

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成22年4月12日

【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

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 マネックス資産設計ファンド<育成型>

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 3,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド<育成型>  
(以下「ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）  
格付けは取得していません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）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（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

3,000億円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### <基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンドの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。

当ファンドの基準価額は、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（営業日の午前9時から午後5時まで）

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【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。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

**(7)【申込期間】**

継続申込期間：平成22年4月13日から平成23年4月11日まで

ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所の休業日に該当する場合（以下「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付を行いません。

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**(8)【申込取扱場所】**

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、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（営業日の午前9時から午後5時まで）

**(9)【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。

**(10)【払込取扱場所】**

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・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（営業日の午前9時から午後5時まで）

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

**(12)【その他】**

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。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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。

ただし、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取得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かか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。

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

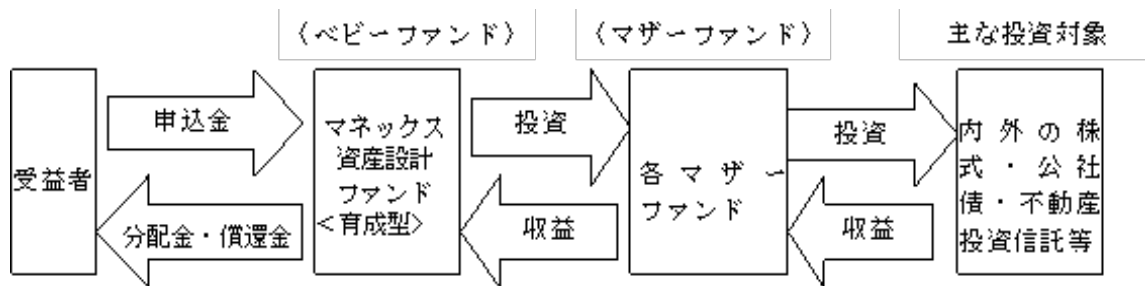
## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- 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、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。「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、投資家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（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）の受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



- 当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。
- 委託会社との投資一任契約に基づき、当ファンドの主要投資対象である各マザーファンドのうちグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドについてはDIAM International Ltdが信託財産の運用指図等を行います。
- 委託会社との投資顧問契約に基づき、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社が、基本資産配分比率について助言を行います。
- 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	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## ・商品分類定義

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	グローバル (日本を含む)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリーファ ンド	あり ( )	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
不動産投信	日々	オセアニア			
	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ ・ファンズ	なし	
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))		アフリカ			その他 (MSCIコクサイ ・インデックス、N OMURA - 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)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)			
		エマージング			

(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1回」とは目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

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)【ファンドの仕組み】

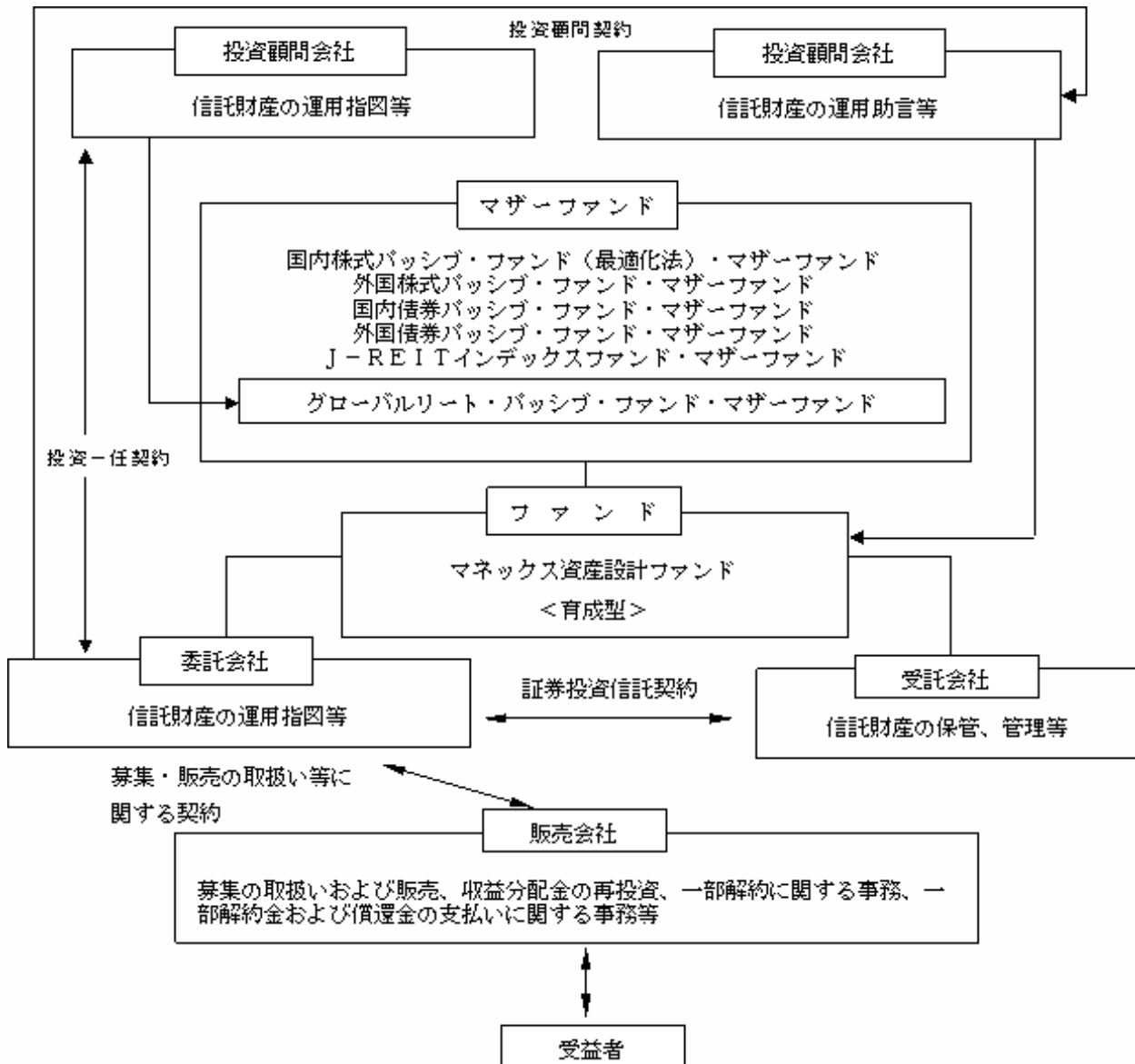
ファンドの関係法人は次の通りです。

- ・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、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、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・アソシエイツ・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。

### ファンドの関係法人



・「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、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、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）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）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。



## 委託会社の概況

## 資本金の額

20億円（平成22年1月29日現在）

## 委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日 会社設立

平成10年 3月31日 「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

平成10年12月 1日 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

平成11年10月 1日 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22年1月29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	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

（ ）平成22年4月1日現在

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <投資態度>

実質的に、国内外の株式、債券および不動産投資信託証券（REIT）の計6資産への分散投資を行います。各資産への投資は、以下のマザーファンド受益証券を通じて行います。

国内株式

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内債券

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国債券

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内REIT（リート）

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

外国REIT（リート）

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

不動産投資信託証券（REIT）とは

- ・不動産投資信託証券（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不動産投資信託証券については、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・不動産投資信託証券（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。多くの不動産投資信託証券（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、不動産投資信託証券（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、そのほとんどを不動産投資信託証券（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。

基本資産配分比率は原則として年1回見直します。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。

基本資産配分比率については、原則として各資産の長期のヒストリカルデータをもとに期待リターン・ボラティリティ・相関を推計し、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かれた配分とします。ただし、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投資比率は50%以下にします。

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。

## (2)【投資対象】

## 1. 投資の対象とする資産の種類（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。

a. 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ます。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 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（以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」といいます。）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、第5号から第15号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ます。）

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

(24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

- (25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に  
限ります。)
- (26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券  
に表示されるべきもの
- (28) 外国の者に対する権利で前号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、前記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

### 4. 前記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を前記3. の(1)から(4)までの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)「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の投資方針
--

#### <基本方針>

この投資信託は、わが国の株式市場全体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)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### <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)流動性基準によるユニバース設定

