-------------------------|---|--|
| 1. 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。 | (1)無形固定資産 同左 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準および評価方法 | 時価法を採用しております。 | 同左 |
| 3. 引当金の計上基準 | (1)貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権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および年金資産の見込額に基づき、当事業年度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。なお、会計基準変更時差異（283,741千円）については15年による均等額を費用処理していましたが、平成18年3月期のリストラの実施による従業員の大量退職に伴い、終了部分に対応する金額（83,930千円）を一時償却したため、未処理額を残存年数により均等に費用処理しております。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それぞれ発生の翌事業年度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退職給付引当金に含めて計上しております。 | (1)貸倒引当金 同左 (2)賞与引当金 同左 (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および年金資産の見込額に基づき、当事業年度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。なお、会計基準変更時差異（283,741千円）については15年による均等額を費用処理していましたが、平成18年3月期のリストラの実施による従業員の大量退職に伴い、終了部分に対応する金額（83,930千円）を一時償却したため、未処理額を残存年数により均等に費用処理しております。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それぞれ発生の翌事業年度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退職給付引当金に含めて計上しております。 |

| | 前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日) | 当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) |
|--------------------------|--|--|
| | | (追加情報) 当社は、退職給付制度の見直しを行い、平成21年5月1日に、従来の適格年金制度から退職一時金制度と確定拠出年金制度へ移行しております。なお、規定等の改定日が当事業年度中であることから、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（平成14年1月31日企業会計基準適用指針第1号）および「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（平成14年3月29日実務対応報告第2号）を適用して、退職給付制度の終了に伴い発生が見込まれる損失を「確定拠出年金制度移行に伴う損失」として特別損失に89,608千円を計上しております。 |
| 4. 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、期末決算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。 | 同左 |
| 5. リース取引の処理方法 | リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・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。 | 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。 |
| 6. 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。 | (1)消費税等の処理方法 同左 |

会計方針の変更

| 前事業年度 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日) |
|---|---|
| | <p>(リース取引に関する会計基準等)</p> <p>当事業年度から平成19年3月30日改正の「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第13号)及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第16号)を適用しております。なお、これに伴う当事業年度への損益の影響はありません。また、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。</p> |

表示方法の変更

| 前事業年度 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日) |
|---|---|
| <p>金融商品取引法の施行及び投資運用業等統一経理基準(旧 投資顧問業統一経理基準の制定について)の改正に伴い、区分表示をより明瞭にするため、以下の表示方法の変更を行っております。</p> <p>(貸借対照表)</p> <p>前事業年度において「未収投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の未収運用受託報酬および投資顧問(助言)契約の未収投資助言報酬は、当事業年度においては「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」は、それぞれ478,694千円、114,718千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において「投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の運用受託契約および投資顧問(助言)契約の投資助言報酬は、当事業年度においては「運用受託報酬」および「投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」および「投資助言報酬」はそれぞれ、929,495千円、222,752千円であります。</p> <p>なお、上記変更は、当該改正が当下半期に行われたため、当下半期に行っており、当中間会計期間は従来の方法によるっております。</p> | |

注記事項

（貸借対照表関係）

| 前事業年度 (平成20年3月31日) | 当事業年度 (平成21年3月31日) |
|--|--|
| 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。 ソフトウェア 48,620 千円 | 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。 ソフトウェア 40,031 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。 預金 732,977 千円 立替金 1,480 千円 未払費用 241,209 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。 預金 654,799 千円 立替金 3,062 千円 未払費用 386,677 千円 |

（損益計算書関係）

| 前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日) | 当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) |
|---|--|
| 1 関係会社に対するものは次の通りであります。 情報機器関連費 5,480 千円 福利厚生費 4,211 千円 業務委託費 568,591 千円 | 1 関係会社に対するものは次の通りであります。 情報機器関連費 13,151 千円 業務委託費 308,465 千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 株式の種類 | 前事業年度末 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|--------|----|----|--------|
| 普通株式（株） | 46,560 | - | - | 46,560 |

当事業年度（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 株式の種類 | 前事業年度末 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|--------|----|----|--------|
| 普通株式（株） | 46,560 | - | - | 46,560 |

