

【表紙】	
【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年2月10日
【計算期間】	第10特定期間 （自 平成23年5月12日 至 平成23年11月11日）
【ファンド名】	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
【発行者名】	D I A M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 中島 敬雄
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	大楽 信雄
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】	03-3287-3110
【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】

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドは、契約型の追加型株式投資信託に属します。

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。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

ファンドの特色

- 1 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。**



- 各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※不動産投信等をリート(REIT)と呼びます。また、リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用指図等に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用しますので、上記マザーファンドには信託報酬はかかりません。

② 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にします。

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

③ 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。信託報酬率は信託財産の純資産総額に対して年率0.9975%(税抜0.95%)と、1%を下回る水準に設定しました。

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

④ 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

決算ごとに分配することを重視します。隔月(奇数月)に利子・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益(評価益を含みます。)等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)です。

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

投資信託の収益分配金に関するご説明

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が
支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

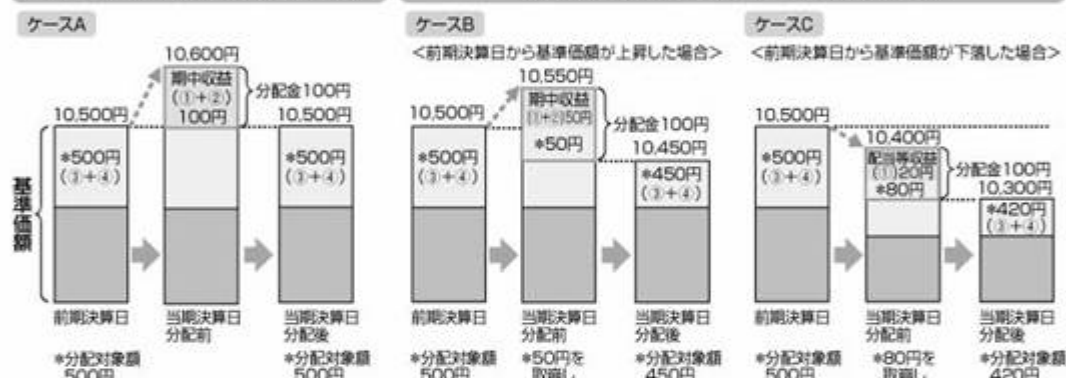
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上図のそれぞれの場合において、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

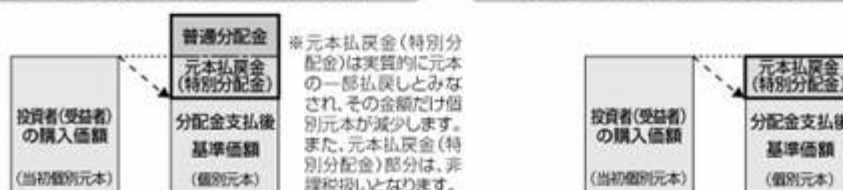
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

・商品分類表

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)	補足分類
----------------	--------	-------------------	------

単位型投信	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
		不動産投信	
追加型投信	内 外	その他資産 ()	特 殊 型
		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。

・商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「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。

投資対象地域

「内外」とは目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

補足分類

「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めざす旨の記載があるものをいいます。

・属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ・インデックス、NOMURA-BPI総合、シティグループ世界国債インデックス、東証REIT指数、S&P先進国REITインデックス)
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、)資産配分変更型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。

決算頻度

「年6回（隔月）」とは目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

「グローバル（日本を含む）」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

「ファミリーファンド」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。

為替ヘッジ

「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。

対象インデックス

「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

上記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

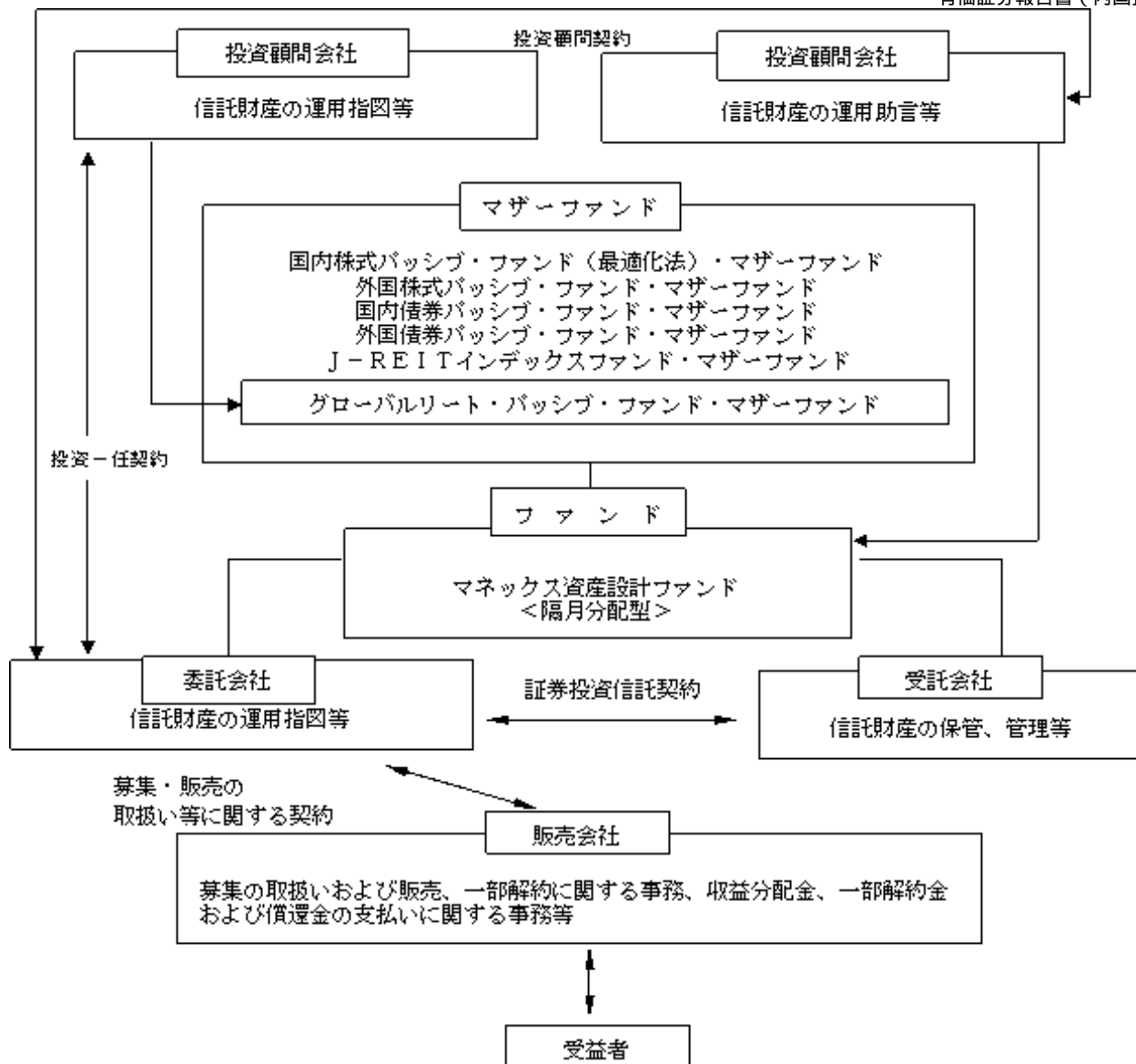
・投資信託協会への照会

ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2)【ファンドの沿革】

平成19年1月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、一部解約に関する事務、収益分配金、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

投資顧問会社：

イボットソン・アソシエーツ・ジャパン株式会社

委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

DIAM International Ltd

委託会社との投資一任契約に基づき、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

・「投資一任契約」の概要

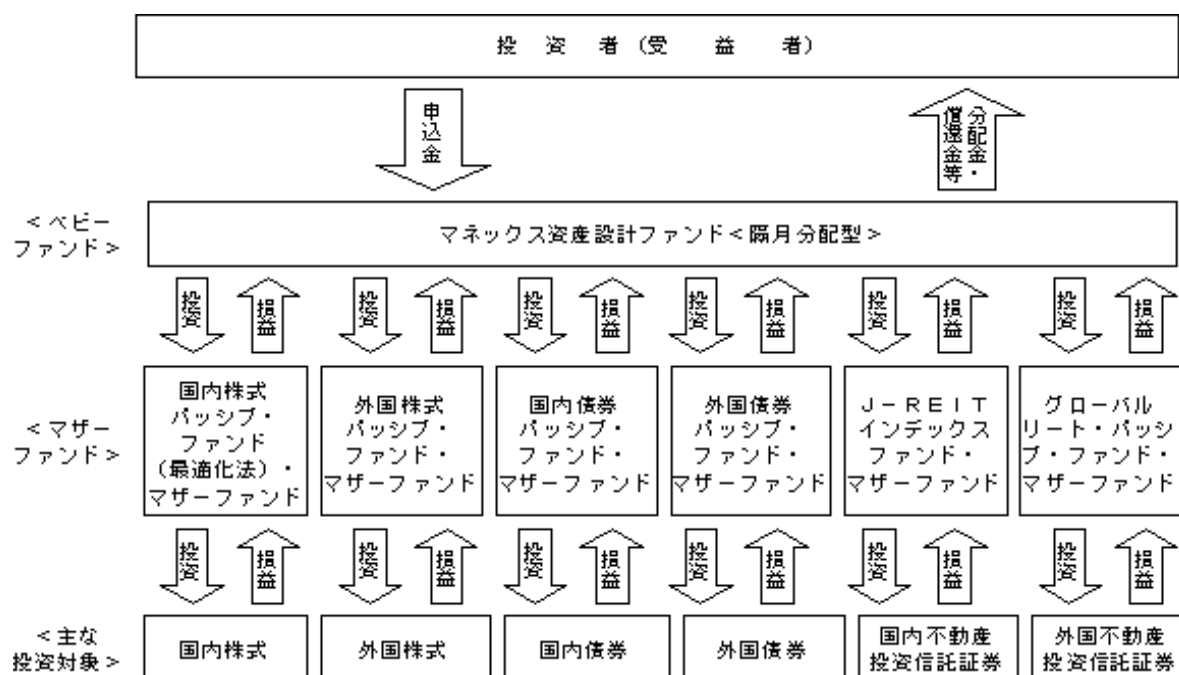
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

●ファミリーファンド方式とは●

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、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行います。



○委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年11月30日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月 1日

平成10年3月 31日

平成10年12月 1日

平成11年10月 1日

会社設立

「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ

・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併

し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月 1日

「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A M
アセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成23年11月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

<投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート（REIT）とは

- ・リート（REIT）とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。（以下同じ。）
- ・REIT（リート）とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・リート（REIT）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート（REIT）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（REIT）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（REIT）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限り、)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる1)から6)までのD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

5) J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

6) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

7) 株券または新株引受権証券

8) 国債証券

9) 地方債証券

10) 特別の法律により法人の発行する債券

11) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

16) コマーシャル・ペーパー

17) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券

18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)から15)までの証券または証書の性質を有するもの

19) 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、振替投資信託受益権を含みます。）

20) 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。）

21) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

22) オプションを表示する証券または証書（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、)

23) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)

26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28) 外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)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、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの

証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

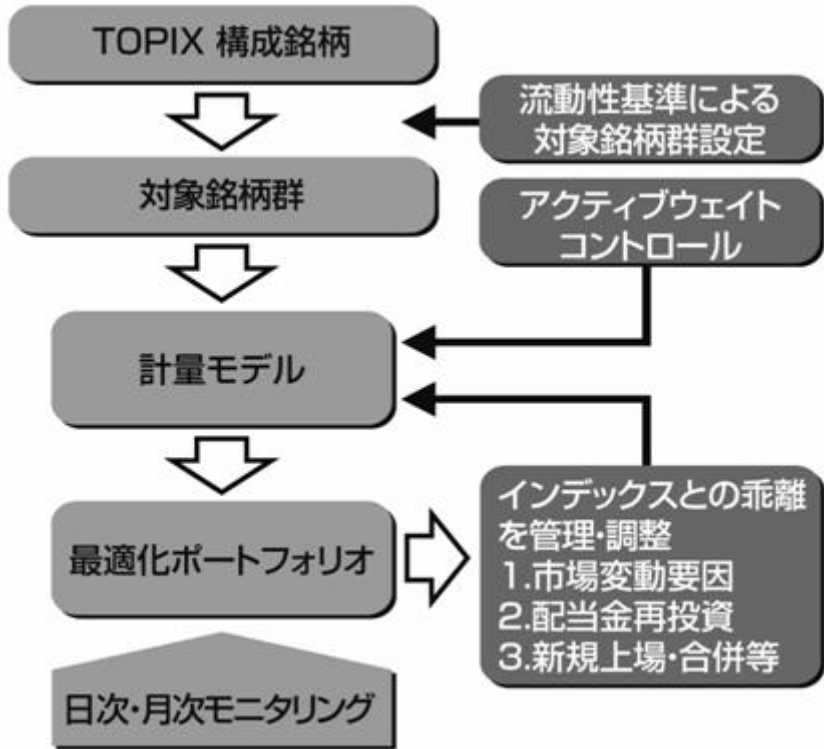
5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

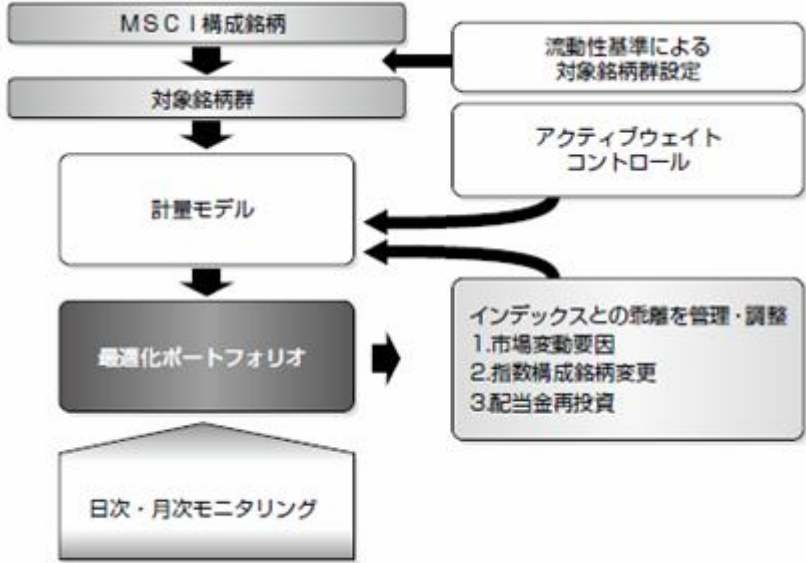
4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は信託金を上記3．の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 （注）TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。 株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。 当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。 当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。 株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。 株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。 以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

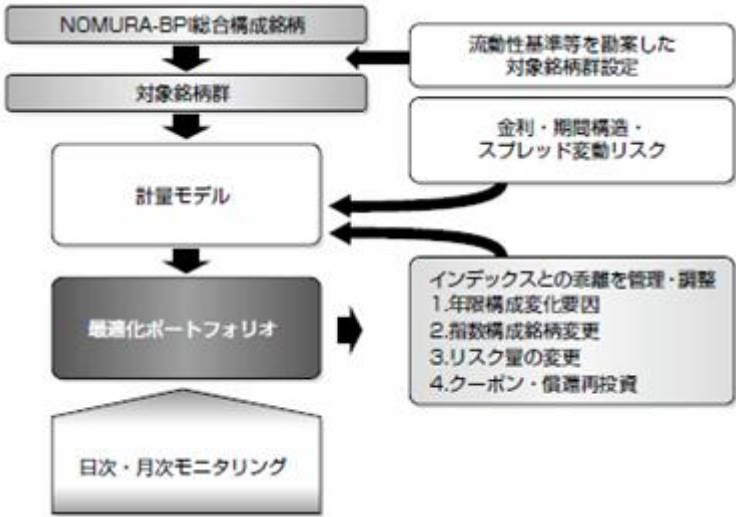
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 運用プロセス 1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入れ替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50％以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10％以下とします。 6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-----------------------

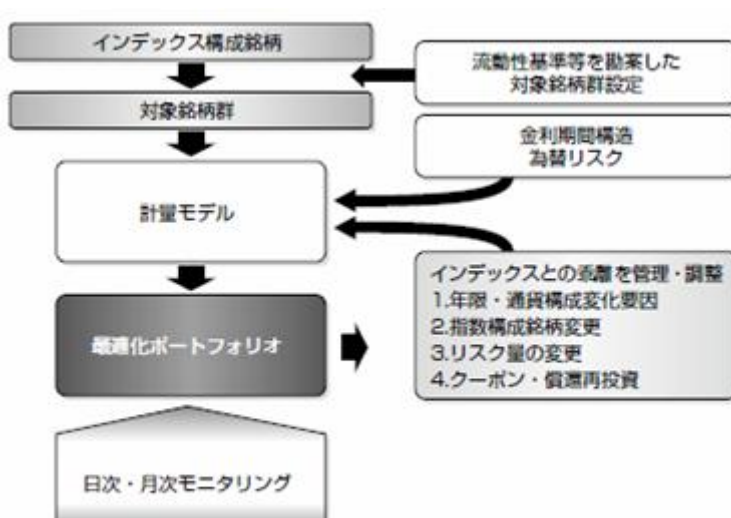
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 <運用プロセス>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整
1.市場変動要因
2.指数構成銘柄変更
3.配当金再投資] --> D </pre> 1)流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
--------	---

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 (注)NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

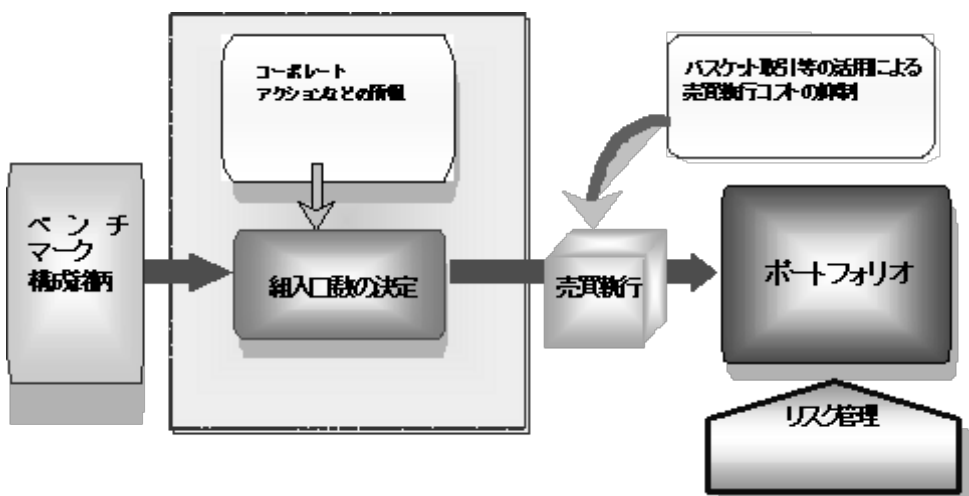
投資態度	主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 <運用プロセス>  1)流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 - 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 - 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（注）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。 シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 < 運用プロセス >  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造 為替リスク] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限・通貨構成変化要因 2.指数構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> D </pre> 1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資
------	--

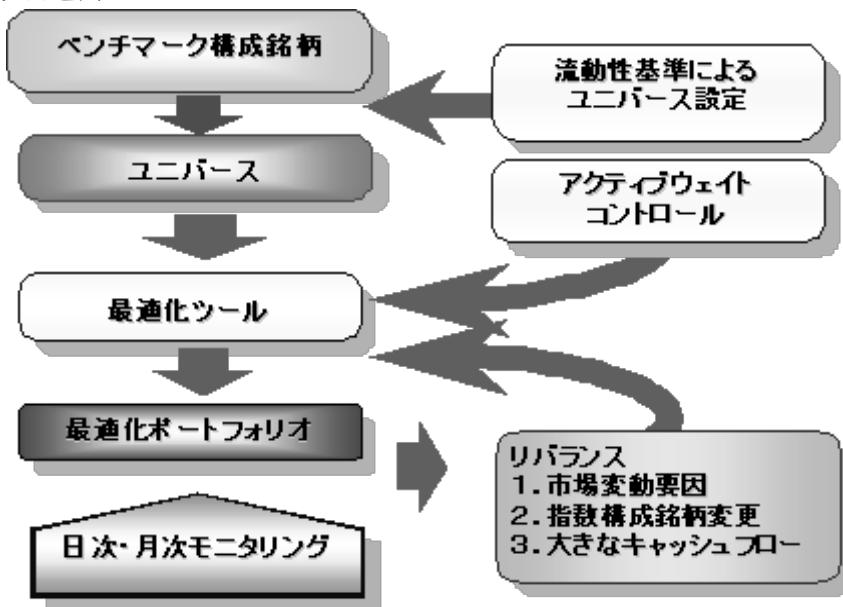
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
--------	--

ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証 R E I T 指数（配当込み）（注）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）東証 R E I T 指数の指数値及び東証 R E I T 指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証 R E I T 指数に関するすべての権利及び東証 R E I T 指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。 ㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証 R E I T 指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。 ㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の商標の使用もしくは東証 R E I T 指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。 ㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。 当マザーファンドは東証 R E I T 指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額と東証 R E I T 指数の指数値の動向が乖離することがあります。 当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。 ㈱東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。 ㈱東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証 R E I T 指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度	1. 東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数 に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 4. 運用プロセス ・ 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・ 新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・ 配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。  <pre> graph LR BM[ベンチマーク構成銘柄] --> ID[組入口数の決定] ID --> SO[売買執行] SO --> PF[ポートフォリオ] PF --> RM[リスク管理] subgraph Box1 [] direction TB ID CA[コーポレート アクションなどの情報] --> ID end SO --> B[バスケット取引等の活用による 売買執行コストの削減] </pre>
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。

ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	----------------------------

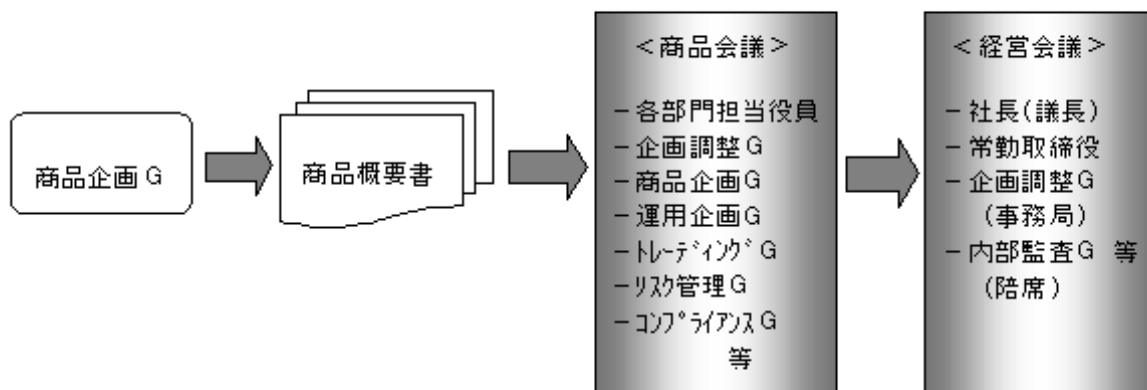
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REITインデックス（除く日本・円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 （注）「Standard & Poor's」、「S&P」、は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社の使用のためにライセンスされているものです。当マザーファンドは、Standard & Poor'sによって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではなく、また、Standard & Poor'sは、当マザーファンドの投資の妥当性を表明するものではありません。 当マザーファンドは、The McGraw-Hill Companies, Inc.の一部門であるStandard & Poor's（以下「S&P」という）によって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではありません。S&Pは、当マザーファンドの所有者若しくは一般の者に対して、一般に証券について若しくは特に当マザーファンドに対する投資の妥当性に関して、又はS&P先進国REITインデックスの株式市場の運用成績を追跡する能力に関して、明示的にも黙示的にも、表明又は保証するものではありません。S&Pのライセンシーに対する唯一の関係は、S&Pの特定の商標及び商号についてのライセンスを行うこと、並びにS&Pによりライセンシー又は当マザーファンドと関係なく決定、作成及び計算されたS&P先進国REITインデックスについてライセンスすることです。S&Pは、S&P先進国REITインデックスの決定、作成及び計算において、当マザーファンドのライセンシー又は所有者の要求を考慮に入れる義務を負いません。S&Pは、当マザーファンドの価格及び量の決定、当マザーファンドの発行若しくは販売の時期の決定、又は、当マザーファンドを現金に換算する方程式の決定若しくは計算に、責任を負わず、また関わっていません。S&Pは、当マザーファンドの管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を負うものではありません。 S&Pは、S&P先進国REITインデックス、又はそれに含まれるデータの正確性あるいは完全性を保証しません。また、S&Pは、当マザーファンドに含まれる誤り、欠落又は障害に対する責任を負わないものとします。S&Pは、S&P先進国REITインデックス又はそれらに含まれるデータの使用により、ライセンシー、当マザーファンドの所有者又はその他の人や組織に生じた結果に関して、明示的にも黙示的にも保証しないものとします。また、S&Pは、S&P先進国REITインデックス又はそれに含まれるデータに関して、その市場性又は特別な目的若しくは使用への適合性について、明示若しくは黙示の保証を行わず、かつあらゆる保証を放棄します。前述のいずれかを制限することなく、S&Pは、特別な、懲罰的な、間接の又は派生的な損害（逸失利益を含む）の可能性を通知されたとしても、かかる損害に対して何ら責任を負いません。
主な投資対象	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資態度	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。 <運用プロセス>  <pre> graph TD A[ベンチマーク構成銘柄] --> B[ユニバース] B --> C[最適化ツール] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準によるユニバース設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C H[リバランス 1. 市場変動要因 2. 指数構成銘柄変更 3. 大きなキャッシュフロー] --> E </pre> 1)流動性基準によるユニバース設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)リバランス 日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。 リバランス要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの ・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3)【運用体制】

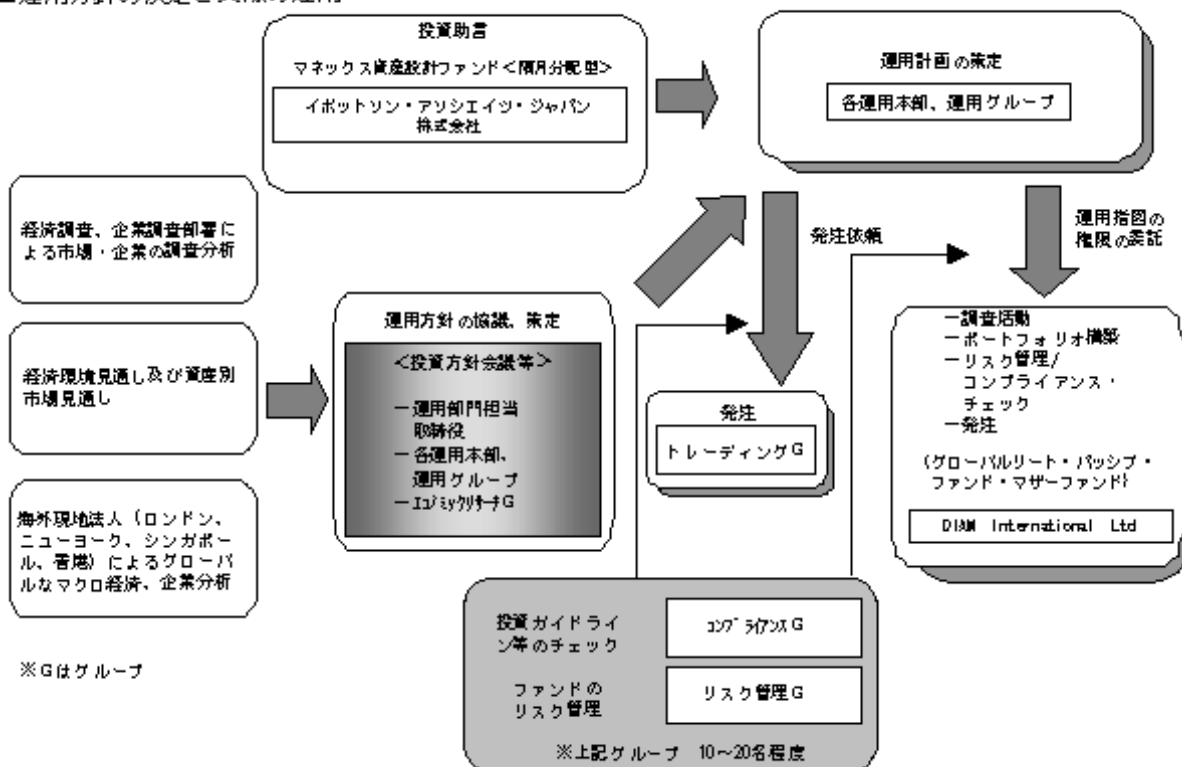
■ ファンドの組成時のプロセスについて



※ Gはグループ

※商品会議は各部門の担当役員、グループリーダーや実務担当者等 20 名程度が参加、経営会議は常勤取締役 8 名により構成。

■ 運用方針の決定と実際の運用



※ Gはグループ

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

< 運用方針の決定と実際の運用 >

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議・策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

1)当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

2)グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。	
クオンツ運用グループ	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用はクオンツ運用グループが担当します。 主に日本を除く株式のクオンツ商品を運用しております。当グループでは、ユニバースの決定を行い、ポートフォリオの最適化、トレーディングを行い、主要なリスク要因はリアル・タイムで把握できる体制を敷いています。
ミドル・オフィス	週次・月次でパフォーマンスを測定し、要因分析を社内CEO以下に向けて報告するとともに、各種リスクをモニターします。
サポート・グループ	決済を主に担当しており、加えて執行された売買につき委託会社や日本の信託銀行への連絡を行います。

DIAM International Ltd

株式運用 G

クオンツ運用 G

債券運用 G

ミドル・オフィス

サポート G

ビジネス・デベロプメント G

↓

トレーディング
リスク・モニタリング
助言業者、委託会社との
コミュニケーション

↓

パフォーマンス
測定・寄与度分
析・リスク分析

↓

決済
執行連絡

上記運用体制は、平成23年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として奇数月の各11日、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分配を行います。

1)分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当等収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2)分配対象額についての分配方針

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、毎計算期間の末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（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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します。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(5) 【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)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。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券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。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第19条）

1) 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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論

見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲（約款第22条）

- 1) 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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

- 1) 委託会社は、わが国の金融商品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て取扱うものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかか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。
- 3) 委託会社は、わが国の取引所における金利にかか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。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資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。
- 2) 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。
- 3) 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出した価額で行うものとします。
- 4) 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。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 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。
- 3) 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出した価額で評価するものとします。
- 4) 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。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 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各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付けは、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を超

えないものとしします。

2. 公社債の貸付けは、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を超えないものとしします。
 - 2) 上記1) 各号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します。
 - 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって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します。
- 公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）
- 1) 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（信託財産により借り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ますものとしします。
 - 2) 上記1) 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します。
 - 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2) 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します。

公社債の借入れ（約款第28条）

- 1) 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たときは、担保の提供の指図を行うものとしします。
- 2) 上記1) 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します。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2) 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返還するための指図をするものとしします。
- 4) 上記1) の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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。

外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

- 1) 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。
- 2) 上記1) の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- 3) 上記2) においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の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信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の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信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2) 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します。

資金の借入れ（約款第37条）

- 1) 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に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）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します。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する

有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

デリバティブ取引にかかる投資制限（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、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかか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運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

○資産配分リスク

各資産（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○株価変動リスク

株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

○金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

○リートの価格変動リスク

一般にリートが投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、当該国または国際的な景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リートの価格および分配金はその影響を受けることになり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

リートは、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

リートが投資対象とする建物の用途規制等、不動産等に係る規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があり、その結果、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

○為替リスク

当ファンドでは外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、為替相場が円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

○信用リスク

債券、コマーシャルペーパーおよび短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）またはそれが予想される場合には、当該債券等の価格は下落し（価格がゼロになることもあります。）、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

株式や短期金融商品等の発行者が、経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。また、こうした状況に陥ると予想された場合、当該株式等の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

リートが、投資対象とする不動産の収益性悪化または資金繰りの悪化等により、清算される場合には、投資した資金が回収困難になる可能性があります。また、こうした状況に陥ると予想される場合、当該リーートの価格が下落する可能性があります。

○流動性リスク

流動性リスクとは、市場における売買量の欠如等の理由により、当ファンドにとって最適な時期で株式等の売買ができず機会損失を被るリスクをいいます。当ファンドでは、市場規模が小さい国を投資対象とする場合がありますが、そのような市場では流動性に欠ける場合があります。また価格変動性が高いことから、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

特にリートは、市場規模や取引量が少ないため、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できない等のリスクがあります。また、金融商品取引所等が定める基準に抵触し、上場廃止等になった場合は、売買取引が困難になる可能性があります。

< 分配金に関する留意点 >

- 収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

- 受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

- 分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

< その他の留意点 >

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

- 当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

- 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

- 委託会社は、金融商品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があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付

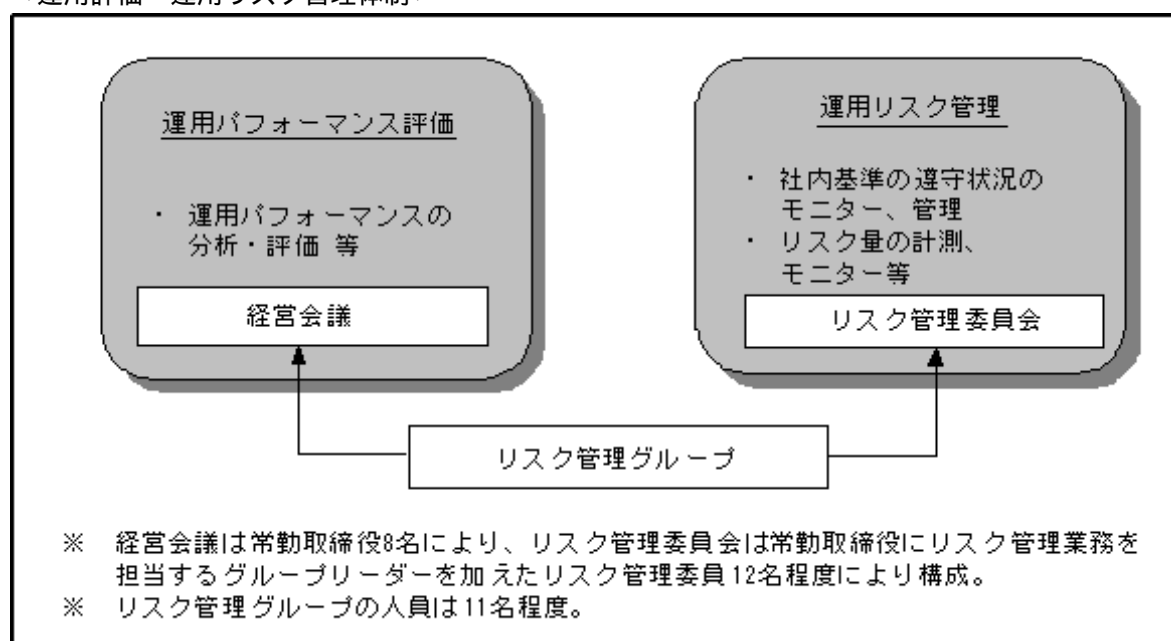
を取り消すことができるものとします。

○当ファンドは、信託財産の純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生したときは、当初定められた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、リートなど値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

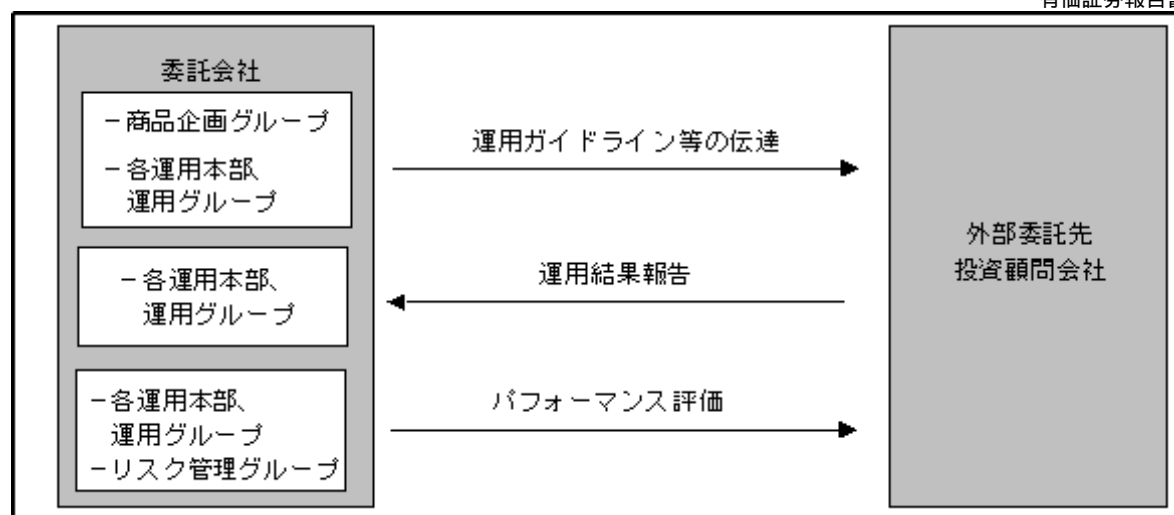
< 運用評価・運用リスク管理体制 >



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

< 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成23年11月30日現在のものであり、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】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(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以下の率を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用	
毎日	信託報酬	総額	信託財産の純資産総額に対して年率0.9975%（税抜0.95%）
		配分	委託会社 年率0.441%（税抜0.42%）～0.546%（税抜0.52%）
			販売会社 年率0.378%（税抜0.36%）～0.483%（税抜0.46%）
			受託会社 年率0.0735%（税抜0.07%）

委託会社と販売会社の信託報酬の額は、各販売会社の取扱純資産額に応じ、下記の通り配分します。

各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社
100億円以下の部分	年率0.546%（税抜0.52%）	年率0.378%（税抜0.36%）
100億円超300億円以下の部分	年率0.4935%（税抜0.47%）	年率0.4305%（税抜0.41%）
300億円超の部分	年率0.441%（税抜0.42%）	年率0.483%（税抜0.46%）

信託報酬は日々の基準価額に反映され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資顧問会社（DIAM International Ltd）が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支弁するものとします。その報酬額は、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た金額の合計に、当該マザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属する当該マザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額とします。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの純資産総額	投資顧問会社が受ける総報酬率
25億円以下の部分	年率0.20%
25億円超75億円以下の部分	年率0.18%
75億円超の部分	年率0.15%

当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）が受ける報酬は当ファンドまたはマザーファンドから直接的な支弁は行ないません。同社への投資顧問報酬は委託会社が受け取った上記の報酬の中から支弁するものとします。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

実質的に投資対象とするリートには運用報酬等の費用がかかりますが、投資するリー트의銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額等を示すことはできません。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成24年12月31日までの間は、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、配当所得として、原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

平成24年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率での申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（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7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

また、上記7.147%の税率は平成26年1月1日からは、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかか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、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、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合について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支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	693,886,795	98.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,463,233	1.35
合 計 （純資産総額）		703,350,028	100.00

（注）投資比率とは、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）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	238,672,642,108	97.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,845,529,298	2.39
合 計 （純資産総額）		244,518,171,406	100.00

（注）投資比率とは、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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
-------	----	---------	---------

株式	米国	138,646,524,317	53.30
	英国	25,982,624,246	9.99
	カナダ	14,567,843,594	5.60
	スイス	11,344,188,976	4.36
	スウェーデン	3,471,195,634	1.33
	デンマーク	1,274,597,074	0.49
	ノルウェー	913,965,503	0.35
	アイルランド	1,622,580,647	0.62
	オランダ	3,100,792,759	1.19
	ベルギー	1,161,782,895	0.45
	ルクセンブルク	574,755,821	0.22
	フランス	10,370,012,573	3.99
	ドイツ	9,690,660,567	3.73
	ポルトガル	254,949,730	0.10
	スペイン	3,934,228,000	1.51
	イタリア	2,667,766,651	1.03
	フィンランド	1,070,626,233	0.41
	オーストリア	271,563,578	0.10
	ギリシャ	98,856,286	0.04
	香港	3,039,090,617	1.17
	中国	20,502,122	0.01
	シンガポール	2,006,493,810	0.77
	イスラエル	765,031,139	0.29
	オーストラリア	9,833,515,830	3.78
	ニュージーランド	126,588,055	0.05
	パナマ	200,753,515	0.08
	バミューダ諸島	640,538,138	0.25
	オランダ領キュラソー	1,251,582,680	0.48
	ケイマン諸島	260,272,372	0.10
	ガーンジー・チャネル諸島	77,959,815	0.03
	ジャージー・チャネル諸島	747,324,704	0.29
	マン島	80,411,751	0.03
	リベリア	43,795,291	0.02
	モーリシャス	60,107,334	0.02
	小計	250,173,482,259	96.18
投資信託受益証券	シンガポール	66,290,899	0.03
	オーストラリア	769,820,282	0.30
	小計	836,111,181	0.32
投資証券	米国	2,947,579,021	1.13
	英国	309,005,239	0.12
	カナダ	136,986,157	0.05
	オランダ	41,357,422	0.02
	フランス	308,167,185	0.12
	香港	112,464,886	0.04
	小計	3,855,559,910	1.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,245,279,733	2.02
合 計 （純資産総額）		260,110,433,083	100.00

（注）投資比率とは、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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	303,948,591,700	76.28
地方債証券	日本	27,536,982,353	6.91
特殊債券	日本	36,016,578,862	9.04
社債券	日本	28,704,865,580	7.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,234,064,995	0.56

合 計（純資産総額）	398,441,083,490	100.00
------------	-----------------	--------

(注) 投資比率とは、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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	米国	146,764,575,926	40.96
	英国	31,975,465,843	8.92
	カナダ	10,413,119,808	2.91
	スウェーデン	2,190,057,410	0.61
	デンマーク	3,303,699,700	0.92
	ノルウェー	1,085,789,733	0.30
	アイルランド	2,168,852,851	0.61
	オランダ	9,308,206,320	2.60
	ベルギー	8,617,911,231	2.40
	フランス	33,667,660,757	9.40
	ドイツ	33,414,312,389	9.32
	ポルトガル	1,453,587,173	0.41
	スペイン	14,496,399,775	4.05
	イタリア	29,618,587,622	8.27
	フィンランド	2,194,300,702	0.61
	ポーランド	2,485,603,320	0.69
	オーストリア	6,027,078,826	1.68
	シンガポール	1,566,177,940	0.44
	マレーシア	1,683,772,149	0.47
	オーストラリア	5,046,138,856	1.41
	メキシコ	2,907,992,065	0.81
	小計	350,389,290,395	97.78
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,954,748,227	2.22
合 計（純資産総額）		358,344,038,622	100.00

(注) 投資比率とは、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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資証券	日本	3,573,543,070	98.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		48,758,354	1.35
合 計（純資産総額）		3,622,301,424	100.00

(注) 投資比率とは、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。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資信託受益証券	シンガポール	71,477,112	2.78
	オーストラリア	312,644,961	12.14
	小計	384,122,073	14.92

投資証券	米国	1,615,482,497	62.75
	英国	168,706,005	6.55
	カナダ	83,017,781	3.22
	オランダ	39,387,338	1.53
	ベルギー	22,549,867	0.88
	フランス	131,923,817	5.12
	香港	49,529,143	1.92
	シンガポール	7,827,813	0.30
	ニュージーランド	11,602,269	0.45
	小計	2,130,026,531	82.74
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		60,178,957	2.34
合 計（純資産総額）		2,574,327,561	100.00