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

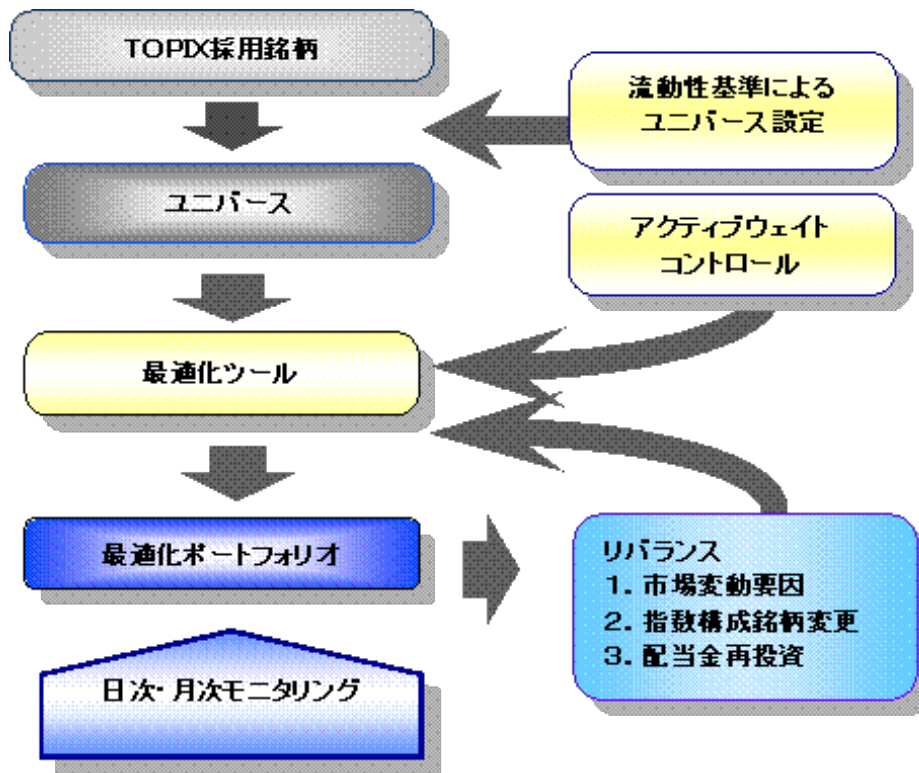
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

##### 3)リバランス

日々・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
- ・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. 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。

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が、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。

#### < 主な投資制限 >

株式への投資割合には、制限を設けません。

(参考)「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針
----------------------------------

## &lt;基本方針&gt;

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。

## &lt;主な投資対象&gt;

海外の株式を主要投資対象とします。

## &lt;投資態度&gt;

1. 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)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、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。

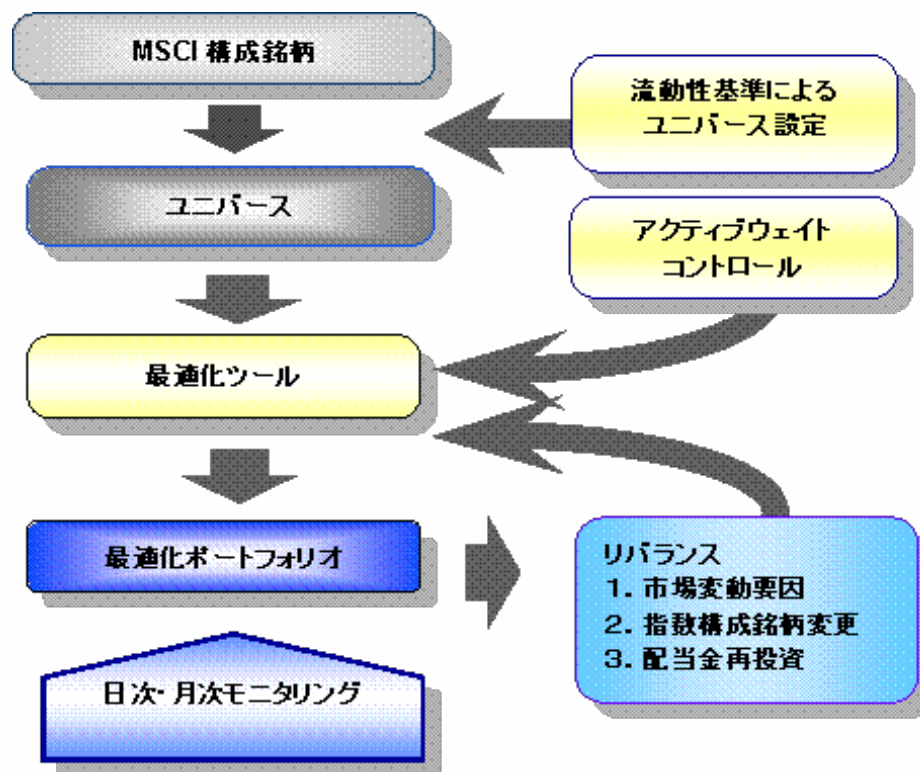
## 2)最適化法によるポートフォリオの構築

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：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



3. 株式の組入比率は、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. 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。

5. 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。

M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I I n c . 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M S C I I n c . に属しており、また、M S C I I n c . 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。

#### < 主な投資制限 >

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 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。
- 3) 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。以下同じ。)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。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

(参考)「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

#### < 基本方針 >

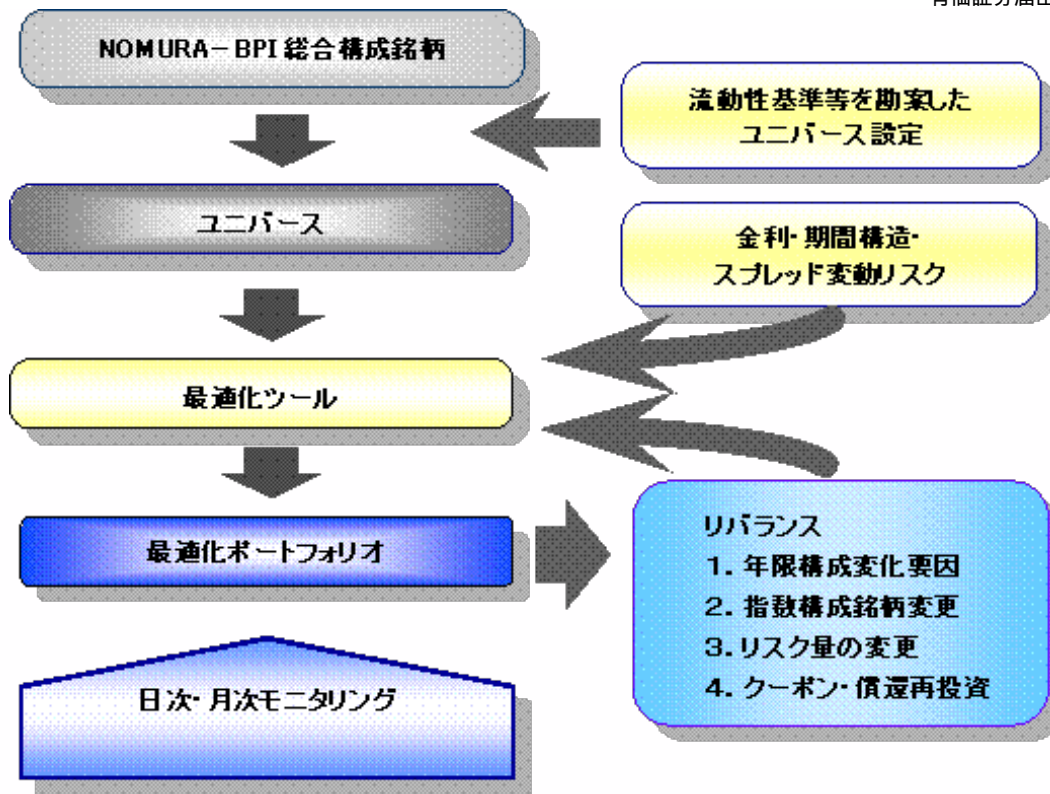
この投資信託は、N O M U R A - B P I 総合 に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### < 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 >

1. 主としてわが国の公社債に投資し、N O M U R A - 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。
2. 運用プロセス
  - 1) 流動性基準によるユニバース設定  
N O M U R A - 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  
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  
、 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) 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。
    - ・ 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



3. 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、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。
5. 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。

NOMURA-BPI 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。

#### < 主な投資制限 >

- 1) 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ます。
- 2) 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。
- 3) 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。
- 4) 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。
- 5) 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。



（参考）「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

<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>

1. 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）」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) 流動性基準によるユニバース設定