（リース取引関係）

| 前事業年度 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日） | | | | 当事業年度 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日） | | | |
|--|---------|---------|-------------|--|---------|---------|-------------|
| リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 | | | | 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) | | | |
| 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 | | | | 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 | | | |
| | 器具備品 | 建物附属設備 | 合計 | | 器具備品 | 建物附属設備 | 合計 |
| 取得価額相当額 | 466,660 | 626,567 | 1,093,228千円 | 取得価額相当額 | 458,345 | 626,567 | 1,084,912千円 |
| 減価償却累計額相当額 | 295,793 | 239,674 | 535,467千円 | 減価償却累計額相当額 | 324,775 | 274,297 | 599,073千円 |
| 期末残高相当額 | 170,867 | 386,892 | 557,760千円 | 期末残高相当額 | 133,569 | 352,270 | 485,839千円 |
| 未経過リース料期末残高相当額 | | | | 未経過リース料期末残高相当額 | | | |
| 未経過リース料期末残高相当額 | | | | 未経過リース料期末残高相当額 | | | |
| 1年以内 | | | | 1年以内 | | | |
| 110,667千円 | | | | 101,449千円 | | | |
| 1年超 | | | | 1年超 | | | |
| 565,821千円 | | | | 469,698千円 | | | |
| 合計 | | | | 合計 | | | |
| 676,488千円 | | | | 571,148千円 | | | |
| 支払リース料、減価償却費相当額、支払利息相当額 | | | | 支払リース料、減価償却費相当額、支払利息相当額 | | | |
| 支払リース料 | | | | 支払リース料 | | | |
| 81,324千円 | | | | 97,089千円 | | | |
| 減価償却費相当額 | | | | 減価償却費相当額 | | | |
| 63,511千円 | | | | 68,479千円 | | | |
| 支払利息相当額 | | | | 支払利息相当額 | | | |
| 7,219千円 | | | | 6,249千円 | | | |
| 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 | | | | 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。 | | | | ・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 | | | | 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。 | | | | ・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。 | | | |

（有価証券関係）

当事業年度中に売却したその他有価証券

| 区分 | 前事業年度 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日） | 当事業年度 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日） |
|-------------|---|---|
| 売却額（千円） | - | 128,435 |
| 売却益の合計額（千円） | - | - |
| 売却損の合計額（千円） | - | 371,564 |

(デリバティブ取引関係)

1 取引の状況に関する事項

| 前事業年度 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日) |
|--|---|
| (1) 取引の内容及び利用目的等 当社は通常の取引範囲における外貨建取引の為替相場の変動リスクを回避するために為替予約取引を行っております。 | (1) 取引の内容及び利用目的等 同左 |
| (2) 取引に対する取組方針 当社は外貨建取引に係る為替相場の変動リスクを回避する目的で為替予約取引を行っており、投機的な取引及び短期的な売買差益を得る取引は行っておりません。 | (2) 取引に対する取組方針 同左 |
| (3) 取引に係るリスクの内容 為替予約取引には、為替相場の変動によるリスクを有しております。なお、為替予約取引の契約先は、信用度の高い金融機関であるため、相手先の不履行によるいわゆる信用リスクは限定的と判断しております。 | (3) 取引に係るリスクの内容 同左 |
| (4) 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引の実行及び管理は、経理部が行っており、取引結果については経理部が定期的に取り締役及び各部長に報告することにより取引状況の管理が行われております。 | (4) 取引に係るリスク管理体制 同左 |

2 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

前事業年度（平成20年3月31日現在）

(1) 通貨関連

| 種類 | 契約額等（千円） | 契約額等のうち一年超 （千円） | 時価（千円） | 評価損益（千円） |
|--------|----------|--------------------|---------|----------|
| 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | - | - | - | - |
| 買建 | 485,662 | - | 481,705 | 3,956 |
| 合計 | 485,662 | - | 481,705 | 3,956 |

(注) 1 時価の算定方法

為替予約取引・・・先物為替相場によっております。

当事業年度（平成21年3月31日現在）

(1) 通貨関連

| 種類 | 契約額等（千円） | 契約額等のうち一年超 （千円） | 時価（千円） | 評価損益（千円） |
|--------|----------|--------------------|---------|----------|
| 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | - | - | - | - |
| 買建 | 631,357 | - | 673,315 | 41,957 |
| 合計 | 631,357 | - | 673,315 | 41,957 |