(注) 投資比率とは、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。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	195,039,113	11,385.00	222,052,032	11,327.00	220,920,803	31.41
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	167,589,435	11,363.00	190,431,877	11,251.00	188,554,873	26.81
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	137,580,629	9,714.00	133,645,824	9,708.00	133,563,274	18.99
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	76,839,123	11,592.00	89,071,913	11,262.00	86,536,220	12.30
5	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	47,825,691	7,068.00	33,803,200	6,867.00	32,841,902	4.67
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	45,548,884	6,951.00	31,661,031	6,909.00	31,469,723	4.47

(注1)投資比率とは、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。

(注2)簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3)投資有価証券は6銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.65
合計	98.65

(注)投資比率とは、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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3,087,600	3,418.25	10,554,202,100	2,509.00	7,746,788,400	3.17
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	17,955,300	434.17	7,795,662,916	328.00	5,889,338,400	2.41
3	キヤノン	株式	日本	電気機器	1,492,900	3,888.24	5,804,747,916	3,420.00	5,105,718,000	2.09
4	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2,027,600	3,405.41	6,904,808,800	2,389.00	4,843,936,400	1.98
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1,092,200	3,868.22	4,224,867,390	3,775.00	4,123,055,000	1.69
6	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,793,700	2,830.76	5,077,536,347	2,089.00	3,747,039,300	1.53
7	ファナック	株式	日本	電気機器	250,200	12,386.53	3,099,110,960	12,270.00	3,069,954,000	1.26
8	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	30,466,400	157.10	4,786,340,092	100.00	3,046,640,000	1.25
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	942,900	3,961.82	3,735,600,314	3,145.00	2,965,420,500	1.21
10	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1,074,500	2,961.43	3,182,056,858	2,547.00	2,736,751,500	1.12
11	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,727,400	2,308.59	3,987,856,139	1,551.00	2,679,197,400	1.10
12	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	19,544	148,121.25	2,894,881,619	135,000.00	2,638,440,000	1.08
13	三井物産	株式	日本	卸売業	2,047,400	1,466.82	3,003,163,059	1,182.00	2,420,026,800	0.99
14	日立	株式	日本	電気機器	5,396,000	486.82	2,626,891,320	423.00	2,282,508,000	0.93
15	小松製作所	株式	日本	機械	1,192,400	2,531.14	3,018,135,765	1,895.00	2,259,598,000	0.92
16	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,970	335,282.35	2,001,635,605	364,500.00	2,176,065,000	0.89
17	セブン&アイ・HLDS	株式	日本	小売業	992,100	2,151.21	2,134,215,928	2,127.00	2,110,196,700	0.86
18	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,660,000	1,564.47	2,597,024,080	1,262.00	2,094,920,000	0.86
19	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	3,036,000	844.85	2,564,961,604	690.00	2,094,840,000	0.86
20	ソニー	株式	日本	電気機器	1,499,300	2,653.55	3,978,461,888	1,372.00	2,057,039,600	0.84
21	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,745,700	1,055.38	2,897,769,463	727.00	1,996,123,900	0.82
22	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	417,900	5,218.90	2,180,976,463	4,695.00	1,962,040,500	0.80
23	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,681	486,319.13	1,790,140,706	505,000.00	1,858,905,000	0.76

24	東 芝	株式	日本	電気機器	5,059,000	492.63	2,492,204,760	347.00	1,755,473,000	0.72
25	信越化学	株式	日本	化学	451,400	4,667.06	2,106,712,791	3,805.00	1,717,577,000	0.70
26	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,403,000	984.37	2,365,437,300	712.00	1,710,936,000	0.70
27	国際石油開発 帝石	株式	日本	鉱業	3,274	544,245.88	1,781,861,002	504,000.00	1,650,096,000	0.67
28	東京海上H D	株式	日本	保険業	900,400	2,449.15	2,205,216,540	1,832.00	1,649,532,800	0.67
29	アステラス 製薬	株式	日本	医薬品	558,800	3,206.72	1,791,914,558	2,938.00	1,641,754,400	0.67
30	任 天 堂	株式	日本	その他 製品	137,400	22,091.87	3,035,423,376	11,630.00	1,597,962,000	0.65

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	電気機器	13.92
	輸送用機器	9.26
	銀行業	9.03
	情報・通信業	6.57
	化学	5.97
	卸売業	5.30
	機械	4.99
	医薬品	4.72
	小売業	4.16
	陸運業	3.98
	食料品	3.59
	電気・ガス業	3.14
	建設業	2.33
	不動産業	2.29
	保険業	2.22
	サービス業	1.86
	鉄鋼	1.80
	その他製品	1.65
	精密機器	1.38
	ガラス・土石製品	1.16
	非鉄金属	1.13
	証券、商品先物取引業	0.96
	繊維製品	0.93
	石油・石炭製品	0.92
	その他金融業	0.79
	ゴム製品	0.78
	鉱業	0.76
	金属製品	0.67
	パルプ・紙	0.40
	海運業	0.33
	空運業	0.31
	倉庫・運輸関連業	0.23
	水産・農林業	0.11
合計		97.61

(注)投資比率とは、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。

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗 燃料	809,133	6,511.52	5,268,687,616	6,010.54	4,863,326,990	1.87
2	APPLE INC	株式	米国	コンピュ ータ・周 辺機器	154,173	28,314.38	4,365,313,279	29,158.12	4,495,394,218	1.73
3	INTL BUSINES S MACHINES C ORP	株式	米国	情報技術 サービス	198,862	12,896.08	2,564,540,008	14,136.84	2,811,280,714	1.08
4	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗 燃料	334,489	7,569.85	2,532,032,615	7,609.08	2,545,153,794	0.98
5	MICROSOFT CO RP	株式	米国	ソフトウ ェア	1,256,502	2,103.63	2,643,219,095	1,940.75	2,438,555,251	0.94
6	NESTLE SA-RE GISTERED	株式	スイス	食品	540,194	4,375.01	2,363,355,159	4,304.43	2,325,227,259	0.89
7	JOHNSON & JO HNSON	株式	米国	医薬品	456,744	4,777.83	2,182,247,208	4,905.00	2,240,329,959	0.86
8	PROCTER & GA MBLE CO	株式	米国	家庭用品	458,510	5,019.61	2,301,541,327	4,885.47	2,240,036,345	0.86
9	AT&T INC	株式	米国	各種電気 通信サー ビス	986,221	2,226.64	2,195,956,928	2,192.33	2,162,119,715	0.83
10	GENERAL ELEC TRIC CO	株式	米国	コングロ マリット	1,767,063	1,596.01	2,820,253,867	1,165.70	2,059,864,632	0.79
11	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,298,781	1,481.32	1,923,903,838	1,515.72	1,968,590,935	0.76
12	GOOGLE INC	株式	米国	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	42,344	47,804.38	2,024,228,648	45,544.32	1,928,528,724	0.74
13	COCA-COLA CO /THE	株式	米国	飲料	346,155	4,982.31	1,724,652,743	5,171.42	1,790,114,517	0.69
14	HSBC HOLDING S PLC	株式	英国	商業銀行	2,970,358	819.80	2,435,105,262	593.14	1,761,840,520	0.68
15	VODAFONE GRO UP PLC	株式	英国	無線通信 サービス	8,455,168	216.87	1,833,682,538	207.02	1,750,390,232	0.67
16	PHILIP MORRI S INTERNATI ONAL-W/I	株式	米国	タバコ	293,921	4,796.60	1,409,821,996	5,817.56	1,709,902,994	0.66
17	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗 燃料	3,150,324	570.48	1,797,187,568	534.99	1,685,375,959	0.65
18	INTEL CORP	株式	米国	半導体・ 半導体製 造装置	882,190	1,692.92	1,493,480,273	1,842.31	1,625,263,401	0.62
19	NOVARTIS AG- REG SHS	株式	スイス	医薬品	388,750	4,498.06	1,748,621,407	4,145.67	1,611,628,046	0.62
20	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	838,734	2,512.80	2,107,569,082	1,881.37	1,577,969,321	0.61

21	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	676,142	2,539.82	1,717,276,281	2,323.59	1,571,074,220	0.60
22	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗 燃料	589,874	2,562.27	1,511,417,756	2,610.31	1,539,752,349	0.59
23	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	532,081	3,575.24	1,902,318,166	2,748.73	1,462,546,156	0.56
24	JPMORGAN CHA SE & CO	株式	米国	各種金融 サービス	651,377	3,455.93	2,251,111,408	2,231.39	1,453,477,948	0.56
25	WAL-MART STO RES INC	株式	米国	食品・生活必需品 小売り	317,844	4,280.23	1,360,444,028	4,544.82	1,444,544,436	0.56
26	ROCHE HOLDIN G AG-GENUSSC HEIN	株式	スイス	医薬品	117,094	11,951.13	1,399,405,856	12,021.84	1,407,685,333	0.54
27	GLAXOSMITHKL INE PLC	株式	英国	医薬品	843,645	1,463.99	1,235,087,093	1,666.65	1,406,057,902	0.54
28	MERCK & CO. I NC.	株式	米国	医薬品	513,906	2,567.74	1,319,577,062	2,693.92	1,384,422,885	0.53
29	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗 燃料	355,229	4,348.47	1,544,702,224	3,881.00	1,378,644,317	0.53
30	VERIZON COMM INC	株式	米国	各種電気 通信サービス	473,310	2,807.17	1,328,663,107	2,861.90	1,354,566,788	0.52

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.85
	商業銀行	6.76
	医薬品	6.62
	金属・鉱業	3.94
	保険	3.84
	各種電気通信サービス	3.26
	食品	2.93
	化学	2.75
	コンピュータ・周辺機器	2.54
	ソフトウェア	2.49
	メディア	2.44
	食品・生活必需品小売り	2.42
	飲料	2.39
	情報技術サービス	2.30
	電力	2.06
	コングロマリット	2.02
	各種金融サービス	1.91
	機械	1.82
	航空宇宙・防衛	1.78
	タバコ	1.75
	資本市場	1.72
	ホテル・レストラン・レジャー	1.65
	半導体・半導体製造装置	1.63
	エネルギー設備・サービス	1.63
	家庭用品	1.53
	通信機器	1.48
	専門小売り	1.44

総合公益事業	1.43
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス	1.36
ヘルスケア機器・用品	1.25
インターネットソフトウェア・サービス	1.08
無線通信サービス	1.07
繊維・アパレル・贅沢品	0.98
バイオテクノロジー	0.92
陸運・鉄道	0.88
自動車	0.85
電気設備	0.77
複合小売り	0.64
不動産管理・開発	0.57
航空貨物・物流サービス	0.56
インターネット販売・カタログ販売	0.54
消費者金融	0.44
商業サービス・用品	0.43
建設・土木	0.41
専門サービス	0.38
自動車部品	0.35
電子装置・機器・部品	0.33
ライフサイエンス・ツール / サービス	0.29
パーソナル用品	0.28
建設資材	0.28
商社・流通業	0.21
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.20
運送インフラ	0.18
紙製品・林産品	0.18
ガス	0.17
容器・包装	0.16
建設関連製品	0.16
家庭用耐久財	0.14
販売	0.13
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.09
水道	0.08
レジャー用品	0.07
各種消費者サービス	0.07
事務用電子機器	0.07
貯蓄・抵当・不動産金融	0.07
不動産投資信託	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
株式 計	96.18
投資信託受益証券	0.32
投資証券	1.48
合計	97.98

(注) 投資比率とは、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。

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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	313回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.21	6,578,615,000	102.59	6,668,545,000	1.30	2021/ 3/20	1.67
2	312回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	5,700,000,000	100.14	5,708,062,000	101.95	5,811,378,000	1.20	2020/ 12/20	1.46
3	293回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	107.65	5,382,600,000	1.80	2018/ 6/20	1.35
4	305回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	5,100,000,000	101.39	5,170,808,000	103.74	5,290,638,000	1.30	2019/ 12/20	1.33
5	315回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.52	5,076,125,000	101.48	5,073,800,000	1.20	2021/ 6/20	1.27
6	99回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.09	5,004,325,000	100.05	5,002,350,000	0.40	2016/ 9/20	1.26
7	70回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	100.87	4,942,483,000	0.80	2013/ 3/20	1.24
8	306回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	102.18	4,598,292,000	104.34	4,695,255,000	1.40	2020/ 3/20	1.18
9	285回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	4,400,000,000	105.76	4,653,499,000	106.57	4,688,904,000	1.70	2017/ 3/20	1.18
10	75回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,600,000,000	102.03	4,693,334,000	101.72	4,679,304,000	1.10	2013/ 9/20	1.17
11	81回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.28	4,557,600,000	101.48	4,566,645,000	0.80	2014/ 3/20	1.15
12	310回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	97.56	4,390,410,000	100.53	4,523,760,000	1.00	2020/ 9/20	1.14
13	89回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.47	4,476,220,000	100.47	4,521,285,000	0.40	2015/ 6/20	1.13
14	93回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,300,000,000	99.89	4,295,190,000	100.72	4,330,874,000	0.50	2015/ 12/20	1.09
15	72回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.81	4,317,920,000	102.11	4,288,746,000	1.50	2013/ 6/20	1.08
16	296回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	105.70	4,228,000,000	1.50	2018/ 9/20	1.06
17	301回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	3,800,000,000	103.02	3,914,570,000	105.62	4,013,370,000	1.50	2019/ 6/20	1.01
18	317回 利付 国庫債券（10年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.45	4,017,930,000	100.31	4,012,400,000	1.10	2021/ 9/20	1.01
19	97回 利付 国庫債券（5年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.28	4,011,080,000	100.13	4,005,320,000	0.40	2016/ 6/20	1.01

20	288回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,600,000,000	105.57	3,800,412,000	106.78	3,844,224,000	1.70	2017/9/20	0.96
21	266回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.60	3,833,015,000	1.40	2014/12/20	0.96
22	286回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,500,000,000	106.40	3,723,840,000	107.24	3,753,330,000	1.80	2017/6/20	0.94
23	282回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,400,000,000	105.85	3,598,841,000	106.21	3,611,208,000	1.70	2016/9/20	0.91
24	289回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,400,000,000	104.27	3,545,067,000	105.71	3,594,106,000	1.50	2017/12/20	0.90
25	85回 利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	3,500,000,000	100.94	3,532,935,000	101.43	3,550,050,000	0.70	2014/9/20	0.89
26	88回 利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	3,500,000,000	99.96	3,498,520,000	100.85	3,529,680,000	0.50	2015/3/20	0.89
27	83回 利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	3,400,000,000	101.59	3,454,204,000	101.86	3,463,172,000	0.90	2014/6/20	0.87
28	290回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,200,000,000	103.51	3,312,432,000	105.10	3,363,232,000	1.40	2018/3/20	0.84
29	297回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,200,000,000	102.65	3,284,672,000	105.01	3,360,448,000	1.40	2018/12/20	0.84
30	284回 利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,100,000,000	105.67	3,275,708,000	106.40	3,298,307,000	1.70	2016/12/20	0.83

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.28
地方債証券	6.91
特殊債券	9.04
社債券	7.20
合計	99.44

(注)投資比率とは、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。

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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,125,200,000	108.13	3,379,122,500	108.22	3,382,028,936	4.00	2014/ 2/15	0.94
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,125,200,000	108.55	3,392,279,592	107.77	3,368,121,796	4.25	2013/ 11/15	0.94
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	3,125,200,000	101.13	3,160,400,948	101.25	3,164,265,000	1.00	2013/ 7/15	0.88
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,734,550,000	110.70	3,027,010,123	110.86	3,031,494,785	4.75	2014/ 5/15	0.85
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,734,550,000	107.98	2,952,876,472	106.84	2,921,675,257	4.25	2013/ 8/15	0.82
6	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	2,734,550,000	100.75	2,755,059,125	101.00	2,761,786,118	1.13	2012/ 12/15	0.77
7	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,500,160,000	105.84	2,646,144,877	104.93	2,623,392,886	3.50	2013/ 5/31	0.73
8	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,500,160,000	106.23	2,656,019,974	104.49	2,612,467,187	3.88	2013/ 2/15	0.73
9	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,343,900,000	109.63	2,569,664,448	111.30	2,608,666,944	4.25	2014/ 11/15	0.73
10	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,343,900,000	103.81	2,433,249,468	105.85	2,480,947,833	2.63	2014/ 6/30	0.69
11	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	2,343,900,000	105.79	2,479,588,371	103.67	2,429,944,569	4.00	2012/ 11/15	0.68
12	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,187,640,000	109.34	2,391,856,194	110.47	2,416,642,155	4.25	2014/ 8/15	0.67
13	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,265,770,000	106.11	2,404,185,889	104.97	2,378,333,454	3.63	2013/ 5/15	0.66
14	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,343,900,000	98.41	2,306,725,746	100.45	2,354,424,111	0.50	2013/ 10/15	0.66
15	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,187,640,000	102.64	2,245,481,202	105.59	2,309,819,694	2.38	2014/ 9/30	0.64
16	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,083,200,000	107.04	2,229,905,194	107.93	2,248,397,760	4.25	2014/ 1/4	0.63
17	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,187,640,000	101.14	2,212,491,590	101.55	2,221,460,914	1.38	2013/ 3/15	0.62
18	US T N/B 3.25 06/30/16	国債 証券	米国	1,953,250,000	105.54	2,061,415,891	111.09	2,169,767,763	3.25	2016/ 6/30	0.61
19	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	1,979,040,000	107.72	2,131,821,888	109.37	2,164,476,048	4.25	2014/ 7/4	0.60
20	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フランス	2,083,200,000	104.83	2,183,752,731	103.89	2,164,236,480	4.00	2013/ 4/25	0.60
21	US T N/B 3.125 05/15/21	国債 証券	米国	1,953,250,000	104.44	2,040,046,554	110.43	2,156,954,443	3.13	2021/ 5/15	0.60
22	US T N/B 3.625 02/15/21	国債 証券	米国	1,875,120,000	102.06	1,913,729,487	114.88	2,154,175,358	3.63	2021/ 2/15	0.60
23	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フランス	1,979,040,000	105.39	2,085,770,252	104.15	2,061,170,160	4.00	2013/ 10/25	0.58

24	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	1,953,250,000	101.55	1,983,447,245	105.08	2,052,436,035	2.13	2014/ 11/30	0.57
25	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債 証券	ドイツ	1,874,880,000	104.61	1,961,218,224	108.31	2,030,682,528	3.25	2015/ 7/4	0.57
26	US T N/B 1.75 03/31/14	国債 証券	米国	1,953,250,000	102.90	2,009,803,904	103.34	2,018,547,148	1.75	2014/ 3/31	0.56
27	US T N/B 1.75 04/15/13	国債 証券	米国	1,953,250,000	101.96	1,991,533,700	102.14	1,995,127,680	1.75	2013/ 4/15	0.56
28	US T N/B 3.625 02/15/20	国債 証券	米国	1,718,860,000	101.66	1,747,324,322	114.98	1,976,276,474	3.63	2020/ 2/15	0.55
29	US T N/B 2.625 08/15/20	国債 証券	米国	1,796,990,000	92.67	1,665,288,603	106.69	1,917,154,721	2.63	2020/ 8/15	0.54
30	US T N/B 2.375 02/28/15	国債 証券	米国	1,796,990,000	102.21	1,836,649,569	106.13	1,907,055,638	2.38	2015/ 2/28	0.53

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.78
合計	97.78

(注)投資比率とは、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。

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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本ビルファンド投資法人	投資 証券	日本	694	792,362.41	549,899,514	710,000.00	492,740,000	13.60
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資 証券	日本	587	755,877.89	443,700,320	643,000.00	377,441,000	10.42
3	日本リテールファンド投資法人	投資 証券	日本	2,257	123,798.12	279,412,351	118,300.00	267,003,100	7.37
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資 証券	日本	2,525	92,065.69	232,465,877	82,100.00	207,302,500	5.72
5	森トラスト総合リート投資法人	投資 証券	日本	291	777,910.87	226,372,063	639,000.00	185,949,000	5.13
6	アドバンス・レジデンス投資法人	投資 証券	日本	1,176	163,416.35	192,177,624	143,000.00	168,168,000	4.64
7	日本プライムリアルティ投資法人	投資 証券	日本	858	213,652.67	183,313,987	188,000.00	161,304,000	4.45

8	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	233	720,517.43	167,880,562	640,000.00	149,120,000	4.12
9	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	366	507,079.54	185,591,112	396,000.00	144,936,000	4.00
10	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	234	581,818.63	136,145,559	506,000.00	118,404,000	3.27
11	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	178	719,287.78	128,033,225	627,000.00	111,606,000	3.08
12	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	341	400,266.80	136,490,978	326,000.00	111,166,000	3.07
13	ビ・ライフ投資法人	投資証券	日本	193	516,777.50	99,738,058	466,000.00	89,938,000	2.48
14	大和証券オフィス投資法人	投資証券	日本	475	251,779.67	119,595,341	160,300.00	76,142,500	2.10
15	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	344	289,681.98	99,650,601	220,200.00	75,748,800	2.09
16	福岡リート投資法人	投資証券	日本	148	566,255.18	83,805,767	505,000.00	74,740,000	2.06
17	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	203	491,402.02	99,754,611	352,500.00	71,557,500	1.98
18	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	226	409,322.43	92,506,870	309,500.00	69,947,000	1.93
19	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	278	275,707.55	76,646,698	247,800.00	68,888,400	1.90
20	トップリート投資法人	投資証券	日本	186	448,572.60	83,434,504	344,500.00	64,077,000	1.77
21	プレミア投資法人	投資証券	日本	232	316,741.47	73,484,021	248,300.00	57,605,600	1.59
22	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	116	663,466.65	76,962,131	491,500.00	57,014,000	1.57
23	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	日本	1,598	35,227.85	56,294,105	30,550.00	48,818,900	1.35
24	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	151	429,335.10	64,829,600	320,500.00	48,395,500	1.34
25	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	112	417,577.73	46,768,706	390,500.00	43,736,000	1.21
26	M I D リート投資法人	投資証券	日本	220	223,840.54	49,244,918	189,400.00	41,668,000	1.15
27	積水ハウス・S I 投資法人	投資証券	日本	138	343,164.86	47,356,751	284,000.00	39,192,000	1.08
28	阪急リート投資法人	投資証券	日本	103	402,375.98	41,444,726	335,000.00	34,505,000	0.95
29	平和不動産リート投資法人	投資証券	日本	835	45,601.74	38,077,457	36,650.00	30,602,750	0.84
30	いちご不動産投資法人	投資証券	日本	1,012	33,716.32	34,120,911	26,950.00	27,273,400	0.75

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.65
合計	98.65

(注)投資比率とは、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。

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。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年11月30日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資 証券	米国	18,274	10,066.27	183,951,003	9,311.53	170,158,961	6.61
2	PUBLIC STORAGE	投資 証券	米国	8,678	9,752.19	84,629,475	9,892.04	85,843,117	3.33
3	EQUITY RESIDENTIAL	投資 証券	米国	19,900	4,568.26	90,908,396	4,133.08	82,248,232	3.19
4	WESTFIELD GROUP	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	128,200	612.92	78,576,857	633.35	81,196,085	3.15
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資 証券	フランス	5,760	14,462.62	83,304,668	13,832.45	79,674,900	3.09
6	HCP INC	投資 証券	米国	24,600	2,969.72	73,055,144	2,872.06	70,652,646	2.74
7	VENTAS INC	投資 証券	米国	17,102	4,242.46	72,554,534	3,932.28	67,249,902	2.61
8	VORNADO REALTY TRUST	投資 証券	米国	11,729	6,289.47	73,769,135	5,555.04	65,155,099	2.53
9	BOSTON PROPERTIES INC	投資 証券	米国	8,750	7,720.03	67,550,221	7,028.57	61,500,030	2.39
10	PROLOGIS INC	投資 証券	米国	29,129	2,286.87	66,614,093	2,036.07	59,308,619	2.30
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資 証券	米国	5,868	10,181.90	59,747,399	9,282.63	54,470,445	2.12
12	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資 証券	英国	52,600	842.47	44,313,775	815.64	42,902,916	1.67
13	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資 証券	米国	41,168	1,136.01	46,767,268	1,031.32	42,457,217	1.65
14	HEALTH CARE REIT INC	投資 証券	米国	11,201	3,906.50	43,756,707	3,787.74	42,426,503	1.65
15	STOCKLAND	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	158,140	253.81	40,138,051	260.89	41,256,449	1.60
16	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	190,200	198.81	37,813,167	196.45	37,364,790	1.45
17	LINK REIT/THE	投資 証券	香港	135,000	271.81	36,694,755	276.33	37,304,078	1.45
18	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	投資 証券	米国	34,963	1,136.79	39,745,641	1,057.88	36,986,665	1.44
19	BRITISH LAND CO PLC	投資 証券	英国	58,200	617.52	35,939,943	581.92	33,867,986	1.32
20	THE MACERICH COMPANY	投資 証券	米国	8,820	3,925.25	34,620,716	3,728.36	32,884,167	1.28
21	KIMCO REALTY	投資 証券	米国	27,299	1,353.21	36,941,323	1,163.36	31,758,447	1.23

22	GPT GROUP	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	121,000	243.60	29,475,358	246.74	29,855,685	1.16
23	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資 証券	米国	5,510	4,969.85	27,383,870	4,933.13	27,181,536	1.06
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資 証券	米国	4,030	6,976.23	28,114,198	6,669.18	26,876,783	1.04
25	SL GREEN	投資 証券	米国	5,625	5,346.44	30,073,702	4,737.02	26,645,748	1.04
26	UDR INC	投資 証券	米国	13,779	1,927.47	26,558,569	1,766.52	24,340,869	0.95
27	DEXUS PROPERTY GROUP	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	357,400	66.40	23,731,396	67.19	24,012,241	0.93
28	CAPITAMALL TRUST	投資 信託 受益 証券	シンガポール	206,000	107.81	22,209,628	106.02	21,840,027	0.85
29	CFS RETAIL PROPERTY	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	153,300	143.80	22,044,755	141.84	21,743,597	0.84
30	HAMMERSON PLC	投資 証券	英国	46,200	495.73	22,902,574	459.88	21,246,559	0.83

(注)投資比率とは、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。

種類別業種別投資比率

平成23年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	14.92
投資証券	82.74
合計	97.66

(注)投資比率とは、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。

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】**

直近日（平成23年11月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額 （百万円）		1口当たり純資産額 （円）	
		分配落	分配付	分配落	分配付
第1特定期間	第1期末（平成19年5月11日現在）	1,285	1,326	1.0111	1.0436
	第2期末（平成19年7月11日現在）	1,757	1,761	0.9978	1.0003
第2特定期間	第3期末（平成19年9月11日現在）	1,731	1,736	0.9083	0.9108
	第4期末（平成19年11月12日現在）	1,696	1,700	0.9051	0.9076
第3特定期間	第5期末（平成20年1月11日現在）	1,565	1,569	0.8744	0.8769
	第6期末（平成20年3月11日現在）	1,387	1,391	0.8086	0.8111
第4特定期間	第7期末（平成20年5月12日現在）	1,426	1,430	0.8458	0.8483
	第8期末（平成20年7月11日現在）	1,355	1,360	0.8187	0.8212
第5特定期間	第9期末（平成20年9月11日現在）	1,249	1,253	0.7757	0.7782
	第10期末（平成20年11月11日現在）	964	968	0.6215	0.6240
第6特定期間	第11期末（平成21年1月13日現在）	920	923	0.5989	0.6014
	第12期末（平成21年3月11日現在）	878	882	0.5763	0.5788
第7特定期間	第13期末（平成21年5月11日現在）	972	976	0.6435	0.6460
	第14期末（平成21年7月13日現在）	938	942	0.6209	0.6234
第8特定期間	第15期末（平成21年9月11日現在）	995	998	0.6680	0.6705
	第16期末（平成21年11月11日現在）	966	970	0.6528	0.6553
第9特定期間	第17期末（平成22年1月12日現在）	981	985	0.6746	0.6771
	第18期末（平成22年3月11日現在）	943	946	0.6580	0.6605
第10特定期間	第19期末（平成22年5月11日現在）	927	930	0.6634	0.6659
	第20期末（平成22年7月12日現在）	880	883	0.6328	0.6353
第11特定期間	第21期末（平成22年9月13日現在）	851	854	0.6238	0.6263
	第22期末（平成22年11月11日現在）	861	863	0.6399	0.6414
第12特定期間	第23期末（平成23年1月11日現在）	856	858	0.6487	0.6502
	第24期末（平成23年3月11日現在）	840	842	0.6513	0.6528
第13特定期間	第25期末（平成23年5月11日現在）	823	825	0.6487	0.6502
	第26期末（平成23年7月11日現在）	795	797	0.6454	0.6469
第14特定期間	第27期末（平成23年9月12日現在）	722	724	0.5988	0.6003
	第28期末（平成23年11月11日現在）	712	714	0.5956	0.5971
	平成22年11月末	851	-	0.6362	-
	12月末	855	-	0.6442	-
	平成23年1月末	846	-	0.6481	-
	2月末	849	-	0.6569	-
	3月末	832	-	0.6502	-
	4月末	833	-	0.6552	-
	5月末	815	-	0.6453	-
	6月末	807	-	0.6428	-
	7月末	764	-	0.6298	-
	8月末	739	-	0.6114	-
	9月末	717	-	0.5962	-
	10月末	732	-	0.6120	-
	11月末	703	-	0.5896	-

【分配の推移】

		1口当たりの分配額（円）
第1特定期間	第1期	0.0325
	第2期	0.0025
第2特定期間	第3期	0.0025
	第4期	0.0025

第3特定期間	第5期	0.0025
	第6期	0.0025
	第7期	0.0025
第4特定期間	第8期	0.0025
	第9期	0.0025
	第10期	0.0025
第5特定期間	第11期	0.0025
	第12期	0.0025
	第13期	0.0025
第6特定期間	第14期	0.0025
	第15期	0.0025
	第16期	0.0025
第7特定期間	第17期	0.0025
	第18期	0.0025
	第19期	0.0025
第8特定期間	第20期	0.0025
	第21期	0.0025
	第22期	0.0015
第9特定期間	第23期	0.0015
	第24期	0.0015
	第25期	0.0015
第10特定期間	第26期	0.0015
	第27期	0.0015
	第28期	0.0015

【収益率の推移】

		収益率（％）
第1特定期間	第1期	4.36
	第2期	1.07
第2特定期間	第3期	8.72
	第4期	0.08
第3特定期間	第5期	3.12
	第6期	7.24
	第7期	4.91
第4特定期間	第8期	2.91
	第9期	4.95
	第10期	19.56
第5特定期間	第11期	3.23
	第12期	3.36
	第13期	12.09
第6特定期間	第14期	3.12
	第15期	7.99
	第16期	1.90
第7特定期間	第17期	3.72
	第18期	2.09
	第19期	1.20
第8特定期間	第20期	4.24
	第21期	1.03
	第22期	2.82
第9特定期間	第23期	1.61
	第24期	0.63
	第25期	0.17
第10特定期間	第26期	0.28
	第27期	6.99
	第28期	0.28

(注)収益率 = (当期分配付き基準価額－前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

<< 参考情報 >>

データの基準日：2011年11月30日

基準価額・純資産の推移

（設定日（2007年1月26日）～2011年11月30日）



※基準価額（分配金再投資）は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。（設定日：2007年1月26日）
※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移（税引前）

第24期	(2011.03.11)	15円
第25期	(2011.05.11)	15円
第26期	(2011.07.11)	15円
第27期	(2011.09.12)	15円
第28期	(2011.11.11)	15円
直近1年間累計		90円
設定来累計		930円

（注）分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄一覧

（注）投資比率（%）は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率（%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	31.41
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.81
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	18.99
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.30
5	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.67
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.47

■国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

（注）投資比率（%）は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率（%）
株式	日本	97.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2.39
合 計（純資産総額）		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	業種	投資比率（%）
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	3.17
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	銀行業	2.41
3	キヤノン	日本	電気機器	2.09
4	本田技研	日本	輸送用機器	1.98
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	1.69

組入上位5業種（株式）

順位	業種	投資比率（%）
1	電気機器	13.92
2	輸送用機器	9.26
3	銀行業	9.03
4	情報・通信業	6.57
5	化学	5.97

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

（注）投資比率（%）は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率（%）
株式	米国	53.30
	英国	9.99
	カナダ	5.60
	スイス	4.36
	フランス	3.99
	その他	18.94
	小計	96.18
投資信託受益証券	オーストラリア	0.30
	シンガポール	0.03
	小計	0.32
投資証券	米国	1.13
	英国	0.12
	フランス	0.12
	カナダ	0.05
	香港	0.04
	その他	0.02
	小計	1.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2.02
合 計（純資産総額）		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率（%）
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・ 消耗燃料	1.87
2	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ・ 周辺機器	1.73
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術 サービス	1.08
4	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・ 消耗燃料	0.98
5	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	0.94

組入上位5業種（株式）

順位	業種	投資比率（%）
1	石油・ガス・ 消耗燃料	10.85
2	商業銀行	6.76
3	医薬品	6.62
4	金属・鉱業	3.94
5	保険	3.84

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2011年11月30日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	日本	76.28
地方債証券	日本	6.91
特殊債券	日本	9.04
社債券	日本	7.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.56
合 計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	313回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2021/3/20	1.67
2	312回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2020/12/20	1.46
3	293回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.80	2018/6/20	1.35
4	305回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2019/12/20	1.33
5	315回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2021/6/20	1.27

■外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	米国	40.96
	フランス	9.40
	ドイツ	9.32
	英国	8.92
	イタリア	8.27
	その他	20.92
	小計	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.22
合 計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.94
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.94
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債証券	米国	1.00	2013/7/15	0.88
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	米国	4.75	2014/5/15	0.85
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/8/15	0.82

■J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資証券	日本	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.35
合 計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	13.60
2	ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	10.42
3	日本リテールファンド投資法人	日本	7.37
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	5.72
5	森トラスト総合リート投資法人	日本	5.13

■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

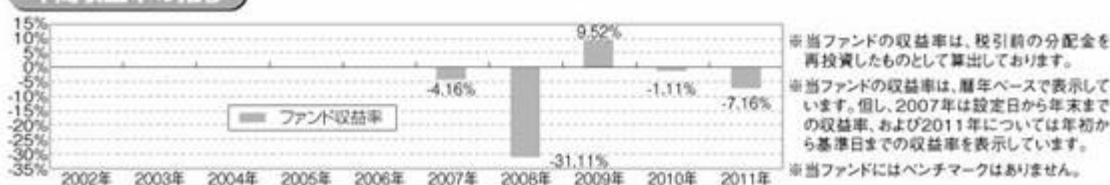
ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資信託受益証券	オーストラリア	12.14
	シンガポール	2.78
	小計	14.92
投資証券	米国	62.75
	英国	6.55
	フランス	5.12
	カナダ	3.22
	香港	1.92
	その他	3.16
	小計	82.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.34
合 計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	6.61
2	PUBLIC STORAGE	米国	3.33
3	EQUITY RESIDENTIAL	米国	3.19
4	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.15
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	3.09

年間収益率の推移



○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

		設定口数	解約口数
第1特定期間	第1期	1,341,630,000	70,590,000
第2特定期間	第2期	577,890,000	87,930,000
	第3期	296,160,000	150,910,000
	第4期	93,840,000	126,280,000
第3特定期間	第5期	41,330,000	125,160,000
	第6期	25,480,000	99,450,000
	第7期	21,320,000	50,420,000
第4特定期間	第8期	16,370,000	47,060,000
	第9期	6,940,000	52,110,000
	第10期	11,770,000	70,550,000
第5特定期間	第11期	10,070,000	26,080,000
	第12期	6,950,000	18,250,000
	第13期	4,240,000	17,240,000
第6特定期間	第14期	13,950,000	14,090,000
	第15期	9,650,000	31,860,000
	第16期	8,370,000	17,600,000
第7特定期間	第17期	7,650,000	32,970,000
	第18期	3,830,000	25,630,000
	第19期	4,950,000	40,920,000
第8特定期間	第20期	3,350,000	9,540,000
	第21期	2,930,000	28,830,000
	第22期	5,840,000	24,430,000
第9特定期間	第23期	1,400,000	27,550,000
	第24期	13,800,000	43,680,000
	第25期	6,010,000	27,510,000
第10特定期間	第26期	3,470,000	39,180,000
	第27期	2,200,000	29,470,000
	第28期	1,450,000	11,270,000

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品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があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、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かか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かかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

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、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の受け付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約にかか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。なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

信託財産留保額は、解約に際して生じる売買手数料等の費用について、受益者間の公平性を確保するため解約者から一定の金額を徴収し、信託財産に繰り入れるものです。

解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

- ・委託会社は、金融商品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があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解

約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、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解約の請求を受付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（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。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(2)【保管】

該当事項はありません。

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ります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成19年1月26日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

各計算期間の終了日が休業日の場合には翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

b. 上記a.の規定にかかわらず、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】

イ.償還規定

a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、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出ます。

b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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出ます。

c. 委託会社は、上記a.およびb.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かかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかか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。

d. 委託会社は上記c.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。

e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。

f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約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、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、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。

- g. 上記d. からf. 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d. 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。
- h. 委託会社は、監督官庁より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。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき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。ただし、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継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その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。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、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、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。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。
- k. 上記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 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、この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出ます。
- b. 委託会社は、上記a. 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かかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかか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。
- c. 委託会社は上記b. 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異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更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、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、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。
- f. 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a. ～e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。投資一任契約および投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドおよびマザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二. 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。

ホ.運用報告書

委託会社は、毎年5月11日、11月11日（休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、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。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者は分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が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。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかか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てします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が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。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかか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します。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの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。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる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3【ファンドの経理状況】

- （１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- （２）当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごと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10特定期間（平成23年5月12日から平成23年11月11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】

【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成23年 5 月11日現在	当期 平成23年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,835,188	11,845,130
親投資信託受益証券	812,995,433	702,445,496
未収入金	1,073,000	1,264,000
流動資産合計	827,903,621	715,554,626
資産合計	827,903,621	715,554,626
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,903,620	1,794,420
未払解約金	1,399,597	42,293
未払受託者報酬	101,149	86,596
未払委託者報酬	1,271,745	1,088,853
その他未払費用	6,837	5,844
流動負債合計	4,682,948	3,018,006
負債合計	4,682,948	3,018,006
純資産の部		
元本等		
元本	1,269,080,000	1,196,280,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	* ₃ 445,859,327	* ₃ 483,743,380
(分配準備積立金)	7,422,861	7,275,224
元本等合計	823,220,673	712,536,620
純資産合計	823,220,673	712,536,620
負債純資産合計	827,903,621	715,554,626

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成22年11月12日 至 平成23年 5 月11日	当期 自 平成23年 5 月12日 至 平成23年11月11日
営業収益		
受取利息	3,830	3,744
有価証券売買等損益	21,426,047	55,548,937
営業収益合計	21,429,877	55,545,193
営業費用		
受託者報酬	308,042	280,268
委託者報酬	* ₁ 3,873,073	* ₁ 3,523,840
その他費用	20,815	18,929
営業費用合計	4,201,930	3,823,037
営業利益又は営業損失（ ）	17,227,947	59,368,230
経常利益又は経常損失（ ）	17,227,947	59,368,230
当期純利益又は当期純損失（ ）	17,227,947	59,368,230
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	175,284	866,340
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	484,933,439	445,859,327
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,856,683	28,736,972
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	34,856,683	28,736,972
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,365,622	2,665,510
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,365,622	2,665,510
分配金	* ₂ 5,820,180	* ₂ 5,453,625
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	445,859,327	483,743,380

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(追加情報)

当特定期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 平成23年5月11日現在	当期 平成23年11月11日現在
*1 期首元本額	1,346,610,000円	1,269,080,000円
期中追加設定元本額	21,210,000円	7,120,000円
期中解約元本額	98,740,000円	79,920,000円
*2 特定期間末日における受益権の総数	1,269,080,000口	1,196,280,000口
*3 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445,859,327円であります。	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483,743,380円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	当期 自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
*1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	43,538円	37,310円
*2 分配金の計算過程	（平成22年11月12日から平成23年1月11日までの分配金計算期間）	（平成23年5月12日から平成23年7月11日までの分配金計算期間）

	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,803,111円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,236,692円）及び分配準備積立金（4,948,139円）より分配対象収益は9,987,942円（1万口当たり75.64円）であり、うち1,980,690円（1万口当たり15円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。） （平成23年1月12日から平成23年3月11日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,397,621円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,253,371円）及び分配準備積立金（5,580,519円）より分配対象収益は10,231,511円（1万口当たり79.28円）であり、うち1,935,870円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （平成23年3月12日から平成23年5月11日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,412,743円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,251,202円）及び分配準備積立金（5,913,738円）より分配対象収益は11,577,683円（1万口当たり91.23円）であり、うち1,903,620円（1万口当たり15円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,865,882円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,210,183円）及び分配準備積立金（7,194,154円）より分配対象収益は11,270,219円（1万口当たり91.38円）であり、うち1,850,055円（1万口当たり15円）を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。（以下、各期間において同じ。） （平成23年7月12日から平成23年9月12日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,358,990円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,175,040円）及び分配準備積立金（7,037,784円）より分配対象収益は10,571,814円（1万口当たり87.65円）であり、うち1,809,150円（1万口当たり15円）を分配金額としております。 （平成23年9月13日から平成23年11月11日までの分配金計算期間） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,543,539円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,166,338円）及び分配準備積立金（6,526,105円）より分配対象収益は11,235,982円（1万口当たり93.92円）であり、うち1,794,420円（1万口当たり15円）を分配金額としております。
--	--	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	当期 自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 平成23年5月11日現在	当期 平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	前期 平成23年5月11日現在	当期 平成23年11月11日現在
種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終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	462,386	921,256
合計	462,386	921,256

（デリバティブ取引等に関する注記）

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。

（１口当たり情報に関する注記）

	前期 平成23年5月11日現在	当期 平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額	0.6487円	0.5956円
（1万口当たり純資産額）	(6,487円)	(5,956円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	137,999,575	134,052,787	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	195,601,240	222,692,011	
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	45,687,156	31,757,142	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	76,996,368	89,254,189	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	167,928,414	190,817,056	
親投資信託受益証券	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	47,923,474	33,872,311	
合 計		672,136,227	702,445,496	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」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あります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 （円）	金額 （円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,139,275,075	5,788,703,647
株式	*2	263,527,941,475	232,766,713,017
派生商品評価勘定		11,758,567	1,072,039
未収配当金		2,667,471,744	2,366,414,923
前払金		42,918,000	205,189,000
流動資産合計		269,389,364,861	241,128,092,626
資産合計		269,389,364,861	241,128,092,626

負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		57,703,242	233,669,360
未払金		540,329	535,173
未払解約金		204,470,000	131,262,000
流動負債合計		262,713,571	365,466,533
負債合計		262,713,571	365,466,533
純資産の部			
元本等			
元本		238,161,295,577	247,855,496,173
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*4	30,965,355,713	7,092,870,080
元本等合計		269,126,651,290	240,762,626,093
純資産合計		269,126,651,290	240,762,626,093
負債純資産合計		269,389,364,861	241,128,092,626

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	247,233,093,186円	238,161,295,577円
同期中追加設定元本額	30,644,085,658円	28,283,273,132円
同期中解約元本額	39,715,883,267円	18,589,072,536円
同期末における元本の内訳		