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

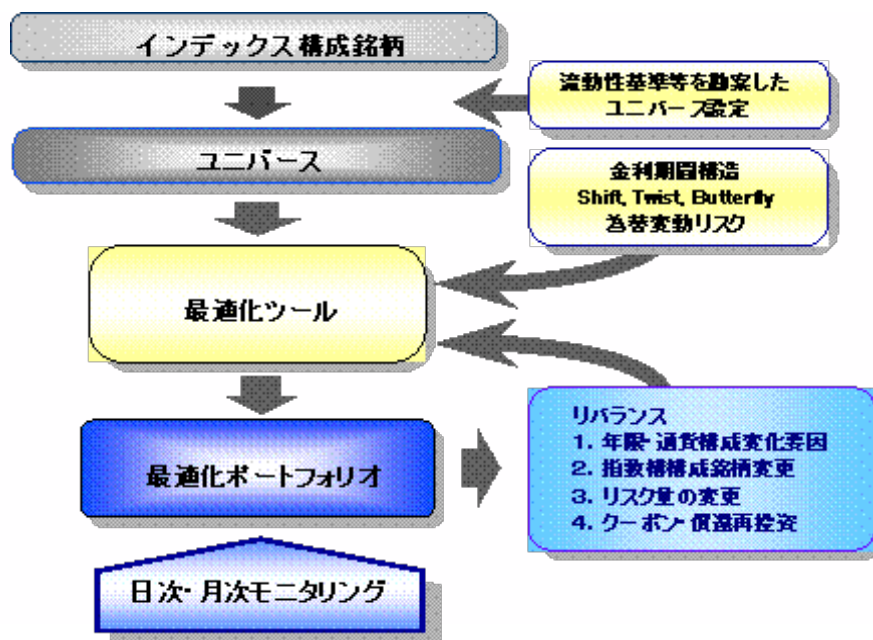
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3) 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。

- ・ 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



3. 外国債券の組入比率は、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. 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。

5. 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。

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・マーケッツ・インクに帰属します。

#### < 主な投資制限 >

- 1) 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。
- 2) 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。
- 3) 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。
- 4) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

(参考)「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の投資方針

#### < 基本方針 >

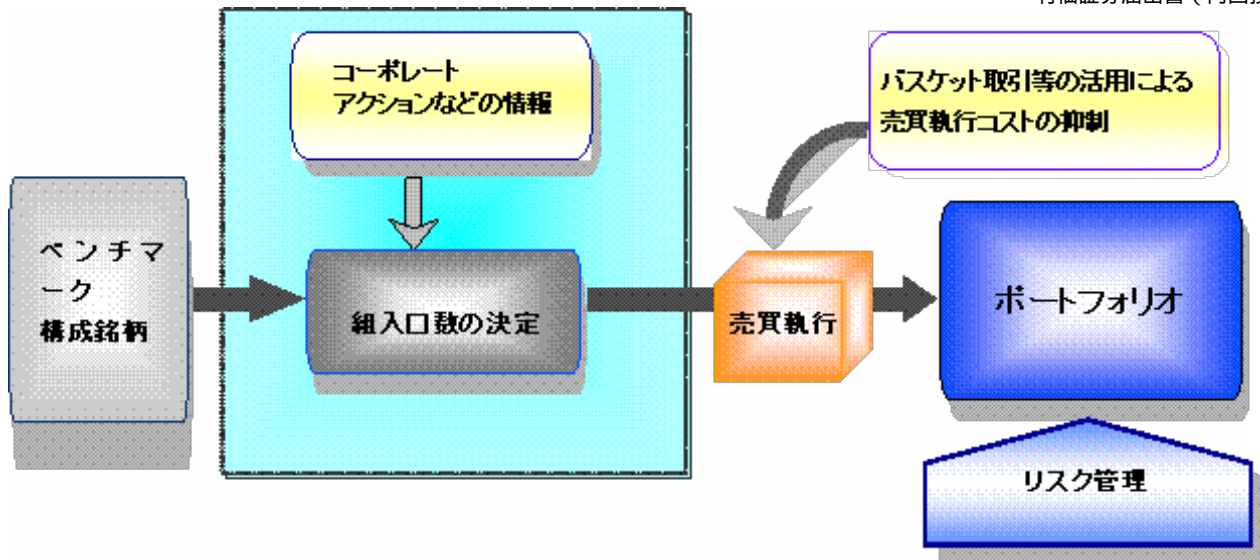
この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

#### < 主な投資対象 >

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（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。



東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数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、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT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。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT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、東証REIT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。また株東京証券取引所は、東証REIT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REIT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REIT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、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、東証REIT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、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。

（参考）「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

## &lt;基本方針&gt;

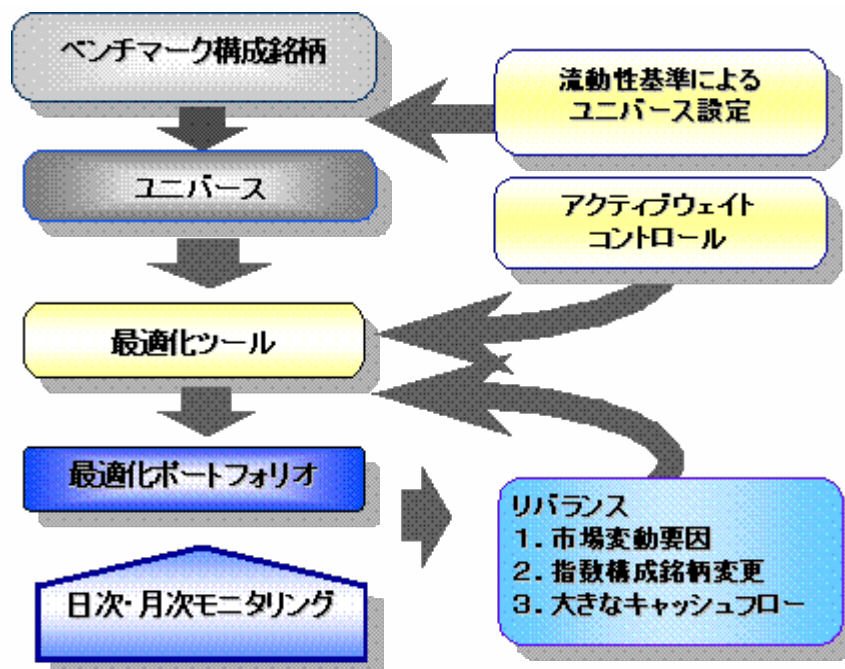
この投資信託は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

## &lt;主な投資対象&gt;

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（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。）を主要投資対象とします。

## &lt;投資態度&gt;

1. 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。
2. 運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。
3. 運用プロセス
  - 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



4. 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。

「Standard & Poor's」、 「S&P」、 は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、また「Citigroup」はCitigroup Global Markets Limited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 >

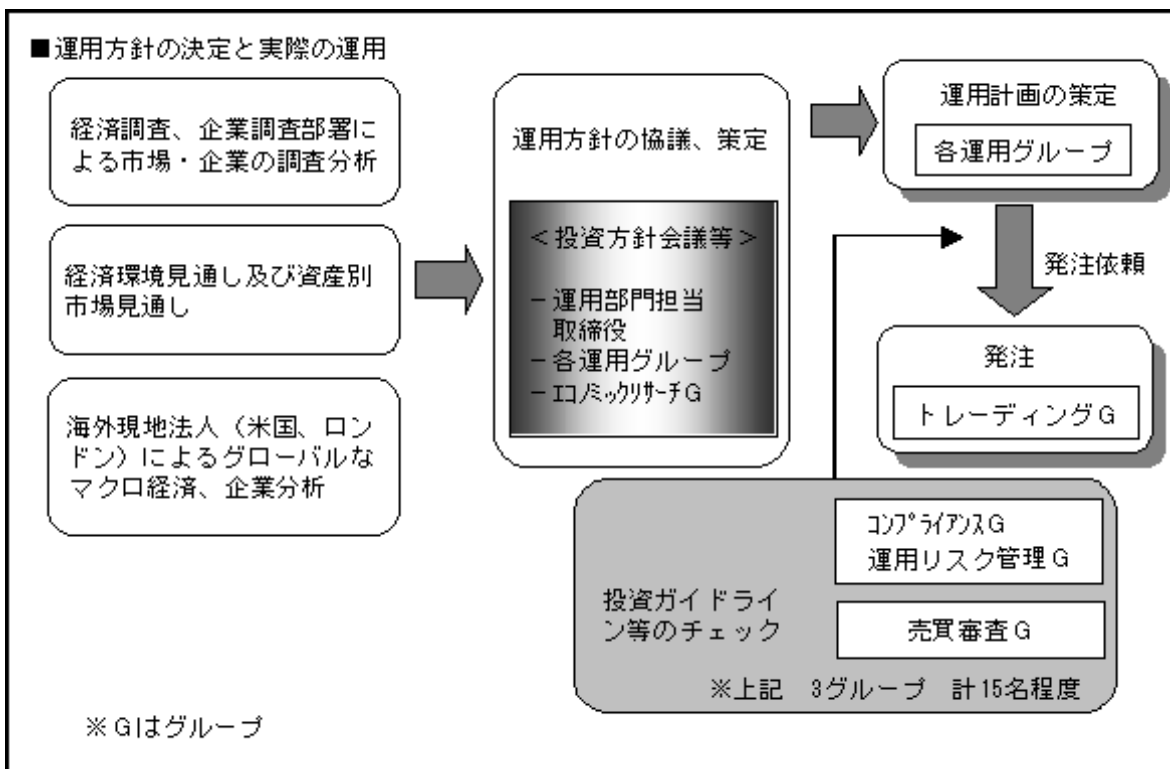
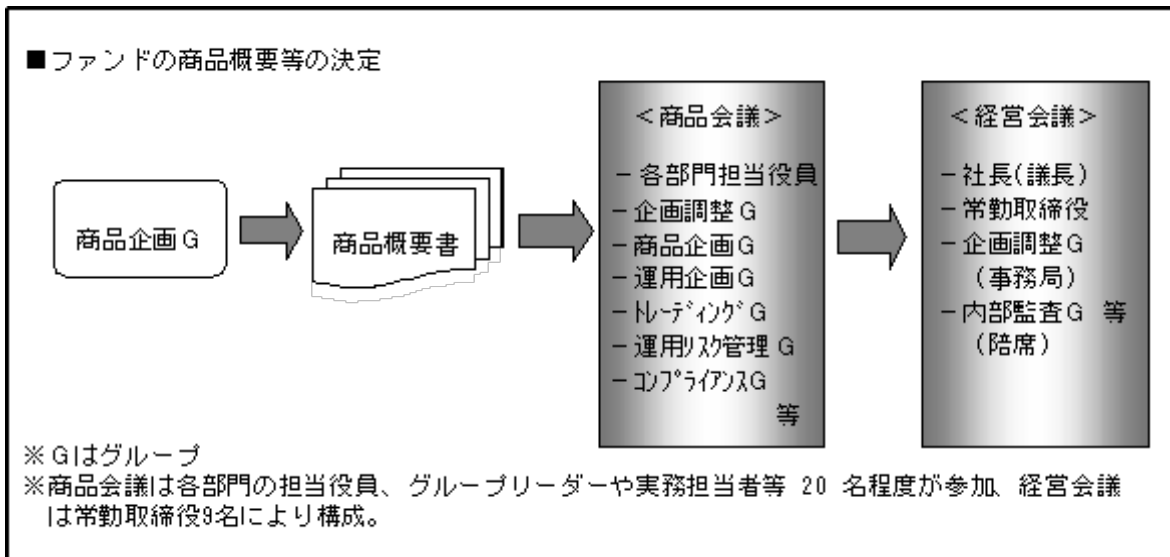
投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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。