(注) 1 時価の算定方法

為替予約取引・・・先物為替相場によっております。

（退職給付関係）

（単位：千円）

| 前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日) | 当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---------|---------|---------|----------------------|---------|--------------------|--------|-------------------------|---------|--|-------------------|---|---------|--------------------|------------|--|------------------|---------|--------------------|---------|-------------------------|---------|-------------------|--------|----------------|---------|---------------------------|--------|--------------|---------|--------------------|--------|------------------------|---------|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の退職金制度を有しております。平成4年12月より、この退職金制度の100%について適格退職年金制度を採用しております。また、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。</p> | <p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の退職金制度を有しております。平成4年12月より、この退職金制度の100%について適格退職年金制度を採用しております。また、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。 当社は、退職給付制度を見直し、平成21年5月より適格退職年金制度に代えて、退職一時金制度と確定拠出年金制度に移行することとしました。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成20年3月31日）</p> <table border="1"> <tr><td>(1)退職給付債務</td><td style="text-align: right;">280,690</td></tr> <tr><td>(2)年金資産</td><td style="text-align: right;">104,118</td></tr> <tr><td>(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)</td><td style="text-align: right;">176,571</td></tr> <tr><td>(4)会計基準変更時差異の未処理額</td><td style="text-align: right;">67,133</td></tr> <tr><td>(5)未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">5,852</td></tr> <tr><td>(6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5)</td><td style="text-align: right;">115,291</td></tr> <tr><td>(7)特別退職慰労引当金</td><td style="text-align: right;">676,844</td></tr> <tr><td>(8)退職給付引当金 (6)+(7)</td><td style="text-align: right;">792,135</td></tr> </table> | (1)退職給付債務 | 280,690 | (2)年金資産 | 104,118 | (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 176,571 | (4)会計基準変更時差異の未処理額 | 67,133 | (5)未認識数理計算上の差異 | 5,852 | (6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5) | 115,291 | (7)特別退職慰労引当金 | 676,844 | (8)退職給付引当金 (6)+(7) | 792,135 | <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成21年3月31日）</p> <table border="1"> <tr><td>(1)退職給付債務</td><td style="text-align: right;">399,679</td></tr> <tr><td>(2)年金資産</td><td style="text-align: right;">212,231</td></tr> <tr><td>(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)</td><td style="text-align: right;">187,448</td></tr> <tr><td>(4)会計基準変更時差異の未処理額</td><td style="text-align: right;">49,253</td></tr> <tr><td>(5)未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">40,355</td></tr> <tr><td>(6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5)</td><td style="text-align: right;">97,839</td></tr> <tr><td>(7)特別退職慰労引当金</td><td style="text-align: right;">693,375</td></tr> <tr><td>(8)確定拠出年金制度移行に伴う損失</td><td style="text-align: right;">89,608</td></tr> <tr><td>(9)退職給付引当金 (6)+(7)+(8)</td><td style="text-align: right;">880,823</td></tr> </table> <p style="text-align: center;">平成21年5月の、適格退職年金制度から退職一時金制度と確定拠出年金制度への移行に伴う発生する損失見積り額を、退職給付引当金として計上しています。</p> | (1)退職給付債務 | 399,679 | (2)年金資産 | 212,231 | (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 187,448 | (4)会計基準変更時差異の未処理額 | 49,253 | (5)未認識数理計算上の差異 | 40,355 | (6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5) | 97,839 | (7)特別退職慰労引当金 | 693,375 | (8)確定拠出年金制度移行に伴う損失 | 89,608 | (9)退職給付引当金 (6)+(7)+(8) | 880,823 |
| (1)退職給付債務 | 280,690 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (2)年金資産 | 104,118 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 176,571 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)会計基準変更時差異の未処理額 | 67,133 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)未認識数理計算上の差異 | 5,852 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5) | 115,291 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (7)特別退職慰労引当金 | 676,844 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (8)退職給付引当金 (6)+(7) | 792,135 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (1)退職給付債務 | 399,679 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (2)年金資産 | 212,231 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)未積立退職給付債務 (1)+(2) | 187,448 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)会計基準変更時差異の未処理額 | 49,253 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)未認識数理計算上の差異 | 40,355 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (6)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5) | 97,839 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (7)特別退職慰労引当金 | 693,375 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (8)確定拠出年金制度移行に伴う損失 | 89,608 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (9)退職給付引当金 (6)+(7)+(8) | 880,823 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>3. 