D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,691,132,648円	2,001,968,096円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	889,747,073円	1,107,810,227円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	31,466,651,831円	33,474,588,948円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	757,737,666円	886,615,267円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,902,199,545円	3,188,190,756円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,058,081,078円	3,214,215,307円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	456,219,730円	505,311,526円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,378,266,983円	1,502,524,838円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,052,890,032円	1,135,261,225円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	148,265,752円	137,999,575円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,409,866,084円	1,442,846,477円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,170,887円	19,725,278円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	267,995,676円	273,108,368円
D I A Mグローバル・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	10,898,468,213円	11,129,211,000円
D I A Mグローバル・バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	1,874,775,984円	1,826,318,810円
D I A M国際分散バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	214,398,565円	217,373,414円
D I A M国際分散バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	819,439,012円	834,966,854円
D I A M国内重視バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	217,663,237円	225,642,197円
D I A M国内重視バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	294,410,195円	300,612,095円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限定）	20,350,127,607円	20,814,523,018円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	6,796,530,511円	6,894,479,039円
D I A Mバランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	5,261,414,090円	5,404,067,938円
D I A Mバランスファンド 3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	3,529,900,169円	3,569,598,858円
D I A Mバランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,327,978,171円	8,261,677,880円
D I A Mグローバル・アセット・バランス V A（適格機関投資家限定）	1,268,566,213円	1,260,106,197円
D I A Mグローバル・アセット・バランス V A 2（適格機関投資家限定）	2,682,335,164円	2,747,767,918円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	2,722,011,788円	2,813,520,200円
D I A M世界アセットバランスファンド V A（適格機関投資家向け）	14,498,880,648円	15,380,907,437円
D I A Mグローバルβ 私募ファンド（適格機関投資家向け）	204,230,422円	222,287,324円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	305,082,865円	- 円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限定）	4,968,525,806円	5,088,611,566円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド 3 5 V A（適格機関投資家限定）	9,305,539,082円	9,598,988,779円
D I A Mグローバル分散ファンド V A（適格機関投資家限定）	456,653,082円	488,514,372円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A（適格機関投資家限定）	41,689,187,140円	43,277,058,571円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限定）	2,802,415,423円	2,834,843,976円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	5,114,121,077円	5,321,649,222円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A（適格機関投資家限定）	25,238,415,173円	26,432,071,837円
D I A Mバランス 3 0 V A（適格機関投資家限定）	288,628,129円	305,541,383円
D I A Mバランス 5 0 V A（適格機関投資家限定）	100,275円	104,598円
D I A Mバランス 7 0 V A（適格機関投資家限定）	157,779円	161,414円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A（適格機関投資家限定）	22,000,692,653円	23,130,047,733円
D I A M世界バランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	236,326,262円	258,089,667円
D I A M国内バランス 3 0 V A（適格機関投資家限定）	79,441,191円	92,459,986円
D I A Mバランス 2 0 V A（適格機関投資家限定）	218,418,277円	233,878,920円
D I A Mバランス 4 0 V A（適格機関投資家限定）	92,827円	99,089円
D I A Mバランス 6 0 V A（適格機関投資家限定）	143,562円	148,993円
（合 計）	238,161,295,577円	247,855,496,173円
*2 差入代用有価証券	株式 1,635,000,000円	株式 1,227,000,000円
*3 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	238,161,295,577口	247,855,496,173口
*4 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7,092,870,080円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。	(1)株式 同左 (2)派生商品評価勘定 同左

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	23,247,962,137	61,734,512,242
合 計	23,247,962,137	61,734,512,242

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（株式関連）

平成23年5月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX 先物	5,578,633,000	-	5,532,990,000	45,944,675
合 計		5,578,633,000	-	5,532,990,000	45,944,675

平成23年11月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX 先物	8,194,521,000	-	7,962,440,000	232,597,321
合 計		8,194,521,000	-	7,962,440,000	232,597,321

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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。

（１口当たり情報に関する注記）

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1300円 (11,300円)	0.9714円 (9,714円)

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年11月11日現在

銘 柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	106,000	175	18,550,000	
日本水産	303,500	261	79,213,500	
マルハニチロホールディングス	522,000	134	69,948,000	
ハウスイ	20,000	88	1,760,000	
サカタのタネ	39,100	1,100	43,010,000	
ホクト	27,000	1,631	44,037,000	
ショーボンドHD	23,400	1,724	40,341,600	
ミライト・ホールディングス	74,500	565	42,092,500	
住石ホールディングス	72,700	63	4,580,100	
日鉄鉱業	67,000	303	20,301,000	
三井松島	171,000	134	22,914,000	
国際石油開発帝石	3,190	506,000	1,614,140,000	
日本海洋掘削	6,500	2,458	15,977,000	
関東天然瓦斯	27,000	384	10,368,000	
石油資源開発	37,400	3,035	113,509,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	180,000	3,960,000	
間組	103,100	164	16,908,400	
東急建設	93,730	204	19,120,920	
コムシスホールディングス	128,200	766	98,201,200	
ミサワホーム	25,400	473	12,014,200	
高松コンストラクションGP	20,000	1,175	23,500,000	
東建コーポレーション	9,790	2,692	26,354,680	
ヤマウラ	8,500	205	1,742,500	
大成建設	1,327,000	214	283,978,000	
大 林 組	787,000	344	270,728,000	
清水建設	803,000	335	269,005,000	
飛島建設	152,600	78	11,902,800	
長谷工コーポレーション	1,638,000	49	80,262,000	
松井建設	2,000	302	604,000	
鹿島建設	1,230,000	252	309,960,000	
不動テトラ	186,100	155	28,845,500	
大末建設	93,000	40	3,720,000	
鉄建建設	148,000	88	13,024,000	
安藤建設	89,000	98	8,722,000	
太平工業	46,000	404	18,584,000	
西松建設	345,000	122	42,090,000	
三井住友建設	146,200	49	7,163,800	
大豊建設	80,000	93	7,440,000	
前田建設	163,000	280	45,640,000	
佐田建設	91,000	62	5,642,000	
ナカノフドー建設	20,500	180	3,690,000	
奥 村 組	251,000	308	77,308,000	
大和小田急建設	14,000	193	2,702,000	
東鉄工業	35,000	656	22,960,000	
イチケン	31,000	116	3,596,000	
浅沼組	86,000	63	5,418,000	
戸田建設	283,000	273	77,259,000	
熊 谷 組	201,000	68	13,668,000	
青木あすなろ建設	19,000	407	7,733,000	
北野建設	60,000	170	10,200,000	

植 木 組	33,000	158	5,214,000
三井ホーム	34,000	381	12,954,000
矢作建設	32,900	385	12,666,500
ピーエス三菱	17,700	222	3,929,400
大東建託	99,700	6,960	693,912,000
新日本建設	31,500	197	6,205,500
N I P P O	61,000	660	40,260,000
東亜道路	51,000	138	7,038,000
前田道路	76,000	761	57,836,000
日本道路	79,000	190	15,010,000
東亜建設	229,000	132	30,228,000
若築建設	142,000	113	16,046,000
東洋建設	368,000	78	28,704,000
五洋建設	333,000	241	80,253,000
大林道路	32,000	181	5,792,000
世紀東急	81,000	45	3,645,000
福 田 組	39,000	264	10,296,000
住友林業	180,900	660	119,394,000
日本基礎技術	29,200	245	7,154,000
日成ビルド工業	78,000	168	13,104,000
エス・バイ・エル	133,000	180	23,940,000
巴コーポレーション	35,400	273	9,664,200
パナホーム	98,000	538	52,724,000
大和ハウス	654,000	967	632,418,000
ライト工業	56,300	349	19,648,700
積水ハウス	738,000	667	492,246,000
日特建設	64,000	91	5,824,000
北陸電気工事	15,000	203	3,045,000
ユアテック	35,000	358	12,530,000
西部電気工業	1,000	330	330,000
四電工	6,000	304	1,824,000
中電工	38,800	842	32,669,600
関 電 工	120,000	319	38,280,000
きんでん	175,000	631	110,425,000
東京エネシス	30,000	375	11,250,000
トーエネック	39,000	384	14,976,000
住友電設	19,000	439	8,341,000
日本電設工業	48,000	723	34,704,000
協和エクシオ	85,700	714	61,189,800
新日本空調	20,100	391	7,859,100
日本工営	83,000	261	21,663,000
日本電話施設	43,000	248	10,664,000
九電工	49,000	461	22,589,000
三機工業	61,000	397	24,217,000
日 揮	245,000	2,017	494,165,000
中外炉工業	85,000	230	19,550,000
ヤマト	16,000	310	4,960,000
太平電業	34,000	497	16,898,000
高砂熱学	75,800	612	46,389,600
三晃金属	29,000	236	6,844,000
N E C ネットズエスアイ	22,200	1,118	24,819,600
朝日工業社	8,000	313	2,504,000
アタカ大機	18,000	240	4,320,000
大 気 社	40,500	1,757	71,158,500
ダイダン	25,000	508	12,700,000
日比谷総合設	32,100	745	23,914,500
東芝プラントシステム	43,000	767	32,981,000
日本製粉	165,000	339	55,935,000
日清製粉 G 本社	238,500	942	224,667,000

日東富士製粉	8,000	288	2,304,000
昭和産業	108,000	232	25,056,000
鳥越製粉	24,000	696	16,704,000
協同飼料	94,000	85	7,990,000
中部飼料	23,700	487	11,541,900
日本配合飼料	80,000	102	8,160,000
東洋精糖	41,000	89	3,649,000
日本甜菜糖	149,000	149	22,201,000
三井製糖	93,000	286	26,598,000
ネクスト	8,300	314	2,606,200
日本M & A センター	48	426,500	20,472,000
ノバレーゼ	49	49,800	2,440,200
アコーディア・ゴルフ	996	58,900	58,664,400
パソナグループ	242	76,800	18,585,600
リンクアンドモチベーション	51	52,500	2,677,500
テンプホールディングス	33,600	725	24,360,000
森永製菓	261,000	179	46,719,000
中 村 屋	62,000	406	25,172,000
江崎グリコ	95,000	919	87,305,000
名糖産業	12,200	1,004	12,248,800
不 二 家	151,000	154	23,254,000
山崎製パン	192,000	1,034	198,528,000
第一屋製パン	41,000	79	3,239,000
モロゾフ	43,000	278	11,954,000
カルビー	14,100	3,390	47,799,000
森永乳業	222,000	293	65,046,000
ヤクルト	140,800	2,279	320,883,200
明治ホールディングス	77,800	3,295	256,351,000
雪印メグミルク	56,600	1,489	84,277,400
プリマハム	148,000	105	15,540,000
日本ハム	199,000	957	190,443,000
伊藤ハム	145,000	295	42,775,000
林兼産業	86,000	61	5,246,000
丸大食品	125,000	262	32,750,000
米 久	23,500	694	16,309,000
S F o o d s	17,500	588	10,290,000
学情	8,200	241	1,976,200
スタジオアリス	11,300	1,218	13,763,400
シミック	8,000	1,261	10,088,000
システナ	276	42,900	11,840,400
N E C フィールドイング	20,000	924	18,480,000
新日鉄ソリューションズ	15,400	1,654	25,471,600
総合警備保障	89,100	824	73,418,400
日本駐車場開発	2,518	3,495	8,800,410
コア	9,000	636	5,724,000
カカクコム	38,000	3,015	114,570,000
アイロムホールディングス	542	4,245	2,300,790
ルネサンス	11,400	375	4,275,000
新日本科学	15,600	203	3,166,800
エムスリー	190	375,500	71,345,000
ベストブライダル	54	72,100	3,893,400
ディー・エヌ・エー	109,700	2,762	302,991,400
博報堂 D Y H L D G S	31,080	4,200	130,536,000
ぐるなび	17,100	918	15,697,800
一休	176	35,300	6,212,800
ジャパンベストレスキュー S	37	70,500	2,608,500
ジェイコムホールディングス	4,300	780	3,354,000
P G M ホールディングス	605	51,800	31,339,000
サッポロホールディングス	430,000	280	120,400,000

アサヒグループホールディング	492,500	1,642	808,685,000
キリンHD	1,053,000	901	948,753,000
宝ホールディングス	223,000	484	107,932,000
オエノンホールディングス	72,000	178	12,816,000
養命酒	3,000	724	2,172,000
三国コカ・コ・ラ	27,300	670	18,291,000
コカ・コーラウエスト	89,000	1,341	119,349,000
コカコーラセントラルジャパン	30,200	1,018	30,743,600
ダイドードリンコ	12,000	2,987	35,844,000
伊藤園	79,900	1,317	105,228,300
キーコーヒー	23,500	1,395	32,782,500
ユニカフェ	6,100	342	2,086,200
ジャパンフーズ	4,000	750	3,000,000
日清オイリオグループ	101,000	325	32,825,000
不二製油	63,900	1,096	70,034,400
J・オイルミルズ	99,000	214	21,186,000
ローソン	72,900	4,570	333,153,000
インターニックス	9,800	336	3,292,800
サンエー	7,900	3,010	23,779,000
キリン堂	10,100	481	4,858,100
ダイユーエイト	3,200	671	2,147,200
カワチ薬品	16,100	1,499	24,133,900
エービーシー・マート	32,900	3,010	99,029,000
ハードオフコーポレーション	11,400	450	5,130,000
高千穂交易	10,100	867	8,756,700
アスクル	18,100	1,043	18,878,300
ゲオホールディングス	382	83,600	31,935,200
ポイント	19,480	3,315	64,576,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	97	485,000
伊藤忠食品	5,900	2,699	15,924,100
くらコーポレーション	12,000	972	11,664,000
キャンドウ	126	85,500	10,773,000
エレマテック	18,500	1,270	23,495,000
パル	6,700	2,958	19,818,600
JALUX	7,300	702	5,124,600
エディオン	92,200	580	53,476,000
サーラコーポレーション	20,500	464	9,512,000
トーマンデバイス	2,900	1,669	4,840,100
あみやき亭	40	196,900	7,876,000
東京エレクトロンデバイス	48	128,400	6,163,200
ひらまつ	97	53,400	5,179,800
双日	1,550,400	125	193,800,000
ゲンキー	1,700	1,542	2,621,400
アルフレッサホールディングス	60,500	2,925	176,962,500
ハニーズ	20,210	1,033	20,876,930
キッコーマン	215,000	846	181,890,000
味の素	691,000	908	627,428,000
キュービー	133,900	1,071	143,406,900
ハウス食品	93,500	1,395	130,432,500
カゴメ	101,400	1,481	150,173,400
焼津水産化工	12,900	699	9,017,100
アリアケジャパン	23,900	1,376	32,886,400
ニチレイ	296,000	350	103,600,000
横浜冷凍	54,700	594	32,491,800
東洋水産	113,000	1,944	219,672,000
日清食品HD	102,500	2,962	303,605,000
永谷園	7,000	847	5,929,000
フジッコ	29,000	949	27,521,000
ロックフィールド	13,200	1,236	16,315,200

日本たばこ産業	5,818	373,000	2,170,114,000
わらべや日洋	14,900	952	14,184,800
なとり	13,200	830	10,956,000
片倉工業	30,900	767	23,700,300
グ ン ゼ	183,000	224	40,992,000
昭 栄	42,200	582	24,560,400
神 栄	27,000	129	3,483,000
山下医科器械	1,900	970	1,843,000
ラサ商事	11,500	328	3,772,000
アルペン	14,700	1,341	19,712,700
アルコニックス	6,000	1,567	9,402,000
ビックカメラ	874	40,400	35,309,600
D C Mホールディングス	119,700	635	76,009,500
M o n o t a R O	13,000	791	10,283,000
あい ホールディングス	41,100	326	13,398,600
J . フロント リテイリング	546,000	343	187,278,000
ドトール・日レスHD	36,800	962	35,401,600
マツモトキヨシH L D G S	42,800	1,459	62,445,200
物語コーポレーション	2,400	1,300	3,120,000
ココカラファイン	24,100	1,997	48,127,700
三越伊勢丹HD	459,100	772	354,425,200
東洋紡績	1,037,000	106	109,922,000
ユニチカ	542,000	41	22,222,000
富士紡ホールディングス	110,000	138	15,180,000
日清紡ホールディングス	156,000	659	102,804,000
倉敷紡績	251,000	149	37,399,000
ダイワボウHD	228,000	179	40,812,000
シキボウ	150,000	89	13,350,000
日東紡績	180,000	283	50,940,000
トヨタ紡織	81,800	842	68,875,600
クリエイトS D H	9,700	1,551	15,044,700
バイタルK S K H D	43,600	580	25,288,000
U K Cホールディングス	13,700	725	9,932,500
丸善C H I H D	6,700	196	1,313,200
T O K A Iホールディングス	113,100	397	44,900,700
日本毛織	84,000	583	48,972,000
大東紡織	38,000	56	2,128,000
トーア紡コーポレーション	99,000	52	5,148,000
ダイドーリミテッド	30,700	748	22,963,600
東京建物不動産販	9,200	218	2,005,600
野村不動産H L D G S	110,800	1,167	129,303,600
常和ホールディングス	4,300	1,216	5,228,800
ヒューリック	74,900	823	61,642,700
帝国繊維	23,000	506	11,638,000
ブックオフコーポレーション	14,100	660	9,306,000
日本コークス工業	197,500	99	19,552,500
ミタチ産業	3,800	367	1,394,600
J F E 商事H L D G S	156,000	310	48,360,000
あさひ	13,400	1,674	22,431,600
サークルKサンクス	50,200	1,272	63,854,400
日本調剤	2,920	2,644	7,720,480
コスモス薬品	11,600	3,735	43,326,000
シップヘルスケアHD	30,000	1,881	56,430,000
ソフトクリエイト	2,200	1,046	2,301,200
セブン&アイ・H L D G S	966,800	2,121	2,050,582,800
ツルハホールディングス	20,700	3,990	82,593,000
サンマルクホールディングス	6,600	2,929	19,331,400
フェリシモ	6,600	1,007	6,646,200
トリドール	20,000	726	14,520,000

クスリのアオキ	3,400	1,253	4,260,200
帝 人	1,003,000	232	232,696,000
東 レ	1,780,000	571	1,016,380,000
ク ラ レ	389,800	1,075	419,035,000
旭 化 成	1,428,000	446	636,888,000
サカイ オーベックス	70,000	107	7,490,000
稲葉製作所	11,900	889	10,579,100
宮地エンジニアリングG	79,000	74	5,846,000
三協・立山H L D G S	331,000	100	33,100,000
トーカロ	13,800	1,575	21,735,000
アルファC O	7,600	793	6,026,800
S U M C O	149,900	683	102,381,700
川田テクノロジーズ	5,700	1,100	6,270,000
住江織物	67,000	132	8,844,000
日本フェルト	14,700	380	5,586,000
イチカワ	14,000	140	1,960,000
日本バイリ - ン	27,000	318	8,586,000
エコナックホールディングス	73,000	30	2,190,000
日東製網	31,000	100	3,100,000
芦森工業	59,000	106	6,254,000
アツギ	192,000	93	17,856,000
ダイニック	47,000	129	6,063,000
共和レザー	13,400	264	3,537,600
セーレン	61,300	491	30,098,300
東海染工	35,000	84	2,940,000
小松精練	37,000	330	12,210,000
ワコールホールディングス	146,000	955	139,430,000
ホギメディカル	15,400	3,205	49,357,000
レナウン	46,900	141	6,612,900
クラウドディア	3,000	971	2,913,000
T S Iホールディングス	108,800	405	44,064,000
デジタルハーツ	16	153,900	2,462,400
I Tホールディングス	70,200	828	58,125,600
グリー	101,000	2,742	276,942,000
コーエーテクモH D	45,900	693	31,808,700
三菱総合研究所	9,000	1,315	11,835,000
ボルテージ	2,100	985	2,068,500
特種東海製紙	154,000	183	28,182,000
ダウンゴ	115	116,800	13,432,000
ベリサーブ	13	136,500	1,774,500
マクロミル	26,800	876	23,476,800
ティーガイア	149	152,000	22,648,000
G M Oペイメントゲートウェイ	50	327,500	16,375,000
ザッパラス	127	75,000	9,525,000
インターネットイニシアティブ	135	305,500	41,242,500
ソネットエンタテインメント	130	308,500	40,105,000
S R Aホールディングス	12,200	747	9,113,400
J B I Sホールディングス	24,500	239	5,855,500
朝日ネット	20,000	347	6,940,000
王子製紙	1,083,000	387	419,121,000
三菱製紙	352,000	71	24,992,000
北越紀州製紙	152,000	506	76,912,000
中越パルプ	95,000	126	11,970,000
巴川製紙	42,000	160	6,720,000
大王製紙	103,000	433	44,599,000
日本製紙G 本社	118,300	1,682	198,980,600
レンゴー	197,000	559	110,123,000
トーモク	77,000	205	15,785,000
ザ・バック	15,900	1,142	18,157,800

コ - プケミカル	38,000	91	3,458,000
昭和電工	1,525,000	147	224,175,000
住友化学	1,685,000	265	446,525,000
日本化成	47,000	133	6,251,000
住友精化	46,000	327	15,042,000
日産化学	186,500	734	136,891,000
ラサ工業	92,000	117	10,764,000
クレハ	159,000	355	56,445,000
テイカ	42,000	287	12,054,000
石原産業	411,000	87	35,757,000
片倉チツカリン	13,000	181	2,353,000
日本曹達	146,000	327	47,742,000
東ソー	656,000	229	150,224,000
トクヤマ	381,000	252	96,012,000
セントラル硝子	234,000	368	86,112,000
東亜合成	307,000	323	99,161,000
ダイソー	98,000	245	24,010,000
関東電化	55,000	369	20,295,000
電気化学	515,000	298	153,470,000
イビデン	153,600	1,739	267,110,400
信越化学	439,900	3,735	1,643,026,500
日本カ - バイド	77,000	100	7,700,000
堺 化 学	77,000	296	22,792,000
エア・ウォーター	200,000	1,039	207,800,000
大陽日酸	323,000	555	179,265,000
日本化学工業	93,000	120	11,160,000
日本パ - カライジング	58,000	1,002	58,116,000
高圧ガス	37,000	442	16,354,000
チタン工業	29,000	379	10,991,000
四国化成	34,000	425	14,450,000
戸田工業	32,000	586	18,752,000
ステラ ケミファ	11,600	2,129	24,696,400
保土谷化学	49,000	206	10,094,000
日本触媒	185,000	784	145,040,000
大日精化	88,000	338	29,744,000
カネカ	306,000	408	124,848,000
協和発酵キリン	336,000	917	308,112,000
三菱瓦斯化学	422,000	457	192,854,000
三井化学	1,040,000	237	246,480,000
J S R	223,300	1,406	313,959,800
東京応化工業	44,100	1,527	67,340,700
三菱ケミカルH L D G S	1,533,500	434	665,539,000
日本合成化学	50,000	399	19,950,000
ダイセル	318,000	407	129,426,000
住友ベ - クライト	210,000	420	88,200,000
積水化学	510,000	604	308,040,000
日本ゼオン	229,000	623	142,667,000
アイカ工業	66,100	1,062	70,198,200
宇部興産	1,027,000	220	225,940,000
積水樹脂	36,000	695	25,020,000
タキロン	58,000	250	14,500,000
旭有機材	88,000	198	17,424,000
日立化成	105,900	1,365	144,553,500
ニチバン	22,000	254	5,588,000
リケンテクノス	44,000	227	9,988,000
大倉工業	59,000	280	16,520,000
積水化成品	63,000	278	17,514,000
群栄化学	68,000	209	14,212,000
タイガース ポリマー	12,300	282	3,468,600

日本カ - リット	19,900	401	7,979,900
日本化薬	173,000	757	130,961,000
イーピーエス	132	170,200	22,466,400
パナソニック電工 I S	4,700	2,138	10,048,600
フェイス	780	8,250	6,435,000
アミューズ	7,200	999	7,192,800
野村総合研究所	130,700	1,773	231,731,100
ドリームインキュベータ	70	55,600	3,892,000
サイバネットシステム	187	19,090	3,569,830
T A C	13,900	177	2,460,300
ケネディクス	2,659	11,020	29,302,180
電通	222,500	2,265	503,962,500
インテージ	6,900	1,495	10,315,500
テイクアンドギヴニーズ	1,235	4,580	5,656,300
ぴあ	7,600	788	5,988,800
シンプレクスホールディング	384	28,320	10,874,880
イオンファンタジー	8,000	1,113	8,904,000
ソースネクスト	43	17,600	756,800
ネクシィーズ	952	1,906	1,814,512
メディカルシステムネットワーク	3,900	795	3,100,500
日本精化	21,000	504	10,584,000
A D E K A	105,500	743	78,386,500
日油	195,000	354	69,030,000
ミヨシ油脂	88,000	105	9,240,000
ハリマ化成	21,100	616	12,997,600
花 王	650,400	2,029	1,319,661,600
第一工業製薬	45,000	207	9,315,000
三洋化成	77,000	504	38,808,000
武田薬品	918,800	3,300	3,032,040,000
アステラス製薬	544,500	2,997	1,631,866,500
大日本住友製薬	174,000	836	145,464,000
塩野義製薬	383,000	968	370,744,000
田辺三菱製薬	245,000	1,307	320,215,000
わかもと製薬	7,000	226	1,582,000
あすか製薬	29,000	504	14,616,000
日本新薬	51,000	912	46,512,000
中外製薬	285,000	1,191	339,435,000
科研製薬	96,000	981	94,176,000
エーザイ	302,000	3,020	912,040,000
ロート製薬	103,000	977	100,631,000
小野薬品	120,000	4,030	483,600,000
久光製薬	76,100	3,110	236,671,000
有機合成薬品	18,000	150	2,700,000
持田製薬	87,000	809	70,383,000
参天製薬	82,400	2,836	233,686,400
扶桑薬品	83,000	196	16,268,000
日本ケミファ	38,000	296	11,248,000
ツムラ	67,000	2,105	141,035,000
日医工	41,500	1,645	68,267,500
テ ル モ	184,100	3,685	678,408,500
みらかホールディングス	63,800	2,912	185,785,600
キッセイ薬品工業	45,500	1,450	65,975,000

[次へ](#)

平成23年11月11日現在

銘 柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
生化学工業	47,100	844	39,752,400	
栄研化学	19,300	996	19,222,800	
日水製薬	10,700	659	7,051,300	
鳥居薬品	16,900	1,384	23,389,600	
東和薬品	12,500	3,325	41,562,500	
沢井製薬	16,100	7,700	123,970,000	
ゼリア新薬工業	35,000	1,215	42,525,000	
第一三共	825,200	1,437	1,185,812,400	
キョーリン製薬H D	60,000	1,375	82,500,000	
大幸薬品	11,300	818	9,243,400	
ダイト	6,800	1,200	8,160,000	
大塚ホールディングス	486,800	2,096	1,020,332,800	
大正製薬H D	59,100	5,090	300,819,000	
大日本塗料	143,000	80	11,440,000	
日本ペイント	232,000	555	128,760,000	
関西ペイント	278,000	721	200,438,000	
トウペ	22,000	60	1,320,000	
中国塗料	75,000	508	38,100,000	
日本特殊塗料	18,800	308	5,790,400	
藤倉化成	31,100	349	10,853,900	
太陽ホールディングス	20,000	1,928	38,560,000	
D I C	936,000	125	117,000,000	
サカタインクス	46,000	334	15,364,000	
東洋インキS Cホールディン	221,000	276	60,996,000	
アルプス技研	11,200	668	7,481,600	
サニックス	35,500	227	8,058,500	
ダイオーズ	4,700	480	2,256,000	
日本空調サービス	6,700	696	4,663,200	
オリエンタルランド	66,100	8,290	547,969,000	
ダスキン	73,500	1,531	112,528,500	
パーク2 4	119,300	892	106,415,600	
明光ネットワークジャパン	22,600	688	15,548,800	
ファルコS Dホールディングス	12,400	889	11,023,600	
クレスコ	6,000	550	3,300,000	
フジ・メディア・H D	2,407	111,600	268,621,200	
秀英予備校	4,100	306	1,254,600	
田谷	900	653	587,700	
ラウンドワン	76,400	534	40,797,600	
リゾートトラスト	37,600	1,100	41,360,000	
オービック	7,240	14,540	105,269,600	
ティーディーシーソフトウェア	4,800	714	3,427,200	
ヤフー	16,922	23,920	404,774,240	
ビー・エム・エル	16,000	1,889	30,224,000	
ワタベウェディング	7,500	612	4,590,000	
トレンドマイクロ	102,000	2,505	255,510,000	
もしもしホットライン	40,400	689	27,835,600	
東急コミュニティー	6,400	2,430	15,552,000	
リソー教育	2,533	4,095	10,372,635	
日本オラクル	36,900	2,664	98,301,600	
アルファシステムズ	6,400	1,110	7,104,000	
フューチャーアーキテクト	281	30,700	8,626,700	
ウェアハウス	5,500	242	1,331,000	
シーエーシー	16,100	583	9,386,300	
ソフトバンク・テクノ	5,700	630	3,591,000	
トーセ	6,000	489	2,934,000	

ユー・エス・エス	31,890	6,650	212,068,500
オービックビジネスC	5,900	3,735	22,036,500
日立ビジネスソリュー	7,700	996	7,669,200
伊藤忠テクノソリュー	27,300	3,540	96,642,000
アイティフォー	25,800	274	7,069,200
東京個別指導学院	17,000	147	2,499,000
東計電算	4,500	1,101	4,954,500
エクスネット	18	115,200	2,073,600
テー・オー・ダブリュー	8,100	449	3,636,900
大塚商会	18,400	5,330	98,072,000
総合メディカル	5,600	2,602	14,571,200
サイボウズ	422	19,000	8,018,000
ソフトブレーン	333	7,050	2,347,650
アグレックス	6,100	740	4,514,000
セントラルスポーツ	8,000	938	7,504,000
電通国際情報S	14,600	699	10,205,400
ウェザーニューズ	6,900	2,537	17,505,300
C I J	24,200	268	6,485,600
WOWOW	71	171,900	12,204,900
フルキャストホールディングス	198	17,350	3,435,300
富士フイルムH L D G S	523,900	1,762	923,111,800
コニカミノルタH L D G S	618,500	569	351,926,500
資 生 堂	407,000	1,384	563,288,000
ライオン	283,000	437	123,671,000
高砂香料	81,000	384	31,104,000
マンダム	24,500	1,980	48,510,000
ミルボン	13,100	2,480	32,488,000
ファンケル	61,600	1,068	65,788,800
コーセー	39,700	1,791	71,102,700
ドクターシーラボ	148	422,500	62,530,000
ポーラ・オルビスHD	25,000	2,042	51,050,000
エステー	15,100	957	14,450,700
コ ニ シ	17,800	993	17,675,400
長谷川香料	31,300	1,249	39,093,700
小林製薬	34,000	3,920	133,280,000
荒川化学工業	19,400	627	12,163,800
メック	16,400	258	4,231,200
日本高純度化学	70	199,800	13,986,000
荏原ユージライト	3,400	1,875	6,375,000
アース製薬	17,600	2,846	50,089,600
イハラケミカル	44,000	277	12,188,000
北興化学	11,000	218	2,398,000
大成ラミック	7,000	2,357	16,499,000
クミアイ化学	57,000	263	14,991,000
日本農薬	56,000	347	19,432,000
昭和シェル石油	219,400	507	111,235,800
コスモ石油	678,000	194	131,532,000
富士興産	89,000	65	5,785,000
ニチレキ	32,000	383	12,256,000
東燃ゼネラル石油	370,000	904	334,480,000
ユシロ化学	12,300	885	10,885,500
ビーピー・カストロール	9,800	338	3,312,400
A O Cホールディングス	56,900	428	24,353,200
M O R E S C O	4,400	698	3,071,200
出光興産	29,100	7,770	226,107,000
J Xホールディングス	2,721,500	486	1,322,649,000
横浜ゴム	299,000	420	125,580,000
東洋ゴム	185,000	185	34,225,000
ブリヂストン	768,600	1,771	1,361,190,600

住友ゴム	191,200	927	177,242,400
藤倉ゴム	15,500	287	4,448,500
オカモト	90,000	330	29,700,000
アキレス	201,000	107	21,507,000
フ コ ク	10,400	664	6,905,600
ニッタ	24,200	1,330	32,186,000
クリエートメディック	7,000	802	5,614,000
東海ゴム工業	45,400	902	40,950,800
三ツ星ベルト	65,000	391	25,415,000
バンドー化学	87,000	314	27,318,000
鬼怒川ゴム	54,000	602	32,508,000
旭 硝 子	1,208,000	619	747,752,000
日本板硝子	1,050,000	140	147,000,000
石塚硝子	31,000	141	4,371,000
有沢製作所	38,300	308	11,796,400
日本山村硝子	97,000	167	16,199,000
日本電気硝子	470,000	701	329,470,000
オハラ	9,200	702	6,458,400
住友大阪セメント	497,000	230	114,310,000
太平洋セメント	1,440,000	150	216,000,000
デイ・シイ	25,500	230	5,865,000
リゾートソリューション	23,000	139	3,197,000
日本ヒュ - ム	21,000	280	5,880,000
日本コンクリ - ト	40,000	184	7,360,000
東海カーボン	213,000	371	79,023,000
日本カーボン	115,000	219	25,185,000
東洋炭素	13,600	3,650	49,640,000
ノリタケ	127,000	233	29,591,000
T O T O	378,000	640	241,920,000
日本碍子	319,000	836	266,684,000
日本特殊陶業	211,000	975	205,725,000
ダントーホールディングス	37,000	72	2,664,000
M A R U W A	7,200	3,125	22,500,000
品川リフラクトリーズ	61,000	205	12,505,000
黒崎播磨	52,000	227	11,804,000
東京窯業	30,000	155	4,650,000
ニッカトー	8,800	428	3,766,400
フジミインコーポレーテッド	22,300	871	19,423,300
エーアンドエーマテリアル	51,000	70	3,570,000
ニチアス	109,000	427	46,543,000
新日本製鐵	6,434,000	182	1,170,988,000
住友金属工業	4,543,000	131	595,133,000
神戸製鋼所	3,397,000	120	407,640,000
日新製鋼	868,000	110	95,480,000
中山製鋼所	125,000	70	8,750,000
合同製鐵	137,000	186	25,482,000
J F E ホールディングス	580,700	1,319	765,943,300
東京製鐵	124,000	590	73,160,000
共英製鋼	26,100	1,386	36,174,600
大和工業	55,900	1,976	110,458,400
東京鐵鋼	51,000	211	10,761,000
大阪製鐵	15,400	1,349	20,774,600
淀川製鋼所	174,000	330	57,420,000
東洋鋼鈑	59,000	275	16,225,000
住友鋼管	16,700	518	8,650,600
丸一鋼管	75,200	1,640	123,328,000
モリ工業	40,000	273	10,920,000
大同特殊鋼	410,000	478	195,980,000
日本高周波	97,000	81	7,857,000

日本金属工業	189,000	69	13,041,000
日本冶金工	180,500	116	20,938,000
山陽特殊製鋼	121,000	399	48,279,000
愛知製鋼	130,000	387	50,310,000
日立金属	160,000	858	137,280,000
日本金属	63,000	166	10,458,000
大太平洋金属	171,000	425	72,675,000
日本電工	88,000	369	32,472,000
栗本鉄工所	127,000	127	16,129,000
旭テック	225,000	22	4,950,000
日本鑄鉄管	26,000	154	4,004,000
日本製鋼所	378,000	474	179,172,000
三菱製鋼	148,000	194	28,712,000
日亜鋼業	34,000	187	6,358,000
日本精線	19,000	395	7,505,000
日本軽金属	556,000	98	54,488,000
大紀アルミニウム	39,000	264	10,296,000
三井金属	667,000	189	126,063,000
東邦亜鉛	138,000	291	40,158,000
三菱マテリアル	1,529,000	204	311,916,000
住友鉱山	634,000	998	632,732,000
DOWAホールディングス	293,000	511	149,723,000
古河機金	415,000	67	27,805,000
大阪チタニウム	24,100	4,160	100,256,000
東邦チタニウム	39,700	1,604	63,678,800
住友軽金属	592,000	66	39,072,000
古河スカイ	99,000	162	16,038,000
古河電工	771,000	176	135,696,000
住友電工	866,100	820	710,202,000
フジクラ	368,000	215	79,120,000
昭和電線HLDGS	297,000	71	21,087,000
東京特殊電線	35,000	65	2,275,000
タツタ電線	46,000	346	15,916,000
日立電線	192,000	165	31,680,000
沖 電 線	26,000	140	3,640,000
カナレ電気	3,500	1,229	4,301,500
平河ヒューテック	4,400	745	3,278,000
リョービ	137,000	301	41,237,000
アサヒHD	34,200	1,513	51,744,600
東洋製罐	173,300	1,065	184,564,500
ホッカンホールディングス	59,000	230	13,570,000
コロナ	11,300	1,321	14,927,300
横河ブリッジHLDGS	50,000	471	23,550,000
日本橋梁	10,350	200	2,070,000
駒井ハルテック	48,000	182	8,736,000
サクラダ	222,000	19	4,218,000
高田機工	23,000	155	3,565,000
三和ホールディングス	245,000	229	56,105,000
文化シャッター -	64,000	241	15,424,000
東洋シャッター -	4,800	334	1,603,200
住生活グループ	318,700	1,534	488,885,800
日本ファイルコン	18,100	414	7,493,400
ノーリツ	48,100	1,399	67,291,900
長府製作所	23,700	1,904	45,124,800
リンナイ	39,500	5,930	234,235,000
ユニプレス	37,300	2,147	80,083,100
ダイニチ工業	12,600	772	9,727,200
日東精工	34,000	192	6,528,000
三洋工業	32,000	149	4,768,000

岡 部	50,800	386	19,608,800
日立ツール	14,300	800	11,440,000
中国工業	38,000	81	3,078,000
東 プ レ	47,200	784	37,004,800
高周波熱錬	32,800	596	19,548,800
東京製綱	154,000	162	24,948,000
バイオラックス	10,500	1,576	16,548,000
日本発条	177,000	672	118,944,000
中央発條	28,000	243	6,804,000
アドバネクス	48,000	58	2,784,000
三浦工業	36,400	2,115	76,986,000
タ ク マ	83,000	355	29,465,000
ツ ガ ミ	59,000	445	26,255,000
オークマ	147,000	545	80,115,000
東芝機械	133,000	385	51,205,000
ア マ ダ	346,000	470	162,620,000
アイダエンジニア	63,400	351	22,253,400
牧野フライス	122,000	513	62,586,000
オーエスジー	108,000	968	104,544,000
ダイジェット	29,000	138	4,002,000
旭ダイヤモンド	60,300	1,051	63,375,300
森精機製作所	129,100	686	88,562,600
ディスコ	24,700	3,845	94,971,500
日東工器	14,400	1,821	26,222,400
豊田自動織機	213,200	2,091	445,801,200
豊和工業	128,000	57	7,296,000
大阪機工	83,000	79	6,557,000
石川製作所	55,000	51	2,805,000
東洋機械金属	20,400	192	3,916,800
津田駒工業	59,000	135	7,965,000
エンシュウ	56,000	80	4,480,000
島精機製作所	31,900	1,292	41,214,800
日阪製作所	31,000	884	27,404,000
やまびこ	9,700	910	8,827,000
ペガサスミシン製造	24,700	193	4,767,100
ナブテスコ	101,800	1,620	164,916,000
三井海洋開発	20,300	1,311	26,613,300
レオン自動機	21,000	171	3,591,000
S M C	73,100	12,070	882,317,000
新川	17,500	378	6,615,000
ホソカワミクロン	38,000	352	13,376,000
ユニオンツール	13,400	1,390	18,626,000
オイレス工業	27,100	1,401	37,967,100
サト - ホールディングス	25,600	890	22,784,000
日本エアーテック	6,800	331	2,250,800
日精樹脂工業	20,000	252	5,040,000
ワイエイシイ	10,500	649	6,814,500
小松製作所	1,161,900	1,906	2,214,581,400
住友重機械	625,000	431	269,375,000
日立建機	125,100	1,448	181,144,800
日 工	33,000	266	8,778,000
巴工業	9,200	1,256	11,555,200
井関農機	251,000	170	42,670,000
T O W A	23,600	323	7,622,800
丸山製作所	56,000	160	8,960,000
北川鉄工所	113,000	108	12,204,000
シンニッタン	23,200	281	6,519,200
クボタ	1,122,000	646	724,812,000
荏原実業	6,400	1,201	7,686,400

東洋エンジニア	140,000	262	36,680,000
三菱化工機	76,000	128	9,728,000
月島機械	36,000	567	20,412,000
帝国電機製作所	8,300	1,410	11,703,000
東京機械	74,000	47	3,478,000
新東工業	49,400	673	33,246,200
渋谷工業	14,200	787	11,175,400
アイチ コーポレーション	40,600	292	11,855,200
小森コーポレーション	69,500	422	29,329,000
鶴見製作所	14,000	590	8,260,000
住友精密	35,000	522	18,270,000
酒井重工業	48,000	128	6,144,000
荏原製作所	396,000	264	104,544,000
石井鉄工所	36,000	136	4,896,000
西島製作所	28,300	982	27,790,600
千代田化工建	208,000	854	177,632,000
ダイキン工業	298,400	2,221	662,746,400
オルガノ	46,000	620	28,520,000
ト - ヨ - カネツ	131,000	137	17,947,000
栗田工業	135,200	2,052	277,430,400
椿本チエイン	125,000	372	46,500,000
大同工業	49,000	131	6,419,000
日本コンベヤ	78,000	70	5,460,000
日 機 装	76,000	616	46,816,000
木村化工機	22,300	292	6,511,600
新興プランテック	53,900	678	36,544,200
アネスト岩田	42,000	315	13,230,000
ダイフク	107,500	381	40,957,500
加藤製作所	56,000	207	11,592,000
油研工業	43,000	155	6,665,000
タダノ	113,000	510	57,630,000
フジテック	69,000	395	27,255,000
シーケーディ	65,500	485	31,767,500
キトー	98	52,700	5,164,600
平和	50,800	1,352	68,681,600
理想科学工業	16,800	1,236	20,764,800
SANKYO	70,900	3,895	276,155,500
日本金銭機械	21,800	617	13,450,600
マースエンジニアリング	13,200	1,257	16,592,400
福島工業	7,500	906	6,795,000
オーイズミ	8,500	259	2,201,500
ダイコク電機	9,900	670	6,633,000
ア マ ノ	70,900	680	48,212,000
JUKI	141,000	170	23,970,000
サンデン	122,000	208	25,376,000
蛇の目ミシン	226,000	50	11,300,000
ブラザー工業	302,500	1,022	309,155,000
マックス	37,000	899	33,263,000
モリタホールディングス	40,000	411	16,440,000
グローリー	69,900	1,632	114,076,800
大和冷機工業	34,000	395	13,430,000
セガサミーホールディングス	251,700	1,649	415,053,300
日本ピストンリング	91,000	149	13,559,000
リ ケ ン	85,000	286	24,310,000
T P R	25,900	782	20,253,800
ホシザキ電機	47,200	1,857	87,650,400
大豊工業	16,600	614	10,192,400
日本精工	521,000	503	262,063,000
N T N	542,000	302	163,684,000