## (3) 【運用体制】

## 1. 委託会社の運用体制



## &lt;ファンドの商品概要等の決定&gt;

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。

## &lt;運用方針の決定と実際の運用&gt;

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。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よって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、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその

大半が執行されます。

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、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

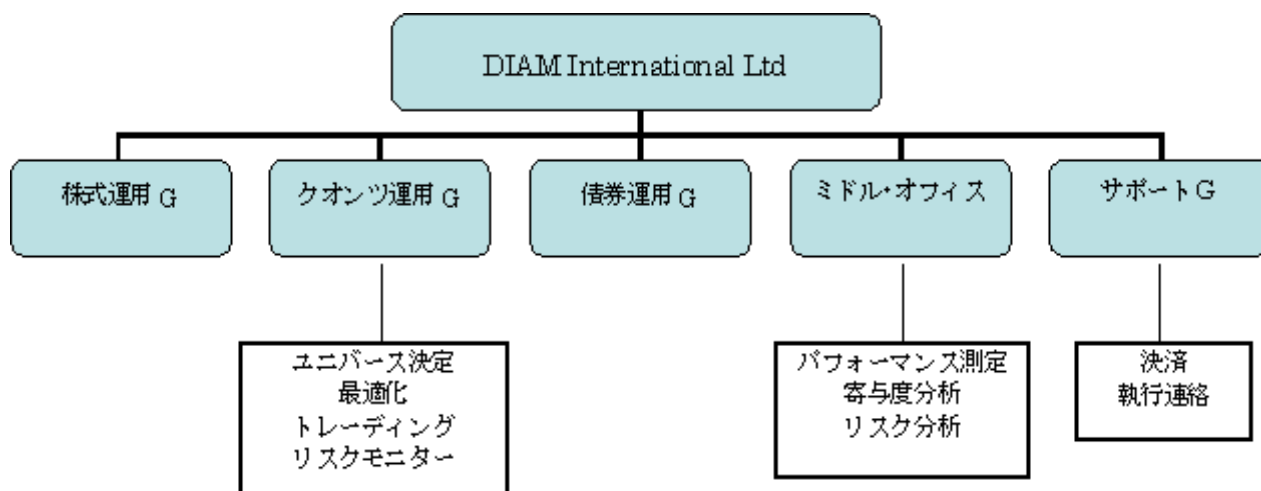
前記体制は平成22年2月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2. 当ファンドの主要投資対象となるグローバルリート・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に関する権限を委託するDIAM International Ltdの運用体制は以下の通りです。

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はクオオンツ運用グループが担当します。当グループは主に日本を除く株式のクオ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・オフィスは、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、リスクをモニターします。

サポート・グループは、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。



上記運用体制は、平成22年1月29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（1月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、経費控除後の利子配当等収益の範囲内で、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」と言います。）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. 前記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、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

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ます。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (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）

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。

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) 前項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券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次の範囲で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評価するものとします。
- 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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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ます。
- 2) 前項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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

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るものとします。
- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額

を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかか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ます。
- 4) 第1項の借入れにかか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) 前項の予約取引の指図は、信託財産にかか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、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかか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ます。
- 3) 前項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かか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かか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) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、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償還金の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) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 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 >

##### 資産配分リスク

当ファンドで行われる各資産毎（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券、国内不動産投資信託証券および外国不動産投資信託証券）の資産配分比率は、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不動産投資信託証券（REIT）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、債券および不動産投資信託証券（REIT）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る可能性があります。

##### 不動産投資信託証券（REIT）の価格変動リスク

一般に不動産投資信託証券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、不動産投資信託証券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の下落要因となる可能性があります。

不動産投資信託証券は、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の下落要因となる可能性があります。

不動産投資信託証券が投資対象とする建物の用途規制等、不動産等にかか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。

不動産投資信託証券が、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、当該不動産

投資信託証券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。

特に不動産投資信託証券は、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。

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する要因となる場合があります。

#### <その他の留意点>

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及ぼす場合があります。

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

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。

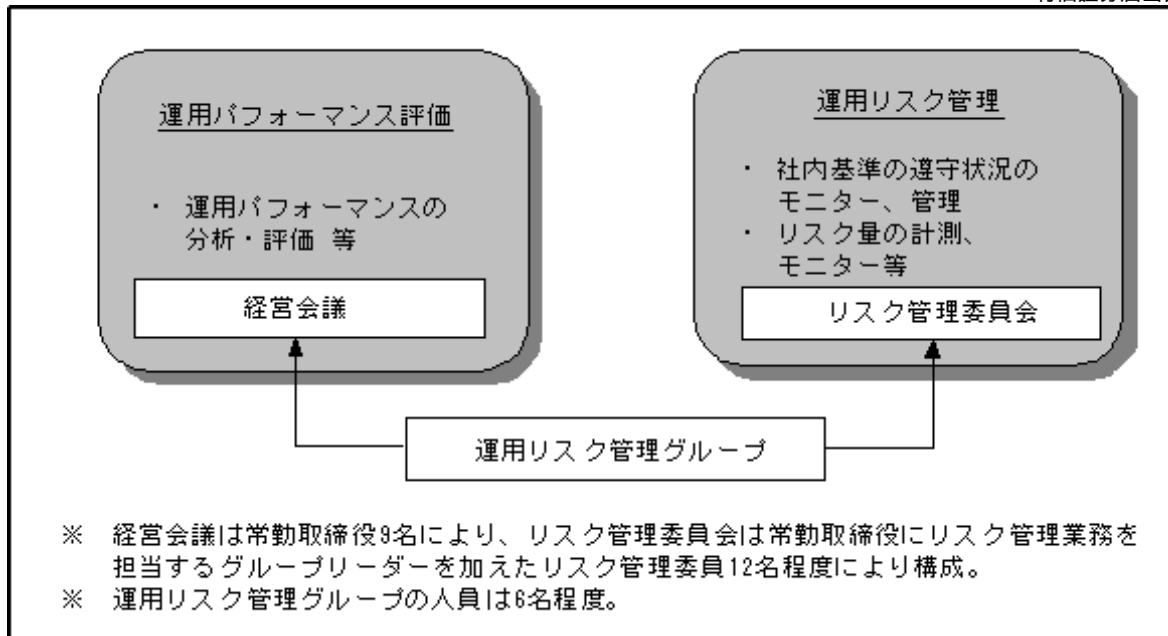
委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券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。したがって、元本が保証されているものではありません。
- ・証券投資信託は、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。
- ・証券投資信託は、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。
- ・証券投資信託は、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。