退職給付費用に関する事項 (自平成19年4月1日至平成20年3月31日)</p> <table border="1"> <tr><td>(1)勤務費用</td><td style="text-align: right;">108,222</td></tr> <tr><td>(2)利息費用</td><td style="text-align: right;">8,723</td></tr> <tr><td>(3)期待運用収益（減算）</td><td style="text-align: right;">1,117</td></tr> <tr><td>(4)会計基準変更時差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">9,590</td></tr> <tr><td>(5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用）</td><td style="text-align: right;">235,633</td></tr> <tr><td>(6)数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">9,721</td></tr> </table> | (1)勤務費用 | 108,222 | (2)利息費用 | 8,723 | (3)期待運用収益（減算） | 1,117 | (4)会計基準変更時差異の費用処理額 | 9,590 | (5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用） | 235,633 | (6)数理計算上の差異の費用処理額 | 9,721 | <p>3. 退職給付費用に関する事項 (自平成20年4月1日至平成21年3月31日)</p> <table border="1"> <tr><td>(1)勤務費用</td><td style="text-align: right;">111,906</td></tr> <tr><td>(2)利息費用</td><td style="text-align: right;">8,141</td></tr> <tr><td>(3)期待運用収益（減算）</td><td style="text-align: right;">2,344</td></tr> <tr><td>(4)会計基準変更時差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">9,379</td></tr> <tr><td>(5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用）</td><td style="text-align: right;">5,746</td></tr> <tr><td>(6)数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">3,516</td></tr> <tr><td>退職給付費用</td><td style="text-align: right;">117,819</td></tr> <tr><td>(7)確定拠出年金制度移行に伴う損失</td><td style="text-align: right;">89,608</td></tr> <tr><td>(8)割増退職金</td><td style="text-align: right;">163,860</td></tr> <tr><td>(9)その他</td><td style="text-align: right;">15,170</td></tr> <tr><td style="text-align: right;">計</td><td style="text-align: right;">386,458</td></tr> </table> | (1)勤務費用 | 111,906 | (2)利息費用 | 8,141 | (3)期待運用収益（減算） | 2,344 | (4)会計基準変更時差異の費用処理額 | 9,379 | (5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用） | 5,746 | (6)数理計算上の差異の費用処理額 | 3,516 | 退職給付費用 | 117,819 | (7)確定拠出年金制度移行に伴う損失 | 89,608 | (8)割増退職金 | 163,860 | (9)その他 | 15,170 | 計 | 386,458 |
| (1)勤務費用 | 108,222 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (2)利息費用 | 8,723 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)期待運用収益（減算） | 1,117 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)会計基準変更時差異の費用処理額 | 9,590 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用） | 235,633 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (6)数理計算上の差異の費用処理額 | 9,721 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (1)勤務費用 | 111,906 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (2)利息費用 | 8,141 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)期待運用収益（減算） | 2,344 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)会計基準変更時差異の費用処理額 | 9,379 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)その他（退職給付債務の対象外の退職費用） | 5,746 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (6)数理計算上の差異の費用処理額 | 3,516 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付費用 | 117,819 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (7)確定拠出年金制度移行に伴う損失 | 89,608 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (8)割増退職金 | 163,860 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (9)その他 | 15,170 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 計 | 386,458 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table border="1"> <tr><td>(1)退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: center;">期間定額基準</td></tr> <tr><td>(2)割引率</td><td style="text-align: right;">2.10%</td></tr> <tr><td>(3)期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">1.50%</td></tr> <tr><td>(4)数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">5年</td></tr> <tr><td>(5)会計基準変更時差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">15年</td></tr> </table> | (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 | 2.10% | (3)期待運用収益率 | 1.50% | (4)数理計算上の差異の処理年数 | 5年 | (5)会計基準変更時差異の処理年数 | 15年 | <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table border="1"> <tr><td>(1)退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: center;">期間定額基準</td></tr> <tr><td>(2)割引率</td><td style="text-align: right;">2.20%</td></tr> <tr><td>(3)期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">1.40%</td></tr> <tr><td>(4)数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">5年</td></tr> <tr><td>(5)会計基準変更時差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">15年</td></tr> </table> | (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 | 2.20% | (3)期待運用収益率 | 1.40% | (4)数理計算上の差異の処理年数 | 5年 | (5)会計基準変更時差異の処理年数 | 15年 | | | | | | | | | | | | | | |
| (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 | 2.10% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)期待運用収益率 | 1.50% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)数理計算上の差異の処理年数 | 5年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)会計基準変更時差異の処理年数 | 15年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (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 | 2.20% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (3)期待運用収益率 | 1.40% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (4)数理計算上の差異の処理年数 | 5年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (5)会計基準変更時差異の処理年数 | 15年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(税効果会計関係)