ジェイテクト	224,000	735	164,640,000
不二越	235,000	375	88,125,000
ミネベア	348,000	316	109,968,000
日本トムソン	75,000	437	32,775,000
T H K	155,500	1,431	222,520,500
ユーシン精機	11,800	1,353	15,965,400
前澤給装工業	9,100	1,061	9,655,100
イーグル工業	29,000	650	18,850,000
前澤工業	17,400	174	3,027,600
日本ピラ - 工業	25,000	449	11,225,000
キッツ	96,300	305	29,371,500
日立	5,258,000	415	2,182,070,000
東芝	4,930,000	319	1,572,670,000
三菱電機	2,342,000	679	1,590,218,000
富士電機	705,000	226	159,330,000
東洋電機製造	41,000	314	12,874,000
安川電機	275,000	633	174,075,000
シンフォニアテクノロジー	141,000	168	23,688,000
明電舎	232,000	272	63,104,000
オリジン電気	32,000	252	8,064,000
デンヨー	22,200	993	22,044,600
日立工機	62,900	555	34,909,500
三桜工業	29,700	553	16,424,100
マキタ	152,700	2,732	417,176,400
東芝テック	147,000	278	40,866,000
芝浦メカトロニクス	41,000	217	8,897,000
マブチモーター	31,900	3,435	109,576,500
日本電産	126,600	6,430	814,038,000
宮越ホールディングス	6,400	231	1,478,400
高岳製作所	92,000	167	15,364,000
ダイヘン	138,000	260	35,880,000
J V C ケンウッド	141,500	319	45,138,500
第一精工	5,500	2,070	11,385,000
日新電機	47,000	434	20,398,000
大崎電気	34,000	724	24,616,000
オムロン	260,700	1,616	421,291,200
日東工業	35,400	920	32,568,000
I D E C	30,600	733	22,429,800
エルピーダメモリ	316,200	369	116,677,800
ジーエス・ユアサコーポ	451,000	400	180,400,000
サクサホールディングス	61,000	109	6,649,000
メルコホールディングス	12,900	2,035	26,251,500
テクノメディカ	13	284,000	3,692,000
日本電気	3,220,000	157	505,540,000
富士通	2,257,000	398	898,286,000
沖電気	904,000	66	59,664,000
岩崎通信機	104,000	65	6,760,000
電気興業	72,000	267	19,224,000
サンケン電気	119,000	291	34,629,000
ナカヨ通信機	18,000	185	3,330,000
アイホン	13,500	1,430	19,305,000
ルネサスエレクトロニクス	60,600	531	32,178,600
セイコーエプソン	159,800	959	153,248,200
ワコム	460	114,200	52,532,000
アルバック	43,000	912	39,216,000
アクセル	10,900	1,697	18,497,300
ピクセラ	9,900	194	1,920,600
ナナオ	19,900	1,515	30,148,500
日本信号	54,600	410	22,386,000

京三製作所	51,000	303	15,453,000
能美防災	31,000	471	14,601,000
ホーチキ	19,000	343	6,517,000
日本無線	62,000	177	10,974,000
パナソニック	2,675,800	689	1,843,626,200
シャープ	1,131,000	712	805,272,000
アンリツ	112,000	911	102,032,000
富士通ゼネラル	55,000	453	24,915,000
日立国際電気	54,000	553	29,862,000
ソ ニ ー	1,461,100	1,354	1,978,329,400
T D K	122,500	3,300	404,250,000
帝国通信工業	59,000	126	7,434,000
ミツミ電機	82,600	471	38,904,600
タムラ製作所	78,000	183	14,274,000
アルプス電気	184,700	523	96,598,100
池上通信機	76,000	46	3,496,000
パイオニア	331,800	326	108,166,800
日本電波工業	18,100	963	17,430,300
日本トリム	2,750	1,717	4,721,750
ローランド ディー . ジー .	10,500	825	8,662,500
日本コロムビア	189,000	27	5,103,000
山水電気	1,498,000	2	2,996,000
フオスタ - 電機	22,100	1,145	25,304,500
クラリオン	144,000	129	18,576,000
S M K	75,000	258	19,350,000
ヨコオ	20,000	403	8,060,000
東 光	106,000	151	16,006,000
ティアック	131,000	27	3,537,000
ホシデン	63,400	496	31,446,400
ヒロセ電機	40,700	6,960	283,272,000
日本航空電子	54,000	524	28,296,000
T O A	26,000	427	11,102,000
ユニデン	69,000	269	18,561,000
アルパイン	45,700	907	41,449,900
スミダコーポレーション	14,700	566	8,320,200
アイコム	13,100	1,831	23,986,100
船井電機	21,000	1,669	35,049,000
横河電機	253,900	754	191,440,600
新電元工業	83,000	289	23,987,000
山武	60,100	1,625	97,662,500
日本光電工業	46,600	1,885	87,841,000
チ ノ ー	47,000	190	8,930,000
共和電業	3,000	244	732,000
日本電子材料	10,400	390	4,056,000
堀場製作所	43,300	2,383	103,183,900
アドバンテスト	174,100	816	142,065,600
小野測器	23,000	210	4,830,000
エスベック	24,500	471	11,539,500
パナソニック電工 S U N X	20,800	400	8,320,000
キーエンス	52,300	20,250	1,059,075,000
日置電機	11,500	1,413	16,249,500
シスメックス	82,400	2,656	218,854,400
メガチップス	19,200	1,194	22,924,800
O B A R A G R O U P	16,700	916	15,297,200
日本電産コパル電子	24,400	477	11,638,800
ミヤチテクノス	11,500	559	6,428,500
東京電波	7,000	369	2,583,000
澤藤電機	14,000	228	3,192,000
デンソー	578,600	2,234	1,292,592,400

コーセル	34,200	1,047	35,807,400	
日立メディコ	17,000	839	14,263,000	
新日本無線	18,000	113	2,034,000	
オプテックス	16,300	931	15,175,300	
千代田インテグレ	11,500	1,003	11,534,500	
東光電気	15,000	346	5,190,000	
スタンレー電気	158,100	1,046	165,372,600	
岩崎電気	85,000	159	13,515,000	
ウシオ電機	142,100	1,093	155,315,300	
岡谷電機	12,900	344	4,437,600	
ヘリオステクノH	21,900	147	3,219,300	
日本セラミック	15,400	1,362	20,974,800	
新神戸電機	18,000	1,270	22,860,000	
日本デジタル研究所	19,900	729	14,507,100	
古河電池	17,000	331	5,627,000	
双信電機	11,400	329	3,750,600	
山一電機	23,600	165	3,894,000	
図 研	13,900	519	7,214,100	
日本電子	87,000	203	17,661,000	
カ シ オ	223,300	437	97,582,100	
ファナック	243,800	12,360	3,013,368,000	
日本シイエムケイ	50,400	285	14,364,000	
エンプラス	11,800	1,454	17,157,200	
ロ ー ム	115,400	3,755	433,327,000	
浜松ホトニクス	91,400	2,821	257,839,400	
三井ハイテック	28,000	361	10,108,000	
新光電気工業	78,600	516	40,557,600	
京 セ ラ	194,700	6,700	1,304,490,000	
協栄産業	25,000	136	3,400,000	
太陽誘電	104,900	599	62,835,100	
村田製作所	245,600	4,190	1,029,064,000	
ユーシン	32,600	600	19,560,000	
双葉電子工業	40,200	1,400	56,280,000	
日東電工	202,100	2,965	599,226,500	
北陸電気工業	95,000	113	10,735,000	
東海理化電機	54,800	1,163	63,732,400	
ニチコン	73,700	806	59,402,200	
日本ケミコン	135,000	276	37,260,000	
K O A	29,500	715	21,092,500	
三井造船	906,000	115	104,190,000	
日立造船	926,000	102	94,452,000	
佐世保重工業	153,000	114	17,442,000	
三菱重工業	3,925,000	316	1,240,300,000	
川崎重工業	1,702,000	213	362,526,000	
I H I	1,600,000	173	276,800,000	
日本車輛	86,000	295	25,370,000	
日本輸送機	28,000	215	6,020,000	
近畿車輛	35,000	242	8,470,000	
日産自動車	2,958,400	705	2,085,672,000	
いすゞ自動車	1,481,000	355	525,755,000	
トヨタ自動車	3,008,800	2,454	7,383,595,200	*
日野自動車	334,000	468	156,312,000	
三菱自動車工業	5,235,000	97	507,795,000	
エフテック	8,100	864	6,998,400	
武蔵精密工業	22,700	1,700	38,590,000	
トヨタ車体	42,600	1,105	47,073,000	
日産車体	69,000	712	49,128,000	
関東自動車	35,600	610	21,716,000	
新明和工業	105,000	255	26,775,000	

極東開発工業	40,400	421	17,008,400	
日信工業	42,800	1,020	43,656,000	
トピー工業	175,000	183	32,025,000	
ティラド	85,000	255	21,675,000	
曙ブレーキ	118,700	322	38,221,400	
タチエス	30,600	1,294	39,596,400	
N O K	113,200	1,282	145,122,400	
フタバ産業	66,200	457	30,253,400	
カヤバ工業	162,000	391	63,342,000	
シロキ工業	52,000	210	10,920,000	
市光工業	57,000	122	6,954,000	
大同メタル工業	36,000	697	25,092,000	
プレス工業	108,000	340	36,720,000	
カルソニックカンセイ	139,000	428	59,492,000	
太平洋工業	48,000	333	15,984,000	
ケーヒン	48,400	1,164	56,337,600	
河西工業	29,000	388	11,252,000	
アイシン精機	192,800	2,344	451,923,200	
富士機工	27,000	216	5,832,000	
マ ッ ダ	1,942,000	141	273,822,000	
ダイハツ	217,000	1,376	298,592,000	
愛知機械	53,000	226	11,978,000	
今仙電機製作所	15,800	895	14,141,000	
本田技研	1,975,800	2,272	4,489,017,600	
スズキ	489,500	1,621	793,479,500	
富士重工業	740,000	443	327,820,000	
ヤマハ発動機	381,400	1,098	418,777,200	
ショーワ	49,800	415	20,667,000	
小糸製作所	117,000	1,049	122,733,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

銘 柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
T B K	24,000	322	7,728,000	
エクセディ	31,800	2,300	73,140,000	
ミツバ	43,000	559	24,037,000	
豊田合成	66,100	1,270	83,947,000	
愛三工業	24,200	641	15,512,200	
ヨ ロ ズ	14,000	1,699	23,786,000	
エフ・シー・シー	38,300	1,594	61,050,200	
新家工業	56,000	112	6,272,000	
シマノ	88,600	3,880	343,768,000	
タカタ	42,300	1,691	71,529,300	
テイ・エス テック	49,400	996	49,202,400	
小 野 建	20,300	610	12,383,000	
はるやま商事	11,100	361	4,007,100	
佐島電機	17,200	467	8,032,400	
カップクリエイト	17,000	1,694	28,798,000	
エコートレーディング	5,900	697	4,112,300	
伯東	14,300	690	9,867,000	
コンドーテック	8,400	882	7,408,800	
中山福	14,400	581	8,366,400	
ライトオン	17,400	495	8,613,000	
ナガイレーベン	30,800	1,068	32,894,400	
ジーンズメイト	7,800	183	1,427,400	
三菱食品	21,100	1,815	38,296,500	
良品計画	24,500	3,660	89,670,000	
三城ホールディングス	28,700	610	17,507,000	
松田産業	17,000	1,088	18,496,000	
メディバルHD	248,900	747	185,928,300	
アドヴァン	14,100	689	9,714,900	
S P K	5,300	1,283	6,799,900	
アズワン	15,200	1,542	23,438,400	
スズデン	8,000	493	3,944,000	
尾家産業	6,800	808	5,494,400	
シモジマ	14,100	949	13,380,900	
ドウシシャ	11,000	1,961	21,571,000	
コナカ	27,000	333	8,991,000	
高速	13,800	600	8,280,000	
ハウス ローゼ	2,700	1,218	3,288,600	
G - 7ホールディングス	6,000	376	2,256,000	
イオン北海道	17,400	327	5,689,800	
コ ジ マ	31,100	506	15,736,600	
コーナン商事	23,400	1,317	30,817,800	
黒田電気	28,500	778	22,173,000	
ネットワンシステムズ	522	211,900	110,611,800	
エコス	8,400	456	3,830,400	
ワタミ	27,300	1,884	51,433,200	
マルシェ	6,800	690	4,692,000	
ドン・キホーテ	44,700	2,829	126,456,300	
丸文	18,700	295	5,516,500	
メガネトップ	33,100	909	30,087,900	
西松屋チェーン	50,500	575	29,037,500	
ゼンショーホールディングス	87,900	1,027	90,273,300	
ハピネット	6,300	1,310	8,253,000	
幸楽苑	14,600	1,131	16,512,600	
トーメンエレクトロニクス	9,500	890	8,455,000	
ハークスレイ	6,600	498	3,286,800	

サイゼリヤ	34,100	1,291	44,023,100
エクセル	11,400	737	8,401,800
マルカキカイ	7,900	669	5,285,100
アルゴグラフィックス	8,800	980	8,624,000
ガリバーインターナショナル	7,000	3,285	22,995,000
日本エム・ディ・エム	20,400	169	3,447,600
ポプラ	7,600	417	3,169,200
ユナイテッドアローズ	24,900	1,458	36,304,200
進和	14,100	887	12,506,700
エスケイジャパン	5,500	230	1,265,000
ダイトエレクトロン	10,600	462	4,897,200
ハイデイ日高	10,300	1,165	11,999,500
シークス	14,600	908	13,256,800
京都きもの友禅	15,100	906	13,680,600
コロワイド	77,000	505	38,885,000
田中商事	7,400	391	2,893,400
オーハシテクニカ	13,100	563	7,375,300
壱番屋	9,400	2,358	22,165,200
マクニカ	11,900	1,629	19,385,100
白銅	7,900	747	5,901,300
トップカルチャー	9,200	354	3,256,800
スギホールディングス	41,400	2,084	86,277,600
島津製作所	280,000	638	178,640,000
J M S	32,000	224	7,168,000
クボテック	52	22,600	1,175,200
モリテックス	4,800	320	1,536,000
長野計器	15,600	729	11,372,400
ブイ・テクノロジー	34	316,500	10,761,000
スター精密	38,400	721	27,686,400
東京計器	82,000	129	10,578,000
愛知時計	26,000	243	6,318,000
日本電産トーソク	11,200	895	10,024,000
東京精密	42,000	1,490	62,580,000
ニコン	408,000	1,727	704,616,000
トプコン	54,100	391	21,153,100
オリンパス	276,200	460	127,052,000
理研計器	19,300	553	10,672,900
大日本スクリーン	222,000	539	119,658,000
キヤノン電子	21,500	1,931	41,516,500
タムロン	20,500	2,085	42,742,500
H O Y A	569,400	1,620	922,428,000
ノーリツ鋼機	21,500	357	7,675,500
エー・アンド・デイ	22,900	290	6,641,000
キヤノン	1,454,800	3,435	4,997,238,000
リコー	704,000	620	436,480,000
日本電産コパル	18,400	816	15,014,400
日本電産サンヨー	56,000	497	27,832,000
シチズンホールディングス	280,300	430	120,529,000
リズム時計	117,000	103	12,051,000
大研医器	3,800	762	2,895,600
パラマウントベッドHD	20,000	1,853	37,060,000
S H O - B I	3,700	421	1,557,700
S R Iスポーツ	15,300	826	12,637,800
バンダイナムコHLDGS	250,900	1,142	286,527,800
共立印刷	28,000	157	4,396,000
フランスベッドHLDGS	159,000	117	18,603,000
パイロットコーポレーション	212	153,400	32,520,800
エイベックス・グループHD	43,800	841	36,835,800
トッパン・フォームズ	50,200	569	28,563,800

フジシールインターナショナル	26,200	1,391	36,444,200
タカラトミー	77,000	564	43,428,000
廣済堂	18,000	191	3,438,000
アーク	79,300	73	5,788,900
レック	6,500	1,163	7,559,500
タカノ	9,500	441	4,189,500
プロネクス	26,800	388	10,398,400
ホクシン	17,700	138	2,442,600
ウッドワン	40,000	280	11,200,000
大建工業	96,000	224	21,504,000
き も と	19,900	573	11,402,700
凸版印刷	712,000	562	400,144,000
大日本印刷	713,000	769	548,297,000
図書印刷	38,000	145	5,510,000
共同印刷	73,000	174	12,702,000
日本写真印刷	39,300	856	33,640,800
光村印刷	3,000	246	738,000
藤森工業	17,700	1,171	20,726,700
宝印刷	13,800	599	8,266,200
前澤化成工業	17,800	812	14,453,600
アシックス	218,000	897	195,546,000
ツ ツ ミ	11,700	1,695	19,831,500
ジェイ エス ピー	16,000	1,069	17,104,000
ニ チ ハ	27,100	917	24,850,700
ローランド	22,400	665	14,896,000
エフピコ	10,900	5,150	56,135,000
小松ウオール工業	9,100	783	7,125,300
ヤマハ	172,100	728	125,288,800
河合楽器	87,000	145	12,615,000
クリナップ	25,300	462	11,688,600
ビジョン	20,600	2,858	58,874,800
天馬	19,500	631	12,304,500
兼松日産農林	36,000	142	5,112,000
キングジム	20,000	576	11,520,000
リンテック	44,500	1,380	61,410,000
田崎真珠	50,000	48	2,400,000
信越ポリマー	48,400	350	16,940,000
東 リ	65,000	139	9,035,000
イトーキ	49,900	168	8,383,200
任 天 堂	133,900	12,370	1,656,343,000
三菱鉛筆	19,800	1,341	26,551,800
タカラスタンダ - ド	108,000	580	62,640,000
コ ク ヨ	121,800	566	68,938,800
ナカバヤシ	49,000	178	8,722,000
ニ フ コ	54,700	1,968	107,649,600
グローブライド	107,000	86	9,202,000
岡村製作所	82,000	471	38,622,000
日本バルカー	95,000	194	18,430,000
M U T O Hホールディングス	29,000	119	3,451,000
伊 藤 忠	1,844,000	755	1,392,220,000
丸 紅	2,022,000	442	893,724,000
スクロール	32,800	257	8,429,600
高 島	40,000	163	6,520,000
F & A アクアホールディングス	17,800	769	13,688,200
三陽商会	120,000	175	21,000,000
長瀬産業	131,000	810	106,110,000
ナイガイ	71,000	35	2,485,000
蝶 理	139,000	86	11,954,000
豊田通商	257,900	1,237	319,022,300

オンワ - ドホールディングス	151,000	550	83,050,000
三共生興	40,100	255	10,225,500
兼 松	492,000	68	33,456,000
美 津 濃	116,000	374	43,384,000
ツカモトコーポレーション	41,000	82	3,362,000
ファミリーマート	71,000	3,090	219,390,000
ルック	40,000	192	7,680,000
三井物産	1,995,300	1,140	2,274,642,000
日本紙パルプ	120,000	263	31,560,000
東京エレクトロン	197,000	3,935	775,195,000
日立ハイテクノロジーズ	70,000	1,611	112,770,000
カメイ	30,000	549	16,470,000
東都水産	38,000	129	4,902,000
スターゼン	79,000	225	17,775,000
セイコーHD	136,000	151	20,536,000
山 善	89,300	518	46,257,400
椿本興業	25,000	202	5,050,000
住友商事	1,364,100	1,014	1,383,197,400
日本ユニシス	55,800	455	25,389,000
内田洋行	54,000	212	11,448,000
三菱商事	1,683,400	1,547	2,604,219,800
第一実業	50,000	303	15,150,000
キヤノンマーケティングJPN	76,800	865	66,432,000
西華産業	88,000	206	18,128,000
佐藤商事	20,900	432	9,028,800
菱洋エレクトロ	26,000	705	18,330,000
東京産業	25,000	236	5,900,000
ユアサ商事	237,000	107	25,359,000
神鋼商事	60,000	174	10,440,000
阪和興業	231,000	322	74,382,000
カナデン	2,000	493	986,000
菱電商事	33,000	430	14,190,000
ニプロ	93,200	623	58,063,600
フルサト工業	13,900	600	8,340,000
岩谷産業	258,000	260	67,080,000
すてきナイスグループ	101,000	160	16,160,000
昭光通商	86,000	113	9,718,000
ニチモウ	35,000	137	4,795,000
極東貿易	29,000	174	5,046,000
イ ワ キ	35,000	184	6,440,000
兼松エレクトロニクス	15,200	757	11,506,400
三愛石油	56,000	319	17,864,000
稲畑産業	62,700	427	26,772,900
G S Iクレオス	61,000	96	5,856,000
明和産業	19,200	207	3,974,400
ゴ - ルドウイン	55,000	264	14,520,000
ユニ・チャ - ム	135,200	3,685	498,212,000
デサント	61,000	428	26,108,000
ヤマトインタ - ナショナル	15,500	351	5,440,500
東邦ホールディングス	74,000	1,059	78,366,000
サンゲツ	41,000	1,999	81,959,000
ミツウロコグループ	37,600	465	17,484,000
シナネン	51,000	349	17,799,000
伊藤忠エネクス	51,500	428	22,042,000
サンリオ	58,300	4,090	238,447,000
サンワ テクノス	11,300	621	7,017,300
リョーサン	37,800	1,700	64,260,000
新光商事	25,300	610	15,433,000
トーホー	51,000	305	15,555,000

三信電気	33,000	618	20,394,000
東陽テクニカ	34,000	806	27,404,000
モスフード サービス	30,400	1,479	44,961,600
加賀電子	25,000	752	18,800,000
三益半導体	20,700	622	12,875,400
ソーダニツカ	2,000	334	668,000
立花エレテック	14,300	578	8,265,400
木曽路	26,400	1,399	36,933,600
千 趣 会	41,700	516	21,517,200
タカキュー	18,500	135	2,497,500
ケーヨー	43,500	463	20,140,500
アデランス	29,200	809	23,622,800
上新電機	50,000	860	43,000,000
日本瓦斯	22,200	1,131	25,108,200
ベスト電器	72,000	207	14,904,000
マルエツ	48,000	277	13,296,000
ロイヤルホールディングス	38,800	892	34,609,600
東 天 紅	17,000	109	1,853,000
いなげや	26,200	877	22,977,400
島 忠	52,200	1,762	91,976,400
チヨダ	30,300	1,359	41,177,700
ライフコーポレーション	14,600	1,470	21,462,000
カ ス ミ	47,900	490	23,471,000
リンガーハット	20,900	1,080	22,572,000
さ が 美	20,000	76	1,520,000
MR M A X	23,300	301	7,013,300
テンアライド	13,800	254	3,505,200
A O K Iホールディングス	21,400	1,100	23,540,000
オークワ	33,000	1,186	39,138,000
コメリ	31,600	2,533	80,042,800
青山商事	63,700	1,206	76,822,200
しまむら	26,800	7,830	209,844,000
C F Sコーポレーション	19,000	324	6,156,000
高 島 屋	313,000	551	172,463,000
松 屋	46,500	439	20,413,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	120,000	544	65,280,000
丸 栄	40,000	81	3,240,000
ニッセンHD	46,100	466	21,482,600
パ ル コ	42,000	556	23,352,000
丸井グループ	301,400	577	173,907,800
クレディセゾン	188,800	1,472	277,913,600
原信ナルスH L D G S	12,800	1,275	16,320,000
井 筒 屋	126,000	43	5,418,000
ダイエー	142,650	287	40,940,550

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

銘 柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
イズミヤ	81,000	375	30,375,000	
イオン	814,600	1,056	860,217,600	
ユ ニ ー	173,300	685	118,710,500	
イ ズ ミ	69,300	1,208	83,714,400	
東武ストア	31,000	260	8,060,000	
平 和 堂	42,600	951	40,512,600	
フ ジ	25,700	1,712	43,998,400	
ヤオコー	10,200	2,623	26,754,600	
ゼビオ	27,800	1,904	52,931,200	
ケーズホールディングス	57,700	3,130	180,601,000	
P a l t a c	16,200	1,390	22,518,000	
O L Y M P I C	15,800	710	11,218,000	
日産東京販売HD	34,000	119	4,046,000	
新生銀行	1,800,000	80	144,000,000	
あおぞら銀行	720,000	216	155,520,000	
三菱UFJフィナンシャルG	17,497,200	328	5,739,081,600	
りそなホールディングス	2,011,700	344	692,024,800	
三井住友トラストHD	4,531,000	250	1,132,750,000	
三井住友フィナンシャルG	1,748,100	2,022	3,534,658,200	
第四銀行	301,000	250	75,250,000	
北越銀行	240,000	143	34,320,000	
西日本シティ銀行	810,000	215	174,150,000	
札幌北洋ホール	347,400	267	92,755,800	
千葉銀行	911,000	507	461,877,000	
横浜銀行	1,485,000	377	559,845,000	
常陽銀行	890,000	337	299,930,000	
群馬銀行	527,000	431	227,137,000	
武蔵野銀行	37,300	2,577	96,122,100	
千葉興業銀行	44,000	429	18,876,000	
筑波銀行	96,100	257	24,697,700	
東京都民銀行	43,800	887	38,850,600	
七十七銀行	362,000	306	110,772,000	
青森銀行	173,000	232	40,136,000	
秋田銀行	159,000	241	38,319,000	
山形銀行	141,000	375	52,875,000	
岩手銀行	15,600	3,510	54,756,000	
東邦銀行	195,000	199	38,805,000	
東北銀行	130,000	121	15,730,000	
みちのく銀行	116,000	149	17,284,000	
ふくおかフィナンシャルG	937,000	299	280,163,000	
静岡銀行	698,000	809	564,682,000	
十六銀行	290,000	238	69,020,000	
スルガ銀行	225,000	688	154,800,000	
八十二銀行	426,000	451	192,126,000	
山梨中央銀行	141,000	318	44,838,000	
大垣共立銀行	308,000	247	76,076,000	
福井銀行	200,000	235	47,000,000	
北國銀行	276,000	280	77,280,000	
清水銀行	7,900	3,015	23,818,500	
滋賀銀行	217,000	526	114,142,000	
南都銀行	215,000	444	95,460,000	
百五銀行	209,000	307	64,163,000	
京都銀行	413,000	686	283,318,000	
三重銀行	96,000	178	17,088,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,619,000	147	237,993,000	

広島銀行	682,000	364	248,248,000
山陰合同銀行	137,000	596	81,652,000
中国銀行	189,000	1,068	201,852,000
鳥取銀行	74,000	161	11,914,000
伊予銀行	247,000	756	186,732,000
百十四銀行	254,000	306	77,724,000
四国銀行	167,000	289	48,263,000
阿波銀行	204,000	539	109,956,000
鹿児島銀行	149,000	515	76,735,000
大分銀行	150,000	226	33,900,000
宮崎銀行	154,000	166	25,564,000
肥後銀行	181,000	436	78,916,000
佐賀銀行	141,000	198	27,918,000
十八銀行	148,000	203	30,044,000
沖縄銀行	17,500	3,340	58,450,000
琉球銀行	48,700	954	46,459,800
八千代銀行	12,100	1,939	23,461,900
みずほフィナンシャルG	29,686,100	101	2,998,296,100
紀陽ホールディングス	919,000	114	104,766,000
山口フィナンシャルG	231,000	697	161,007,000
フィデック	141	8,440	1,190,040
芙蓉総合リース	22,000	2,658	58,476,000
興銀リース	32,200	1,718	55,319,600
東京センチュリーリース	62,000	1,542	95,604,000
S B Iホールディングス	24,408	6,070	148,156,560
日本証券金融	95,600	359	34,320,400
大阪証券金融	28,500	150	4,275,000
アイフル	210,250	115	24,178,750
日本アジア投資	158,000	56	8,848,000
ポケットカード	22,200	258	5,727,600
長野銀行	81,000	157	12,717,000
名古屋銀行	209,000	256	53,504,000
愛知銀行	8,400	4,460	37,464,000
第三銀行	131,000	160	20,960,000
中京銀行	96,000	192	18,432,000
東日本銀行	111,000	158	17,538,000
大光銀行	82,000	222	18,204,000
愛媛銀行	146,000	228	33,288,000
トマト銀行	92,000	134	12,328,000
みなと銀行	209,000	139	29,051,000
京葉銀行	190,000	379	72,010,000
関西アーバン銀行	323,000	140	45,220,000
栃木銀行	116,000	280	32,480,000
北日本銀行	7,300	1,794	13,096,200
東和銀行	232,000	89	20,648,000
福島銀行	284,000	36	10,224,000
大東銀行	149,000	54	8,046,000
リコーリース	15,900	1,663	26,441,700
イオン クレジットサービス	102,700	1,183	121,494,100
アコム	46,420	1,368	63,502,560
プロミス	117,500	776	91,180,000
ジャックス	140,000	243	34,020,000
オリコ	334,500	70	23,415,000
日立キャピタル	45,400	936	42,494,400
オリックス	120,210	6,630	796,992,300
三菱UFJリース	58,590	3,060	179,285,400
ジャフコ	28,100	1,413	39,705,300
トモニホールディングス	177,600	314	55,766,400
大和証券G本社	2,290,000	250	572,500,000

野村ホールディングス	5,003,500	243	1,215,850,500
岡三証券グループ	197,000	229	45,113,000
丸三証券	77,900	261	20,331,900
東洋証券	88,000	109	9,592,000
東海東京HD	265,000	208	55,120,000
光世証券	57,000	58	3,306,000
水戸証券	64,000	100	6,400,000
いちよし証券	52,400	410	21,484,000
松井証券	137,700	344	47,368,800
N K S Jホールディングス	483,500	1,533	741,205,500
だいこう証券ビジ	13,500	241	3,253,500
マネックスG	1,860	12,050	22,413,000
カブドットコム証券	94,400	210	19,824,000
極東証券	31,500	400	12,600,000
岩井コスモホールディング	22,000	250	5,500,000
フィデアホール	132,900	206	27,377,400
池田泉州HD	953,700	115	109,675,500
M S & A D	690,800	1,509	1,042,417,200
S O N Y F H	221,200	1,243	274,951,600
小林洋行	5,200	178	925,600
第一生命	12,360	75,400	931,944,000
東京海上HD	877,500	1,858	1,630,395,000
アサックス	32	92,300	2,953,600
N E C キャピタルソリューション	7,800	1,054	8,221,200
T & Dホールディングス	842,300	694	584,556,200
三井不動産	1,026,000	1,229	1,260,954,000
三菱地所	1,618,000	1,309	2,117,962,000
平和不動産	218,500	160	34,960,000
東京建物	441,000	219	96,579,000
ダイビル	68,000	510	34,680,000
サンケイビル	39,700	319	12,664,300
東急不動産	465,000	299	139,035,000
京阪神ビルディング	27,700	351	9,722,700
住友不動産	554,000	1,539	852,606,000
東宝不動産	24,900	406	10,109,400
太平洋興発	80,000	65	5,200,000
大京	356,000	140	49,840,000
テーオーシー	89,700	342	30,677,400
東京楽天地	27,000	273	7,371,000
レオパレス21	178,600	195	34,827,000
フジ住宅	29,500	364	10,738,000
空港施設	24,500	304	7,448,000
明和地所	13,400	348	4,663,200
住友不動産販売	8,310	3,105	25,802,550
ゴールドクレスト	20,790	1,241	25,800,390
東栄住宅	15,700	758	11,900,600
日本エスリード	10,200	627	6,395,400
東急リバブル	20,900	659	13,773,100
飯田産業	26,100	608	15,868,800
日神不動産	13,500	422	5,697,000
アーネストワン	38,200	758	28,955,600
タカラレーベン	26,700	412	11,000,400
サンヨーハウジ 名古屋	99	73,600	7,286,400
イオンモール	105,200	1,757	184,836,400
フージャースコーポレーション	353	27,200	9,601,600
タクトホーム	122	64,500	7,869,000
ランド	24,700	15	370,500
トーセイ	224	20,010	4,482,240
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,436	50,900	73,092,400

サンフロンティア不動産	211	8,390	1,770,290
ランドビジネス	160	15,700	2,512,000
東武鉄道	1,330,000	374	497,420,000
相鉄ホールディングス	375,000	235	88,125,000
東京急行	1,378,000	380	523,640,000
京浜急行	602,000	712	428,624,000
小田急電鉄	751,000	741	556,491,000
京王電鉄	654,000	527	344,658,000
京成電鉄	377,000	537	202,449,000
富士急行	65,000	434	28,210,000
新京成電鉄	23,000	347	7,981,000
東日本旅客鉄道	407,200	4,915	2,001,388,000
西日本旅客鉄道	203,600	3,305	672,898,000
東海旅客鉄道	2,032	683,000	1,387,856,000
西日本鉄道	304,000	361	109,744,000
ハマキョウレックス	6,700	2,007	13,446,900
サカイ引越センター	4,300	1,582	6,802,600
近畿鉄道	2,116,000	276	584,016,000
阪急阪神H L D G S	1,571,000	334	524,714,000
南海電鉄	489,000	326	159,414,000
京阪電鉄	526,000	362	190,412,000
名糖運輸	9,400	595	5,593,000
名古屋鉄道	818,000	203	166,054,000
日本通運	927,000	305	282,735,000
ヤマトホールディングス	476,500	1,290	614,685,000
山 九	285,000	290	82,650,000
日 新	89,000	179	15,931,000
丸 運	12,500	187	2,337,500
丸全昭和運輸	79,000	246	19,434,000
センコー	94,000	298	28,012,000
トナミホールディングス	48,000	149	7,152,000
日本梱包運輸	70,300	776	54,552,800
日石輸送	28,000	181	5,068,000
福山通運	142,000	442	62,764,000
セイノーホールディングス	181,000	584	105,704,000
神奈川中央交通	25,000	406	10,150,000
日立物流	48,800	1,378	67,246,400
日本郵船	1,855,000	176	326,480,000
商船三井	1,228,000	258	316,824,000
川崎汽船	723,000	135	97,605,000
N S ユナイテッド海運	101,000	109	11,009,000
乾 汽 船	27,700	277	7,672,900
明治海運	21,500	217	4,665,500
飯野海運	113,300	375	42,487,500
共栄タンカー	21,000	105	2,205,000
第一中央汽船	152,000	93	14,136,000
全日本空輸	3,122,000	233	727,426,000
バスコ	21,000	236	4,956,000
国際航業H L D G S	14,000	202	2,828,000
三菱倉庫	166,000	835	138,610,000
三井倉庫	109,000	273	29,757,000
住友倉庫	171,000	350	59,850,000
渋沢倉庫	55,000	213	11,715,000
ヤマタネ	115,000	112	12,880,000
東陽倉庫	30,000	163	4,890,000
日本トランスシティ	50,000	235	11,750,000
ケイヒン	45,000	85	3,825,000
安田倉庫	20,700	450	9,315,000
東洋埠頭	71,000	125	8,875,000

宇徳	17,500	245	4,287,500
上 組	259,000	667	172,753,000
サンリツ	1,700	520	884,000
キムラユニティー	4,800	670	3,216,000
キューソー流通システム	8,000	870	6,960,000
郵船ロジスティクス	18,400	1,006	18,510,400
近鉄エクスプレス	20,900	2,389	49,930,100
東海運	12,400	181	2,244,400
バンテック	27	138,300	3,734,100
東京放送HD	138,500	973	134,760,500
日本テレビ放送網	20,290	11,110	225,421,900
テレビ朝日	586	121,500	71,199,000
スカパーJ S A T H D	1,759	42,800	75,285,200
テレビ東京HD	14,600	1,090	15,914,000
アイ・ティー・シーネットワーク	20,700	467	9,666,900
イー・アクセス	1,764	19,250	33,957,000
N E C モバイリング	8,500	2,525	21,462,500
日本電信電話	1,064,400	3,945	4,199,058,000
K D D I	3,587	585,000	2,098,395,000
光通信	21,200	1,890	40,068,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,046	138,700	2,641,680,200
G M O インターネット	68,500	294	20,139,000
学研ホールディングス	70,000	154	10,780,000
ゼンリン	33,500	668	22,378,000
昭文社	14,200	565	8,023,000
角川グループH L D G S	21,800	2,683	58,489,400
インプレスホールディングス	19,300	83	1,601,900
東京電力	1,869,800	291	544,111,800
中部電力	771,700	1,368	1,055,685,600
関西電力	955,600	1,122	1,072,183,200
中国電力	323,700	1,149	371,931,300
北陸電力	229,400	1,202	275,738,800
東北電力	585,100	797	466,324,700
四国電力	215,600	1,955	421,498,000
九州電力	517,100	1,020	527,442,000
北海道電力	219,100	987	216,251,700
沖縄電力	14,000	3,255	45,570,000
電源開発	145,300	1,955	284,061,500
東京瓦斯	2,828,000	331	936,068,000
大阪瓦斯	2,273,000	295	670,535,000
東邦瓦斯	596,000	462	275,352,000
北海道瓦斯	42,000	264	11,088,000
西部瓦斯	265,000	191	50,615,000
静岡瓦斯	61,000	485	29,585,000
アイネット	10,300	442	4,552,600
松 竹	152,000	717	108,984,000
東 宝	164,900	1,338	220,636,200
エイチ・アイ・エス	24,900	1,943	48,380,700
東 映	97,000	357	34,629,000
葵プロモーション	7,500	390	2,925,000
N T T データ	1,428	249,500	356,286,000
共立メンテナンス	11,100	1,261	13,997,100
イチネンホールディングス	26,000	385	10,010,000
建設技術研究所	14,000	534	7,476,000
アインファーマシーズ	12,700	3,390	43,053,000
燦ホールディングス	4,900	1,242	6,085,800
スバル興業	3,000	229	687,000
東京テアトル	96,000	106	10,176,000
ホリプロ	8,800	624	5,491,200

よみうりランド	55,000	252	13,860,000
東京都競馬	190,000	104	19,760,000
常磐興産	76,000	80	6,080,000
カナモト	32,000	509	16,288,000
東京ドーム	195,000	165	32,175,000
D T S	23,800	838	19,944,400
スクウェア・エニックス・H D	75,500	1,602	120,951,000
シーイーシー	15,700	364	5,714,800
カプコン	44,300	2,166	95,953,800
東海観光	108,000	19	2,052,000
日本空港ビルデング	73,700	1,018	75,026,600
トランス・コスモス	31,900	893	28,486,700
乃村工藝社	48,000	234	11,232,000
ジャステック	15,900	512	8,140,800
S C S K	47,100	1,252	58,969,200
藤田観光	63,000	252	15,876,000
近畿日本ツーリスト	77,000	81	6,237,000
日本管財	9,200	1,421	13,073,200
トーカイ	9,800	1,682	16,483,600
白 洋 舎	5,000	210	1,050,000
セコム	237,500	3,595	853,812,500
日本システムウエア	9,100	289	2,629,900
セントラル警備保障	11,300	789	8,915,700
アイネス	27,900	543	15,149,700
丹青社	23,000	205	4,715,000
メイテック	38,300	1,380	52,854,000
T K C	19,500	1,491	29,074,500
アサツー ディ・ケイ	42,700	1,895	80,916,500
富士ソフト	31,200	1,224	38,188,800
応用地質	25,900	755	19,554,500
船井総合研究所	26,300	534	14,044,200
N S D	44,700	582	26,015,400
進学会	12,700	276	3,505,200
丸紅建材リース	23,000	136	3,128,000
コナミ	104,400	2,435	254,214,000
ベネッセホールディングス	75,800	3,605	273,259,000
イオンディライト	27,600	1,573	43,414,800
ナック	5,500	1,438	7,909,000
福井コンピュータ	1,500	338	507,000
ニチイ学館	47,800	912	43,593,600
ダイセキ	39,400	1,434	56,499,600
日鐵商事	51,000	194	9,894,000
元気寿司	7,300	964	7,037,200
トラスコ中山	29,100	1,390	40,449,000
ヤマダ電機	112,450	5,720	643,214,000
オートバックスセブン	27,400	3,620	99,188,000
アークランドサカモト	15,000	1,330	19,950,000
ニトリホールディングス	45,700	7,540	344,578,000
グルメ杵屋	15,000	415	6,225,000
愛 眼	18,700	384	7,180,800
吉野家ホールディングス	628	100,800	63,302,400
加藤産業	33,400	1,521	50,801,400
イノテック	13,900	530	7,367,000
イエローハット	21,800	1,056	23,020,800
富士エレクトロニクス	11,900	997	11,864,300
松屋フーズ	11,200	1,487	16,654,400
J B C Cホールディングス	18,600	505	9,393,000
J Kホールディングス	22,000	342	7,524,000
サガミチェーン	28,000	509	14,252,000

日 伝	9,600	2,550	24,480,000
北沢産業	11,000	147	1,617,000
杉本商事	13,000	684	8,892,000
因幡電機産業	27,400	2,203	60,362,200
住金物産	110,000	166	18,260,000
ブレナス	25,800	1,213	31,295,400
ミニストップ	17,300	1,352	23,389,600
アークス	31,700	1,397	44,284,900
バ ロ ー	45,900	1,204	55,263,600
ミスミグループ本社	85,400	1,718	146,717,200
江守商事	5,100	863	4,401,300
アルテック	11,500	181	2,081,500
ベ ル ク	11,400	1,112	12,676,800
大 庄	11,100	938	10,411,800
タキヒヨー	36,000	426	15,336,000
ファーストリテイリング	54,000	13,480	727,920,000
ソフトバンク	1,047,100	2,597	2,719,318,700
スズケン	88,800	1,920	170,496,000
サンドラッグ	43,900	2,337	102,594,300
ジェコス	17,000	298	5,066,000
ヤマザワ	6,200	1,342	8,320,400
や ま や	3,600	837	3,013,200
ベルーナ	28,750	520	14,950,000
合 計	359,871,465		232,766,713,017

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		3,961,092,739	2,803,625,857
コール・ローン		67,427,590	23,671,901
株式		276,039,022,627	244,980,050,118
投資信託受益証券		923,064,356	818,414,531
投資証券		3,769,435,032	3,615,329,400
派生商品評価勘定		32,105,789	85,714,519
未収入金		11,027,269	1,933,540
未収配当金		576,221,778	471,901,264
差入委託証拠金		1,275,806,824	1,406,552,748
流動資産合計		286,655,204,004	254,207,193,878
資産合計		286,655,204,004	254,207,193,878
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		33,067,434	97,372,493
未払解約金		115,340,000	101,751,000
流動負債合計		148,407,434	199,123,493
負債合計		148,407,434	199,123,493
純資産の部			
元本等			
元本		206,783,830,759	219,132,408,137
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		79,722,965,811	34,875,662,248
元本等合計		286,506,796,570	254,008,070,385
純資産合計		286,506,796,570	254,008,070,385
負債純資産合計		286,655,204,004	254,207,193,878

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月16日から平成24年2月15日までとなっております。
----------------------------	--

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	226,752,490,273円	206,783,830,759円
同期中追加設定元本額	9,155,262,252円	38,603,627,885円
同期中解約元本額	29,123,921,766円	26,255,050,507円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,216,008,136円	1,219,254,799円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	29,864,187,666円	31,719,411,718円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	164,724,393円	202,885,755円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	970,765,654円	1,096,543,600円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,204,788,778円	1,339,202,654円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	196,726,997円	213,387,982円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	507,959,260円	545,764,320円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	364,800,063円	393,590,836円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	82,860,528円	76,996,368円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	786,956,001円	805,292,083円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,654,800円	145,931,992円
D I A M外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	619,512,452円	592,339,971円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,963,506,635円	6,000,868,582円