#### リスク管理体制

<運用評価・運用リスク管理体制>

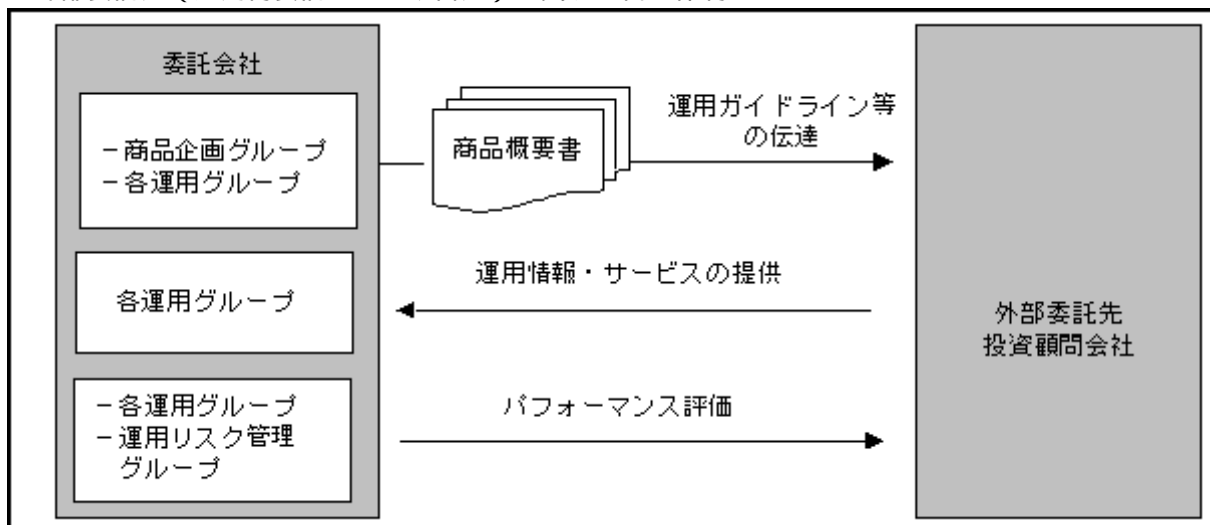


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立した運用リスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、運用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。

上記体制は平成22年1月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### < 外部委託先（運用再委託および助言先）に関する管理体制 >



運用の外部委託先に対しては、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などをまとめた商品概要書によって商品内容を伝達し、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、運用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22年1月29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
		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配分率は、各販売会社の取扱い純資産総額に応じて、以下の通りとします。

純資産総額	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%)

信託報酬の総額は、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および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	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に支払われません。同社への投資顧問報酬は、委託会社が受け取った報酬の中から支払うものとします。

税法が改正された場合等には、前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%の率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および受託会社の立て替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等は、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、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および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係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ならびに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ならびに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、前記内容が変更になることがあります。

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】

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成23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、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として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、申告分離課税もしく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24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

一部解約時および償還時

平成23年12月31日までの間は、一部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%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%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

一部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23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一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）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。

税法が改正された場合等には、前記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、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に個別元本の算出が行われず、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を取得する場合は当該支店毎に、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特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 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「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特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に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、前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22年2月5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	7,051,978,914	98.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		79,869,430	1.12
合 計（純資産総額）		7,131,848,344	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22年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	264,201,181,408	99.56
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,164,244,578	0.44
合 計（純資産総額）		265,365,425,986	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22年2月5日現在

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

株式	米国	140,920,067,405	51.00
	英国	28,767,621,363	10.41
	カナダ	14,453,442,020	5.23
	スイス	12,905,701,432	4.67
	スウェーデン	3,599,815,921	1.30
	デンマーク	1,359,300,085	0.49
	ノルウェー	986,953,879	0.36
	アイルランド	1,508,348,244	0.55
	オランダ	3,864,082,449	1.40
	ベルギー	1,393,591,792	0.50
	ルクセンブルク	821,254,099	0.30
	フランス	14,101,547,264	5.10
	ドイツ	10,797,976,635	3.91
	ポルトガル	380,887,287	0.14
	スペイン	5,673,990,960	2.05
	イタリア	4,570,598,077	1.65
	フィンランド	1,712,026,647	0.62
	オーストリア	470,058,241	0.17
	キプロス	48,154,501	0.02
	ギリシャ	596,346,085	0.22
	香港	3,077,418,095	1.11
	中国	28,926,925	0.01
	シンガポール	2,012,066,994	0.73
	オーストラリア	10,946,484,010	3.96
	ニュージーランド	136,747,795	0.05
	パナマ	301,602,866	0.11
	バミューダ諸島	895,504,602	0.32
	オランダ領アンティル	1,103,933,497	0.40
	ケイマン諸島	246,293,999	0.09
	ガーンジー・チャンネル諸島	43,276,098	0.02
	ジャージー・チャンネル諸島	467,391,984	0.17
	マン島	48,836,701	0.02
	リベリア	53,816,437	0.02
モーリシャス	40,250,740	0.01	
小計	268,334,315,132	97.11	
投資信託受益証券	シンガポール	72,564,682	0.03
	オーストラリア	773,915,174	0.28
	小計	846,479,856	0.31
投資証券	米国	1,944,983,457	0.70
	英国	377,800,500	0.14
	カナダ	50,742,877	0.02
	オランダ	51,253,579	0.02
	フランス	424,834,517	0.15
	香港	81,384,505	0.03
	小計	2,930,999,434	1.06

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4,196,753,354	1.52
合 計 (純資産総額)	276,308,547,776	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22年2月5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	320,851,618,700	75.06
地方債証券	日本	27,828,808,563	6.51
特殊債券	日本	41,027,532,381	9.60
社債券	日本	34,375,716,770	8.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,356,587,558	0.79
合 計 (純資産総額)		427,440,263,972	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22年2月5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	144,636,250,979	35.10
	英国	30,632,521,741	7.43
	カナダ	11,016,465,661	2.67
	スウェーデン	2,802,999,069	0.68
	デンマーク	3,537,980,265	0.86
	ノルウェー	1,399,673,177	0.34
	アイルランド	3,447,066,458	0.84
	オランダ	9,874,074,483	2.40
	ベルギー	12,278,428,787	2.98
	フランス	40,263,334,787	9.77
	ドイツ	43,033,347,951	10.44
	ポルトガル	4,378,223,716	1.06
	スペイン	18,910,259,844	4.59
	イタリア	47,106,345,044	11.43
	フィンランド	2,531,309,030	0.61
	ポーランド	3,634,770,654	0.88
	オーストリア	7,293,121,961	1.77
	ギリシャ	9,256,345,436	2.25
	シンガポール	1,535,026,578	0.37
	マレーシア	2,002,872,799	0.49
オーストラリア	2,919,513,931	0.71	
	小計	402,489,932,352	97.68
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,559,945,730	2.32
合 計（純資産総額）		412,049,878,082	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22年2月5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	3,395,021,500	98.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		67,440,015	1.95
合 計（純資産総額）		3,462,461,515	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22年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
新株予約権証券	フランス	228,800	0.00
投資信託受益証券	シンガポール	152,718,672	2.45
	オーストラリア	990,251,004	15.86
	小計	1,142,969,676	18.30
投資証券	米国	3,487,596,701	55.85
	英国	491,293,643	7.87
	カナダ	73,354,549	1.17
	オランダ	176,538,386	2.83
	ベルギー	48,701,927	0.78
	フランス	454,821,280	7.28
	香港	110,491,990	1.77
	ニュージーランド	33,776,659	0.54
	小計	4,876,575,134	78.09
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		225,118,696	3.60
合 計（純資産総額）		6,244,892,306	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22年2月5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	1,779,861,224	10,906.10	1,941,135,260	10,915.00	1,942,718,525	27.24
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	1,482,710,554	12,819.66	1,900,784,282	12,137.00	1,799,565,799	25.23
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	1,273,114,411	12,194.49	1,552,497,695	11,399.00	1,451,223,117	20.35
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	653,619,799	13,358.79	873,156,838	11,810.00	771,924,982	10.82
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	979,820,181	7,015.22	687,365,730	6,325.00	619,736,264	8.69
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	696,523,765	6,635.13	462,152,675	6,702.00	466,810,227	6.55

(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22年2月5日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.88
合計	98.88

(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22年2月5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	3,062,700	3,345.30	10,245,661,342	3,315.00	10,152,850,500	3.83
2	三菱UFJ フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	16,756,100	489.97	8,210,030,172	457.00	7,657,537,700	2.89
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,901,400	2,454.54	4,667,062,094	3,100.00	5,894,340,000	2.22
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,382,100	2,875.86	3,974,726,688	3,550.00	4,906,455,000	1.85
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,607,900	3,363.35	5,407,930,225	2,808.00	4,514,983,200	1.70
6	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,757,800	1,551.33	2,726,919,947	2,118.00	3,723,020,400	1.40
7	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	927,000	4,043.47	3,748,299,044	4,015.00	3,721,905,000	1.40
8	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,189,700	2,095.37	2,492,865,168	3,085.00	3,670,224,500	1.38
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	876,800	3,852.83	3,378,159,865	4,000.00	3,507,200,000	1.32
10	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,402,000	2,576.58	3,612,360,302	2,431.00	3,408,262,000	1.28
11	みずほフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	19,295,700	204.38	3,943,650,899	172.00	3,318,860,400	1.25