(単位:千円)

| 前事業年度 (平成20年3月31日) | 当事業年度 (平成21年3月31日) |
|--|--|
| 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 | 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 |
| (繰延税金資産) | (繰延税金資産) |
| 賞与引当金損金算入否認額 41,381 千円 | 賞与引当金損金算入否認額 32,417 千円 |
| 未払費用否認額 767,641 千円 | 未払費用否認額 565,741 千円 |
| 未払事業税 7,122 千円 | 未払事業税 216 千円 |
| 退職給付引当金損金算入否認額 306,701 千円 | 退職給付引当金損金算入否認額 358,495 千円 |
| 繰越欠損金 533,102 千円 | 繰越欠損金 1,010,937 千円 |
| その他 17,202 千円 | その他 7,169 千円 |
| 繰延税金資産小計 1,673,149 千円 | 繰延税金資産合計 1,974,977 千円 |
| 評価性引当金 1,448,485 千円 | 評価性引当金 1,974,977 千円 |
| 繰延税金資産合計 224,664 千円 | 繰延税金資産合計 - |
| 繰延税金資産の純額 224,664 千円 | 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 | 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 |
| 法定実効税率 40.7% | 法定実効税率 40.7% |
| (調整) | (調整) |
| 交際費否認額 13.7% | 交際費否認額 3.1% |
| 役員賞与否認額 8.4% | 役員賞与否認額 2.0% |
| 評価性引当金 92.3% | 評価性引当金 51.6% |
| 住民税均等割 0.5% | 住民税均等割 0.6% |
| その他 1.5% | その他 7.1% |
| 税効果会計適用後の法人税の負担率 27.8% | 税効果会計適用後の法人税の負担率 22.6% |

関連当事者情報

前事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

1 親会社及び法人主要株主等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 又は職業 | 議決権 等の 被所有 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-----|----------------------------------|----------------|-------------------|-------------------|------------------------|------------|----------------------|---|------------------------|------------|--------------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 親会社 | Deutsche Bank Aktiengesellschaft | ドイツ フランクフルト | 1,357,824 千ユーロ | 銀行業 | (被所有) 間接100% | なし | 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 | - 484,665 89,406 | 預金 未払費用 | 732,977 241,209 |

2 兄弟会社等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 又は職業 | 議決権 等の 被所有 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|---------|--|----------------|------------------|-------------------|------------------------|------------|------------------------------|--|----------------------------|------|--------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 親会社の子会社 | ドイツ証券株式会社 | 東京都 千代田区 | 63,728 百万円 | 証券業 | なし | 1名 | サービスの 提供 | *3 IT, 管理部門サービス | 601,601 | 未払費用 | 468,476 |
| 親会社の子会社 | DWS Finanz-Service GmbH | ドイツ フランクフルト | 5,000 千ユーロ | 投資 運用業 | なし | なし | 投資一任、 助言契約 サービスの 提供 | *6 委託調査 | 549,527 | 未払費用 | 145,615 |
| 親会社の子会社 | RREEF Limited | 英国 ロンドン | 1,822 千ポンド | 投資 運用業 | なし | なし | 投資一任、 助言契約 サービスの 提供 | *5 その他営業 収益 | 133,146 | 未収収益 | 84,329 |
| 親会社の子会社 | Deutsche Bank Trust Company Americas | 米国 ニューヨーク | 3,627,308 千ドル | 銀行業 | なし | なし | 投資一任、 助言契約 サービスの 提供 | *4 運用受託報酬 *4 投資助言報酬 *5 その他営業 収益 | 31,891 94,020 59,798 | 未収収益 | 138,601 |
| 親会社の子会社 | Deutsche Asset Management (UK) Limited | 英国 ロンドン | 21,000 千ポンド | 投資 運用業 | なし | なし | 投資一任、 助言契約 サービスの 提供 | *4 投資助言報酬 *4 運用受託報酬 | 81,784 26,495 | 未収収益 | 111,000 |