D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド（適格機関投資家限定）	17,000,035,639円	16,543,915,689円
D I A Mワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	91,223,375円	96,706,040円
D I A Mグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,659,081,165円	9,208,853,391円
D I A Mグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,489,351,342円	1,511,252,642円
D I A M国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	170,358,459円	179,847,872円
D I A M国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	977,006,006円	1,036,585,522円
D I A M国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	86,456,288円	93,173,275円
D I A M国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,992,221円	165,765,525円
D I A M世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,174,501,423円	17,221,667,903円
D I A M世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,102,180,126円	8,563,572,299円
D I A Mバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,786,249,573円	2,979,637,983円
D I A Mバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,453,949,529円	2,591,867,013円
D I A Mバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,617,503,044円	6,835,681,832円
D I A Mグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	5,058,637,271円	5,226,085,029円
D I A Mグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	6,412,493,093円	6,851,767,047円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,329,634,599円	4,662,186,236円
D I A M世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	3,834,322,835円	4,229,012,926円
D I A Mグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	58,961,297円	57,674,003円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	252,016,417円	- 円
D I A M世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,661,980,646円	19,081,560,082円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,014,022,706円	3,198,492,340円
D I A Mグローバル分散ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	126,775,679円	147,447,723円
D I A M世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,060,385,620円	23,853,858,855円

D I A M世界アセットバランス ファンド40VA（適格機関投 資家限定）	2,228,300,127円	2,344,969,890円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA（適格機関投 資家限定）	4,066,351,391円	4,402,861,238円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投資 家限定）	13,368,039,162円	14,559,572,911円
D I A Mバランス50VA（適 格機関投資家限定）	159,275円	174,275円
D I A Mバランス70VA（適 格機関投資家限定）	250,832円	268,252円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA（適格機関投資 家限定）	17,480,935,196円	19,136,233,639円
D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定）	73,400円	81,305円
D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	151,660円	164,740円
（合 計）	206,783,830,759円	219,132,408,137円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの特定期間末日 における受益権の総数	206,783,830,759口	219,132,408,137口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左
-------------------	--	----

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) 派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2) 派生商品評価勘定 同左 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	859,639,475	27,681,738,848
投資信託受益証券	40,988,968	93,719,973
投資証券	198,028,962	141,698,014
合計	1,016,679,469	27,917,156,835

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

(株式関連)

平成23年5月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	233,311,264	-	228,217,919	5,093,345
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	376,898,535	-	369,186,138	7,712,397
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,128,469,256	-	1,124,079,159	4,390,097
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	556,393,208	-	555,493,074	900,134
	米ドル S&P 500 FUTURE	2,803,239,177	-	2,821,248,125	18,008,948
合 計		5,098,311,440	-	5,098,224,415	87,025

平成23年11月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	182,041,107	-	184,356,172	2,315,065
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	305,980,564	-	303,542,484	2,438,080
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	893,575,763	-	857,796,215	35,779,548
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	490,924,746	-	482,407,168	8,517,578
	米ドル S&P 500 FUTURE	2,535,963,199	-	2,568,263,916	32,300,717
合 計		4,408,485,379	-	4,396,365,955	12,119,424

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

平成23年5月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	69,025,380	-	69,900,000	874,620
合 計		69,025,380	-	69,900,000	874,620

平成23年11月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	63,609,800	-	63,246,000	363,800
	英ポンド	12,345,950	-	12,345,000	950
	米ドル	54,402,700	-	54,306,000	96,700
合 計		130,358,450	-	129,897,000	461,450

（注）時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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ております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買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売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3855円 (13,855円)	1.1592円 (11,592円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成23年11月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	EVEREST RE GROUP LTD	8,102	89.550	725,534.100	
	PARTNERRE LTD	7,570	66.510	503,480.700	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,784	31.580	403,718.720	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	69.780	592,641.540	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,847	35.770	745,697.190	
	BUNGE LTD	19,670	61.250	1,204,787.500	
	INVESCO LTD	73,288	19.740	1,446,705.120	
	ULTRA PETROLEUM CORP	22,514	35.660	802,849.240	
	ACE LTD	52,602	70.420	3,704,232.840	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	73,611	44.610	3,283,786.710	
	WEATHERFORD INTL LTD	121,037	15.620	1,890,597.940	
	NOBLE CORP	40,324	36.770	1,482,713.480	
	GARMIN LTD	20,043	34.970	700,903.710	
	FOSTER WHEELER AG	17,348	19.490	338,112.520	
	TE CONNECTIVITY LTD	64,170	33.860	2,172,796.200	
	SCHLUMBERGER LTD	211,972	74.050	15,696,526.600	
	SEAGATE TECHNOLOGY	71,207	17.510	1,246,834.570	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	22,783	53.910	1,228,231.530	
	XL GROUP PLC	53,089	20.700	1,098,942.300	
	INGERSOLL-RAND PLC	53,301	29.980	1,597,963.980	
	ACCENTURE PLC-CL A	103,471	57.000	5,897,847.000	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,253	36.520	885,719.560	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	32,750	17.030	557,732.500	
	COVIDIEN PLC	75,986	46.570	3,538,668.020	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	26.900	601,941.300	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	44,283	35.070	1,553,004.810	
	NIELSEN HOLDINGS NV	15,158	30.010	454,891.580	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	64,676	32.940	2,130,427.440	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,408	6.180	682,321.440	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,354	33.110	1,137,460.940	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	1,027,000	0.660	677,820.000	
	AMAZON.COM INC	56,324	210.790	11,872,535.960	
	ABBOTT LABORATORIES	242,082	53.950	13,060,323.900	
	AES CORP	89,706	11.480	1,029,824.880	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,815	55.460	821,639.900	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	189,522	183.350	34,748,858.700	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	5.660	527,976.120	
	ADOBE SYSTEMS INC	81,219	28.030	2,276,568.570	
	AGCO CORP	14,077	45.330	638,110.410	
	AIRGAS INC	12,208	71.340	870,918.720	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	33,113	84.470	2,797,055.110	
	ENERGEN CORP	12,554	50.410	632,847.140	
	ALLERGAN INC	47,692	82.820	3,949,851.440	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	149,018	47.510	7,079,845.180	
	RALPH LAUREN CORP	9,673	151.220	1,462,751.060	
	ALLSTATE CORP	80,445	26.200	2,107,659.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	118,922	53.560	6,369,462.320	
	ALTERA CORPORATION	50,199	36.585	1,836,530.410	
	ALCOA INC	165,402	10.250	1,695,370.500	
	AMGEN INC	148,650	57.960	8,615,754.000	

	HESS CORP	47,762	63.850	3,049,603.700	
	BEAM INC	23,016	49.880	1,148,038.080	
	AMERICAN EXPRESS CO	167,265	49.090	8,211,038.850	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	75,772	38.840	2,942,984.480	
	AFLAC INC	73,710	43.710	3,221,864.100	
	AMERICAN INTL GROUP	76,451	23.150	1,769,840.650	
	ANALOG DEVICES	48,702	35.890	1,747,914.780	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	80,197	79.490	6,374,859.530	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	28,648	63.600	1,822,012.800	
	NABORS INDUSTRIES LTD	49,134	19.620	964,009.080	
	ARCH COAL INC	33,405	16.810	561,538.050	
	TIME WARNER	171,008	34.180	5,845,053.440	
	VALERO ENERGY CORP	88,182	25.610	2,258,341.020	
	APOLLO GROUP INC	22,785	46.530	1,060,186.050	
	APACHE CORP	61,668	101.540	6,261,768.720	
	APPLE INC	145,090	385.220	55,891,569.800	
	APPLIED MATERIALS INC	223,045	12.250	2,732,301.250	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,776	28.880	2,881,530.880	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,201	45.950	790,385.950	
	AMEREN CORP	37,494	32.640	1,223,804.160	
	ARROW ELECTRONICS INC	17,437	34.530	602,099.610	
	AUTOLIV INC	14,963	54.710	818,625.730	
	AUTODESK INC	38,885	32.720	1,272,317.200	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	77,786	51.190	3,981,865.340	
	AUTOZONE INC	4,387	330.710	1,450,824.770	
	AVERY DENNISON CORP	15,202	25.630	389,627.260	
	AVNET INC	22,835	29.620	676,372.700	
	AVON PRODUCTS INC	70,640	18.130	1,280,703.200	
	BMC SOFTWARE INC	28,920	36.250	1,048,350.000	
	BAKER HUGHES INC	69,228	57.240	3,962,610.720	
	BALL CORP	20,878	34.490	720,082.220	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	141,694	75.990	10,767,327.060	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	31,946	40.170	1,283,270.820	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	197,430	20.720	4,090,749.600	
	CR BARD INC	14,153	87.500	1,238,387.500	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	87,295	53.670	4,685,122.650	
	BED BATH & BEYOND INC	38,406	59.740	2,294,374.440	
	BECTON DICKINSON & CO	35,059	73.560	2,578,940.040	
	AMETEK INC	25,735	40.470	1,041,495.450	
	NII HOLDINGS INC	25,446	23.430	596,199.780	
	VERIZON COMM INC	445,067	37.330	16,614,351.110	
	WR BERKLEY CORP	18,150	34.770	631,075.500	
	BEST BUY CO INC	59,621	27.300	1,627,653.300	
	YUM! BRANDS INC	66,938	54.740	3,664,186.120	
	FIRSTENERGY CORP	64,444	44.750	2,883,869.000	
	SLM CORP	85,331	13.780	1,175,861.180	
	H&R BLOCK INC	55,467	15.530	861,402.510	
	BOEING CO	112,465	64.830	7,291,105.950	
	ROBERT HALF INTL INC	24,240	26.360	638,966.400	
	BORGWARNER INC	16,519	67.820	1,120,318.580	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	268,520	5.860	1,573,527.200	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26,277	67.690	1,778,690.130	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272,850	31.320	8,545,662.000	
	ONEOK INC	15,305	77.160	1,180,933.800	
	SEMPRA ENERGY	35,687	53.050	1,893,195.350	
	FEDEX CORP	47,277	80.120	3,787,833.240	
	VERISIGN INC	26,815	32.460	870,414.900	
	AMPHENOL CORP	31,249	45.370	1,417,767.130	
	BROWN-FORMAN CORP	13,755	74.040	1,018,420.200	

	QUANTA SERVICES INC	33,320	18.940	631,080.800	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,732	21.660	557,355.120	
	SIRIUS XM RADIO INC	614,899	1.690	1,039,179.310	
	CSX CORP	173,731	21.700	3,769,962.700	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	14.960	559,638.640	
	CABOT OIL & GAS CORP	16,699	86.550	1,445,298.450	
	CAMPBELL SOUP CO	30,602	33.600	1,028,227.200	
	WHITING PETROLEUM CORP	17,265	47.300	816,634.500	
	CONSTELLATION BRANDS INC	30,765	19.720	606,685.800	
	CARDINAL HEALTH INC	55,062	43.200	2,378,678.400	
	CATERPILLAR INC	99,795	92.200	9,201,099.000	
	CELGENE CORP	72,999	64.310	4,694,565.690	
	CITRIX SYSTEMS INC	30,333	71.090	2,156,372.970	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	106,565	25.540	2,721,670.100	
	CENTURYLINK INC	92,807	37.460	3,476,550.220	
	CERNER CORP	20,155	64.120	1,292,338.600	
	JPMORGAN CHASE & CO	619,769	32.740	20,291,237.060	
	CHUBB CORP	45,961	67.070	3,082,604.270	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	23,516	43.560	1,024,356.960	
	CIGNA CORP	38,955	43.190	1,682,466.450	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	28.740	684,126.960	
	CINTAS CORP	13,173	28.750	378,723.750	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	164,569	5.620	924,877.780	
	CISCO SYSTEMS INC	858,691	18.610	15,980,239.510	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	25,587	66.850	1,710,490.950	
	CLOROX COMPANY	21,099	65.370	1,379,241.630	
	COCA-COLA CO/THE	320,786	67.390	21,617,768.540	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	49,318	26.350	1,299,529.300	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	78,864	88.140	6,951,072.960	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	47,564	30.270	1,439,762.280	
	AON CORP	46,043	47.390	2,181,977.770	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	110,849	22.000	2,438,678.000	
	COMERICA INC	31,637	25.640	811,172.680	
	NRG ENERGY, INC.	31,248	21.640	676,206.720	
	COMCAST CORP-CL A	318,068	22.170	7,051,567.560	
	CA INC	53,086	21.340	1,132,855.240	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	25.240	582,135.360	
	CONAGRA FOODS INC	66,889	25.330	1,694,298.370	
	CONSOLIDATED EDISON INC	47,195	58.880	2,778,841.600	
	SARA LEE CORP	90,891	18.480	1,679,665.680	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	38,217	50.110	1,915,053.870	
	MOLSON COORS BREWING CO	24,801	40.040	993,032.040	
	CORNING INC	249,781	14.570	3,639,309.170	
	DIRECTV	123,996	45.420	5,631,898.320	
	COVANCE INC	10,195	47.050	479,674.750	
	CREE INC	15,994	28.210	451,190.740	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	28,393	32.020	909,143.860	
	SEALED AIR CORP	30,348	17.610	534,428.280	
	BROADCOM CORP-CL A	76,142	34.130	2,598,726.460	
	CUMMINS INC	29,309	97.280	2,851,179.520	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,299	68.450	978,766.550	
	DR HORTON INC	39,483	11.660	460,371.780	
	DANAHER CORP	91,324	48.590	4,437,433.160	
	MOODY'S CORP	30,243	34.170	1,033,403.310	
	AMERICAN TOWER CORP	62,322	56.630	3,529,294.860	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,689	67.340	3,211,377.260	
	TARGET CORP	104,308	51.770	5,400,025.160	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	12,609	64.700	815,802.300	

	DEERE & CO	66,793	73.580	4,914,628.940	
	DELL INC	271,070	14.960	4,055,207.200	
	MORGAN STANLEY	220,656	15.860	3,499,604.160	
	REPUBLIC SERVICES INC	53,213	27.150	1,444,732.950	
	DEVRY INC	11,178	36.280	405,537.840	
	THE WALT DISNEY CO	278,318	34.640	9,640,935.520	
	DOLLAR TREE INC	18,954	77.870	1,475,947.980	
	RR DONNELLEY & SONS CO	36,360	15.860	576,669.600	
	DOVER CORP	27,697	53.850	1,491,483.450	
	DOW CHEMICAL	188,045	27.410	5,154,313.450	
	OMNICOM GROUP	47,303	43.560	2,060,518.680	
	DTE ENERGY CO	28,132	51.180	1,439,795.760	
	DUKE ENERGY CORP	213,159	20.750	4,423,049.250	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	47,742	40.810	1,948,351.020	
	FLOWERVE CORP	8,844	95.780	847,078.320	
	DARDEN RESTAURANTS INC	21,227	46.530	987,692.310	
	EBAY INC	186,649	30.750	5,739,456.750	
	EMC CORP/MASS	330,575	24.060	7,953,634.500	
	BANK OF AMERICA CORP	1,568,278	6.030	9,456,716.340	
	EL PASO CORP	120,489	24.730	2,979,692.970	
	CITIGROUP INC	452,192	28.630	12,946,256.960	
	EASTMAN CHEMICAL CO	23,682	39.880	944,438.160	
	EATON CORP	51,814	44.490	2,305,204.860	
	EATON VANCE CORP	19,507	25.340	494,307.380	
	DISH NETWORK CORP	30,117	25.210	759,249.570	
	ECOLAB INC	35,375	54.720	1,935,720.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	52,870	23.570	1,246,145.900	
	SALESFORCE.COM INC	18,981	127.810	2,425,961.610	
	EMERSON ELECTRIC CO	119,595	50.560	6,046,723.200	
	ENTERGY CORP	27,589	69.020	1,904,192.780	
	EOG RESOURCES INC	42,985	100.040	4,300,219.400	
	EQUIFAX INC	9,977	35.360	352,786.720	
	EQT CORP	21,454	62.880	1,349,027.520	
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,944	115.980	2,197,125.120	
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	34,083	44.560	1,518,738.480	
	EXPRESS SCRIPTS INC	78,777	47.020	3,704,094.540	
	EXXON MOBIL CORP	773,763	78.700	60,895,148.100	
	FMC CORP	9,929	81.950	813,681.550	
	NEXTERA ENERGY INC	63,677	55.290	3,520,701.330	
	FAMILY DOLLAR STORES	18,264	57.940	1,058,216.160	
	ASSURANT INC	19,981	38.140	762,075.340	
	FASTENAL CO	45,490	40.160	1,826,878.400	
	FIFTH THIRD BANCORP	148,746	12.010	1,786,439.460	
	M&T BANK CORP	20,397	72.370	1,476,130.890	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	18,192	35.890	652,910.880	
	FISERV INC	23,158	57.210	1,324,869.180	
	FLIR SYSTEMS INC	27,409	25.810	707,426.290	
	MACY'S INC	62,722	30.770	1,929,955.940	
	FORD MOTOR CO	572,755	10.990	6,294,577.450	
	FOREST LABORATORIES INC	46,503	30.060	1,397,880.180	
	FOSSIL INC	8,025	90.410	725,540.250	
	FRANKLIN RESOURCES INC	24,134	104.770	2,528,519.180	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	151,333	39.200	5,932,253.600	
	GAP INC/THE	74,828	19.680	1,472,615.040	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	22,388	35.480	794,326.240	
	GENERAL DYNAMICS CORP	49,345	63.380	3,127,486.100	
	GENERAL MILLS INC	99,940	39.160	3,913,650.400	
	GENUINE PARTS CO	25,053	57.850	1,449,316.050	

	GILEAD SCIENCES INC	124,643	40.160	5,005,662.880	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	31,505	48.840	1,538,704.200	
	GOODRICH CORP	19,092	122.500	2,338,770.000	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	13.510	495,560.310	
	MCKESSON CORP	40,111	81.740	3,278,673.140	
	NVIDIA CORP	96,093	14.470	1,390,465.710	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,661,096	16.060	26,677,201.760	
	WW GRAINGER INC	8,547	176.270	1,506,579.690	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	22,545	40.890	921,865.050	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,927	40.090	959,233.430	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	41,880	25.340	1,061,239.200	
	HALLIBURTON CO	146,529	37.290	5,464,066.410	
	HANSEN NATURAL CORP	12,038	89.990	1,083,299.620	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,841	99.500	7,546,179.500	
	HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	37.640	1,380,258.800	
	HARRIS CORP	21,855	37.260	814,317.300	
	JEFFERIES GROUP INC NPR	18,639	11.110	207,079.290	
	CONSOL ENERGY INC	36,761	41.990	1,543,594.390	
	HASBRO INC	14,290	36.750	525,157.500	
	HENRY SCHEIN INC	13,991	64.940	908,575.540	
	DENBURY RESOURCES INC	68,370	16.870	1,153,401.900	
	HJ HEINZ CO	51,559	53.150	2,740,360.850	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,984	53.580	856,422.720	
	HERSHEY FOODS CORP	25,491	56.960	1,451,967.360	
	HEWLETT-PACKARD CO	348,566	26.760	9,327,626.160	
	F5 NETWORKS INC	12,462	106.990	1,333,309.380	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	29,491	32.400	955,508.400	
	REYNOLDS AMERICAN INC	53,408	38.790	2,071,696.320	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	18,519	38.400	711,129.600	
	HUMAN GENOME SCIENCES INC	33,061	9.360	309,450.960	
	JUNIPER NETWORKS INC	85,477	23.770	2,031,788.290	
	HOLLYFRONTIER CORP	35,010	29.770	1,042,247.700	
	HOLOGIC INC	49,195	17.090	840,742.550	
	UNUM GROUP	49,083	21.800	1,070,009.400	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	HOME DEPOT INC	256,367	37.200	9,536,852.400	
	HORMEL FOODS CORP	24,530	29.350	719,955.500	
	HUDSON CITY BANCORP INC	86,651	5.720	495,643.720	
	CENTERPOINT ENERGY INC	64,137	19.550	1,253,878.350	
	HUMANA INC	25,341	86.570	2,193,770.370	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,075	41.260	415,694.500	
	RED HAT INC	32,403	49.070	1,590,015.210	
	BIOGEN IDEC INC	36,831	112.080	4,128,018.480	
	ILLINOIS TOOL WORKS	70,431	46.190	3,253,207.890	
	INTUIT INC	44,821	52.800	2,366,548.800	
	INTEL CORP	830,469	24.060	19,981,084.140	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,144	53.640	705,044.160	
	INTL GAME TECH	44,449	16.820	747,632.180	
	INTERNATIONAL PAPER CO	67,397	28.330	1,909,357.010	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	85,658	9.320	798,332.560	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	37.890	741,886.200	
	JOHNSON & JOHNSON	429,777	64.120	27,557,301.240	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	63,376	17.100	1,083,729.600	
	JOHNSON CONTROLS INC	100,080	30.850	3,087,468.000	
	KLA-TENCOR CORP	24,993	46.350	1,158,425.550	
	DEVON ENERGY CORP	64,453	67.240	4,333,819.720	
	NSTAR	17,088	44.900	767,251.200	
	KELLOGG CO	38,305	49.380	1,891,500.900	
	KEYCORP	169,321	7.250	1,227,577.250	
	KIMBERLY-CLARK CORP	62,968	70.450	4,436,095.600	
	BLACKROCK INC/NEW YORK	14,451	159.880	2,310,425.880	
	KOHL'S CORP	40,351	55.360	2,233,831.360	
	KROGER CO	94,372	22.920	2,163,006.240	
	LSI CORP	89,888	5.790	520,451.520	
	LAM RESEARCH CORP	20,796	42.330	880,294.680	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	27,255	28.940	788,759.700	
	LEGG MASON INC	22,970	26.040	598,138.800	
	LEGGETT & PLATT INC	19,896	22.110	439,900.560	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	30,757	23.590	725,557.630	
	ELI LILLY & CO	165,664	37.230	6,167,670.720	
	LIMITED BRANDS	42,413	42.310	1,794,494.030	
	LINCOLN NATIONAL CORP	46,505	19.540	908,707.700	
	LINEAR TECH CORP	29,706	31.720	942,274.320	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	118,780	69.880	8,300,346.400	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,045	36.860	2,139,538.700	
	LOCKHEED MARTIN CORP	46,915	76.130	3,571,638.950	
	LOEWS CORP	57,918	38.690	2,240,847.420	
	RANGE RESOURCES CORP	23,850	71.190	1,697,881.500	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,568	47.650	694,165.200	
	LOWE'S COS INC	206,337	22.460	4,634,329.020	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	88,598	51.350	4,549,507.300	
	IRON MOUNTAIN INC	33,638	29.620	996,357.560	
	SCANA CORP	15,400	42.190	649,726.000	
	MDU RESOURCES GROUP INC	32,188	20.320	654,060.160	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,276	9.940	489,803.440	
	MCCORMICK & CO INC	19,813	48.820	967,270.660	
	MCDONALD'S CORPORATION	165,983	93.260	15,479,574.580	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	45,478	42.300	1,923,719.400	
	MANPOWER INC	13,462	38.260	515,056.120	

	EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	18,047	69.020	1,245,603.940	
	MARSH & MCLENNAN COS	85,095	30.460	2,591,993.700	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	11,343	69.830	792,081.690	
	MASCO CORP	58,195	9.130	531,320.350	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	74.630	380,762.260	
	MATTEL INC	56,682	28.510	1,616,003.820	
	METLIFE INC	170,890	32.310	5,521,455.900	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	52,075	26.070	1,357,595.250	
	MEDTRONIC INC	169,366	34.530	5,848,207.980	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	85,641	12.980	1,111,620.180	
	CVS CAREMARK CORP	217,764	38.500	8,383,914.000	
	MERCK & CO. INC.	482,627	34.970	16,877,466.190	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	81.970	1,282,912.470	
	MICROSOFT CORP	1,187,732	26.280	31,213,596.960	
	MICRON TECH INC	134,484	5.180	696,627.120	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	35.760	959,011.680	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	80,651	14.480	1,167,826.480	
	3M CO	108,342	80.320	8,702,029.440	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	52.210	467,697.180	
	PROGRESS ENERGY INC	47,674	53.120	2,532,442.880	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	48,368	45.030	2,178,011.040	
	MURPHY OIL CORPORATION	30,207	54.490	1,645,979.430	
	MYLAN LABORATORIES	60,562	18.350	1,111,312.700	
	ILLUMINA INC	20,615	31.390	647,104.850	
	XCEL ENERGY INC	76,360	25.990	1,984,596.400	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	64,620	68.800	4,445,856.000	
	NETAPP INC	56,606	41.890	2,371,225.340	
	SEARS HOLDINGS CORP	6,881	72.800	500,936.800	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,264	42.430	859,801.520	
	NEWELL RUBBERMAID INC	50,723	15.830	802,945.090	
	DUN & BRADSTREET CORP	8,370	67.070	561,375.900	
	NEWMONT MINING CORP	79,243	68.830	5,454,295.690	
	NIKE INC-CL B	58,194	93.920	5,465,580.480	
	NOBLE ENERGY INC	28,225	92.710	2,616,739.750	
	NORDSTROM INC	26,726	49.620	1,326,144.120	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	55,740	73.790	4,113,054.600	
	NORTHEAST UTILITIES	29,133	34.290	998,970.570	
	NISOURCE INC	44,250	21.920	969,960.000	
	COACH INC	45,740	62.590	2,862,866.600	
	NORTHERN TRUST CORP	31,465	38.820	1,221,471.300	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	40,805	58.060	2,369,138.300	
	WELLS FARGO & CO	785,696	25.080	19,705,255.680	
	NUCOR CORP	46,635	38.380	1,789,851.300	
	MONSANTO CO	85,459	73.510	6,282,091.090	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,479	44.490	3,224,590.710	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	126,674	98.100	12,426,719.400	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22,143	76.380	1,691,282.340	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	38,339	8.300	318,213.700	
	OMNICARE INC	18,060	30.000	541,800.000	
	ORACLE CORP	631,556	31.730	20,039,271.880	
	OWENS-ILLINOIS INC	23,621	19.770	466,987.170	
	PACCAR INC	52,618	41.850	2,202,063.300	
	PALL CORP	19,300	50.620	976,966.000	
	EXELON CORP	102,041	44.410	4,531,640.810	
	PARKER HANNIFIN CORP	26,410	82.380	2,175,655.800	
	PATTERSON COS INC	9,459	29.910	282,918.690	
	PAYCHEX INC	46,374	28.770	1,334,179.980	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	25,588	32.900	841,845.200	
	PPL CORPORATION	90,174	29.900	2,696,202.600	

	PEPSICO INC	245,014	62.960	15,426,081.440	
	PENTAIR INC	14,352	36.470	523,417.440	
	PERRIGO CO	13,145	90.290	1,186,862.050	
	PFIZER INC	1,237,929	19.790	24,498,614.910	
	CONOCOPHILLIPS	210,307	71.440	15,024,332.080	
	PETSMART INC	18,380	46.620	856,875.600	
	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	17,704	33.080	585,648.320	
	PG&E CORP	62,245	40.090	2,495,402.050	
	PITNEY BOWES INC	40,682	19.000	772,958.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,254	92.120	1,589,438.480	
	ALTRIA GROUP INC	336,357	27.630	9,293,543.910	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	84,364	52.650	4,441,764.600	
	AETNA INC	56,047	40.230	2,254,770.810	
	FLUOR CORP (NEW)	26,618	53.940	1,435,774.920	
	PPG INDUSTRIES INC	21,533	86.220	1,856,575.260	
	PRAXAIR INC	47,744	99.840	4,766,760.960	
	PRECISION CASTPARTS CORP	22,584	166.040	3,749,847.360	
	COSTCO WHOLESALE CORP	69,597	82.720	5,757,063.840	
	T ROWE PRICE GROUP INC	41,103	52.150	2,143,521.450	
	QUEST DIAGNOSTICS	24,069	57.240	1,377,709.560	
	PROCTER & GAMBLE CO	435,051	63.240	27,512,625.240	
	PROGRESSIVE CORP	97,111	19.240	1,868,415.640	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79,277	33.620	2,665,292.740	
	PULTE GROUP INC	52,991	5.610	297,279.510	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	70,124	12.200	855,512.800	
	QUALCOMM INC	259,750	55.210	14,340,797.500	
	US BANCORP	311,086	25.640	7,976,245.040	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	78.600	710,229.600	
	ROSS STORES INC	19,262	88.070	1,696,404.340	
	ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,158	60.010	609,581.580	
	ROPER INDUSTRIES INC	16,209	82.550	1,338,052.950	
	ROWAN COS INC	21,239	34.820	739,541.980	
	PEABODY ENERGY CORP	41,483	40.030	1,660,564.490	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,328	72.160	1,683,348.480	
	RAYTHEON COMPANY	61,426	44.660	2,743,285.160	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	14,114	67.070	946,625.980	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	100.500	854,752.500	
	FMC TECHNOLOGIES INC	36,804	46.370	1,706,601.480	
	KRAFT FOODS INC-A	268,447	35.130	9,430,543.110	
	SANDISK CORP	38,624	49.420	1,908,798.080	
	SAFeway INC	56,305	19.670	1,107,519.350	
	ROCKWELL COLLINS INC	25,042	54.950	1,376,057.900	
	ST JUDE MEDICAL INC	49,860	38.560	1,922,601.600	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	68,088	57.400	3,908,251.200	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	37,094	25.090	930,688.460	
	PRICELINE.COM INC	7,926	528.360	4,187,781.360	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	165,176	12.100	1,998,629.600	
	JOY GLOBAL INC	16,611	82.060	1,363,098.660	
	ZIMMER HOLDINGS INC	30,008	51.670	1,550,513.360	
	SPX CORP	7,436	57.130	424,818.680	
	SEI INVESTMENTS CO	28,657	15.950	457,079.150	
	WELLPOINT INC	55,584	68.570	3,811,394.880	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	44,825	38.730	1,736,072.250	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	52,376	23.680	1,240,263.680	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,042	85.880	1,291,806.960	
	SIGMA-ALDRICH	20,592	61.990	1,276,498.080	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	74,340	52.910	3,933,329.400	

	ADVANCE AUTO PARTS	12,466	69.510	866,511.660	
	UNITED STATES STEEL CORP	20,827	25.440	529,838.880	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	55,432	41.650	2,308,742.800	
	EDISON INTERNATIONAL	46,526	40.470	1,882,907.220	
	SOUTHERN CO	132,332	43.600	5,769,675.200	
	BB&T CORP	102,369	23.060	2,360,629.140	
	SOUTHWEST AIRLINES	37,457	8.110	303,776.270	
	AT&T INC	931,325	29.160	27,157,437.000	
	CHEVRON CORP	315,705	105.500	33,306,877.500	
	MEADWESTVACO CORP	27,873	28.180	785,461.140	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	25,717	65.440	1,682,920.480	
	STAPLES INC	102,282	14.540	1,487,180.280	
	STATE STREET CORP	82,469	40.110	3,307,831.590	
	STARBUCKS CORP	116,933	43.520	5,088,924.160	
	STRYKER CORP	44,084	48.270	2,127,934.680	
	NETFLIX INC	7,832	85.120	666,659.840	
	SUNOCO INC	17,700	36.130	639,501.000	
	STERICYCLE INC	12,270	77.850	955,219.500	
	SUNTRUST BANKS INC	83,234	18.900	1,573,122.600	
	SYMANTEC CORP	108,592	16.700	1,813,486.400	
	SYNOPSYS INC	22,281	26.990	601,364.190	
	SYSCO CORP	92,867	27.570	2,560,343.190	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,872	429.540	2,522,258.880	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	185,622	30.620	5,683,745.640	
	TEXTRON INC	42,770	18.380	786,112.600	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	61,217	47.730	2,921,887.410	
	TIFFANY & CO	19,250	75.130	1,446,252.500	
	TOLL BROTHERS INC	20,812	18.640	387,935.680	
	TORCHMARK CORP	13,057	41.670	544,085.190	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	19.680	479,542.560	
	DAVITA INC	15,287	73.390	1,121,912.930	
	TYSON FOODS INC	47,556	19.230	914,501.880	
	URS CORP	17,162	33.850	580,933.700	
	MARATHON OIL CORP	110,823	27.330	3,028,792.590	
	UNION PACIFIC CORP	78,295	100.380	7,859,252.100	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	135,017	77.470	10,459,766.990	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	173,222	46.130	7,990,730.860	
	SPRINT NEXTEL CORP	444,678	2.840	1,262,885.520	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,206	56.910	1,036,103.460	
	VF CORP	12,611	132.900	1,676,001.900	
	CBS CORP	100,965	25.060	2,530,182.900	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,939	31.980	1,149,329.220	
	VULCAN MATERIALS CO	20,011	29.790	596,127.690	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,027	26.170	497,936.590	
	WALGREEN CO	146,465	31.950	4,679,556.750	
	WAL-MART STORES INC	299,886	58.130	17,432,373.180	
	WASTE MANAGEMENT INC	64,451	31.160	2,008,293.160	
	WATERS CORP	12,959	77.930	1,009,894.870	
	WASHINGTON POST	1,143	335.140	383,065.020	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	20,595	65.400	1,346,913.000	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	76.930	1,391,202.120	
	WALTER INDUSTRIES INC	10,524	70.740	744,467.760	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	60,879	56.870	3,462,188.730	
	WESTERN DIGITAL CORP	34,951	25.790	901,386.290	
	WEYERHAEUSER CO	88,971	16.460	1,464,462.660	
	WHIRLPOOL CORP	11,190	53.260	595,979.400	
	WYNN RESORTS LTD	12,936	119.570	1,546,757.520	
	WHOLE FOODS MARKET INC	21,819	67.130	1,464,709.470	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	18,704	25.680	480,318.720	

	CME GROUP INC	9,348	260.100	2,431,414.800	
	WILLIAMS COS INC	93,512	30.750	2,875,494.000	
	PEPCO HOLDINGS INC	36,572	19.400	709,496.800	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,827	41.400	738,037.800	
	WISCONSIN ENERGY CORP	35,977	32.560	1,171,411.120	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	34.810	804,389.480	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,983	51.350	666,677.050	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	40,324	16.820	678,249.680	
	CARMAX INC	38,348	28.380	1,088,316.240	
	XEROX CORP	222,233	8.130	1,806,754.290	
	XILINX INC	36,827	31.980	1,177,727.460	
	YAHOO! INC	188,047	15.950	2,999,349.650	
	CIMAREX ENERGY CO	12,720	64.820	824,510.400	
	TJX COMPANIES INC	61,926	59.990	3,714,940.740	
	HOSPIRA INC	25,220	31.630	797,708.600	
	GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	6.550	480,953.400	
	CBRE GROUP INC	50,310	15.940	801,941.400	
	LIBERTY GLOBAL INC	17,272	40.300	696,061.600	
	REGIONS FINANCIAL CORP	221,699	4.140	917,833.860	
	GOOGLE INC	39,575	595.080	23,550,291.000	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	43,496	8.480	368,846.080	
	LAS VEGAS SANDS CORP	56,522	44.560	2,518,620.320	
	MOSAIC CO/THE	49,222	56.250	2,768,737.500	
	NEWS CORP CLASS B	91,624	17.250	1,580,514.000	
	NEWS CORP INC CLASS A	273,708	16.820	4,603,768.560	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	8,633	28.850	249,062.050	
	CELANESE CORP	24,956	43.150	1,076,851.400	
	WINDSTREAM CORP	81,351	11.830	962,382.330	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	37,286	25.470	949,674.420	
	IHS INC-CLASS A	8,189	84.420	691,315.380	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	17,131	42.070	720,701.170	
	EXPEDIA INC	29,761	27.470	817,534.670	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,523	169.140	1,949,000.220	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,711	45.600	1,856,421.600	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	16,984	38.480	653,544.320	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	35,921	15.260	548,154.460	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	24.600	573,967.200	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,124	125.340	1,268,942.160	
	VIACOM INC-CLASS B	84,583	43.610	3,688,664.630	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,315	325.880	1,406,172.200	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	12,917	17.320	223,722.440	
	NYSE EURONEXT	43,767	26.930	1,178,645.310	
	VIRGIN MEDIA INC	47,938	23.640	1,133,254.320	
	MASTERCARD INC	17,360	360.110	6,251,509.600	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP	92,772	15.160	1,406,423.520	
	WESTERN UNION CO	102,998	16.760	1,726,246.480	
	SAIC INC	43,465	12.310	535,054.150	
	KBR INC	23,562	27.060	637,587.720	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	37,702	11.650	439,228.300	
	FIRST SOLAR INC	8,706	45.130	392,901.780	
	SPECTRA ENERGY CORP	100,338	29.040	2,913,815.520	
	TIME WARNER CABLE INC	53,147	60.160	3,197,323.520	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	63,413	12.640	801,540.320	
	DELTA AIR LINES INC	29,903	7.620	227,860.860	

平成23年11月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	66.320	408,464.880	
	DISCOVER FINANCIAL	85,015	23.740	2,018,256.100	
	CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	96.760	1,440,853.160	
	LULULEMON ATHLETICA INC	16,598	53.980	895,960.040	
	VMWARE INC	13,639	97.190	1,325,574.410	
	TERADATA CORP	26,391	55.340	1,460,477.940	
	CALPINE CORP NPR	39,169	15.020	588,318.380	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	276,691	71.000	19,645,061.000	
	VISA INC	83,874	93.040	7,803,636.960	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	36,271	37.400	1,356,535.400	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	31.190	895,932.750	
	LORILLARD INC	23,305	107.730	2,510,647.650	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	19,261	39.490	760,616.890	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	22,552	38.770	874,341.040	
	MARATHON PETROLEUM CORP	56,591	37.700	2,133,480.700	
	CAREFUSION CORP	34,028	24.550	835,387.400	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	22,125	27.430	606,888.750	
	XYLEM INC	24,722	23.650	584,675.300	
	HCA HOLDINGS INC	33,601	25.870	869,257.870	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	48,273	39.100	1,887,474.300	
	VERISK ANALYTICS INC	19,501	37.720	735,577.720	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	33,053	70.150	2,318,667.950	
	CIT GROUP INC	30,698	34.490	1,058,774.020	
	DOLLAR GENERAL CORP	20,592	38.960	802,264.320	
	QEP RESOURCES INC	27,559	35.820	987,163.380	
	GENERAL MOTORS CO	116,861	22.700	2,652,744.700	
米ドル小計	銘柄数 : 568	49,009,720		1,809,710,464.780	
	組入時価比率 : 55.28%			(140,415,434,962)	
	合計時価比率 : 56.30%				
英ポンド	XSTRATA PLC	329,639	10.030	3,306,279.170	
	AMEC PLC	62,610	9.015	564,429.150	
	ANTOFAGASTA PLC	58,006	11.590	672,289.540	
	SEVERN TRENT PLC	38,266	15.760	603,072.160	
	BHP BILLITON PLC	331,594	19.565	6,487,636.610	
	BARCLAYS PLC	1,774,839	1.700	3,017,226.300	
	BALFOUR BEATTY PLC	92,571	2.344	216,986.420	
	BT GROUP PLC	1,219,556	1.884	2,297,643.500	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	168,273	7.385	1,242,696.100	
	AGGREKO PLC	36,191	17.720	641,304.520	
	TULLOW OIL PLC	141,420	13.370	1,890,785.400	
	BUNZL PLC	38,195	7.830	299,066.850	
	CAPITA GROUP PLC	102,099	6.590	672,832.410	
	AVIVA PLC	441,178	3.084	1,360,592.950	
	DIAGEO PLC	398,398	13.030	5,191,125.940	
	SCHRODERS PLC	10,497	13.040	136,880.880	
	NATIONAL GRID PLC	559,198	6.120	3,422,291.760	
	LONMIN	24,209	10.370	251,047.330	
	GKN PLC	127,870	1.898	242,697.260	
	KINGFISHER PLC	332,300	2.500	830,750.000	
	BAE SYSTEMS PLC	506,678	2.729	1,382,724.260	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	306,964	29.005	8,903,490.820	
	MAN GROUP PLC	309,687	1.433	443,781.470	
	COBHAM PLC	230,440	1.779	409,952.760	

	NEXT PLC	28,133	27.480	773,094.840	
	REXAM PLC	138,079	3.277	452,484.880	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	161,212	23.070	3,719,160.840	
	JOHNSON MATTHEY PLC	35,451	18.260	647,335.260	
	SABMILLER PLC	153,836	22.050	3,392,083.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	211,227	23.835	5,034,595.540	
	COMPASS GROUP PLC	308,183	5.545	1,708,874.730	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,787,567	4.969	13,851,420.420	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.033	941,910.060	
	ARM HOLDINGS PLC	215,348	6.240	1,343,771.520	
	CENTRICA PLC	793,221	2.972	2,357,452.810	
	UNILEVER PLC	203,532	20.400	4,152,052.800	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	359,061	3.178	1,141,095.850	
	INTL POWER PLC	244,870	3.321	813,213.270	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	105,557	6.170	651,286.690	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442,155	1.073	474,432.310	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,767	11.180	634,655.060	
	PEARSON PLC	131,717	11.190	1,473,913.230	
	PRUDENTIAL PLC	406,510	6.070	2,467,515.700	
	RIO TINTO PLC	221,992	34.190	7,589,906.480	
	VODAFONE GROUP PLC	8,044,546	1.778	14,303,202.780	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,980	32.010	3,136,339.800	
	REED ELSEVIER PLC	185,486	5.345	991,422.670	
	OLD MUTUAL PLC	854,991	1.076	919,970.310	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	290,446	7.095	2,060,714.370	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,454,043	0.211	517,803.070	
	SSE PLC	145,042	13.080	1,897,149.360	
	SERCO GROUP PLC	72,250	5.025	363,056.250	
	BP PLC	2,963,048	4.486	13,292,233.320	
	SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	2.761	607,856.230	
	INVENSYS PLC	143,358	2.109	302,342.020	
	SMITHS GROUP PLC	59,731	9.205	549,823.850	
	STANDARD CHARTERED PLC	381,264	13.900	5,299,569.600	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,572,100	0.271	1,781,039.100	
	BG GROUP PLC	528,071	13.795	7,284,739.440	
	TESCO PLC	1,284,831	4.001	5,140,608.830	
	3I GROUP PLC	140,522	1.989	279,498.250	
	SMITH & NEPHEW PLC	149,006	5.480	816,552.880	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	806,902	13.800	11,135,247.600	
	WEIR GROUP	34,823	18.630	648,752.490	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,822	8.465	235,513.230	
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	6.835	414,638.440	
	ASTRAZENECA PLC	219,774	28.430	6,248,174.820	
	WHITBREAD PLC	33,917	16.110	546,402.870	
	CARNIVAL PLC	30,375	21.460	651,847.500	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	262,929	3.226	848,208.950	
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	18.680	523,152.080	
	BURBERRY GROUP PLC	71,170	13.910	989,974.700	
	INVESTEC PLC	74,705	3.595	268,564.470	
	CAIRN ENERGY	224,914	2.859	643,029.120	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	49,316	10.630	524,229.080	
	VEDANTA RESOURCES PLC	16,418	11.310	185,687.580	
	ICAP PLC	87,128	3.581	312,005.360	
	ITV PLC	657,334	0.633	416,092.420	
	SAINSBURY (J) PLC	190,870	2.967	566,311.290	
	G4S PLC	231,452	2.449	566,825.940	
	ADMIRAL GROUP PLC	29,856	8.200	244,819.200	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	569,803	21.725	12,378,970.170	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	417,256	22.400	9,346,534.400	