12	任天堂	株式	日本	その他製品	125,800	26,000.26	3,270,832,432	24,300.00	3,056,940,000	1.15
13	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,178,800	1,184.29	2,580,324,061	1,392.00	3,032,889,600	1.14
14	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	4,404,100	577.84	2,544,871,685	637.00	2,805,411,700	1.06
15	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・通信業	19,519	145,198.88	2,834,136,847	140,200.00	2,736,563,800	1.03
16	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	414,600	5,608.74	2,325,382,905	6,030.00	2,500,038,000	0.94
17	三井物産	株式	日本	卸売業	1,895,400	1,081.98	2,050,792,792	1,291.00	2,446,961,400	0.92
18	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	961,400	1,647.09	1,583,509,944	2,304.00	2,215,065,600	0.83
19	東京海上HD	株式	日本	保険業	893,200	2,434.64	2,174,620,136	2,421.00	2,162,437,200	0.81
20	東芝	株式	日本	電気機器	5,018,000	359.72	1,805,056,266	430.00	2,157,740,000	0.81
21	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,544,000	1,265.73	1,954,291,913	1,387.00	2,141,528,000	0.81
22	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	6,549,000	303.94	1,990,528,960	320.00	2,095,680,000	0.79
23	ファナック	株式	日本	電気機器	230,500	6,792.99	1,565,783,707	8,860.00	2,042,230,000	0.77
24	日産自動車	株式	日本	輸送用機器	2,676,700	392.35	1,050,190,726	733.00	1,962,021,100	0.74
25	関西電力	株式	日本	電気・ガス業	910,800	2,199.56	2,003,357,163	2,090.00	1,903,572,000	0.72
26	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	939,100	2,190.04	2,056,669,849	2,000.00	1,878,200,000	0.71
27	信越化学	株式	日本	化学	383,800	4,561.26	1,750,612,836	4,775.00	1,832,645,000	0.69
28	小松製作所	株式	日本	機械	1,034,900	1,256.89	1,300,759,803	1,758.00	1,819,354,200	0.69
29	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	5,551	255,926.06	1,420,645,546	324,500.00	1,801,299,500	0.68
30	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,650	496,338.52	1,811,635,586	485,000.00	1,770,250,000	0.67

(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22年2月5日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	14.66
	輸送用機器	9.81
	銀行業	9.74
	化学	5.86
	情報・通信業	5.68
	電気・ガス業	5.18

卸売業	4.98
機械	4.49
医薬品	4.32
陸運業	3.86
小売業	3.55
食料品	3.47
鉄鋼	2.48
その他製品	2.25
不動産業	2.23
保険業	2.12
建設業	1.96
証券、商品先物取引業	1.82
精密機器	1.60
サービス業	1.57
ガラス・土石製品	1.23
非鉄金属	1.19
繊維製品	0.88
その他金融業	0.72
石油・石炭製品	0.68
金属製品	0.67
ゴム製品	0.57
海運業	0.53
鉱業	0.41
パルプ・紙	0.39
空運業	0.32
倉庫・運輸関連業	0.23
水産・農林業	0.09
合計	99.56

(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22年2月5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	796,174	6,601.14	5,255,658,511	5,800.85	4,618,488,814	1.67
2	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1,328,655	1,800.28	2,391,946,759	2,492.61	3,311,819,138	1.20
3	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	2,880,336	677.50	1,951,440,846	926.80	2,669,486,188	0.97
4	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	485,063	4,666.24	2,263,420,189	5,503.28	2,669,438,477	0.97
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	457,315	5,153.70	2,356,865,646	5,614.42	2,567,559,946	0.93
6	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	148,448	9,910.24	1,471,154,766	17,208.96	2,554,635,694	0.92
7	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コングロマーリット	1,759,706	1,063.46	1,871,383,188	1,437.67	2,529,868,078	0.92
8	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	3,114,930	723.10	2,252,396,189	798.37	2,486,876,881	0.90
9	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	575,869	3,256.02	1,875,039,476	4,180.15	2,407,218,570	0.87
10	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	217,386	8,702.28	1,891,753,370	11,024.49	2,396,569,783	0.87
11	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	651,611	2,465.98	1,606,861,668	3,437.31	2,239,789,332	0.81
12	AT&T INC	株式	米国	各種電気通信サービス	977,648	2,184.36	2,135,534,092	2,243.44	2,193,293,554	0.79
13	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,337,685	1,372.97	1,836,598,732	1,616.03	2,161,737,619	0.78
14	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	332,123	6,254.17	2,077,154,301	6,396.89	2,124,555,327	0.77
15	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	954,486	1,509.19	1,440,504,145	2,072.25	1,977,929,414	0.72
16	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	804,471	1,703.12	1,370,110,202	2,425.39	1,951,154,149	0.71
17	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	40,131	33,813.72	1,356,978,547	47,272.65	1,897,098,902	0.69
18	BANK OF AMERICA CORP	株式	米国	各種金融サービス	1,432,958	746.47	1,069,653,357	1,322.04	1,894,431,377	0.69

19	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	388,872	4,231.17	1,645,383,749	4,747.70	1,846,248,022	0.67
20	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	352,177	5,022.56	1,768,829,585	5,117.68	1,802,330,140	0.65
21	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	556,721	2,582.91	1,437,962,736	3,188.61	1,775,167,317	0.64
22	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	8,750,577	189.09	1,654,619,512	196.80	1,722,140,155	0.62
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	116,462	12,662.34	1,474,681,129	14,749.02	1,717,700,367	0.62
24	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	349,839	4,187.46	1,464,938,192	4,844.91	1,694,937,070	0.61
25	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	506,482	2,309.12	1,169,526,417	3,325.27	1,684,190,920	0.61
26	HEWLETT-PACKARD CO	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	395,694	3,318.93	1,313,279,077	4,215.30	1,667,968,483	0.60
27	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	346,469	4,043.49	1,400,943,345	4,788.93	1,659,216,100	0.60
28	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	929,150	1,304.19	1,211,786,280	1,703.87	1,583,147,373	0.57
29	BANCO SANTANDER SA	株式	スペイン	商業銀行	1,348,688	758.49	1,022,967,668	1,138.77	1,535,842,062	0.56
30	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	864,970	1,709.22	1,478,424,245	1,732.09	1,498,208,309	0.54

(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22年2月5日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.19
	商業銀行	8.68
	医薬品	6.57
	保険	4.25
	金属・鉱業	3.81
	各種電気通信サービス	3.28
	コンピュータ・周辺機器	2.92
	食品	2.69
	食品・生活必需品小売り	2.66
	各種金融サービス	2.66
	ソフトウェア	2.56

資本市場	2.35
化学	2.35
メディア	2.34
電力	2.22
飲料	2.15
コングロマリット	2.14
通信機器	1.90
航空宇宙・防衛	1.79
家庭用品	1.63
総合公益事業	1.61
エネルギー設備・サービス	1.59
ヘルスケア機器・用品	1.58
機械	1.50
半導体・半導体製造装置	1.47
専門小売り	1.41
タバコ	1.36
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.26
ホテル・レストラン・レジャー	1.26
情報技術サービス	1.07
バイオテクノロジー	1.04
無線通信サービス	1.01
インターネットソフトウェア・サービス	0.99
電気設備	0.86
繊維・アパレル・贅沢品	0.73
自動車	0.71
陸運・鉄道	0.62
不動産管理・開発	0.60
複合小売り	0.60
航空貨物・物流サービス	0.59
建設・土木	0.55
建設資材	0.44
電子装置・機器・部品	0.42
商業サービス・用品	0.39
消費者金融	0.36
インターネット販売・カタログ販売	0.33
パーソナル用品	0.31
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.31
専門サービス	0.30
自動車部品	0.26
家庭用耐久財	0.26
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.24
ガス	0.23
紙製品・林産品	0.23
建設関連製品	0.20
運送インフラ	0.17

容器・包装	0.16
商社・流通業	0.16
旅客航空輸送業	0.14
海運業	0.12
各種消費者サービス	0.12
販売	0.10
貯蓄・抵当・不動産金融	0.09
レジャー用品	0.06
事務用電子機器	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
水道	0.04
不動産投資信託	0.02
株式計	97.11
投資信託受益証券	0.31
投資証券	1.06
合計	98.48