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局の承認に基づき、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。
- * 4 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運用受託報酬、投資助言報酬を受取っております。
- * 5 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。
- * 6 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。

当事業年度(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 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 | 1,461,399 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 | 267,087 54,530 | 預金 未払費用 | 654,799 - 386,677 |

(イ) 兄弟会社等

| 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) |
|---------|--|----------------|------------------|-------------------|----------------------------|----------------------|---|---|--------------|------------------|
| 親会社の子会社 | 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 | *3 IT、管理部門サービス | 607,419 | 未払費用 | 160,901 |
| 親会社の子会社 | DWS Finanz-Service GmbH | ドイツ フランクフルト | 5,000 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 | *6 委託調査 | 416,588 | 未払費用 | 142,985 |
| 親会社の子会社 | RREEF Limited | 英国 ロンドン | 1,822 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 | *5 その他営業収益 | 52,025 | - | - |
| 親会社の子会社 | Deutsche Bank Trust Company Americas | 米国 ニューヨーク | 3,627,308 千ドル | 銀行業 | なし | 投資一任、助言契約 サービスの提供 | *4 運用受託報酬 *4 投資助言報酬 | 65,872 60,622 | 未収収益 | 139,804 |
| 親会社の子会社 | 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 | *4 投資助言報酬 | 113,891 | 未収収益 | 97,433 |
| 親会社の子会社 | ドイツ銀不動産有限会社 | 東京都 千代田区 | 46 百万円 | サービス 業 | なし | サービスの提供 | *6 不動産賃借料 *2 マネージメントサービス | 333,276 58,096 | - | - |
| 親会社の子会社 | Deutsche Investment Management Americas Inc. | 米国 ニューヨーク | 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 | *4 運用受託報酬 *4 投資助言報酬 *5 その他営業収益 *3 IT、管理部門サービス *6 委託調査 | 32,296 40,251 47,922 55,937 173,217 | 未収収益 未払費用 | 99,424 90,707 |
| 親会社の子会社 | 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 | 投資一任、助言契約 サービスの提供 | *5 その他営業収益 | 104,590 | - | - |

| 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) |
|---------|---|-------------|------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------|----------------|--------------|------|--------------|
| 親会社の子会社 | Deutsche Asset Management (Hong Kong) Limited | 中国香港特別行政区 | 238,600 千香港ドル | 投資運用業 | なし | 投資一任、助言契約サービスの提供 役員の兼任 | *4 投資助言報酬 | 54,317 | - | - |
| 親会社の子会社 | Deutsche Asset Management (Australia) Limited | オーストラリアシドニー | 23,000 千豪ドル | 投資運用業 | なし | 投資一任、助言契約サービスの提供 | *5 その他営業収益 | 56,804 | - | - |
| 親会社の子会社 | RREEF Management L.L.C. | 米国ウィルミントン | 1 千ドル | 投資運用業 | なし | 投資一任、助言契約サービスの提供 | *2 マネージメントサービス | 33,244 | - | - |
| 親会社の子会社 | Deutsche Asset Management (Asia) Limited | シンガポール | 96,700 千SGドル | 投資運用業 | なし | 投資一任、助言契約サービスの提供 | *6 委託調査 | 49,951 | - | - |
| 親会社の子会社 | DWS Investment S.A. | ルクセンブルグ | 30,677 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 運用受託報酬 | 82,580 | - | - |
| 親会社の子会社 | D W S 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 | *2 マネージメントサービス | 33,216 | 未払費用 | 46,926 |
| 親会社の子会社 | 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 | *6 委託調査 | 52,417 | - | - |

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局の承認に基づき、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。
- * 4 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運用受託報酬、投資助言報酬を受取っております。
- * 5 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。
- * 6 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。