	INMARSAT PLC	80,402	4.559	366,552.710	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	9.075	309,766.050	
	STANDARD LIFE PLC	325,057	2.033	660,840.880	
	EXPERIAN PLC	162,080	8.260	1,338,780.800	
	TUI TRAVEL PLC	96,617	1.560	150,722.520	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	37,820	6.725	254,339.500	
	FRESNILLO PLC NPR	33,218	18.290	607,557.220	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C SHRS	20,040,774	0.001	20,040.770	
	ESSAR ENERGY PLC	48,506	2.742	133,003.450	
	RESOLUTION LTD	274,318	2.631	721,730.650	
	SHIRE PLC	89,740	19.950	1,790,313.000	
	WPP PLC	189,654	6.510	1,234,647.540	
	WOLSELEY PLC	46,784	18.440	862,696.960	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	14,969	72.500	1,085,252.500	
	PETROFAC LTD	43,902	14.040	616,384.080	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	137,914	4.355	600,615.470	
英ポンド小計	銘柄数 : 99	65,925,112		216,099,987.590	
	組入時価比率 : 10.50%			(26,681,865,468)	
	合計時価比率 : 10.70%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	27,787	47.090	1,308,489.830	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	19,198	30.770	590,722.460	
	BARRICK GOLD CORP	159,936	52.020	8,319,870.720	
	TMX GROUP INC	12,892	44.310	571,244.520	
	TALISMAN ENERGY INC	167,312	13.960	2,335,675.520	
	BANK OF MONTREAL	102,997	56.870	5,857,439.390	
	BANK OF NOVA SCOTIA	173,004	50.990	8,821,473.960	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	68.760	1,754,067.600	
	BCE INC	40,524	39.390	1,596,240.360	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	83,101	28.620	2,378,350.620	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	50,390	42.190	2,125,954.100	
	BOMBARDIER INC 'B'	240,632	4.190	1,008,248.080	
	SAPUTO INC	23,636	40.200	950,167.200	
	RESEARCH IN MOTION LTD	74,198	17.870	1,325,918.260	
	CGI GROUP INC	44,501	20.120	895,360.120	
	CAE INC	57,414	10.140	582,177.960	
	CAMECO CORP	64,286	19.690	1,265,791.340	
	ROGERS COMM-CL B	65,502	37.950	2,485,800.900	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,175	71.450	4,442,403.750	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	175,064	37.140	6,501,876.960	
	NEXEN INC	86,198	16.960	1,461,918.080	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	12,753	62.000	790,686.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	60.750	833,793.750	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,527	80.590	5,844,950.930	
	AGRIUM INC	22,588	79.190	1,788,743.720	
	YAMANA GOLD INC	115,290	16.280	1,876,921.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,729	27.000	640,683.000	
	OPEN TEXT CORP	9,281	58.890	546,558.090	
	ELDORADO GOLD CORP	89,925	18.950	1,704,078.750	
	OSISKO MINING CORP	52,038	11.760	611,966.880	
	KINROSS GOLD CORP	173,556	14.060	2,440,197.360	
	FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	22.350	672,288.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	21,916	20.340	445,771.440	
	FORTIS INC	29,702	32.960	978,977.920	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,329	18.200	1,279,987.800	
	TELUS CORP-NON VOTE	30,640	51.030	1,563,559.200	
	GREAT WEST LIFECO INC	45,535	20.600	938,021.000	

	IAMGOLD CORP	65,070	21.320	1,387,292.400	
	IMPERIAL OIL LTD	50,996	41.770	2,130,102.920	
	ENBRIDGE INC	115,802	34.550	4,000,959.100	
	IGM FINANCIAL INC	19,774	42.790	846,129.460	
	IVANHOE MINES LTD/CA	43,708	20.380	890,769.040	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	268,208	12.010	3,221,178.080	
	LOBLAW CO LTD	17,526	38.430	673,524.180	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,573	20.280	863,380.440	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,674	27.300	373,300.200	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	36,714	34.140	1,253,415.960	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	83,291	21.550	1,794,921.050	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,141	415.000	1,303,515.000	
	INMET MINING CORPORATION	7,347	57.430	421,938.210	
	METRO INC	16,380	48.600	796,068.000	
	HUSKY ENERGY INC	48,615	24.530	1,192,525.950	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,557	41.730	1,483,793.610	
	NIKO RESOURCES LTD	7,050	54.700	385,635.000	
	ONEX CORP	17,569	34.090	598,927.210	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	21,311	26.440	563,462.840	
	GOLDCORP INC	127,538	52.300	6,670,237.400	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	137,099	47.000	6,443,653.000	
	POWER CORP OF CANADA	48,941	23.660	1,157,944.060	
	POWER FINANCIAL CORP	43,517	25.500	1,109,683.500	
	ROYAL BANK OF CANADA	221,173	45.000	9,952,785.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	51.200	1,074,483.200	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,563	62.180	1,527,327.340	
	SHAW COMM INC-B	56,820	20.300	1,153,446.000	
	SINO-FOREST CORP	38,862	4.810	186,926.220	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	42.840	1,464,099.840	
	NEW GOLD INC	62,801	11.760	738,539.760	
	SUNCOR ENERGY INC	250,475	31.610	7,917,514.750	
	ENCANA CORP	112,909	20.480	2,312,376.320	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	91,181	37.750	3,442,082.750	
	THOMSON REUTERS CORP	60,059	29.680	1,782,551.120	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	137,184	71.870	9,859,414.080	
	TRANSCANADA CORP	107,339	39.850	4,277,459.150	
	TRANSALTA CORP	34,014	21.560	733,341.840	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,627	68.080	519,246.160	
	CENTERRA GOLD INC	23,677	20.140	476,854.780	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	34,783	14.160	492,527.280	
	INTACT FINANCIAL CORP	17,942	58.600	1,051,401.200	
	SILVER WHEATON CORP	44,767	35.640	1,595,495.880	
	VITERRA INC NPR	76,444	10.490	801,897.560	
	PRECISION DRILLING CORP	30,296	11.670	353,554.320	
	BELL ALIANT INC	3,554	27.560	97,948.240	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,093	42.630	813,934.590	
	CI FINANCIAL CORP	23,137	20.780	480,786.860	
	TOURMALINE OIL CORP	15,696	33.200	521,107.200	
	TIM HORTONS INC	27,358	50.090	1,370,362.220	
	BAYTEX ENERGY CORP	18,200	53.530	974,246.000	
	MEG ENERGY CORP	17,166	44.000	755,304.000	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	43,032	13.200	568,022.400	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	118,611	33.100	3,926,024.100	
	ENERPLUS CORP	24,431	27.530	672,585.430	
	VERMILION ENERGY INC	10,515	48.310	507,979.650	

	PENN WEST PETROLEUM LTD	72,690	18.250	1,326,592.500	
	ARC RESOURCES LTD	42,391	24.870	1,054,264.170	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	76,612	20.570	1,575,908.840	
	BONAVISTA ENERGY CORP	22,644	26.280	595,084.320	
	PENGROWTH ENERGY CORP	55,901	10.390	580,811.390	
カナダドル小計	銘柄数 : 97	5,920,381		186,633,019.840	
	組入時価比率 : 5.60%			(14,219,569,782)	
	合計時価比率 : 5.70%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	33,938	9.900	335,986.200	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	181,466	21.880	3,970,476.080	
	SYNGENTA AG	14,963	269.100	4,026,543.300	
	NESTLE SA-REGISTERED	540,194	50.350	27,198,767.900	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	82,598	48.080	3,971,311.840	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	109,463	139.200	15,237,249.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,515	103.000	877,045.000	
	SIKA INHABER	363	1,570.000	569,910.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,476.000	1,270,836.000	
	SULZER AG-REG	4,702	100.300	471,610.600	
	NOVARTIS AG-REG SHS	363,924	49.540	18,028,794.960	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	68.200	612,708.800	
	SWISSCOM AG-REG	3,764	346.000	1,302,344.000	
	ABB LTD	348,410	16.390	5,710,439.900	
	ADECCO SA-REG	19,348	36.430	704,847.640	
	GEBERIT AG	4,882	182.100	889,012.200	
	LONZA GROUP AG-REG	9,112	51.950	473,368.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	57	2,725.000	155,325.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	14	33,200.000	464,800.000	
	UBS AG-REGISTERED	582,764	10.700	6,235,574.800	
	GIVAUDAN-REG	1,382	786.000	1,086,252.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	23,106	196.900	4,549,571.400	
	HOLCIM LTD-REG	37,527	50.450	1,893,237.150	
	ACTELION	19,725	31.020	611,869.500	
	SONOVA HOLDING AG	8,743	92.800	811,350.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,380	108.800	694,144.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,476	154.000	227,304.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,929	357.800	1,763,596.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,048	63.100	381,628.800	
	SCHINDLER NAMEN	4,151	104.900	435,439.900	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,952	98.300	486,781.600	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	4,772	66.500	317,338.000	
	ARYZTA AG	13,689	41.800	572,200.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	32.000	987,936.000	
	SWISS RE LTD	56,205	47.380	2,662,992.900	
	TRANSOCEAN LTD	49,804	45.100	2,246,160.400	
	SYNTHES INC	10,442	148.700	1,552,725.400	
スイスフラン小計	銘柄数 : 37	2,602,526		113,787,480.070	
	組入時価比率 : 3.83%			(9,728,829,546)	
	合計時価比率 : 3.90%				

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	13,787	733.000	10,105,871.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	94,686	135.700	12,848,890.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,097	121.800	7,807,014.600	
	ERICSSON LM-B SHS	480,317	66.500	31,941,080.500	
	GETINGE AB-B SHS	31,964	168.600	5,389,130.400	
	SKF AB-B SHS	63,179	134.800	8,516,529.200	
	SANDVIK AB	161,874	83.400	13,500,291.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	38.890	8,325,337.860	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	102.600	6,002,818.200	
	SWEDBANK AB	125,939	88.200	11,107,819.800	
	SSAB AB-A	26,362	59.050	1,556,676.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	75,229	97.950	7,368,680.550	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,081	177.400	13,319,369.400	
	VOLVO AB-B SHS	213,819	76.800	16,421,299.200	
	HOLMEN AB-B SHS	13,600	182.000	2,475,200.000	
	SCANIA AB	49,676	105.500	5,240,818.000	
	SWEDISH MATCH AB	37,451	218.000	8,164,318.000	
	TELE2 AB-B SHS	49,717	131.800	6,552,700.600	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,708	316.300	2,438,040.400	
	NORDEA AB	417,584	53.950	22,528,656.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,865	77.350	917,757.750	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	116.200	4,483,460.800	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	61.200	3,246,966.000	
	INVESTOR AB-B SHS	69,415	123.300	8,558,869.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	162,271	203.600	33,038,375.600	
	ASSA ABLOY AB-B	48,208	157.500	7,592,760.000	
	TELIASONERA AB	311,185	43.770	13,620,567.450	
	BOLIDEN AB	44,557	90.950	4,052,459.150	
	ALFA LAVAL AB	55,244	120.900	6,678,999.600	
	KINNEVIK INVESTMENT B	33,473	135.100	4,522,202.300	
	HUSQVARNA AB-B SHS	66,807	31.210	2,085,046.470	
	RATOS AB	33,804	80.100	2,707,700.400	
	HEXAGON AB	40,778	94.550	3,855,559.900	
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 33	3,243,897		296,971,267.330	
	組入時価比率 : 1.36%			(3,441,896,988)	
	合計時価比率 : 1.38%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	58,651	8.080	473,900.080	
	OMV AG	24,898	23.970	596,805.060	
	VERBUND AG	11,647	20.185	235,094.690	
	VOEST-ALPINE AG	17,613	22.825	402,016.720	
	ERSTE GROUP BANK AG	31,044	13.820	429,028.080	
	IMMOFINANZ AG	152,609	2.320	354,052.880	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	17.710	161,143.290	
	VIENNA INSURANCE GROUP	2,876	27.600	79,377.600	
	UMICORE	18,212	30.415	553,917.980	
	DELHAIZE GROUP	14,172	45.220	640,857.840	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	24,086	12.725	306,494.350	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	123,383	41.940	5,174,683.020	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
	SOLVAY SA	8,874	66.600	591,008.400	
	MOBISTAR SA	3,768	40.140	151,247.520	
	AGEAS	329,447	1.311	431,905.010	
	UCB SA	18,529	29.875	553,553.870	

	COLRUYT NV	14,070	30.195	424,843.650	
	BEKAERT NV	5,202	29.525	153,589.050	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	54.300	696,669.000	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.003	1.540	
	BELGACOM SA	23,896	22.920	547,696.320	
	BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD NPR	138,160	0.746	103,067.360	
	ADIDAS AG	32,662	49.940	1,631,140.280	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	52,537	57.610	3,026,656.570	
	COMMERZBANK AG	576,747	1.522	877,808.930	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	18,331	72.470	1,328,447.570	
	UNITED INTERNET	16,729	13.710	229,354.590	
	MAN SE	10,044	63.700	639,802.800	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	12,421	36.430	452,497.030	
	GEA GROUP AG	28,135	20.210	568,608.350	
	CONTINENTAL AG	13,432	53.230	714,985.360	
	DEUTSCHE POST AG-REG	117,890	11.170	1,316,831.300	
	AXEL SPRINGER AG	3,091	32.005	98,927.450	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	25,205	42.925	1,081,924.620	
	MERCK KGAA	9,951	70.930	705,824.430	
	RWE AG	66,471	28.765	1,912,038.310	
	RWE AG-N VTG PFD	6,189	26.430	163,575.270	
	SAP AG	147,577	43.680	6,446,163.360	
	E.ON AG	289,445	16.960	4,908,987.200	
	HENKEL AG & CO KGAA	20,540	34.450	707,603.000	
	METRO AG	23,577	34.230	807,040.710	
	SIEMENS AG-REG	127,787	72.410	9,253,056.670	
	BAYER AG	127,480	46.435	5,919,533.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,985	42.055	1,176,909.170	
	DAIMLER AG	139,121	33.240	4,624,382.040	
	BASF SE	141,340	50.200	7,095,268.000	
	CELESIO AG	20,040	11.035	221,141.400	
	BEIERSDORF AG	17,049	40.600	692,189.400	
	HOCHTIEF AG	6,942	49.285	342,136.470	
	HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	31.615	680,955.480	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	31,792	50.410	1,602,634.720	
	ALLIANZ SE	69,868	72.200	5,044,469.600	
	PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	10,199	14.855	151,506.140	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	9.510	352,801.980	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	29,962	88.100	2,639,652.200	
	SALZGITTER	6,090	38.295	233,216.550	
	VOLKSWAGEN AG	4,995	114.200	570,429.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	23,174	126.150	2,923,400.100	
	THYSSENKRUPP AG	55,869	19.755	1,103,692.090	
	TUI AG	18,532	4.118	76,314.770	
	LINDE AG	25,761	107.650	2,773,171.650	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	148,629	27.400	4,072,434.600	
	BMW VORZUG	9,751	39.260	382,824.260	
	K & S	28,708	42.400	1,217,219.200	
	SUEDZUCKER AG	11,295	19.885	224,601.070	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	447,100	9.114	4,074,869.400	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	176,053	6.514	1,146,809.240	
	FRAPORT AG	5,722	45.580	260,808.760	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	14,055	39.885	560,583.670	
	WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	69.560	169,935.080	
	DEUTSCHE BOERSE AG NEW	32,038	40.350	1,292,733.300	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12,123	42.660	517,167.180	

	BRENNTAG AG	6,654	68.980	458,992.920	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	53,464	11.150	596,123.600	
	IBERDROLA SA	622,371	4.790	2,981,157.090	
	INDRA SISTEMAS SA	18,451	11.600	214,031.600	
	REPSOL YPF SA	118,170	21.785	2,574,333.450	
	TELEFONICA S.A	637,703	13.940	8,889,579.820	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	26,031	25.675	668,345.920	
	BANKINTER S.A.	41,581	4.015	166,947.710	
	ACERINOX SA	17,369	9.490	164,831.810	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	690,712	5.891	4,068,984.390	
	ACCIONA S.A.	5,469	67.390	368,555.910	
	GAS NATURAL SDG SA	57,849	12.855	743,648.890	
	BANCO SANTANDER SA	1,305,741	5.575	7,279,506.070	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	18,194	33.130	602,767.220	
	ZARDOYA OTIS	9,251	9.500	87,884.500	
	FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	10,230	17.955	183,679.650	
	BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	3.005	440,584.080	
	BANCO SABADELL	189,828	2.401	455,777.020	
	INDITEX	34,196	63.550	2,173,155.800	
	MAPFRE SA	118,488	2.449	290,177.110	
	ENAGAS	25,191	13.480	339,574.680	
	GRIFOLS SA	24,016	12.400	297,798.400	
	FERROVIAL SA	67,375	9.097	612,910.370	
	CAIXABANK	149,185	3.540	528,114.900	
	EDP RENOVAVEIS SA	38,800	4.341	168,430.800	
	AMADEUS IT HOLDING SA	52,881	12.545	663,392.140	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	167,491	1.655	277,197.600	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	85,939	3.113	267,528.100	
	BANKIA SAU	140,798	3.510	494,200.980	
	KESKO OYJ-B	14,237	24.230	344,962.510	
	WARTSILA OYJ	26,436	21.010	555,420.360	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	17,124	25.970	444,710.280	
	OUTOKUMPU OYJ	22,458	5.600	125,764.800	
	UPM-KYMMENE OYJ	79,405	8.120	644,768.600	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	88,398	4.258	376,398.680	
	SAMPO OYJ-A SHS	59,871	19.050	1,140,542.550	
	FORTUM OYJ	70,526	17.330	1,222,215.580	
	NOKIA OYJ	597,512	4.740	2,832,206.880	
	POHJOLA BANK PLC	23,199	6.960	161,465.040	
	ELISA CORP	20,563	15.150	311,529.450	
	METSO OYJ	21,261	27.200	578,299.200	
	NESTE OIL OYJ	23,509	8.385	197,122.960	
	KONE OYJ	28,457	40.060	1,139,987.420	
	ORION OYJ	18,031	14.300	257,843.300	
	AIR LIQUIDE	45,153	88.920	4,015,004.760	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,253	20.970	1,389,325.410	
	ERAMET	959	104.950	100,647.050	
	AXA	266,452	10.200	2,717,810.400	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	60,532	9.145	553,565.140	
	DANONE	92,643	48.190	4,464,466.170	
	SAFRAN SA	25,102	22.915	575,212.330	
	ACCOR SA	26,806	20.685	554,482.110	
	BOUYGUES	38,432	25.075	963,682.400	
	BNP PARIBAS	147,653	30.510	4,504,893.030	
	THALES SA	18,903	24.320	459,720.960	
	CAP GEMINI SA	24,414	27.620	674,314.680	

	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	63.620	417,792.540	
	CHRISTIAN DIOR	8,931	96.290	859,965.990	
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	16.900	397,859.800	
	ALCATEL-LUCENT	384,592	1.488	572,272.890	
	NATIXIS	130,004	2.120	275,608.480	
	EIFFAGE	6,803	21.360	145,312.080	
	PUBLICIS GROUPE	16,326	35.245	575,409.870	
	IMERYS SA	5,944	37.810	224,742.640	
	LAFARGE SA	32,630	27.335	891,941.050	
	L'OREAL	38,417	77.570	2,980,006.690	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	40,582	114.550	4,648,668.100	
	LAGARDERE S.C.A.	17,950	17.690	317,535.500	
	MICHELIN(CGDE) -B	28,505	48.810	1,391,329.050	
	PERNOD-RICARD	32,110	67.760	2,175,773.600	
	PEUGEOT SA	22,742	13.800	313,839.600	
	RENAULT SA	31,545	27.660	872,534.700	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,891	29.990	1,856,111.090	
	SOCIETE GENERALE-A	98,243	18.100	1,778,198.300	
	VINCI S.A.	67,944	32.050	2,177,605.200	
	SODEXO	11,780	51.880	611,146.400	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	77,535	38.825	3,010,296.370	
	VIVENDI SA	195,314	15.465	3,020,531.010	
	TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,942	66.140	1,054,403.880	
	TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	21,519	9.051	194,768.460	
	TOTAL SA	331,195	37.005	12,255,870.970	
	AIR FRANCE	24,369	4.621	112,609.140	
	VALLOUREC	16,588	45.955	762,301.540	
	FRANCE TELECOM SA	295,145	12.460	3,677,506.700	
	BIC	3,946	63.100	248,992.600	
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	58.960	581,463.520	
	PPR	11,855	108.450	1,285,674.750	
	CNP ASSURANCES	35,379	10.600	375,017.400	
	NEOPOST SA	6,872	55.330	380,227.760	
	CARREFOUR SA	85,148	19.395	1,651,445.460	
	ATOS	6,851	33.520	229,645.520	
	SANOFI	173,286	49.070	8,503,144.020	
	STMICROELECTRONICS NV	97,120	5.216	506,577.920	
	M6-METROPOLE TELEVISION	12,723	11.750	149,495.250	
	EURAZEO	5,093	31.175	158,774.270	
	JC DECAUX INTERNATIONAL	5,294	18.645	98,706.630	
	ESSILOR INTL	29,746	51.750	1,539,355.500	
	CREDIT AGRICOLE SA	157,236	4.900	770,456.400	
	WENDEL	5,950	49.235	292,948.250	
	ILIAD SA	3,225	83.450	269,126.250	
	GDF SUEZ	198,651	19.975	3,968,053.720	
	ALSTOM	33,600	25.695	863,352.000	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	29.030	506,573.500	
	ELECTRICITE DE FRANCE	44,389	20.685	918,186.460	
	ARKEMA SA	9,569	46.625	446,154.620	
	LEGRAND SA	27,939	23.905	667,881.790	
	ADP	7,089	53.930	382,309.770	
	SCOR SE	19,110	16.720	319,519.200	
	BUREAU VERITAS SA	7,690	52.440	403,263.600	
	GROUPE EUROTUNNEL SA	89,249	6.200	553,343.800	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	31,607	10.120	319,862.840	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	EDENRED	27,224	19.120	520,522.880	
	ALPHA BANK A.E.	71,683	1.050	75,267.150	

	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	35,569	13.300	473,067.700	
	NATIONAL BANK OF GREECE	149,407	2.040	304,790.280	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	33,942	3.410	115,742.220	
	OPAP SA	45,577	6.900	314,481.300	
	CRH PLC	115,757	13.050	1,510,628.850	
	KERRY GROUP PLC-A	24,173	26.000	628,498.000	
	ELAN CORPORATION PLC	89,094	8.120	723,443.280	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.132	12,053.710	
	ASSICURAZIONI GENERALI	185,488	12.140	2,251,824.320	
	INTESA SANPAOLO	1,614,798	1.179	1,903,846.840	
	INTESA SANPAOLO-RNC	137,310	0.952	130,719.120	
	UNICREDIT SPA	2,145,108	0.782	1,677,474.450	
	ENI SPA	386,460	15.490	5,986,265.400	
	MEDIOBANCA SPA	81,452	5.505	448,393.260	
	PIRELLI & C	43,558	6.750	294,016.500	
	SAIPEM	41,590	31.790	1,322,146.100	
	LUXOTTICA GROUP SPA	22,387	20.770	464,977.990	
	MEDIASET SPA	120,446	2.194	264,258.520	
	AUTOGRILL SPA	29,172	8.135	237,314.220	
	A2A SPA	12,432	0.895	11,126.640	
	FIAT SPA	119,079	4.110	489,414.690	
	ENEL SPA	1,035,843	3.184	3,298,124.110	
	FINMECCANICA SPA	67,914	4.430	300,859.020	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	777,770	0.283	220,108.910	
	SNAM RETE GAS	270,029	3.340	901,896.860	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	123,631	2.570	317,731.670	
	TELECOM ITALIA SPA	1,374,164	0.846	1,162,542.740	
	TELECOM ITALIA-RNC	897,290	0.717	643,356.930	
	ATLANTIA SPA	54,105	10.590	572,971.950	
	TERNA SPA	229,678	2.716	623,805.440	
	EXOR SPA	8,976	15.260	136,973.760	
	PRYSMIAN SPA	34,257	10.510	360,041.070	
	BANCO POPOLARE SPA	246,216	0.987	243,015.190	
	ENEL GREEN POWER SPA	261,859	1.648	431,543.630	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	6.340	754,960.860	
	ARCELOR MITTAL (NL)	128,901	13.750	1,772,388.750	
	TENARIS SA	72,386	12.680	917,854.480	
	SES FDR	46,853	18.135	849,679.150	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	12,092	24.885	300,909.420	
	REED ELSEVIER NV	112,391	8.875	997,470.120	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,732	36.340	717,060.880	
	SBM OFFSHORE NV	23,374	15.450	361,128.300	
	ING GROEP NV-CVA	616,219	5.670	3,493,961.730	
	RANDSTAD HOLDINGS	17,460	21.745	379,667.700	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	186,470	9.049	1,687,367.030	
	HEINEKEN NV	40,830	33.690	1,375,562.700	
	AKZO NOBEL	35,469	35.940	1,274,755.860	
	ASML HOLDING NV	67,745	29.710	2,012,703.950	
	AEGON NV	277,959	3.181	884,187.570	
	POSTNL	57,215	2.656	151,963.040	
	UNILEVER NV-CVA	250,811	24.270	6,087,182.970	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	151,680	14.290	2,167,507.200	
	WOLTERS KLUWER-CVA	41,659	12.535	522,195.560	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	QIAGEN N.V.	47,970	10.355	496,729.350	
	VOPAK (KON.)	11,504	39.065	449,403.760	
	KONINKLIJKE KPN NV	251,126	9.584	2,406,791.580	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	29.490	553,527.300	
	FUGRO CERT	10,228	39.560	404,619.680	
	TNT EXPRESS NV W/I	70,112	5.080	356,168.960	
	DELTA LLOYD NV	12,117	12.010	145,525.170	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	83,470	1.250	104,337.500	
	JERONIMO MARTINS	40,183	12.880	517,557.040	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	101,404	4.900	496,879.600	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,886	2.300	724,237.800	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	511,426	0.100	51,142.600	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	35,756	14.850	530,976.600	
ユーロ小計	銘柄数 : 253	29,164,771		307,721,778.070	
	組入時価比率 : 12.77%			(32,440,029,844)	
	合計時価比率 : 13.01%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	17,266	384.300	6,635,323.800	
	A P MOLLER A/S	192	34,440.000	6,612,480.000	
	AP MOLLER MAERSK A	100	32,720.000	3,272,000.000	
	DANSKE BANK A/S	105,158	70.150	7,376,833.700	
	NOVOZYMES-B SHS	8,613	809.500	6,972,223.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,358	600.000	39,214,800.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,950	75.150	2,250,742.500	
	TDC A/S	58,423	44.890	2,622,608.470	
	COLOPLAST-B	3,308	841.000	2,782,028.000	
	DSV A/S	29,112	103.000	2,998,536.000	
	WILLIAM DEMANT	3,754	415.200	1,558,660.800	
	TRYG A/S	6,415	299.500	1,921,292.500	
	PANDORA A/S	8,956	50.350	450,934.600	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 13	336,605		84,668,463.870	
	組入時価比率 : 0.47%			(1,199,752,133)	
	合計時価比率 : 0.48%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	46,984	193.600	9,096,102.400	
	ACERGY SA	43,150	109.800	4,737,870.000	
	DNB HOLDING ASA	149,250	62.550	9,335,587.500	
	NORSK HYDRO ASA	138,196	28.530	3,942,731.880	
	TELENOR ASA	115,972	97.350	11,289,874.200	
	ORKLA ASA	129,845	40.950	5,317,152.750	
	STATOIL ASA	181,422	144.900	26,288,047.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,891	255.200	7,372,983.200	
	AKER SOLUTIONS ASA	25,474	65.900	1,678,736.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48,039	62.700	3,012,045.300	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 10	907,223		82,071,131.630	
	組入時価比率 : 0.44%			(1,115,346,679)	
	合計時価比率 : 0.45%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	142,000	22.300	3,166,600.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	40,500	34.800	1,409,400.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	358,000	26.050	9,325,900.000	
	BANK OF EAST ASIA	262,660	27.700	7,275,682.000	
	CLP HOLDINGS LTD	311,500	69.200	21,555,800.000	
	PCCW LTD	581,000	3.100	1,801,100.000	

	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	193,000	13.860	2,674,980.000	
	LI & FUNG LTD	846,400	14.220	12,035,808.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	223,000	91.550	20,415,650.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	76,000	44.700	3,397,200.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	165,900	127.100	21,085,890.000	
	MTR CORP	257,000	25.100	6,450,700.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	350,237	9.500	3,327,251.500	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	46.200	6,237,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	123,500	96.100	11,868,350.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	178,000	40.600	7,226,800.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	217,500	59.550	12,952,125.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	234,750	41.050	9,636,487.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	747,050	17.760	13,267,608.000	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	343,000	70.450	24,164,350.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	97,000	25.350	2,458,950.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	220,000	15.460	3,401,200.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	123,500	28.900	3,569,150.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	590,000	17.420	10,277,800.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	85,800	7.230	620,334.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.780	3,399,400.000	
	SINO LAND CO	389,400	10.240	3,987,456.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	224,000	100.900	22,601,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	120,500	94.650	11,405,325.000	
	WING HANG BANK LTD	36,000	66.800	2,404,800.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	169,000	22.750	3,844,750.000	
	SJM HOLDINGS LTD	290,000	13.300	3,857,000.000	
	AIA GROUP LTD	1,341,600	23.900	32,064,240.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT CO LTD RTS	366,900	1.480	543,012.000	
	ASM PACIFIC TECH	23,800	81.650	1,943,270.000	
	WYNN MACAU LTD	250,400	21.450	5,371,080.000	
	SANDS CHINA LTD	361,200	23.150	8,361,780.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 37	10,705,097		319,385,829.000	
	組入時価比率 : 1.25%			(3,184,276,715)	
	合計時価比率 : 1.28%				
シンガポール・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	887,400	1.685	1,495,269.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,431,640	0.660	944,882.400	
	SINGAPORE TECH ENG	272,000	2.810	764,320.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	92,000	4.180	384,560.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.860	1,007,460.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	272,000	12.590	3,424,480.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	10.250	902,000.000	
	SEMBCORP MARINE	79,000	3.950	312,050.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	45.660	821,880.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	6.380	899,580.000	
	CAPITALAND LTD	390,000	2.640	1,029,600.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	180,500	6.090	1,099,245.000	
	KEPPEL CORP LTD	232,500	9.130	2,122,725.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	114,000	1.405	160,170.000	
	NEPTUNE ORIENT	127,750	1.040	132,860.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	646,763	1.180	763,180.340	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	391,200	8.300	3,246,960.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,264,867	3.180	4,022,277.060	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	87,400	11.110	971,014.000	
	KEPPEL LAND LTD	116,000	2.660	308,560.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	202,000	15.870	3,205,740.000	
	STARHUB LTD	54,000	2.880	155,520.000	

	OLAM INTERNATIONAL LTD	302,800	2.440	738,832.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	322,000	5.170	1,664,740.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	278,000	0.950	264,100.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	215,000	1.330	285,950.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	1.710	432,630.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 27	8,719,820		31,560,584.800	
	組入時価比率 : 0.75%			(1,893,635,088)	
	合計時価比率 : 0.76%				
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	155,225	12.750	1,979,118.750	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	170,143	11.550	1,965,151.650	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	282,651	7.700	2,176,412.700	
	PARTNER COMMUNICATIONS	24,254	40.990	994,171.460	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	206,948	5.630	1,165,117.240	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	83,599	41.900	3,502,798.100	
	NICE SYSTEMS LTD	9,608	125.300	1,203,882.400	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	149,776	153.400	22,975,638.400	
	ISRAEL CORP LTD/THE	548	2,540.000	1,391,920.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	33,542	30.850	1,034,770.700	
イスラエル・シュケル小計	銘柄数 : 10	1,116,294		38,388,981.400	
	組入時価比率 : 0.31%			(797,723,033)	
	合計時価比率 : 0.32%				
オーストラリアドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	23,959	19.460	466,242.140	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	400,543	20.520	8,219,142.360	
	AMCOR LTD	210,271	7.050	1,482,410.550	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	466,685	20.860	9,735,049.100	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	204,785	4.690	960,441.650	
	TELSTRA CORP LTD	677,536	3.110	2,107,136.960	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	9.200	516,865.200	
	AMP LTD	449,927	4.260	1,916,689.020	
	LYNAS CORP LTD	243,389	1.170	284,765.130	
	ASX LTD	29,737	30.250	899,544.250	
	BHP BILLITON LTD	502,804	37.480	18,845,093.920	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	13.160	279,413.120	
	COMPUTERSHARE LT	53,329	8.030	428,231.870	
	CSL LIMITED	74,688	30.400	2,270,515.200	
	TRANSURBAN GROUP	198,917	5.350	1,064,205.950	
	COCA-COLA AMATIL LTD	93,286	11.950	1,114,767.700	
	COCHLEAR LTD	8,596	52.500	451,290.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	155,402	14.130	2,195,830.260	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	242,201	48.830	11,826,674.830	
	BORAL LIMITED	107,619	3.480	374,514.120	
	RIO TINTO LIMITED	65,964	68.880	4,543,600.320	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	339,591	3.010	1,022,168.910	
	ONESTEEL LIMITED	224,361	0.995	223,239.190	
	FOSTER'S GROUP LTD	337,000	5.320	1,792,840.000	
	MACARTHUR COAL LTD	23,475	16.210	380,529.750	
	OZ MINERALS LTD	55,513	11.030	612,308.390	
	ORICA LTD	48,570	25.500	1,238,535.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	362,918	0.925	335,699.150	

	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	20.120	437,750.840	
	BLUESCOPE STEEL LTD	255,174	0.740	188,828.760	
	MAP GROUP	76,167	3.480	265,061.160	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,238	23.200	1,304,721.600	
	WORLEYPARSONS LTD	28,202	27.400	772,734.800	
	SUNCORP GROUP LTD	211,551	8.450	1,787,605.950	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	348,981	24.530	8,560,503.930	
	NEWCREST MINING LTD	121,376	36.400	4,418,086.400	
	PALADIN ENERGY LTD	117,788	1.445	170,203.660	
	INCITEC PIVOT LTD	270,689	3.480	941,997.720	
	TOLL HOLDINGS LTD	119,945	4.820	578,134.900	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	1.580	282,881.620	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	169,191	13.950	2,360,214.450	
	SANTOS LTD	140,142	13.180	1,847,071.560	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	27,467	12.870	353,500.290	
	SONIC HEALTHCARE	64,654	10.870	702,788.980	
	TABCORP HOLDINGS LTD	129,307	2.830	365,938.810	
	WESFARMERS LTD	156,607	32.750	5,128,879.250	
	ALUMINA LIMITED	397,286	1.470	584,010.420	
	ILUKA RESOURCES LIM	71,975	17.100	1,230,772.500	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	101,123	35.750	3,615,147.250	
	WOOLWORTHS LTD	184,799	24.470	4,522,031.530	
	METCASH LTD	73,223	4.220	309,001.060	
	TATTS GROUP LTD	237,678	2.350	558,543.300	
	AGL ENERGY LTD	78,197	14.730	1,151,841.810	
	BRAMBLES LTD	257,796	6.650	1,714,343.400	
	ASCIANO LTD	485,711	1.485	721,280.830	
	WESFARMERS LTD-PPS	27,301	33.040	902,025.040	
	CROWN LTD	81,750	8.140	665,445.000	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	113,618	3.760	427,203.680	
	QR NATIONAL LTD	278,184	3.350	931,916.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	70,178	6.050	424,576.900	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 60	10,631,573		123,812,787.840	
	組入時価比率 : 3.83%			(9,732,923,252)	
	合計時価比率 : 3.90%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	165,935	6.280	1,042,071.800	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	407,280	2.695	1,097,619.600	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	573,215		2,139,691.400	
	組入時価比率 : 0.05%			(128,766,628)	
	合計時価比率 : 0.05%				
合計				244,980,050,118	
				(244,980,050,118)	

(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. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	294,800.00	515,900.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.00	585,893.880	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	590,706.00	1,101,793.880	
	組入時価比率 : 0.03%		(66,107,632)	

	合計時価比率： 0.03%			
	MIRVAC GROUP	612,711.00	775,079.410	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	603,101.380	
	GPT GROUP	292,236.00	911,776.320	
	LEND LEASE GROUP	89,837.00	662,997.060	
	STOCKLAND	357,887.00	1,159,553.880	
	WESTFIELD GROUP	354,089.00	2,786,680.430	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	746,520.160	
	GOODMAN GROUP	1,183,581.00	727,902.310	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	474,804.00	1,196,506.080	
オーストラリアドル小計	銘柄数： 9	4,577,089.00	9,570,117.030	
	組入時価比率： 0.30%		(752,306,899)	
	合計時価比率： 0.30%			
投資信託受益証券計			818,414,531	
			(818,414,531)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,201.00	2,213,143.390	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	144,552.00	2,341,742.400	
	PROLOGIS INC	68,983.00	1,879,096.920	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,805.00	1,727,419.650	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	435,296.140	
	EQUITY RESIDENTIAL	44,402.00	2,543,790.580	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	874,991.040	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	72,923.00	1,031,131.220	
	HCP INC	66,067.00	2,491,386.570	
	HEALTH CARE REIT INC	24,501.00	1,214,024.550	
	RAYONIER INC	14,915.00	606,443.900	
	KIMCO REALTY	66,054.00	1,062,148.320	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	18,875.00	589,088.750	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	965,286.070	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	108,265.00	1,447,503.050	
	PLUM CREEK TIMBER CO	29,979.00	1,083,740.850	
	REGENCY	15,096.00	565,345.200	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,670.00	5,872,952.800	
	PUBLIC STORAGE	21,726.00	2,695,762.080	
	VENTAS INC	40,444.00	2,132,207.680	
	VORNADO REALTY TRUST	24,478.00	1,909,528.780	
米ドル小計	銘柄数： 21	913,016.00	35,682,029.940	
	組入時価比率： 1.09%		(2,768,568,703)	
	合計時価比率： 1.11%			
	BRITISH LAND CO PLC	155,704.00	764,662.340	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	396,240.120	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.00	728,199.460	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	83,396.00	258,694.390	
	SEGRO PLC	122,102.00	282,910.330	
英ポンド小計	銘柄数： 5	570,822.00	2,430,706.640	
	組入時価比率： 0.12%		(300,119,349)	
	合計時価比率： 0.12%			
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	49,605.00	798,640.500	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	17,832.00	444,195.120	
カナダドル小計	銘柄数： 2	67,437.00	1,242,835.620	

	組入時価比率： 0.04%		(94,691,646)	
	合計時価比率： 0.04%			
	GECINA SA	3,258.00	208,512.000	
	ICADE EMGP	4,185.00	259,804.800	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,804.00	1,994,839.000	
	KLEPIERRE	10,661.00	236,567.590	
	FONCIERE DES REGIONS	4,045.00	196,182.500	
	CORIO NV	12,066.00	407,468.820	
ユーロ小計	銘柄数： 6	49,019.00	3,303,374.710	
	組入時価比率： 0.14%		(348,241,762)	
	合計時価比率： 0.14%			
	LINK REIT/THE	371,500.00	10,402,000.000	
香港ドル小計	銘柄数： 1	371,500.00	10,402,000.000	
	組入時価比率： 0.04%		(103,707,940)	
	合計時価比率： 0.04%			
投資証券計			3,615,329,400	
			(3,615,329,400)	
合計			4,433,743,931	
			(4,433,743,931)	

(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. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 568銘柄	55.28%	56.30%
米ドル	投資証券 21銘柄	1.09%	1.11%
英ポンド	株式 99銘柄	10.50%	10.70%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.12%	0.12%
カナダドル	株式 97銘柄	5.60%	5.70%
カナダドル	投資証券 2銘柄	0.04%	0.04%
スイスフラン	株式 37銘柄	3.83%	3.90%
スウェーデンクローネ	株式 33銘柄	1.36%	1.38%
ユーロ	株式 253銘柄	12.77%	13.01%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.14%	0.14%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	0.47%	0.48%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.44%	0.45%
香港ドル	株式 37銘柄	1.25%	1.28%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.04%	0.04%
シンガポール・ドル	株式 27銘柄	0.75%	0.76%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.03%	0.03%
イスラエル・シェケル	株式 10銘柄	0.31%	0.32%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	3.83%	3.90%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 9銘柄	0.30%	0.30%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	0.05%	0.05%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,824,798,087	1,430,737,889
国債証券		333,831,594,400	317,851,977,200
地方債証券		29,228,730,406	28,110,352,112
特殊債券		40,095,665,509	36,949,635,934
社債券		31,927,617,810	29,551,388,540
未収利息		1,444,231,140	1,381,931,890
前払費用		63,783,688	56,713,474
流動資産合計		438,416,421,040	415,332,737,039
資産合計		438,416,421,040	415,332,737,039
負債の部			
流動負債			
未払金		626,051,000	-
未払解約金		191,991,000	201,558,000
流動負債合計		818,042,000	201,558,000
負債合計		818,042,000	201,558,000
純資産の部			
元本等			
元本		390,026,049,070	364,643,942,666
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		47,572,329,970	50,487,236,373
元本等合計		437,598,379,040	415,131,179,039
純資産合計		437,598,379,040	415,131,179,039
負債純資産合計		438,416,421,040	415,332,737,039

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	376,475,625,210円	390,026,049,070円
同期中追加設定元本額	34,351,687,871円	18,897,285,868円
同期中解約元本額	20,801,264,011円	44,279,392,272円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	5,578,446,389円	5,373,886,627円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	7,621,652,873円	8,226,701,665円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	2,606,925,644円	2,661,718,935円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	4,163,612,218円	4,110,156,626円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,670,813,298円	1,626,765,581円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	1,184,961,483円	1,191,394,109円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,184,021,688円	1,190,606,149円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	152,558,937円	152,558,937円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	210,060,360円	195,601,240円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,997,318,834円	2,041,174,757円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,615,710円	7,211,845円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	19,556,937,908円	19,626,913,453円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	110,596,194円	110,129,562円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	885,666,248円	807,217,549円
D I A Mグローバル・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家限定）	13,159,623,952円	12,010,753,758円
D I A Mグローバル・バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	753,800,740円	656,533,368円
D I A M国際分散バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	503,224,565円	456,224,693円
D I A M国際分散バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	1,235,946,603円	1,126,422,012円
D I A M国内重視バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家限定）	547,289,468円	507,270,884円
D I A M国内重視バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	394,722,768円	360,517,758円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限定）	30,703,952,254円	28,077,662,335円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限定）	10,253,010,882円	9,302,326,174円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	14,113,483,025円	12,961,527,805円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	5,324,630,684円	4,818,550,119円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,374,145,643円	7,428,515,475円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A（適格機関投資家限定）	1,914,262,905円	1,700,853,205円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	6,746,165,440円	6,185,022,419円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	8,217,667,368円	7,594,920,927円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A（適格機関投資家 向け）	14,579,213,261円	13,828,161,253円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	745,905,317円	708,137,610円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	622,553,631円	- 円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限定）	15,032,672,067円	13,721,554,392円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	7,257,000,221円	6,823,139,570円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A（適格機関投資家限定）	1,518,465,811円	1,440,894,846円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	111,745,669,864円	103,831,099,275円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A（適格機関投 資家限定）	2,817,920,538円	2,548,894,856円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A（適格機関投 資家限定）	10,288,913,939円	9,572,960,140円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	33,835,535,829円	31,681,864,688円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	2,325,697,630円	2,208,694,874円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	251,854円	236,701円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	158,385円	145,905円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	36,880,583,622円	34,668,637,603円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	781,218,042円	762,537,936円
D I A M国内バランス3 0 V A （適格機関投資家限定）	186,418,417円	193,952,296円

D I A Mバランス 2 0 V A（適格機関投資家限定）	2,200,200,754円	2,103,369,036円
D I A Mバランス 4 0 V A（適格機関投資家限定）	328,421円	312,378円
D I A Mバランス 6 0 V A（適格機関投資家限定）	240,505円	224,459円
（合 計）	390,026,049,070円	364,643,942,666円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	390,026,049,070口	364,643,942,666口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	4,035,965,300	7,254,915,700
地方債証券	204,935,314	302,987,487
特殊債券	232,433,755	369,359,683
社債券	282,824,140	627,146,900
合計	4,190,510,229	7,300,115,970