(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22年2月5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	63回利付 国庫債券(5年)	国債 証券	日本	7,500,000,000	102.10	7,657,188,000	102.18	7,663,500,000	1.20	2012/ 3/20	1.79
2	81回利付 国庫債券(5年)	国債 証券	日本	7,500,000,000	100.45	7,534,020,000	101.53	7,614,975,000	0.80	2014/ 3/20	1.78
3	85回利付 国庫債券(5年)	国債 証券	日本	7,400,000,000	100.67	7,449,776,000	100.95	7,470,004,000	0.70	2014/ 9/20	1.75
4	303回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	7,100,000,000	100.83	7,159,027,000	100.68	7,148,422,000	1.40	2019/ 9/20	1.67
5	299回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	6,600,000,000	99.26	6,551,433,000	100.49	6,632,340,000	1.30	2019/ 3/20	1.55
6	83回利付 国庫債券(5年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.24	6,580,436,000	101.92	6,624,930,000	0.90	2014/ 6/20	1.55

7	301回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	6,400,000,000	101.53	6,497,944,000	101.88	6,520,320,000	1.50	2019/6/20	1.53
8	61回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	6,300,000,000	102.03	6,428,083,000	101.95	6,423,102,000	1.20	2011/12/20	1.50
9	60回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	6,300,000,000	101.87	6,417,670,000	101.72	6,408,171,000	1.20	2011/9/20	1.50
10	64回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	6,200,000,000	103.11	6,392,707,000	103.10	6,392,014,000	1.50	2012/6/20	1.50
11	285回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,900,000,000	104.87	6,187,256,000	105.41	6,219,308,000	1.70	2017/3/20	1.46
12	66回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,800,000,000	101.85	5,907,543,000	102.32	5,934,618,000	1.10	2012/9/20	1.39
13	72回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,600,000,000	103.47	5,794,320,000	103.99	5,823,272,000	1.50	2013/6/20	1.36
14	293回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,500,000,000	105.02	5,776,137,000	105.44	5,799,035,000	1.80	2018/6/20	1.36
15	75回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,500,000,000	102.00	5,609,847,000	102.73	5,649,985,000	1.10	2013/9/20	1.32
16	286回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,200,000,000	105.48	5,485,148,000	105.99	5,511,480,000	1.80	2017/6/20	1.29
17	297回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	5,200,000,000	100.97	5,250,638,000	101.68	5,287,464,000	1.40	2018/12/20	1.24
18	57回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	5,000,000,000	102.20	5,110,150,000	101.73	5,086,300,000	1.40	2011/6/20	1.19
19	288回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,800,000,000	104.58	5,019,671,000	105.14	5,046,480,000	1.70	2017/9/20	1.18
20	296回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,500,000,000	101.89	4,584,865,000	102.78	4,625,145,000	1.50	2018/9/20	1.08
21	266回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,300,000,000	103.33	4,443,315,000	104.19	4,480,299,000	1.40	2014/12/20	1.05
22	289回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,300,000,000	102.39	4,402,623,000	103.49	4,450,113,000	1.50	2017/12/20	1.04
23	284回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	4,200,000,000	104.81	4,402,134,000	105.54	4,432,764,000	1.70	2016/12/20	1.04
24	70回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	4,300,000,000	100.56	4,324,243,000	101.65	4,370,821,000	0.80	2013/3/20	1.02

25	290回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	101.79	4,275,010,000	102.54	4,306,554,000	1.40	2018/ 3/20	1.01
26	78回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	100.95	4,037,995,000	101.98	4,079,040,000	0.90	2013/ 12/20	0.95
27	54回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,900,000,000	101.41	3,955,068,000	101.09	3,942,354,000	1.10	2011/ 3/20	0.92
28	69回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	101.40	3,853,389,000	101.87	3,871,174,000	0.90	2012/ 12/20	0.91
29	286回利付 国庫債券 (2年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	100.29	3,710,843,000	100.28	3,710,397,000	0.30	2011/ 11/15	0.87
30	280回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,300,000,000	106.68	3,520,491,000	106.98	3,530,208,000	1.90	2016/ 6/20	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22年2月5日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.06
地方債証券	6.51
特殊債券	9.60
社債券	8.04
合計	99.21

(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22年2月5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 11/15/12	国債 証券	米国	3,943,720,000	109.35	4,312,497,257	107.73	4,248,727,305	4.00	2012/ 11/15	1.03
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,585,200,000	110.98	3,978,866,053	109.41	3,922,710,728	4.25	2013/ 11/15	0.95

3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,585,200,000	111.15	3,985,090,796	108.49	3,889,655,184	4.00	2014/ 2/15	0.94
4	US T N/B 4.875 04/30/11	国債 証券	米国	3,585,200,000	108.43	3,887,253,100	105.59	3,785,720,236	4.88	2011/ 4/30	0.92
5	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	3,137,050,000	112.58	3,531,846,092	111.60	3,500,979,171	4.75	2014/ 5/15	0.85
6	US T N/B 5.0 08/15/11	国債 証券	米国	3,226,680,000	109.38	3,529,462,880	106.91	3,449,514,521	5.00	2011/ 8/15	0.84
7	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	3,137,050,000	110.85	3,477,310,411	109.21	3,425,972,305	4.25	2013/ 8/15	0.83
8	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	3,137,050,000	109.84	3,445,678,043	108.38	3,399,777,938	4.38	2012/ 8/15	0.83
9	US T N/B 1.125 06/30/11	国債 証券	米国	3,137,050,000	100.50	3,152,723,912	100.96	3,167,165,680	1.13	2011/ 6/30	0.77
10	US T N/B 1.0 09/30/11	国債 証券	米国	3,137,050,000	100.51	3,153,164,457	100.64	3,157,127,120	1.00	2011/ 9/30	0.77
11	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	3,137,050,000	99.40	3,118,114,963	99.58	3,123,937,131	1.13	2012/ 12/15	0.76
12	US T N/B 4.5 03/31/12	国債 証券	米国	2,868,160,000	108.76	3,119,529,552	107.66	3,087,975,782	4.50	2012/ 3/31	0.75
13	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,868,160,000	108.94	3,124,664,249	107.59	3,085,939,389	3.88	2013/ 2/15	0.75
14	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	2,957,790,000	100.09	2,960,395,426	100.59	2,975,093,072	1.38	2012/ 9/15	0.72
15	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,688,900,000	111.79	3,005,966,354	109.51	2,944,533,723	4.25	2014/ 11/15	0.71
16	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,599,270,000	108.19	2,812,072,453	106.98	2,780,595,075	3.63	2013/ 5/15	0.67
17	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,688,900,000	100.78	2,709,805,229	102.55	2,757,574,506	2.63	2014/ 6/30	0.67
18	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,509,640,000	111.21	2,790,942,586	109.70	2,753,150,369	4.25	2014/ 8/15	0.67
19	US T N/B 0.875 03/31/11	国債 証券	米国	2,688,900,000	100.11	2,691,937,570	100.62	2,705,598,069	0.88	2011/ 3/31	0.66
20	US T N/B 4.5 11/30/11	国債 証券	米国	2,509,640,000	108.54	2,724,033,339	106.90	2,682,754,967	4.50	2011/ 11/30	0.65
21	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	2,339,090,000	108.86	2,546,367,845	108.80	2,544,929,920	4.25	2014/ 7/4	0.62
22	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,509,640,000	100.58	2,524,319,695	101.02	2,535,112,846	2.38	2014/ 9/30	0.62

23	US T N/B 1.125 01/15/12	国債 証券	米国	2,420,010,000	99.60	2,410,445,282	100.64	2,435,401,264	1.13	2012/ 1/15	0.59
24	US T N/B 4.875 02/15/12	国債 証券	米国	2,240,750,000	110.18	2,468,875,156	108.13	2,422,967,790	4.88	2012/ 2/15	0.59
25	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債 証券	フラン ス	2,215,980,000	108.63	2,407,263,394	108.39	2,401,900,722	4.75	2012/ 10/25	0.58
26	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	国債 証券	ドイ ツ	2,215,980,000	108.46	2,403,511,001	108.25	2,398,798,350	4.50	2013/ 1/4	0.58
27	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債 証券	ドイ ツ	2,215,980,000	106.72	2,364,893,856	106.62	2,362,677,876	3.75	2013/ 7/4	0.57
28	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	国債 証券	イタ リア	2,215,980,000	106.18	2,353,035,901	106.08	2,350,711,584	5.00	2012/ 2/1	0.57
29	US T N/B 1.875 06/15/12	国債 証券	米国	2,240,750,000	100.91	2,261,126,629	102.05	2,286,685,375	1.88	2012/ 6/15	0.55
30	US T N/B 0.875 05/31/11	国債 証券	米国	2,240,750,000	100.12	2,243,448,939	100.64	2,255,180,430	0.88	2011/ 5/31	0.55

(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22年2月5日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.68
合計	97.68

(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22年2月5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	665	843,178.25	560,713,539	779,000.00	518,035,000	14.96
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資 証券	日本	601	742,592.49	446,298,089	760,000.00	456,760,000	13.19