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 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日) |
|----------------------|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 40,001円 51銭 | 13,144円 99銭 |
| 1株当たり当期純利益又は当期純損失（ ） | 21,984円 30銭 | 26,856円 51銭 |

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在していないため、記述しておりません。
2. 1株当たり当期純利益又は当期純損失（ ）の算定上の基礎は、以下の通りであります。2. 1株当たり当期純利益又は当期純損失（ ）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19年4月 1日 至 平成20年3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日) |
|----------------------------|---|---|
| 当期純利益又は当期純損失（ ）（千円） | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 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又は当期純損失（ ）（千円） | 1,023,589 | 1,250,439 |
| 期中平均株式数 | 46,560 | 46,560 |

（重要な後発事象）

| 前事業年度 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日) | 当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日) |
|--|--|
| | <p>1. 増資について 平成21年5月1日付取締役会決議に基づく、平成21年5月8日開催の臨時株主総会での決議に基づき、平成21年5月15日から平成21年5月31日までを払込期間とする第三者割当増資により新株式を次のとおり発行し、払込は5月29日に完了しました。</p> <p>(1) 発行新株株式数 普通株式 15,000株</p> <p>(2) 発行価額 1株につき 100,000円</p> <p>(3) 発行価額の総額 1,500,000,000円</p> <p>(4) 資本組入額の総額 750,000,000円</p> <p>2. 事業効率化に伴う人員の減少 当社は市場環境の変化に適応するために、平成21年4月より事業を効率化し、人員の適正配置を進めております。これに伴い追加で発生する退職金支給額は約130百万円を見込んでおり、平成22年3月期に特別損失として計上する予定です。</p> |

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)および(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)および(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟その他重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

受託会社

| | |
|-------|--|
| 名称 | 住友信託銀行株式会社 |
| 資本金の額 | 287,537百万円（平成21年3月末日現在） |
| 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21年3月末日現在） |
| 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。 |
| 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 ¹ | 664,986百万円 (平成21年3月末日現在) | 銀行法に基づき、日本において銀行業務を営んでいます。 |
| 株式会社広島銀行 ¹ | 54,573百万円 (平成21年3月末日現在) | |
| 株式会社北海道銀行 | 93,524百万円 (平成21年3月末日現在) | |
| 日本生命保険相互会社 | 950,000百万円 ² (平成21年3月末日現在) | 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21年3月末日現在) | 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証券株式会社 | 65,518百万円 (平成21年3月末日現在) | |
| 野村證券株式会社 ¹ | 10,000百万円 (平成21年3月末日現在) | |
| 日興コーディアル証券株式会社 | 100,000百万円 (平成21年3月末日現在) | |
| 楽天証券株式会社 | 7,445百万円 (平成21年1月13日現在) | |

1 新規申込みの取扱いを行いません。

2 日本生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金およ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 360百万円（平成21年5月末日現在）
 事業の内容 内外の有価証券等に係る投資顧問業務およびその業務に付帯関連する一切の業務を営むとともに、金融商品取引法に定める第一種金融取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理、基準価額の計算、外国証券を保管・管理する外国の金融機関への指図等を行います。

販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金および一部解約金の支払い等を行います。

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およびマザーファンドの運用指図等を行います。

3【資本関係】

委託会社と他の関係法人との間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

平成21年1月27日 有価証券報告書

平成21年1月27日 有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

平成21年6月10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20年10月28日から平成21年4月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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21年4月27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。

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XBR 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21年6月10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20年10月28日から平成21年4月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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21年4月27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。

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XBR 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21年6月23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

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 林 秀行
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20年4月1日から平成21年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

追記情報

1. 重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成21年5月15日から平成21年5月31日までを払込期間とする第三者割当増資を行い、平成21年5月29日に払込を完了した。
2. 重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成21年4月より事業の効率化、人員の適正配置を進めており、平成22年3月期に割増退職金として約130百万円を特別損失として計上する予定である。

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

以 上

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

[前へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年12月10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20年4月26日から平成20年10月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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20年10月27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。

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XBR 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20年12月10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20年4月26日から平成20年10月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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20年10月27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。

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20年6月24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

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 林 秀行
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19年4月1日から平成20年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[前へ](#)