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1220円 (11,220円)	1.1385円 (11,385円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	2 9 9 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,001,720,000	
	3 0 0 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,001,960,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,002,120,000	
	3 0 2 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,002,100,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券（2 年）	1,500,000,000	1,501,680,000	
	3 0 4 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,002,380,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券（2 年）	3,000,000,000	3,003,540,000	
	3 0 6 回 利付国庫債券（2 年）	2,000,000,000	2,002,480,000	
	3 0 7 回 利付国庫債券（2 年）	2,200,000,000	2,202,860,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券（2 年）	1,000,000,000	999,520,000	
	6 8 回 利付国庫債券（5 年）	2,000,000,000	2,021,380,000	
	6 9 回 利付国庫債券（5 年）	3,800,000,000	3,832,338,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5 年）	4,900,000,000	4,944,541,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5 年）	4,200,000,000	4,291,392,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5 年）	4,600,000,000	4,682,064,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5 年）	3,500,000,000	3,555,860,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5 年）	4,500,000,000	4,569,795,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5 年）	3,400,000,000	3,466,266,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5 年）	3,500,000,000	3,553,480,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5 年）	4,000,000,000	4,038,720,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5 年）	3,500,000,000	3,533,635,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5 年）	4,500,000,000	4,526,415,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5 年）	1,700,000,000	1,709,367,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5 年）	3,000,000,000	3,005,130,000	
	9 3 回 利付国庫債券（5 年）	4,300,000,000	4,339,130,000	
	9 5 回 利付国庫債券（5 年）	2,000,000,000	2,026,120,000	
	9 6 回 利付国庫債券（5 年）	1,500,000,000	1,513,170,000	
	9 7 回 利付国庫債券（5 年）	5,500,000,000	5,519,910,000	
	9 9 回 利付国庫債券（5 年）	2,500,000,000	2,507,125,000	
	2 回 利付国庫債券（4 0 年）	600,000,000	615,132,000	
	3 回 利付国庫債券（4 0 年）	1,000,000,000	1,023,410,000	
	4 回 利付国庫債券（4 0 年）	300,000,000	305,148,000	
	2 4 6 回 利付国庫債券（1 0 年）	1,900,000,000	1,914,098,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（1 0 年）	700,000,000	706,363,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（1 0 年）	2,060,000,000	2,072,092,200	
	2 5 4 回 利付国庫債券（1 0 年）	2,700,000,000	2,763,072,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（1 0 年）	2,500,000,000	2,566,000,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（1 0 年）	1,000,000,000	1,027,050,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（1 0 年）	2,100,000,000	2,178,876,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（1 0 年）	2,700,000,000	2,810,052,000	

	2 6 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,700,000,000	3,838,232,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	1,500,000,000	1,554,210,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	1,900,000,000	1,972,409,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,100,000,000	2,191,518,000	
	2 7 4 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,400,000,000	2,518,992,000	
	2 7 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,000,000,000	3,168,420,000	
	2 8 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,800,000,000	3,001,544,000	
	2 8 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,400,000,000	3,622,054,000	
	2 8 4 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,100,000,000	3,309,405,000	
	2 8 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,400,000,000	4,706,416,000	
	2 8 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,700,000,000	3,984,382,000	
	2 8 8 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,600,000,000	3,863,916,000	
	2 8 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,400,000,000	4,676,760,000	
	2 9 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,200,000,000	3,383,200,000	
	2 9 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	5,000,000,000	5,419,950,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,000,000,000	4,260,440,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,200,000,000	3,388,000,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,100,000,000	4,310,822,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	3,800,000,000	4,046,848,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,800,000,000	2,957,808,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,300,000,000	4,502,745,000	
	3 0 6 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,500,000,000	4,740,705,000	
	3 0 8 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	1,800,000,000	1,877,634,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,500,000,000	2,565,450,000	
	3 1 0 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	4,500,000,000	4,568,670,000	
	3 1 2 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	5,700,000,000	5,868,378,000	
	3 1 3 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	6,500,000,000	6,732,700,000	
	3 1 5 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	6,500,000,000	6,660,355,000	
	3 1 7 回 利付国庫債券（ 1 0 年 ）	2,000,000,000	2,026,080,000	
	1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	100,000,000	118,049,000	
	2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	100,000,000	111,701,000	
	3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	220,146,000	
	4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	239,646,000	
	5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	216,392,000	
	6 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	223,236,000	
	7 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	300,000,000	329,625,000	
	8 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	500,000,000	505,780,000	
	1 1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	400,000,000	396,244,000	
	1 2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	300,000,000	318,351,000	
	1 3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	300,000,000	312,696,000	
	1 4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	500,000,000	557,115,000	
	1 5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	226,670,000	
	1 6 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	400,000,000	453,772,000	
	1 7 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	223,030,000	
	1 8 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	820,000,000	899,203,800	
	1 9 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	200,000,000	219,282,000	
	2 0 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	300,000,000	340,140,000	
	2 1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	500,000,000	547,530,000	
	2 2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	470,000,000	533,351,300	
	2 3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	400,000,000	453,916,000	
	2 4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	600,000,000	680,274,000	

	2 5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	600,000,000	655,824,000	
	2 6 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,000,000,000	1,113,130,000	
	2 7 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	900,000,000	1,021,023,000	
	2 8 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,300,000,000	1,475,773,000	
	2 9 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,500,000,000	1,671,960,000	
	3 0 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,500,000,000	1,637,415,000	
	3 1 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,700,000,000	1,817,691,000	
	3 2 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,600,000,000	1,743,584,000	
	3 3 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,800,000,000	1,840,392,000	
	3 4 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	2,000,000,000	2,131,080,000	
	3 5 回 利付国庫債券（ 3 0 年 ）	1,000,000,000	1,019,040,000	
	3 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	600,000,000	692,700,000	
	3 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	400,000,000	452,728,000	
	4 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	720,000,000	805,226,400	
	4 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	800,000,000	916,016,000	
	4 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	860,000,000	1,007,421,200	
	4 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	900,000,000	1,020,555,000	
	4 6 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	500,000,000	558,325,000	
	4 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	950,000,000	1,061,197,500	
	4 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	500,000,000	571,585,000	
	5 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	780,000,000	849,061,200	
	5 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	600,000,000	658,578,000	
	5 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	550,000,000	608,591,500	
	5 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	700,000,000	781,662,000	
	5 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	810,000,000	888,416,100	
	5 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	830,000,000	901,106,100	
	5 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	900,000,000	976,374,000	
	6 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	990,000,000	1,021,887,900	
	6 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	800,000,000	789,144,000	
	6 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,000,000,000	961,740,000	
	6 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	800,000,000	864,344,000	
	6 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,300,000,000	1,402,765,000	
	6 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,300,000,000	1,400,815,000	
	7 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,250,000,000	1,417,175,000	
	7 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,250,000,000	1,372,900,000	
	7 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,390,000,000	1,507,288,200	
	7 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,340,000,000	1,468,532,800	
	7 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,550,000,000	1,658,376,000	
	8 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,700,000,000	1,837,445,000	
	8 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,600,000,000	1,747,248,000	
	8 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,750,000,000	1,907,675,000	
	8 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,700,000,000	1,894,565,000	
	9 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,600,000,000	1,760,544,000	
	9 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,700,000,000	1,844,823,000	
	9 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,000,000,000	1,069,680,000	
	9 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	800,000,000	866,880,000	
	9 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,700,000,000	1,886,150,000	
	9 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,500,000,000	1,640,715,000	
	9 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,600,000,000	1,726,688,000	
	1 0 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,800,000,000	1,966,626,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,900,000,000	2,129,995,000	

	1 0 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,800,000,000	1,936,098,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,000,000,000	2,148,640,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,000,000,000	2,085,680,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,200,000,000	2,391,048,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,000,000,000	2,140,280,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,000,000,000	2,137,300,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,600,000,000	2,817,178,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,200,000,000	1,261,548,000	
	1 1 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,500,000,000	1,528,740,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,200,000,000	2,275,768,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,200,000,000	2,343,726,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,400,000,000	2,595,408,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	2,000,000,000	2,061,800,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	1,000,000,000	1,013,950,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券（ 2 0 年 ）	900,000,000	912,672,000	
国債証券計			317,851,977,200	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	151,498,720	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	208,422,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	167,798,500	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	207,148,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,588,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	207,114,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	208,408,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	207,212,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,589,264	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	207,310,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,626,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	105,120,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	516,491,820	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,469,005	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,957,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,544,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	214,448,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	160,395,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	107,080,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	217,447,890	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	316,359,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	319,932,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	209,564,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	512,040,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	200,984,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	205,870,420	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	257,777,500	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	203,899,770	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	107,681,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	323,781,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	212,196,000	
	1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,822,000	
	1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	184,529,446	
	1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,250,000	

	1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,624,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,862,250	
	1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,974,000	
	1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,723,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,511,000	
	2 5 2 回 大阪府公募公債	100,000,000	100,680,000	
	2 6 1 回 大阪府公募公債	129,000,000	132,359,160	
	2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	206,616,000	
	2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	104,459,000	
	2 8 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	209,032,000	
	2 8 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	212,024,000	
	2 9 3 回 大阪府公募公債	200,000,000	215,454,000	
	3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	107,034,000	
	3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	254,980,800	
	3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	209,462,000	
	1 回 大阪府公募公債 7 年	500,000,000	513,795,000	
	1 5 年度 3 回 京都府公募公債	219,300,000	225,311,013	
	1 6 年度 2 回 京都府公募公債	100,000,000	103,619,000	
	1 8 年度 1 回 京都府公募公債	100,000,000	106,433,000	
	1 4 年度 5 回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,736,000	
	1 5 年度 1 回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,658,000	
	1 6 年度 4 回 兵庫県公募公債	251,970,000	260,421,073	
	1 6 年度 8 回 兵庫県公募公債	111,500,000	116,492,970	
	1 7 年度 2 回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,244,000	
	1 7 年度 9 回 兵庫県公募公債	306,000,000	320,831,820	
	1 7 年度 1 3 回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,799,150	
	1 8 年度 1 回 兵庫県公募公債	120,000,000	127,243,200	
	1 5 年度 1 回 静岡県公募公債	268,500,000	269,823,705	
	1 5 年度 3 回 静岡県公募公債	116,130,000	118,863,700	
	1 8 年度 5 回 静岡県公募公債	129,800,000	138,913,258	
	2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	206,237,330	
	1 5 年度 1 回 愛知県公募公債	303,600,000	310,746,744	
	1 6 年度 2 回 愛知県公募公債	200,000,000	207,990,000	
	1 8 年度 2 回 愛知県公募公債	160,300,000	172,141,361	
	2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	106,698,000	
	2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	205,156,000	
	1 6 年度 2 回 広島県公募公債	200,000,000	208,104,000	
	2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	208,612,000	
	1 5 年度 3 回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,632,000	
	1 7 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,078,000	
	1 8 年度 1 回 埼玉県公募公債	200,000,000	212,582,000	
	2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債	440,000,000	464,930,400	
	2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,628,000	
	1 6 年度 3 回 福岡県公募公債	131,040,000	135,442,944	
	1 7 年度 1 回 福岡県公募公債	100,000,000	104,082,000	
	1 7 年度 5 回 福岡県公募公債	100,000,000	104,792,000	
	1 8 年度 1 回 福岡県公募公債	104,000,000	112,379,280	
	2 1 年度 3 回 福岡県公募公債	200,000,000	212,628,000	
	1 5 年度 4 回 千葉県公募公債	100,000,000	102,620,000	
	1 6 年度 3 回 千葉県公募公債	100,000,000	104,638,000	
	1 6 年度 8 回 千葉県公募公債	200,000,000	206,726,000	

	17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	207,160,000	
	19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	323,601,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	210,358,000	
	18年度2回 新潟県公募公債	169,000,000	181,071,670	
	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,625,000	
	3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,499,000	
	8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,368,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,741,400	
	11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,488,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,659,500	
	13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	227,952,660	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,893,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	135,179,200	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,784,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,626,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,363,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,576,320	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,278,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,158,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,160,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,122,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,360,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,560,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,350,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,426,000	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	182,355,600	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	156,103,200	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,917,500	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	173,046,128	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,734,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,596,000	
	61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	318,888,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,818,000	
	75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	535,260,000	
	80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	742,770,000	
	94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,585,000	
	17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	103,365,000	
	17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	207,684,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	209,352,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,941,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	107,002,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	161,371,500	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	145,837,800	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,630,000	
	12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	207,262,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	374,376,110	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,982,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	109,300,041	
	16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	206,950,000	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	108,317,890	
	15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,992,000	

	1 6 年度 1 回 横浜市公募公債	200,000,000	206,534,000	
	1 7 年度 1 回 横浜市公募公債	300,000,000	310,218,000	
	1 4 年度 5 回 札幌市公募公債	106,000,000	106,779,100	
	1 4 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	100,722,000	
	1 6 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	104,052,000	
	2 回 川崎市公募公債 1 5 年	100,000,000	106,386,000	
	1 9 回 川崎市公募公債 5 年	100,000,000	101,935,000	
	1 8 年度 4 回 福岡市公募公債	100,000,000	106,704,000	
	1 6 年度 1 回 広島市公募公債	100,000,000	103,475,000	
	1 6 年度 2 回 千葉市公募公債	100,000,000	103,573,000	
地方債証券計			28,110,352,112	
特殊債券	8 回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	106,515,540	
	1 3 回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,275,860	
	1 6 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,423,000	
	7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,398,000	
	9 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,430,000	
	1 3 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,062,000	
	2 7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,342,000	
	4 6 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,338,000	
	1 2 回 日本道路・機構承継債	100,000,000	101,186,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	3 4 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	207,490,000	
	3 1 9 回 政保道路債	132,000,000	133,718,640	
	3 2 2 回 政保道路債	106,000,000	108,864,120	
	3 2 3 回 政保道路債	200,000,000	205,540,000	
	3 2 4 回 政保道路債	200,000,000	205,352,000	
	3 2 8 回 政保道路債	200,000,000	206,654,000	
	3 2 9 回 政保道路債	100,000,000	103,668,000	
	3 3 3 回 政保道路債	300,000,000	312,225,000	
	3 3 5 回 政保道路債	237,000,000	245,579,400	
	3 3 8 回 政保道路債	264,000,000	275,035,200	
	3 3 9 回 政保道路債	301,000,000	312,766,090	
	1 5 回 高速道路機構債	400,000,000	430,016,000	
	2 5 回 高速道路機構債	300,000,000	321,531,000	
	3 5 回 高速道路機構債	400,000,000	425,696,000	
	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	749,182,000	
	3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,721,000	
	5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	220,275,550	
	8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,896,800	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,546,000	
	1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	323,860,950	
	1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,414,740	
	1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,832,000	
	2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	401,295,000	
	2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,680,000	
	2 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,042,000	
	3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	320,271,000	
	3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	317,264,310	
	3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	371,678,240	
	4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	358,142,000	
	4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	212,076,000	
	5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,028,000	
	6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	172,019,700	
	6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	428,673,010	
	7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	633,426,000	

	7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,998,000	
	8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,198,000	
	8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,566,000	
	1 6 回 日本道路・機構承継債	430,000,000	434,175,300	
	2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	205,886,000	
	4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	311,634,000	
	5 回 公営企業債券	100,000,000	100,745,000	
	8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	406,296,000	
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	305,125,180	
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	212,785,650	
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	444,407,040	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	619,254,000	
	8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	268,598,200	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,695,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,410,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,890,000	
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,849,770	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	311,052,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,870,720	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	316,634,240	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,344,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	217,132,650	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	254,250,590	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,792,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	213,604,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,957,890	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	109,118,580	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	515,180,880	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	691,563,810	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,177,160	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,640,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,975,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,955,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,526,000	
	2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,638,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,803,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,795,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,680,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,656,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,826,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	322,317,000	
	1 9 1 回 政保首都高速道路債	113,000,000	117,877,080	
	1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,598,000	
	1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	111,108,800	
	5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,530,000	
	1 7 6 回 政保中小企業債券	100,000,000	102,626,000	
	1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	148,086,120	
	1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	107,971,760	
	2 6 回 中小企業債券	400,000,000	411,124,000	

	1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	207,552,000	
	8 回 国際協力銀行債券	300,000,000	301,614,000	
	1 2 回 国際協力銀行債券	200,000,000	206,220,000	
	2 回 都市再生債券	100,000,000	104,674,000	
	1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	217,024,000	
	2 3 回 都市再生機構債券	200,000,000	203,866,000	
	2 回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	103,278,000	
	6 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	102,866,000	
	1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,740,000	
	3 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,987,000	
	3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,653,000	
	6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	129,888,000	138,096,921	
	8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	89,646,000	94,696,655	
	9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	134,007,000	142,143,905	
	2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	154,398,000	163,664,967	
	1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	67,472,000	71,199,153	
	1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	345,855,000	360,764,809	
	4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,706,000	87,133,760	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,413,000	66,437,390	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	243,504,000	259,550,913	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	194,847,000	205,943,536	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	330,505,000	347,611,938	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	421,425,000	439,997,199	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	733,680,000	759,292,768	
	1 4 回 政保国民生活債券	132,000,000	136,821,960	
	6 9 2 号 利附商工債	200,000,000	202,294,000	
	7 0 4 号 利附商工債	200,000,000	204,792,000	
	7 0 6 号 利付商工債	300,000,000	307,710,000	
	7 1 4 号 利付商工債	300,000,000	305,379,000	
	7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	301,455,000	
	7 3 2 号 利付商工債	200,000,000	201,466,000	
	6 9 4 号 利附農林債	400,000,000	404,812,000	
	6 9 5 号 利附農林債	200,000,000	202,534,000	
	6 9 8 号 利附農林債	300,000,000	306,231,000	
	7 0 1 号 利附農林債	200,000,000	204,546,000	
	7 0 9 号 利附農林債	400,000,000	408,800,000	
	7 1 3 号 利附農林債	300,000,000	304,173,000	
	7 1 7 号 利附農林債	300,000,000	303,819,000	
	7 2 1 号 利附農林債	120,000,000	120,920,400	
	2 2 2 回 利附信金中金債	200,000,000	203,510,000	
	2 2 3 回 利附信金中金債	300,000,000	306,039,000	
	2 2 6 回 利附信金中金債	300,000,000	306,135,000	
	2 2 9 回 利附信金中金債	400,000,000	409,596,000	
	2 3 3 回 利附信金中金債	300,000,000	307,854,000	
	2 3 6 回 利附信金中金債	300,000,000	304,944,000	

	2 4 1 回 利附信金中金債	300,000,000	303,519,000	
	1 回 政保東日本高速道路債	101,000,000	106,196,450	
	2 回 政保東日本高速道路債	101,000,000	105,833,860	
	4 回 政保中日本高速道路債	170,000,000	179,242,900	
	8 回 政保中日本高速道路債	170,000,000	182,979,500	
	2 1 回 政保中日本高速道路債	300,000,000	322,233,000	
	5 回 中日本高速道路債	200,000,000	215,520,000	
	1 回 政保西日本高速道路債	201,000,000	211,341,450	
	5 回 政保西日本高速道路債	259,000,000	277,420,080	
	6 回 政保西日本高速道路債	117,000,000	125,429,850	
	2 回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	312,726,000	
特殊債券計			36,949,635,934	
社債券	3 4 5 回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,550,000	
	9 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,656,000	
	1 2 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,247,000	
	1 4 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	102,718,000	
	2 回 J P モルガン・チェース劣後債	100,000,000	98,236,000	
	4 回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	98,451,000	
	1 6 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	97,901,000	
	2 2 回 シティグループ円貨社債	200,000,000	200,814,000	
	3 回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	92,695,000	
	8 回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	86,434,000	
	7 回 ウェストパック銀行円貨社債	100,000,000	100,006,000	
	1 回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	102,668,000	
	1 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,114,000	
	7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,866,000	
	5 回 日本たばこ産業社債	100,000,000	102,102,000	
	2 5 回 住友化学工業社債	100,000,000	102,523,000	
	3 3 回 住友化学社債	100,000,000	101,025,000	
	4 1 回 住友化学社債	100,000,000	105,175,000	
	2 5 回 三菱化学社債	100,000,000	101,844,000	
	3 4 回 三井化学社債	100,000,000	105,527,000	
	2 回 花王社債	100,000,000	102,594,000	
	2 4 回 新日本石油社債	100,000,000	103,764,000	
	8 回 旭硝子社債	100,000,000	100,628,000	
	2 9 回 新日本製鐵社債	100,000,000	114,529,000	
	4 8 回 新日本製鐵社債	100,000,000	101,150,000	
	5 2 回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,223,000	
	1 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	101,621,000	
	1 5 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,645,000	
	1 1 回 豊田自動織機社債	100,000,000	100,988,000	
	1 2 回 日立製作所社債	100,000,000	100,666,000	
	2 5 回 富士通社債	100,000,000	103,878,000	
	7 回 パナソニック社債	200,000,000	205,010,000	
	1 0 回 パナソニック社債	200,000,000	202,034,000	
	1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	102,198,000	
	2 4 回 シャープ社債	200,000,000	202,590,000	

17回 ソニー社債	100,000,000	103,970,000	
19回 ソニー社債	100,000,000	101,675,000	
3回 パナソニック電工社債	100,000,000	104,356,000	
15回 三菱重工業社債	100,000,000	100,925,000	
19回 三菱重工業社債	100,000,000	107,175,000	
49回 日産自動車社債	100,000,000	104,215,000	
51回 日産自動車社債	100,000,000	101,075,000	
7回 トヨタ自動車社債	300,000,000	306,690,000	
9回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,022,000	
49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	109,669,000	
77回 丸紅社債	100,000,000	101,207,000	
45回 三井物産社債	100,000,000	100,701,000	
29回 住友商事社債	100,000,000	101,410,000	
16回 三菱商事社債	100,000,000	105,846,000	
14回 クレディセゾン社債	100,000,000	100,862,000	
1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	206,142,000	
7回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,848,000	
11回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,952,000	
13回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,632,000	
14回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,487,000	
15回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,576,000	
18回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,748,000	
20回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,124,000	
24回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,086,000	
100回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,722,000	
106回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,944,000	
112回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,112,000	
114回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,168,000	
3回2号 三菱東京UFJ銀行社債（劣後）	200,000,000	202,588,000	
6回 東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,514,000	
8回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	207,102,000	
12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,802,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	202,606,000	
11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,994,000	
4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,132,000	
6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,786,000	
4回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,992,000	
7回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,874,000	
5回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,863,000	
45回 三井住友銀行社債	200,000,000	204,134,000	
47回 三井住友銀行社債	200,000,000	203,266,000	
50回 三井住友銀行社債	200,000,000	200,890,000	
51回 三井住友銀行社債	200,000,000	199,590,000	
6回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,035,000	
7回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,210,000	
8回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,904,000	
9回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,937,000	
11回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,912,000	
20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	215,004,000	
1回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,926,000	

6 回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,092,000	
1 0 回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,585,000	
1 4 回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,819,000	
3 8 回 N T Tファイナンス社債	200,000,000	200,978,000	
1 7 回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,761,000	
1 9 回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,799,000	
2 3 回 トヨタファイナンス社債	300,000,000	321,144,000	
4 0 回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	103,045,000	
1 1 8 回 オリックス社債	100,000,000	103,802,000	
1 4 4 回 オリックス社債	100,000,000	100,966,000	
1 4 8 回 オリックス社債	200,000,000	200,316,000	
1 2 回 三菱UFJリース社債	100,000,000	100,373,000	
8 回 野村ホールディングス社債	100,000,000	105,387,000	
1 5 回 野村ホールディングス社債	100,000,000	103,285,000	
1 7 回 野村ホールディングス社債	200,000,000	202,906,000	
2 0 回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,417,000	
2 2 回 野村ホールディングス社債	200,000,000	200,384,000	
2 4 回 三井不動産社債	100,000,000	104,841,000	
3 1 回 三井不動産社債	100,000,000	103,701,000	
6 0 回 三菱地所社債	100,000,000	101,036,000	
6 6 回 三菱地所社債	100,000,000	100,799,000	
7 9 回 三菱地所社債	200,000,000	213,286,000	
9 0 回 三菱地所社債	100,000,000	106,327,000	
7 3 回 住友不動産社債	100,000,000	100,958,000	
4 1 回 小田急電鉄社債	100,000,000	108,042,000	
2 回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	229,686,000	
7 回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,488,000	
1 9 回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,493,000	
2 5 回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	302,079,000	
3 1 回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,998,000	
4 1 回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,400,000	
3 回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,777,000	
1 0 回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,715,000	
1 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,923,000	
2 回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	230,750,000	
6 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,793,000	
1 0 回 東海旅客鉄道社債	190,000,000	199,266,300	
2 3 回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,531,000	
3 回 東京地下鉄社債	100,000,000	106,791,000	
4 8 回 日本電信電話社債	400,000,000	414,712,000	
5 0 回 日本電信電話社債	100,000,000	104,516,000	
5 1 回 日本電信電話社債	200,000,000	214,528,000	
5 8 回 日本電信電話社債	100,000,000	101,822,000	
5 回 K D D I 社債	100,000,000	113,999,000	
1 6 回 N T T ドコモ社債	200,000,000	204,208,000	
1 8 回 N T T ドコモ社債	200,000,000	202,074,000	
4 5 5 回 東京電力社債	200,000,000	122,362,000	
5 1 1 回 東京電力社債	100,000,000	79,188,000	
5 1 6 回 東京電力社債	100,000,000	71,382,000	
5 1 9 回 東京電力社債	372,000,000	251,739,840	
5 4 2 回 東京電力社債	500,000,000	305,780,000	

	4 0 7 回 中部電力社債	100,000,000	109,794,000	
	4 0 9 回 中部電力社債	300,000,000	342,015,000	
	4 6 3 回 中部電力社債	200,000,000	200,994,000	
	4 6 7 回 中部電力社債	100,000,000	102,704,000	
	4 6 8 回 中部電力社債	100,000,000	102,434,000	
	4 7 1 回 中部電力社債	300,000,000	306,459,000	
	4 7 6 回 中部電力社債	100,000,000	107,186,000	
	4 7 8 回 中部電力社債	100,000,000	105,080,000	
	4 8 0 回 中部電力社債	200,000,000	209,528,000	
	4 8 4 回 中部電力社債	200,000,000	204,370,000	
	4 8 7 回 中部電力社債	140,000,000	141,702,400	
	4 9 6 回 中部電力社債	500,000,000	497,730,000	
	4 1 0 回 関西電力社債	300,000,000	318,963,000	
	4 2 7 回 関西電力社債	100,000,000	101,581,000	
	4 3 3 回 関西電力社債	200,000,000	203,932,000	
	4 4 1 回 関西電力社債	200,000,000	205,292,000	
	4 4 6 回 関西電力社債	200,000,000	208,708,000	
	2 9 8 回 中国電力社債	200,000,000	223,762,000	
	3 1 0 回 中国電力社債	200,000,000	225,954,000	
	3 4 1 回 中国電力社債	100,000,000	102,423,000	
	3 5 0 回 中国電力社債	200,000,000	205,444,000	
	2 4 5 回 北陸電力社債	200,000,000	222,120,000	
	2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	108,790,000	
	2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	212,334,000	
	2 8 9 回 北陸電力社債	300,000,000	307,014,000	
	3 6 8 回 東北電力社債	300,000,000	330,090,000	
	3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	110,492,000	
	3 8 0 回 東北電力社債	300,000,000	339,300,000	
	4 2 0 回 東北電力社債	100,000,000	101,579,000	
	4 2 7 回 東北電力社債	200,000,000	204,962,000	
	4 3 2 回 東北電力社債	500,000,000	527,640,000	
	2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	106,824,000	
	2 5 7 回 四国電力社債	200,000,000	204,676,000	
	3 7 4 回 九州電力社債	300,000,000	305,361,000	
	3 8 2 回 九州電力社債	100,000,000	102,499,000	
	3 8 3 回 九州電力社債	100,000,000	102,646,000	
	3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	207,984,000	
	2 5 7 回 北海道電力社債	200,000,000	226,804,000	
	2 8 2 回 北海道電力社債	200,000,000	203,538,000	
	2 8 4 回 北海道電力社債	500,000,000	515,260,000	
	2 8 6 回 北海道電力社債	100,000,000	102,606,000	
	2 回 電源開発社債	100,000,000	101,757,000	
	4 回 電源開発社債	200,000,000	202,886,000	
	6 回 電源開発社債	100,000,000	102,505,000	
	1 4 回 電源開発社債	100,000,000	103,080,000	
	1 7 回 電源開発社債	100,000,000	105,628,000	
	1 4 回 東京ガス社債	100,000,000	112,877,000	
	2 4 回 東京瓦斯社債	200,000,000	204,644,000	
	9 回 大阪ガス社債	100,000,000	113,995,000	
	2 4 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	103,727,000	
	2 7 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	101,877,000	

	2 0 回 N T T データ社債	100,000,000	101,318,000	
社債券計			29,551,388,540	
合計			412,463,353,786	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		5,446,269,550	2,871,664,871
コール・ローン		208,199,369	170,775,621
国債証券		381,787,274,984	357,920,231,801
派生商品評価勘定		5,261	1,444,094
未収利息		5,228,392,825	4,571,127,430
前払費用		202,220,674	210,204,457
流動資産合計		392,872,362,663	365,745,448,274
資産合計		392,872,362,663	365,745,448,274
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,469,591	75,348
未払金		1,449,949,408	-
未払解約金		145,534,000	167,217,000
流動負債合計		1,596,952,999	167,292,348
負債合計		1,596,952,999	167,292,348
純資産の部			
元本等			
元本		334,116,315,089	321,714,165,896
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		57,159,094,575	43,863,990,030
元本等合計		391,275,409,664	365,578,155,926
純資産合計		391,275,409,664	365,578,155,926
負債純資産合計		392,872,362,663	365,745,448,274

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日までとなっております。
--	--

(追加情報)

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	339,015,408,769円	334,116,315,089円
同期中追加設定元本額	26,897,261,403円	18,571,516,995円
同期中解約元本額	31,796,355,083円	30,973,666,188円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	2,125,531,764円	2,096,124,741円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>	3,688,409,172円	3,874,193,425円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	305,001,501円	324,215,560円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,093,726,481円	1,142,218,404円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,170,458,301円	1,189,846,561円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	323,613,584円	339,634,869円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	638,203,038円	670,636,125円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	429,331,956円	415,561,026円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	180,463,880円	167,928,414円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,715,162,658円	1,752,895,046円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,155,879円	16,351,670円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	7,626,721,935円	6,460,377,165円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,372,331,403円	7,897,336,008円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,646,385,289円	7,446,838,701円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	947,377,584円	946,676,260円
D I A Mワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	253,695,580円	240,498,150円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	49,570,211,228円	47,028,947,296円

D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	2,839,557,497円	2,571,344,283円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	473,757,719円	446,376,685円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	775,746,763円	734,628,891円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	206,055,442円	198,574,188円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	92,794,446円	88,107,174円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定）	28,911,767,591円	27,471,479,284円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	6,434,549,451円	6,072,780,655円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	11,625,793,255円	11,096,046,838円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	5,430,133,989円	5,125,191,027円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	7,882,858,531円	7,268,138,307円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A（適格機関投資 家限定）	3,004,164,597円	2,777,830,025円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2（適格機関投 資家限定）	8,893,296,715円	8,474,121,378円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	10,327,637,450円	9,930,618,651円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A（適格機関投資家 向け）	50,542,147,923円	49,888,733,703円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	270,088,311円	267,315,107円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	594,078,581円	- 円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限 定）	7,060,311,640円	6,711,196,194円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	15,767,847,978円	15,061,844,607円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A（適格機関投資家限定）	293,989,022円	290,931,174円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	26,282,110,467円	25,405,826,761円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	31,875,154,619円	31,031,207,133円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	820,791,797円	813,519,355円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	237,709円	230,952円

D I A Mバランス70 V A（適格機関投資家限定）	150,022円	142,391円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	27,773,871,605円	27,133,367,705円
D I A M世界バランス25 V A（適格機関投資家限定）	223,975,733円	226,991,467円
D I A Mバランス20 V A（適格機関投資家限定）	621,308,205円	616,993,225円
D I A Mバランス40 V A（適格機関投資家限定）	221,166円	217,901円
D I A Mバランス60 V A（適格機関投資家限定）	135,632円	131,414円
（合 計）	334,116,315,089円	321,714,165,896円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	334,116,315,089口	321,714,165,896口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,250,150,712	13,180,194,944
合計	3,250,150,712	13,180,194,944

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

（通貨関連）

平成23年5月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超			

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	ユーロ	129,088,176	-	130,130,500	1,042,324
	米ドル	86,243,314	-	86,665,320	422,006
合 計		215,331,490	-	216,795,820	1,464,330

平成23年11月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	マレーシアリングット	99,877,600	-	98,440,000	1,437,600
	ユーロ	67,808,692	-	67,884,040	75,348
	米ドル	57,260,534	-	57,254,040	6,494
合 計		224,946,826	-	223,578,080	1,368,746

（注）時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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ております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買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売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1711円 (11,711円)	1.1363円 (11,363円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.0 11/15/12	40,000,000.00	41,568,400.000	
	US T N/B 1.125 12/15/12	35,000,000.00	35,364,700.000	
	US T N/B 0.625 01/31/13	20,000,000.00	20,117,000.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	33,484,800.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,450,520.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,555,500.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,515,540.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	32,000,000.00	33,628,480.000	
	US T N/B 1.0 07/15/13	40,000,000.00	40,526,400.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,468,900.000	
	US T N/B 0.125 08/31/13	20,000,000.00	19,965,600.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	30,152,100.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	43,209,200.000	
	US T N/B 0.75 12/15/13	10,000,000.00	10,101,900.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,312,400.000	
	US T N/B 1.75 03/31/14	25,000,000.00	25,848,500.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,855,250.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,787,100.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,979,200.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	29,606,640.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	33,447,600.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	26,299,750.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	12,000,000.00	12,819,840.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	22,281,200.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	24,454,520.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	21,379,600.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	20,272,500.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,721,800.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	8,350,560.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	17,056,500.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	15,390,750.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	13,000,000.00	13,325,910.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,735,100.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	15,000,000.00	15,439,350.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.00	18,538,720.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	21,410,800.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.00	12,889,000.000	
	US T N/B 1.75 05/31/16	20,000,000.00	20,862,400.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.00	27,787,000.000	

	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.00	20,200,760.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	22,026,400.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	18,529,140.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	21,790,600.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	22,292,000.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	14,238,720.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	22,057,800.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	11,101,500.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,898,420.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	14,001,390.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	18,033,900.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	8,321,840.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	8,313,680.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	11,000,000.00	12,960,200.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	11,000,000.00	11,663,410.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	15,886,640.000	
	US T N/B 2.875 03/31/18	5,000,000.00	5,487,100.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.00	9,277,440.000	
	US T N/B 2.375 06/30/18	18,000,000.00	19,143,180.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.00	14,040,840.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	11,000,000.00	12,705,000.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	10,596,250.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	15,000,000.00	16,275,000.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	16,000,000.00	17,774,880.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	10,362,730.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	15,000,000.00	17,196,000.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	17,000,000.00	19,183,310.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	22,000,000.00	25,260,400.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	19,000,000.00	21,625,800.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,968,090.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	23,000,000.00	24,489,480.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	22,000,000.00	23,356,080.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	24,000,000.00	27,496,800.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	25,000,000.00	27,507,750.000	
	US T N/B 2.125 08/15/21	20,000,000.00	20,168,600.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.00	9,281,220.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,482,180.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	3,000,000.00	4,476,540.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	7,000,000.00	9,874,340.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	2,000,000.00	3,144,360.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,772,790.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	5,296,725.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.00	5,653,400.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	4,459,920.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,506,870.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,966,700.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	8,715,900.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	4,129,200.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.00	4,027,260.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	3,000,000.00	4,034,040.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	3,000,000.00	4,426,380.000	

	US T N/B 6.25 05/15/30	4,000,000.00	6,022,480.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,000,000.00	6,918,750.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	8,000,000.00	10,076,240.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	6,000,000.00	7,845,420.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	5,421,560.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	5,000,000.00	6,208,200.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	6,000,000.00	7,594,680.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	8,000,000.00	8,608,080.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	9,500,000.00	11,581,830.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	12,000,000.00	15,218,400.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	14,000,000.00	17,409,140.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	13,000,000.00	16,795,350.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	14,000,000.00	17,430,000.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	15,000,000.00	17,194,800.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	17,088,680.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	15,000,000.00	19,804,650.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	14,000,000.00	17,465,980.000	
	US T N/B 3.75 08/15/41	13,000,000.00	14,604,590.000	
米ドル小計	銘柄数 : 108	1,688,000,000.00	1,887,728,815.000	
	組入時価比率 : 40.06%		(146,468,878,756)	
	合計時価比率 : 40.92%			
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	7,000,000.00	7,367,500.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,417,000.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,387,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	10,092,600.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	10,000,000.00	10,632,000.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	9,168,800.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,848,400.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	10,500,000.00	10,930,500.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	8,000,000.00	9,082,400.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	4,500,000.00	4,607,550.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,231,500.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,000,000.00	6,059,500.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,000,000.00	8,346,100.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	9,000,000.00	10,249,200.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.00	7,906,600.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	9,000,000.00	10,237,500.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	4,000,000.00	6,026,000.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	7,000,000.00	7,948,500.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	5,500,000.00	6,389,900.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	7,000,000.00	8,955,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	6,000,000.00	7,168,800.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,500,000.00	6,490,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	7,624,200.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,000,000.00	7,168,200.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,500,000.00	6,800,750.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,500,000.00	8,982,000.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,000,000.00	7,768,200.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	6,000,000.00	7,193,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	7,500,000.00	9,000,750.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	6,500,000.00	8,191,300.000	

	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,500,000.00	7,974,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	6,000,000.00	7,425,000.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,000,000.00	1,128,300.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	7,541,400.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	5,500,000.00	6,640,150.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 35	222,500,000.00	262,981,800.000	
	組入時価比率 : 8.88%		(32,470,362,846)	
	合計時価比率 : 9.07%			
	CANADA 5.25 06/01/13	12,000,000.00	12,797,640.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	13,000,000.00	13,365,170.000	
	CANADA 1.5 11/01/13	7,000,000.00	7,078,260.000	
	CANADA 2.0 03/01/14	1,000,000.00	1,023,090.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,998,400.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	7,184,100.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,913,520.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	4,000,000.00	4,269,800.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	7,500,000.00	8,372,025.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.00	4,251,920.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.00	3,960,075.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.00	4,057,060.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	6,500,000.00	7,368,465.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	5,000,000.00	5,578,950.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,000,000.00	4,382,200.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,000,000.00	1,045,570.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	1,200,000.00	1,895,568.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,200,000.00	2,116,092.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,200,000.00	3,764,948.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	4,500,000.00	6,484,500.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	4,500,000.00	6,707,970.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,200,000.00	7,302,100.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	5,500,000.00	6,877,750.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 23	121,300,000.00	139,795,173.000	
	組入時価比率 : 2.91%		(10,650,994,231)	
	合計時価比率 : 2.98%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	26,000,000.00	29,615,040.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	25,812,900.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	19,418,580.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	21,406,920.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	25,000,000.00	29,625,500.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	27,000,000.00	34,550,820.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,000,000.00	12,928,080.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	20,467,840.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 8	165,000,000.00	193,825,680.000	
	組入時価比率 : 0.61%		(2,246,439,631)	
	合計時価比率 : 0.63%			
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,616,250.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	6,000,000.00	6,459,600.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,145,500.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	5,000,000.00	5,255,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,500,000.00	4,826,250.000	

	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,000,000.00	1,029,300.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,342,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,410,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	4,000,000.00	4,364,400.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,255,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,500,000.00	4,587,750.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,500,000.00	2,563,750.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,800,000.00	3,199,000.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	2,500,000.00	3,212,500.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	4,300,000.00	4,547,680.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	7,000,000.00	7,102,200.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,078,500.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	5,000,000.00	5,064,000.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	5,000,000.00	5,100,500.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	4,978,000.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,026,500.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	2,890,200.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	4,879,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	5,500,000.00	5,497,800.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	3,500,000.00	3,745,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	3,977,200.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	4,000,000.00	3,964,000.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,243,250.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	4,000,000.00	3,926,800.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	4,500,000.00	4,326,300.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.00	1,464,750.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,500,000.00	5,937,800.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,300,000.00	5,343,354.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,000,000.00	2,679,900.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	17,000,000.00	17,822,800.000	
	BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	5,000,000.00	5,078,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	14,500,000.00	15,304,315.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	20,000,000.00	21,660,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,854,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	16,000,000.00	17,564,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	19,683,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	14,000,000.00	15,566,600.000	
	BUNDESOBL 2.75 04/08/16	11,000,000.00	11,920,150.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	11,415,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	8,000,000.00	9,103,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.00	8,208,550.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.00	8,178,450.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	8,000,000.00	9,525,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	8,000,000.00	9,283,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	9,000,000.00	10,339,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	8,000,000.00	9,070,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	8,000,000.00	8,925,600.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	6,288,000.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	7,000,000.00	7,476,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	6,500,000.00	7,352,150.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	6,000,000.00	6,254,400.000	

	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	3,500,000.00	5,054,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,000,000.00	6,146,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,500,000.00	7,868,300.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,000,000.00	5,280,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	5,407,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,800,000.00	8,357,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	7,000,000.00	9,585,100.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	8,500,000.00	10,800,270.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,000,000.00	6,707,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,500,000.00	8,002,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,000,000.00	4,645,600.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	11,000,000.00	11,167,200.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	9,853,300.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	12,000,000.00	11,914,800.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	7,500,000.00	7,467,750.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,500,000.00	5,300,350.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	6,830,600.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	5,666,400.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	6,000,000.00	5,581,800.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	5,000,000.00	4,644,500.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	1,000,000.00	954,020.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.00	5,607,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,000,000.00	5,052,100.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,586,000.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	5,000,000.00	4,729,000.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.00	5,085,850.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	6,000,000.00	5,398,800.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	7,000,000.00	6,615,000.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	5,500,000.00	5,331,150.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	5,500,000.00	4,885,650.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,000,000.00	4,309,500.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.00	2,397,000.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	6,500,000.00	6,165,250.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,000,000.00	4,550,150.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	6,000,000.00	4,303,200.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,500,000.00	3,537,000.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,800,000.00	2,915,740.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	2,500,000.00	2,695,750.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,597,350.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,500,000.00	2,770,625.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	3,061,350.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	2,000,000.00	2,232,000.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,321,100.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	2,000,000.00	2,181,700.000	
	FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.00	1,650,675.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	3,228,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	20,000,000.00	20,792,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	19,000,000.00	19,891,100.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,133,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	15,000,000.00	15,787,500.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	14,000,000.00	14,861,000.000	

	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	16,777,600.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,496,400.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	14,000,000.00	14,516,600.000	
	FR TREASURY 2.5 07/25/16	5,000,000.00	5,000,000.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,163,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,549,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,642,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.00	9,581,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,678,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	10,500,000.00	11,288,550.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.00	4,112,100.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	9,000,000.00	9,329,400.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	11,000,000.00	11,174,900.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	10,000,000.00	9,460,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,000,000.00	11,323,400.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,500,000.00	6,397,950.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,762,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,000,000.00	11,518,100.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,293,600.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,500,000.00	7,239,750.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	9,000,000.00	10,542,600.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,500,000.00	10,372,550.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,000,000.00	6,511,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	8,000,000.00	7,772,800.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	6,000,000.00	6,300,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	5,500,000.00	5,319,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,800,000.00	2,650,760.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	2,850,030.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,723,550.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,613,090.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,435,310.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,378,280.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	2,608,200.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,419,500.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,612,400.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,378,070.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	16,000,000.00	15,755,360.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	15,509,600.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	18,000,000.00	17,091,000.000	
	ITALY BTPS 3.5 06/01/14	4,000,000.00	3,732,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	18,006,300.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	8,000,000.00	7,495,200.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	8,000,000.00	7,155,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	13,687,500.000	
	ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.00	8,917,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	12,416,600.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	9,000,000.00	8,004,600.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	9,000,000.00	8,401,500.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	7,992,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	9,000,000.00	7,920,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.00	6,879,200.000	

	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	7,395,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	8,000,000.00	6,783,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	7,500,000.00	6,423,750.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	7,629,300.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	8,000,000.00	6,608,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	8,000,000.00	6,410,400.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	10,000,000.00	7,952,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/21	8,000,000.00	6,864,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,000,000.00	2,553,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	8,000,000.00	6,496,000.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.00	4,404,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	6,138,300.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,000,000.00	4,560,600.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.00	3,438,400.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	9,000,000.00	8,207,100.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000,000.00	7,914,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	10,500,000.00	8,961,750.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	5,000,000.00	4,117,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,000,000.00	6,022,400.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,000,000.00	6,070,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	7,000,000.00	5,190,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	7,000,000.00	5,178,600.000	
	NETHERLANDS 1.75 01/15/13	2,500,000.00	2,538,250.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,424,900.000	
	NETHERLANDS 1.0 01/15/14	3,000,000.00	3,019,800.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,539,700.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,281,500.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,470,400.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,611,500.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/17	3,000,000.00	3,157,800.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,790,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	5,000,000.00	5,704,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	4,500,000.00	5,159,250.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,678,000.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/21	4,000,000.00	4,356,800.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,772,950.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	6,266,250.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	5,661,450.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	4,000,000.00	4,968,400.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	2,543,850.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,442,660.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	3,340,000.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	1,235,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	1,878,600.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	1,675,560.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	3,000,000.00	1,690,200.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	1,463,100.000	
ユ-口小計	銘柄数 : 205	1,385,100,000.00	1,401,565,549.000	
	組入時価比率 : 40.42%		(147,753,040,176)	
	合計時価比率 : 41.28%			
	DENMARK 4.0 11/15/12	19,000,000.00	19,665,000.000	

	DENMARK 5.0 11/15/13	30,000,000.00	32,634,000.000	
	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.00	6,238,200.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	35,000,000.00	39,221,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	21,000,000.00	24,160,500.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	38,715,600.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	12,000,000.00	13,102,320.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	9,000,000.00	13,901,400.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	35,500,000.00	51,307,795.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 9	200,500,000.00	238,945,815.000	
	組入時価比率 : 0.93%		(3,385,862,199)	
	合計時価比率 : 0.95%			
	NORWAY 6.5 05/15/13	20,000,000.00	21,430,000.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	22,290,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	15,000,000.00	16,824,000.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	10,000,000.00	11,620,000.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	8,000,000.00	8,916,800.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 5	73,000,000.00	81,080,800.000	
	組入時価比率 : 0.30%		(1,101,888,072)	
	合計時価比率 : 0.31%			
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,128,380.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	15,000,000.00	15,120,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	12,000,000.00	12,284,520.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,500,000.00	4,591,125.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	17,000,000.00	17,816,000.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	3,000,000.00	2,991,360.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	12,037,200.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.00	8,934,390.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	7,500,000.00	7,224,375.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.00	2,484,000.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.00	8,972,550.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	2,933,400.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 12	108,500,000.00	109,517,300.000	
	組入時価比率 : 0.71%		(2,605,416,567)	
	合計時価比率 : 0.73%			
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	3,000,000.00	3,101,550.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,352,960.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	3,000,000.00	3,263,190.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,440,700.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,975,300.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	3,197,488.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,200,000.00	2,503,226.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,339,940.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.00	881,712.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	23,300,000.00	26,056,066.000	
	組入時価比率 : 0.43%		(1,563,363,960)	
	合計時価比率 : 0.44%			
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	9,000,000.00	9,097,020.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,621,660.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	6,000,000.00	6,130,500.000	

	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,284,900.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,140,350.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,286,790.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,000,000.00	8,417,680.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	2,500,000.00	2,589,500.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,716,750.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,295,120.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 10	66,500,000.00	68,580,270.000	
	組入時価比率 : 0.46%		(1,687,760,445)	
	合計時価比率 : 0.47%			
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	9,000,000.00	9,387,000.000	
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	8,500,000.00	9,099,335.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	8,000,000.00	8,722,960.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,500,000.00	4,725,990.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,500,000.00	7,232,485.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,000,000.00	3,281,160.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	5,000,000.00	5,428,900.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,500,000.00	5,689,970.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,000,000.00	5,651,850.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.00	3,405,630.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,000,000.00	1,114,250.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 11	59,000,000.00	63,739,530.000	
	組入時価比率 : 1.37%		(5,010,564,453)	
	合計時価比率 : 1.40%			
	MEXICAN BONDS 9.0 12/20/12	49,000,000.00	51,425,990.000	
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	120,000,000.00	136,640,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	78,804,600.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	70,000,000.00	79,265,200.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.00	72,333,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	50,000,000.00	56,700,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	42,000,000.00	45,961,440.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 : 7	456,000,000.00	521,131,430.000	
	組入時価比率 : 0.81%		(2,975,660,465)	
	合計時価比率 : 0.83%			
合計			357,920,231,801	
			(357,920,231,801)	

(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. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 108銘柄	40.06%	40.92%
英ポンド	国債証券 35銘柄	8.88%	9.07%
カナダドル	国債証券 23銘柄	2.91%	2.98%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.61%	0.63%
ユーロ	国債証券 205銘柄	40.42%	41.28%

デンマーククローネ	国債証券	9銘柄	0.93%	0.95%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	0.30%	0.31%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	0.71%	0.73%
シンガポール・ドル	国債証券	9銘柄	0.43%	0.44%
マレーシアリングgit	国債証券	10銘柄	0.46%	0.47%
オーストラリアドル	国債証券	11銘柄	1.37%	1.40%
メキシコ ペソ	国債証券	7銘柄	0.81%	0.83%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,923,296	3,221,864
投資証券		3,989,131,620	4,126,423,510
未収入金		-	288,813,310
未収配当金		52,932,794	50,026,956
流動資産合計		4,044,987,710	4,468,485,640
資産合計		4,044,987,710	4,468,485,640
負債の部			
流動負債			
未払解約金		225,000	189,736,000
流動負債合計		225,000	189,736,000
負債合計		225,000	189,736,000
純資産の部			
元本等			
元本		4,818,520,039	6,155,381,436
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	773,757,329	1,876,631,796
元本等合計		4,044,762,710	4,278,749,640
純資産合計		4,044,762,710	4,278,749,640
負債純資産合計		4,044,987,710	4,468,485,640

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年6月8日から平成23年6月6日まで及び平成23年6月7日から平成24年6月6日までとなっております。

(追加情報)

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
----	--------------	---------------

*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,046,203,350円	4,818,520,039円
同期中追加設定元本額	2,731,852,993円	3,173,816,879円
同期中解約元本額	2,959,536,304円	1,836,955,482円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	49,123,937円	45,687,156円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	466,233,307円	476,725,760円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,715,643円	2,498,685円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	2,735,162,509円	4,838,618,566円
D I A Mグローバルβ 私募ファンド（適格機関投資家向け）	330,392,888円	363,475,224円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	816,592,293円	- 円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	418,299,462円	428,376,045円
（合 計）	4,818,520,039円	6,155,381,436円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	4,818,520,039口	6,155,381,436口
*3 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773,757,329円であります。	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1,876,631,796円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	223,081,396	730,307,245
合計	223,081,396	730,307,245

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8394円 (8,394円)	0.6951円 (6,951円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額（円）	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	268	136,680,000	
	M I Dリート投資法人	253	46,602,600	
	森ヒルズリート投資法人	319	80,069,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	173	62,626,000	
	産業ファンド投資法人	129	51,019,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,351	196,435,400	
	日本ビルファンド投資法人	797	579,419,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	674	429,338,000	
	日本リテールファンド投資法人	2,592	310,262,400	
	オリックス不動産投資法人	392	121,520,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	986	180,438,000	
	プレミアム投資法人	193	46,860,400	
	東急リアル・エステート投資法人	233	90,637,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	134	70,752,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	421	164,400,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,899	248,734,200	
	森トラスト総合リート投資法人	334	222,110,000	
	インヴィンシブル投資法人	1,858	13,693,460	
	フロンティア不動産投資法人	267	174,084,000	
	平和不動産リート投資法人	959	36,777,650	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	204	133,416,000	
	福岡リート投資法人	170	84,065,000	
	ケネディクス不動産投資法人	395	83,384,500	
	積水ハウス・S I投資法人	159	41,769,300	
	いちご不動産投資法人	1,162	31,374,000	
	大和証券オフィス投資法人	546	89,817,000	
	阪急リート投資法人	118	41,713,000	
	スターツプロシード投資法人	149	14,512,600	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	146	23,228,600	
	トップリート投資法人	214	76,933,000	
	ビ・ライフ投資法人	221	98,013,500	
	日本ホテルファンド投資法人	80	15,368,000	
	日本賃貸住宅投資法人	1,834	50,159,900	
	ジャパンエクセレント投資法人	260	80,210,000	
合計		20,890	4,126,423,510	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況
貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		38,106,492	41,409,768
コール・ローン		37,494,374	6,210,204
投資信託受益証券		540,509,472	382,344,508
投資証券		2,903,142,253	2,211,430,857
未収入金		2,136,069	38,232
未収配当金		15,044,704	6,538,626
流動資産合計		3,536,433,364	2,647,972,195
資産合計		3,536,433,364	2,647,972,195
負債の部			
流動負債			
未払解約金		197,000	139,000
流動負債合計		197,000	139,000
負債合計		197,000	139,000
純資産の部			
元本等			
元本		4,294,154,362	3,746,139,784
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	757,917,998	1,098,306,589
元本等合計		3,536,236,364	2,647,833,195
純資産合計		3,536,236,364	2,647,833,195
負債純資産合計		3,536,433,364	2,647,972,195

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時 価で評価しております。時価評価に あたっては、金融商品取引所等にお ける最終相場（最終相場のないもの については、それに準ずる価額）、又 は金融商品取引業者等から提示され る気配相場に基づいて評価しており ます。
2. デリバティブ等の評価基準及び 評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期 間末日の対顧客先物売買相場の仲値 によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基 本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対 顧客電信売買相場の仲値により円貨 に換算するほか、「投資信託財産の 計算に関する規則」（平成12年総理 府令第133号）第60条及び同第61条 にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価 証券報告書における開示対象ファン ドと異なり、平成22年11月9日から平 成23年11月7日まで及び平成23年11 月8日から平成24年11月6日までと なっております。

（追加情報）

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,538,417,323円	4,294,154,362円
同期中追加設定元本額	31,852,462円	31,131,206円
同期中解約元本額	1,276,115,423円	579,145,784円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	51,473,309円	47,923,474円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	488,493,388円	499,647,966円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,054,746円	33,066,174円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	3,522,957,216円	2,990,376,523円
D I A Mグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	196,175,703円	175,125,647円
（合計）	4,294,154,362円	3,746,139,784円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	4,294,154,362口	3,746,139,784口
*3 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757,917,998円であります。	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1,098,306,589円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年11月12日 至平成23年5月11日	自平成23年5月12日 至平成23年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
--	--------------	---------------

種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	15,822,223	1,159,580
投資証券	192,452,853	67,888,767
合計	176,630,630	69,048,347

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成23年5月11日現在	平成23年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8235円 (8,235円)	0.7068円 (7,068円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年11月11日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	206,000.00	360,500.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	132,000.00	261,360.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	150,000.00	165,000.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	170,000.00	196,350.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	120,000.00	70,200.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	95,000.00	149,625.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 6	873,000.00	1,203,035.000	
	組入時価比率 : 2.73%		(72,182,100)	
	合計時価比率 : 2.78%			
	BWP TRUST	20,500.00	34,645.000	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	152,300.00	140,116.000	
	MIRVAC GROUP	191,854.00	242,695.310	
	INVESTA OFFICE FUND	161,080.00	99,064.200	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	8,480.00	27,136.000	
	CFS RETAIL PROPERTY	153,300.00	272,874.000	
	GPT GROUP	121,000.00	377,520.000	
	ABACUS PROPERTY GR	16,920.00	31,302.000	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	25,840.00	86,822.400	
	STOCKLAND	158,140.00	512,373.600	

	WESTFIELD GROUP	128,200.00	1,008,934.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	357,400.00	305,577.000	
	GOODMAN GROUP	445,762.00	274,143.630	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,590.00	53,077.500	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	190,200.00	479,304.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 15	2,154,566.00	3,945,584.640	
	組入時価比率 : 11.71%		(310,162,409)	
	合計時価比率 : 11.96%			
投資信託受益証券計			382,344,508	
			(382,344,508)	
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,900.00	260,481.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	8,750.00	834,662.500	
	CEDAR REALTY TRUST INC	5,300.00	16,801.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,400.00	31,008.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	8,300.00	142,843.000	
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7,715.00	176,056.300	
	AGREE REALTY CORP	1,100.00	26,917.000	
	BRE PROPERTIES -CL A	5,300.00	255,354.000	
	SL GREEN	5,625.00	378,843.750	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	2,200.00	97,108.000	
	PROLOGIS INC	29,129.00	793,473.960	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,868.00	734,262.840	
	LEXINGTON REALTY TRUST	3,521.00	26,266.660	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,800.00	224,846.000	
	CBL & ASSOCIATES	5,882.00	83,877.320	
	MACK CALI	5,300.00	138,542.000	
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	3,500.00	67,935.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,100.00	80,755.000	
	COUSINS PROPERTIES INC	909.00	5,672.160	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,000.00	116,000.000	
	EQUITY ONE INC	6,000.00	99,360.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.00	44,382.000	
	DDR CORP	12,882.00	150,590.580	
	DUKE REALTY TRUST	17,200.00	196,424.000	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,700.00	58,366.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,060.00	276,575.600	
	EQUITY RESIDENTIAL	19,900.00	1,140,071.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,030.00	347,547.200	
	FIRST INDUSTRIAL RT	4,600.00	42,918.000	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	34,963.00	494,376.820	
	GLIMCHER REALTY TRUST	800.00	7,032.000	
	FELCOR LODGING TR INC	4,700.00	14,476.000	
	HOME PROPERTIES INC	2,400.00	135,960.000	
	HCP INC	24,600.00	927,666.000	
	COMMONWEALTH REIT	4,325.00	74,692.750	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.00	100,514.000	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,300.00	96,855.000	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.00	41,600.000	
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,400.00	185,052.000	
	HEALTH CARE REIT INC	11,201.00	555,009.550	

	EAST GROUP	2,300.00	97,313.000	
	KIMCO REALTY	27,299.00	438,967.920	
	KILROY REALTY CORP	2,500.00	90,525.000	
	LTC PROPERTIES INC	3,500.00	98,420.000	
	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	11,300.00	240,803.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,400.00	230,954.000	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	5,700.00	52,440.000	
	THE MACERICH COMPANY	8,820.00	429,622.200	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,800.00	175,756.000	
	ACADIA REALTY TRUST	4,585.00	89,728.450	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	41,168.00	550,416.160	
	MID AMERICA	2,200.00	132,022.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,000.00	82,270.000	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	11,500.00	81,995.000	
	PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	58,163.000	
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600.00	52,808.000	
	GETTY REALTY CORP	3,500.00	51,520.000	
	POST PROPERTIES, INC	4,400.00	178,508.000	
	PS BUSINESS PARKS	2,100.00	110,208.000	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	52,192.000	
	REALTY INCOME CORP	8,100.00	264,384.000	
	REGENCY	6,400.00	239,680.000	
	UDR INC	13,779.00	333,727.380	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,800.00	87,780.000	
	SAUL CENTERS INC	800.00	27,016.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,274.00	2,299,600.160	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	2,700.00	109,863.000	
	PUBLIC STORAGE	8,678.00	1,076,766.240	
	SUN COMMUNITIES INC	1,200.00	43,920.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	3,100.00	187,798.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	4,700.00	129,297.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.00	31,545.000	
	VENTAS INC	17,102.00	901,617.440	
	VORNADO REALTY TRUST	11,729.00	914,979.290	
	WASHINGTON REIT	4,000.00	111,080.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	7,100.00	147,609.000	
	CAPLEASE INC	7,000.00	27,650.000	
	BIOMED REALTY TRUST INC	8,300.00	150,645.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,709.00	214,943.850	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,900.00	131,334.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.00	63,498.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,340.00	84,142.800	
	CUBESMART	8,900.00	84,550.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,510.00	345,972.900	
	INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.00	35,035.000	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	70,824.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,372.00	71,329.440	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,900.00	37,401.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	9,900.00	180,873.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,000.00	74,720.000	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	3,500.00	76,930.000	

	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	13,000.00	218,010.000	
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,200.00	95,524.000	
米ドル小計	銘柄数 : 93	721,525.00	21,645,851.220	
	組入時価比率 : 63.43%		(1,679,501,596)	
	合計時価比率 : 64.75%			
	BRITISH LAND CO PLC	58,200.00	285,820.200	
	DERWENT LONDON PLC	5,800.00	96,338.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.00	26,400.000	
	HAMMERSON PLC	46,200.00	180,503.400	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	52,600.00	353,998.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	7,067.00	16,904.260	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	37,804.00	117,268.000	
	SHAFTESBURY PLC	16,000.00	80,480.000	
	SEGRO PLC	50,090.00	116,058.530	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	21,400.00	76,119.800	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	60,000.00	68,700.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 11	365,161.00	1,418,590.190	
	組入時価比率 : 6.61%		(175,153,331)	
	合計時価比率 : 6.75%			
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	3,400.00	88,978.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	5,400.00	111,024.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	5,900.00	91,391.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	5,400.00	116,478.000	
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	1,300.00	9,490.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.00	93,987.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	10,000.00	249,100.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	1,200.00	26,388.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	4,900.00	97,265.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	12,000.00	48,480.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800.00	134,736.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 11	55,000.00	1,067,317.000	
	組入時価比率 : 3.07%		(81,318,883)	
	合計時価比率 : 3.14%			
	BEFIMMO	1,104.00	59,152.320	
	COFINIMMO SA	1,090.00	95,669.300	
	WAREHOUSES DE PAUW	1,934.00	72,911.800	
	GECINA SA	1,790.00	114,560.000	
	ICADE EMGP	1,520.00	94,361.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,760.00	776,160.000	
	KLEPIERRE	7,000.00	155,330.000	
	FONCIERE DES REGIONS	2,000.00	97,000.000	
	MERCIALYS	3,065.00	79,077.000	
	EUROCOMMERCIAL	3,000.00	78,225.000	
	VASTNED RETAIL	700.00	23,681.000	
	CORIO NV	5,800.00	195,866.000	
	WERELDHAVE NV	1,500.00	79,980.000	
	NIEUWE STEEN INVS	2,691.00	28,147.860	
ユーロ小計	銘柄数 : 14	38,954.00	1,950,121.880	
	組入時価比率 : 7.76%		(205,581,849)	
	合計時価比率 : 7.93%			
	LINK REIT/THE	135,000.00	3,780,000.000	

	GZI REAL ESTATE INVESTMENT TRU	133,000.00	469,490.000	
	CHAMPION REIT	250,000.00	760,000.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	218,000.00	802,240.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 4	736,000.00	5,811,730.000	
	組入時価比率 : 2.19%		(57,942,948)	
	合計時価比率 : 2.23%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	73,600.00	72,496.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.00	54,500.000	
	ARGOSY PROPERTY TRUST	88,000.00	71,280.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 3	211,600.00	198,276.000	
	組入時価比率 : 0.45%		(11,932,250)	
	合計時価比率 : 0.46%			
投資証券計			2,211,430,857	
			(2,211,430,857)	
合計			2,593,775,365	
			(2,593,775,365)	

(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. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 93銘柄	63.43%	64.75%
英ポンド	投資証券 11銘柄	6.61%	6.75%
カナダドル	投資証券 11銘柄	3.07%	3.14%
ユーロ	投資証券 14銘柄	7.76%	7.93%
香港ドル	投資証券 4銘柄	2.19%	2.23%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 6銘柄	2.73%	2.78%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 15銘柄	11.71%	11.96%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.45%	0.46%

(注)「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	704,946,089円
負債総額	1,596,061円
純資産総額（ - ）	703,350,028円
発行済数量	1,192,830,000口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5896円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	250,847,650,636円
負債総額	6,329,479,230円
純資産総額（ - ）	244,518,171,406円
発行済数量	251,873,645,066口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9708円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	273,927,048,771円
負債総額	13,816,615,688円
純資産総額（ - ）	260,110,433,083円
発行済数量	230,964,070,226口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1262円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	408,093,658,490円
負債総額	9,652,575,000円
純資産総額（ - ）	398,441,083,490円
発行済数量	351,774,884,339口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1327円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	358,410,407,650円
負債総額	66,369,028円
純資産総額（ - ）	358,344,038,622円
発行済数量	318,493,809,179口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1251円

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
-----	--------

資産総額	3,622,411,424円
負債総額	110,000円
純資産総額（ - ）	3,622,301,424円
発行済数量	5,242,716,445口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6909円

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年11月30日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	2,574,354,561円
負債総額	27,000円
純資産総額（ - ）	2,574,327,561円
発行済数量	3,748,956,884口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6867円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割で

きるものとしします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額 20億円

発行する株式総数 80,000株

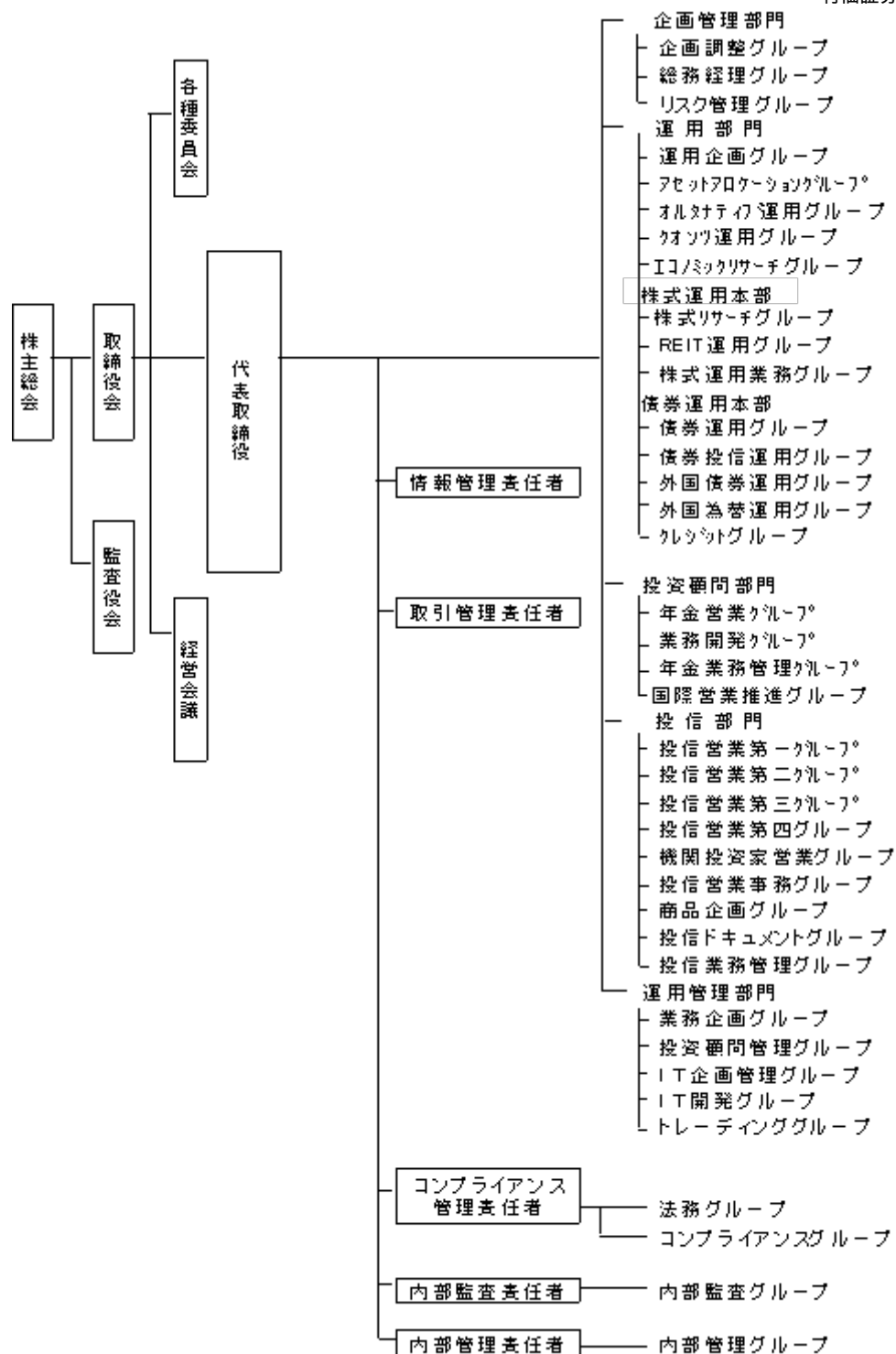
発行済株式総数 24,000株

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

（２）会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成23年11月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

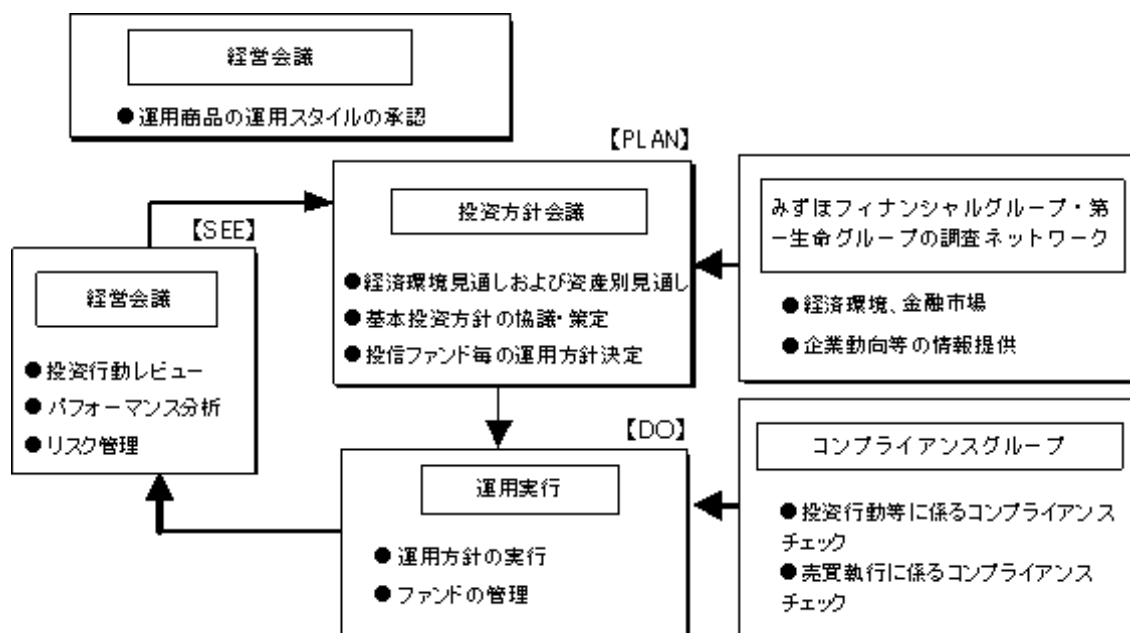
投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成23年11月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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り、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23年11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は276本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	15	27,181,307,408
追加型株式投資信託	250	3,883,142,562,511
単位型公社債投資信託	10	72,965,381,972
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	390,024,043
合計	276	3,983,679,275,934

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）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。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「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。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「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、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	13,820,588	12,220,759
金銭の信託	399,833	5,967,344
前払費用	33,221	27,593
未収委託者報酬	3,169,323	2,942,180
未収運用受託報酬	1,000,785	1,061,935
未収投資助言報酬	2 271,577	2 267,240
未収収益	247,552	186,483
繰延税金資産	383,608	403,201
その他	21,009	102,404
流動資産計	19,347,501	23,179,143
固定資産		
有形固定資産	599,421	400,967
建物	1 237,642	1 183,704
器具備品	1 351,237	1 206,306
建設仮勘定	10,541	10,956
無形固定資産	964,184	1,267,273
商標権	1 804	1 510
ソフトウェア	1 557,870	1 780,190
ソフトウェア仮勘定	397,829	478,971
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 531	1 451
投資その他の資産	5,247,891	4,252,397
投資有価証券	1,194,081	604,498
関係会社株式	2,161,144	2,457,319
繰延税金資産	403,908	402,191
長期差入保証金	1,187,070	702,696
その他	328,612	85,690
貸倒引当金	26,925	-
固定資産計	6,811,497	5,920,638
資産合計	26,158,999	29,099,782

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）	第26期 （平成23年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)		第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	26,734,588		24,367,005	
運用受託報酬	4,297,349		4,458,894	
投資助言報酬	1,027,153		1,019,727	
その他営業収益	723,055		789,867	
営業収益計		32,782,146		30,635,495
営業費用				
支払手数料	13,000,141		10,405,593	
広告宣伝費	218,782		272,928	
公告費	1,767		2,297	
調査費	5,056,427		4,755,890	
調査費	2,555,070		2,611,173	
委託調査費	2,501,356		2,144,716	
委託計算費	351,370		338,206	
営業雑経費	679,608		671,721	
通信費	32,088		30,286	
印刷費	613,198		585,041	
協会費	21,225		23,561	
諸会費	41		38	
支払販売手数料	13,054		32,794	
営業費用計		19,308,097		16,446,637
一般管理費				
給料	4,678,614		4,576,265	
役員報酬	1 244,725		1 235,289	
給料・手当	3,840,052		3,768,114	
賞与	593,836		572,860	
交際費	45,342		38,997	
寄付金	3,450		13,335	
旅費交通費	269,516		255,190	
租税公課	85,030		89,571	
不動産賃借料	791,980		718,929	
退職給付費用	132,513		139,773	
固定資産減価償却費	397,252		486,987	
福利厚生費	22,233		20,476	
修繕費	5,615		20,842	
賞与引当金繰入	572,614		575,326	
役員退職慰労引当金繰入	45,086		42,036	
役員退職金	18,129		13,140	
機器リース料	2,191		1,951	
事務委託費	285,449		331,935	
消耗品費	78,753		70,952	
器具備品費	2,046		575	
諸経費	88,728		124,218	
一般管理費計		7,524,549		7,520,506
営業利益		5,949,500		6,668,351

（単位：千円）

	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）		第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	5,287		4 341,775	
受取利息	18,745		9,168	
時効成立分配金	157		2,574	
投資信託解約益	559,971		157,213	
先物利益	-		9,816	
金銭の信託運用益	-		69,014	
雑収入	3,431		8,602	
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771		755	
時効成立後支払分配金	444		-	
先物損失	719,577		-	
金銭の信託運用損	1,116		-	
雑損失	-		6,089	
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	-		4,288	
過年度損益修正益	-		3, 4 105,241	
特別利益計		-		109,530
特別損失				
固定資産除却損	2 21,626		2 31,419	
固定資産売却損	2,464		1,440	
関係会社株式評価損	-		3,825	
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		135,267		7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	10,040,000	11,650,000
	当期変動額	1,610,000	1,780,000
	当期末残高	11,650,000	13,430,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	3,299,438	3,464,702
	当期変動額		
	剰余金の配当	1,626,000	1,680,000
	別途積立金の積立	1,610,000	1,780,000
	当期純利益	3,401,263	4,454,678
	当期末残高	3,464,702	4,459,380
	利益剰余金合計		
	前期末残高	13,962,732	15,737,995
	当期変動額	1,775,263	2,774,678
	当期末残高	15,737,995	18,512,674
	株主資本合計		
	前期末残高	18,391,210	20,166,473
	当期変動額	1,775,263	2,774,678
	当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	1,547	231,525
	当期変動額（純額）	233,073	14,991
	当期末残高	231,525	216,534
純資産合計			
	前期末残高	18,389,662	20,397,999
	当期変動額	2,008,336	2,759,687
	当期末残高	20,397,999	23,157,686

[次へ](#)

重要な会計方針

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法 3. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法 4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 6. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権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。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。	1. 有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左 3. デリバティブの評価基準及び評価方法 同左 4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左 6. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左

(3)退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。	(3)退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。
(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。	
(4)役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。	(4)同左
7.リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。	7.リース取引の処理方法 同左
8.消費税等の処理方法 税抜方式によっております。	8.消費税等の処理方法 同左

追加情報

第25期（平成22年3月31日現在）	第26期（平成23年3月31日現在）
当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

注記事項

（貸借対照表関係）

第25期（平成22年3月31日現在）			第26期（平成23年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	471,484千円		建物	484,832千円	
器具備品	356,326千円		器具備品	499,620千円	
商標権	6,882千円		商標権	2,428千円	
ソフトウェア	684,370千円		ソフトウェア	809,403千円	
電話施設利用権	1,065千円		電話施設利用権	1,145千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

（損益計算書関係）

第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）		第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	
1. 役員報酬の限度額		1. 役員報酬の限度額	
取締役	年額250,000千円	同左	
監査役	年額 50,000千円		
2. 固定資産除却損の内訳		2. 固定資産除却損の内訳	
建物	1,199千円	建物	15,317千円
器具備品	15,159千円	器具備品	3,597千円
ソフトウェア	5,267千円	ソフトウェア	12,503千円
		3. 過年度損益修正益の内訳	
		特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。	
		4. 関係会社項目	
		各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。	
		受取配当金	331,240千円
		過年度損益修正益	105,241千円

（株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	前事業年度末 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	前事業年度末 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

(リース取引関係)

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)				第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)			
1. 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				1. 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	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	46,681千円	-	46,681千円
減価償却累計額				減価償却累計額			
相当額	75,063千円	-	75,063千円	相当額	46,138千円	-	46,138千円
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円
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			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料				未経過リース料			
期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円	期末残高相当額	586千円	-	586千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		15,998千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		14,995千円	
支払利息相当額		845千円		支払利息相当額		234千円	
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。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産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。				利息相当額の算定方法 同左			
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,475千円	-	1,475千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券及び金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託であり、為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	-
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	1,111,335	1,111,335	-
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	-
資産計	15,393,243	15,393,243	-
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	-
負債計	1,283,275	1,283,275	-
デリバティブ取引(*)	(38,094)	(38,094)	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（3）投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

	1年以内 （千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超 （千円）
（1）預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1．売買目的有価証券

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	368,968	146,101	222,866
債券	-	-	-
その他（投資信託）	716,414	544,802	171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	25,953	30,000	4,047
小計	25,953	30,000	4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
719,016	162,043	4,830

（金銭の信託関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	399,833	838

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	5,967,344	119,701

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 （千円）	契約額のうち 1年超（千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	22,960	-	743	743
	香港ドル	27,416	-	264	264
	豪ドル	101,481	-	1,076	1,076
	シンガポールドル	14,547	-	154	154
合計		166,405	-	2,238	2,238

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（2）株式関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 （千円）	契約額のうち 1年超（千円）	時価 （千円）	評価損益 （千円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	561,971	-	29,413	29,413
合計		561,971	-	29,413	29,413

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	REIT指数先物取引 売建	104,418	-	6,442	6,442
合計		104,418	-	6,442	6,442

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日現在)	(千円)
(1) 退職給付債務	530,305	
(2) 未認識数理計算上の差異	41,515	
退職給付引当金	488,790	

3. 退職給付費用に関する事項

	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	(千円)
(1) 勤務費用	82,653	
(2) 利息費用	6,471	
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	5,402	
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,987	
退職給付費用	132,513	

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第26期（平成23年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項

第26期
(平成23年3月31日現在) (千円)

(1)	退職給付債務	636,624
(2)	未認識数理計算上の差異	57,560
	退職給付引当金	579,063

3．退職給付費用に関する事項

第26期
(自 平成22年4月 1日
至 平成23年3月31日) (千円)

(1)	勤務費用	85,216
(2)	利息費用	7,954
(3)	数理計算上の差異の費用処理額	9,383
(4)	確定拠出年金 拠出額	37,218
	退職給付費用	139,773

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	108,541	128,299
未払事業所税	6,290	6,141
賞与引当金	233,054	234,157
未払法定福利費	26,912	28,823
未払確定拠出年金掛金	2,712	2,739
減価償却超過額	17,598	36,256
減価償却超過額（一括償却資産）	6,098	3,039
繰延資産償却超過額（税法上）	89,657	139,027
退職給付引当金	198,937	235,678
役員退職慰労引当金	39,211	40,806
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	66,421	763
関係会社株式評価損	-	1,556
貸倒引当金繰入額	14,840	-
繰延税金資産合計	815,851	862,867
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	28,334	57,474
繰延税金負債合計	28,334	57,474
差引繰延税金資産の純額	787,517	805,393

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

第25期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第26期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（セグメント情報等）

１．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

２．関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（１）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（追加情報）

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

（関連当事者との取引）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22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 の所有 (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				
その他の 関係会社	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 (基金償却 積立金)	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	711,279	未収投 資助言 報酬	190,025
								販売手数料 の支払	13,054		
								保険料の支 払	6,572		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

（注5）平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。
新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

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 の所有 (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				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	785,924	未払 費用	296,169
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	244,629	未払 費用	98,673

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)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 の所有 (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				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
								信託報酬の 支払	130		

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

第26期（自平成22年4月1日 至平成23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 の所有 (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				
その他の 関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

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 の所有 (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				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)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 の所有 (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				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一ファイ ナンス テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
								信託報酬の 支払	3,163		

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税が含まれております。

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）
_____	_____

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,268,020
金銭の信託		5,629,150
前払費用		59,568
未収委託者報酬		2,810,956
未収運用受託報酬		1,659,443
未収投資助言報酬		313,603
未収収益		243,409
繰延税金資産		375,975
その他		20,513
流動資産計		22,380,642
固定資産		
有形固定資産		381,897
建物	1	168,959
器具備品	1	173,255
建設仮勘定		39,682
無形固定資産		1,279,779
商標権	1	430
ソフトウェア	1	1,082,772
ソフトウェア仮勘定		189,016
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	411
投資その他の資産		4,173,376
投資有価証券		388,843
関係会社株式		2,457,319
繰延税金資産		542,108
長期差入保証金		702,696
その他		82,408
固定資産計		5,835,053
資産合計		28,215,695

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,186,600	
運用受託報酬	2,427,618	
投資助言報酬	487,590	
その他営業収益	367,965	
営業収益計		15,469,773
営業費用		
支払手数料	5,317,217	
広告宣伝費	77,160	
調査費	2,399,769	
調査費	1,478,893	
委託調査費	920,876	
委託計算費	170,060	
営業雑経費	274,550	
通信費	13,894	
印刷費	212,477	
協会費	12,507	
諸会費	19	
支払販売手数料	35,652	
営業費用計		8,238,758
一般管理費		
給料	2,023,999	
役員報酬	123,681	
給料・手当	1,900,318	
交際費	15,479	
寄付金	3,156	
旅費交通費	98,767	
租税公課	46,092	
不動産賃借料	322,850	
退職給付費用	73,794	
固定資産減価償却費	1 228,152	
福利厚生費	15,312	
修繕費	3,575	
賞与引当金繰入	566,648	
役員退職慰労引当金繰入	26,763	
役員退職金	528	
機器リース料	828	
事務委託費	174,574	
消耗品費	28,721	
器具備品費	671	
諸経費	52,322	
一般管理費計		3,682,240
営業利益		3,548,774

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	57,123	
受取利息	2,091	
雑収入	3,855	
営業外収益計		63,070
営業外費用		
為替差損	1,209	
時効成立後支払分配金	36	
金銭の信託運用損	337,781	
雑損失	997	
営業外費用計		340,025
経常利益		3,271,819
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	1,959	
特別利益計		1,959
特別損失		
固定資産除却損	5,729	
固定資産売却損	381	
特別損失計		6,111
税引前中間純利益		3,267,666
法人税、住民税及び事業税		1,344,597
法人税等調整額		24,919
法人税等合計		1,319,677
中間純利益		1,947,989

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)
株主資本	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
評価・換算差額等	当期首残高	13,430,000
	当中間期変動額	2,200,000
	当中間期末残高	15,630,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	4,459,380
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	2,208,000
	別途積立金の積立	2,200,000
純資産合計	中間純利益	1,947,989
	当中間期末残高	1,999,370
	利益剰余金合計	
	当期首残高	18,512,674
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	18,252,663
	株主資本合計	
	当期首残高	22,941,152
	当中間期変動額	260,010
	当中間期末残高	22,681,141
	その他の有価証券評価差額金	
	当期首残高	216,534
	当中間期変動額（純額）	127,883
	当中間期末残高	88,650

	当期首残高	23,157,686
	当中間期変動額	387,894
	当中間期末残高	22,769,792

[前へ](#) [次へ](#)

重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4) 役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間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。

7．リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 ... 499,974千円 器具備品 ... 531,842千円 商標権 ... 2,508千円 ソフトウェア ... 798,730千円 電話施設利用権 ... 1,185千円

（中間損益計算書関係）

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1. 減価償却実施額	有形固定資産 ... 64,964千円 無形固定資産 ... 163,188千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

（リース取引関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

１．ファイナンス・リース取引

(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース資産の内容

該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「４．固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引（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いるもの）

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中間期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料中間期末残高相当額

該当事項はありません。

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	588千円
--------	-------

減価償却費相当額	543千円
----------	-------

支払利息相当額	1千円
---------	-----

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産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。

２．オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額

<u>1年以内</u>	<u>1 年 超</u>	<u>合 計</u>
670千円	-	670千円

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,268,020	11,268,020	-
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	308,597	308,597	-
資産計	17,205,769	17,205,769	-
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	-
負債計	1,383,356	1,383,356	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（3）投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等（中間貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

- 1．満期保有目的の債券
該当事項はありません。
- 2．子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
- 3．その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	298,359	146,101	152,257
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,119	10,000	2,881
小計	7,119	10,000	2,881
合計	308,597	159,101	149,495

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（金銭の信託関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

- 1．満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
- 2．その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

1．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,186,600	2,915,208	367,965	15,469,773

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（持分法損益等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）		
1株当たり純資産額	948,741円	34銭
1株当たり中間純利益金額	81,166円	22銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

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もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(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) (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) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及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】

- (1) 受託会社

- a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

- b. 資本金の額

平成23年3月末日現在 247,303百万円

- c. 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

- (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

（平成23年3月末日現在）

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	7,425	「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おります。

- (3) 投資顧問会社

- a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

平成23年5月末日現在 5,425万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

(4) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM International Ltd

b. 資本金の額

平成23年12月末日現在 400万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (6) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

委託会社は、DIAM International Ltdの株式について100%保有しています。

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当特定期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書 類 名	提 出 年 月 日
有価証券報告書	平成23年8月11日
有価証券届出書の訂正届出書	平成23年8月11日
臨時報告書	平成23年5月20日、平成23年7月20日、平成23年9月20日

独立監査人の監査報告書

平成23年12月21日

D I A M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 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の平成23年5月12日から平成23年11月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の平成23年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

上記は、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。
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。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月10日

D I A Mアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野 功	印
--------------------	-------	------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 浅野 功 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 近藤 敏弘 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以 上

（注）上記は、独立監査人の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。