3	野村不動産オフィスファンド 投資法人	投資 証券	日本	375	571,288.81	214,233,303	527,000.00	197,625,000	5.71
4	日本リテールファンド投資法 人	投資 証券	日本	474	421,572.78	199,825,500	416,000.00	197,184,000	5.69
5	森トラスト総合リート投資法 人	投資 証券	日本	223	705,502.15	157,326,979	799,000.00	178,177,000	5.15
6	日本プライムリアルティ投資 法人	投資 証券	日本	767	185,754.08	142,473,382	187,000.00	143,429,000	4.14
7	オリックス不動産投資法人	投資 証券	日本	309	409,374.90	126,496,843	424,000.00	131,016,000	3.78
8	フロンティア不動産投資法人	投資 証券	日本	196	538,198.43	105,486,893	638,000.00	125,048,000	3.61
9	ユナイテッド・アーバン投資 法人	投資 証券	日本	247	416,571.50	102,893,160	470,500.00	116,213,500	3.36
10	日本ロジスティクスファンド 投資法人	投資 証券	日本	150	613,217.58	91,982,637	630,000.00	94,500,000	2.73
11	日本アコモデーションファン ド投資法人	投資 証券	日本	192	465,025.95	89,284,982	482,500.00	92,640,000	2.68
12	D A オフィス投資法人	投資 証券	日本	486	217,520.95	105,715,181	187,600.00	91,173,600	2.63
13	東急リアル・エステート投資 法人	投資 証券	日本	208	513,316.39	106,769,810	415,000.00	86,320,000	2.49
14	グローバル・ワン不動産投資 法人	投資 証券	日本	119	650,372.68	77,394,349	680,000.00	80,920,000	2.34
15	ジャパンエクセレント投資法 人	投資 証券	日本	190	386,527.93	73,440,307	405,000.00	76,950,000	2.22
16	トップリート投資法人	投資 証券	日本	190	360,274.15	68,452,088	394,500.00	74,955,000	2.16
17	ケネディクス不動産投資法人	投資 証券	日本	287	275,977.63	79,205,580	240,300.00	68,966,100	1.99
18	日本レジデンシャル投資法人	投資 証券	日本	303	203,671.59	61,712,491	218,500.00	66,205,500	1.91
19	福岡リート投資法人	投資 証券	日本	131	414,032.95	54,238,316	501,000.00	65,631,000	1.90
20	森ヒルズリート投資法人	投資 証券	日本	195	325,647.99	63,501,358	272,500.00	53,137,500	1.53
21	野村不動産レジデンシャル投 資法人	投資 証券	日本	154	380,231.19	58,555,603	343,500.00	52,899,000	1.53
22	プレミア投資法人	投資 証券	日本	161	332,092.01	53,466,813	296,500.00	47,736,500	1.38
23	M I D リート投資法人	投資 証券	日本	225	205,246.52	46,180,468	194,800.00	43,830,000	1.27
24	日本賃貸住宅投資法人	投資 証券	日本	286	108,830.68	31,125,575	148,000.00	42,328,000	1.22
25	日本商業投資法人	投資 証券	日本	316	128,578.48	40,630,800	128,700.00	40,669,200	1.17
26	阪急リート投資法人	投資 証券	日本	105	416,088.15	43,689,256	348,000.00	36,540,000	1.06
27	アドバンス・レジデンス投資 法人	投資 証券	日本	93	348,034.57	32,367,215	331,000.00	30,783,000	0.89
28	ビ・ライフ投資法人	投資 証券	日本	60	269,661.05	16,179,663	473,500.00	28,410,000	0.82

29	ジョイント・リート投資法人	投資証券	日本	128	167,869.83	21,487,338	176,500.00	22,592,000	0.65
30	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	97	251,841.79	24,428,654	228,100.00	22,125,700	0.64

(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22年2月5日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.05
合計	98.05

(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22年2月5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	WESTFIELD GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	374,900	922.59	345,878,766	1,006.60	377,375,315	6.04
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	54,704	6,219.91	340,254,027	6,224.80	340,521,651	5.45
3	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	17,380	18,564.99	322,659,491	19,315.96	335,711,367	5.38
4	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	28,100	5,570.50	156,531,176	5,686.13	159,780,174	2.56
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	54,100	2,623.47	141,929,732	2,932.69	158,658,724	2.54
6	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	22,738	6,873.72	156,294,752	6,872.83	156,274,372	2.50
7	STOCKLAND	投資信託受益証券	オーストラリア	483,140	284.71	137,555,466	301.83	145,823,827	2.34
8	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	25,239	5,592.94	141,160,184	5,658.34	142,810,891	2.29
9	HCP INC	投資証券	米国	54,200	2,546.39	138,014,246	2,489.03	134,905,160	2.16

10	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	英国	139,600	950.81	132,733,690	909.84	127,014,111	2.03
11	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	118,968	900.82	107,168,470	958.14	113,988,559	1.83
12	VENTAS INC	投資証券	米国	28,300	3,573.55	101,131,411	3,670.35	103,870,863	1.66
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	15,078	6,239.14	94,073,818	6,644.27	100,182,332	1.60
14	PROLOGIS	投資証券	米国	90,700	1,068.39	96,902,937	1,092.59	99,097,886	1.59
15	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	英国	156,200	651.87	101,821,457	631.52	98,643,674	1.58
16	LINK REIT/THE	投資証券	香港	428,000	197.39	84,484,461	219.07	93,761,960	1.50
17	HAMMERSON PLC	投資証券	英国	150,200	577.84	86,790,847	549.16	82,483,135	1.32
18	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	米国	22,201	3,845.13	85,365,665	3,622.84	80,430,773	1.29
19	KIMCO REALTY	投資証券	米国	69,399	1,078.25	74,829,395	1,134.72	78,748,142	1.26
20	GPT GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	1,590,000	44.73	71,119,508	48.23	76,685,382	1.23
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券	米国	12,900	5,766.79	74,391,645	5,712.12	73,686,347	1.18
22	CORIO NV	投資証券	オランダ	13,400	5,733.23	76,825,318	5,473.47	73,344,506	1.17
23	NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	投資証券	米国	24,700	2,971.23	73,389,492	2,939.86	72,614,641	1.16
24	MIRVAC GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	554,854	107.74	59,779,498	118.63	65,822,191	1.05
25	SL GREEN	投資証券	米国	16,205	3,453.44	55,963,058	4,042.31	65,505,682	1.05
26	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	米国	14,000	4,056.65	56,793,153	4,292.38	60,093,330	0.96
27	DEXUS PROPERTY GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	856,400	59.51	50,963,807	66.51	56,959,549	0.91
28	AMB PROPERTY CORP	投資証券	米国	27,800	1,994.27	55,440,637	2,043.56	56,811,079	0.91
29	GOODMAN GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	1,189,762	44.73	53,217,162	47.45	56,456,467	0.90
30	SEGRO PLC	投資証券	英国	126,090	478.52	60,336,002	443.90	55,971,573	0.90

(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22年2月5日現在

種類	投資比率（％）
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	18.30
投資証券	78.09
合計	96.40

(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22年2月5日）、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期末（平成20年1月11日現在）	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2期末（平成21年1月13日現在）	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3期末（平成22年1月12日現在）	7,473	7,473	0.7361	0.7361
平成21年2月末	5,910	-	0.6247	-
3月末	6,078	-	0.6397	-
4月末	6,409	-	0.6674	-
5月末	6,642	-	0.6849	-
6月末	6,867	-	0.7003	-
7月末	7,052	-	0.7126	-
8月末	7,207	-	0.7237	-
9月末	7,184	-	0.7165	-
10月末	7,216	-	0.7152	-
11月末	7,021	-	0.6916	-
12月末	7,357	-	0.7236	-
平成22年1月末	7,197	-	0.7060	-
2月5日	7,131	-	0.6998	-

#### 【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	8.75
第2期	30.05
第3期	15.32

(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

## 6【手続等の概要】

### 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。  
当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。  
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。  
また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。
- ・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。
- ・海外休業日には、お申込みの受付を行いません。  
また委託会社は、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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかか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係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。

なお、収益分配金を再投資する場合については各計算期間終了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。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

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。

## 換金（解約）手続等

### 解約のお申込み方法

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。

原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の請求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。

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、解約の請求の受付を行いません。

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、解約の請求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。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の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、当該受益権の解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

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。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（営業日の午前9時から午後5時まで）

### 解約代金の受渡日

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お支払いします。

## 7【管理及び運営の概要】

### 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。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従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（営業日の午前9時から午後5時まで）

### 信託期間

信託期間は、平成19年1月26日から原則として無期限です。

ただし、下記 償還規定により、信託を終了する場合があります。

#### 計算期間

計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月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。

#### 償還規定

委託会社は、次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、当該信託を終了する場合があります。

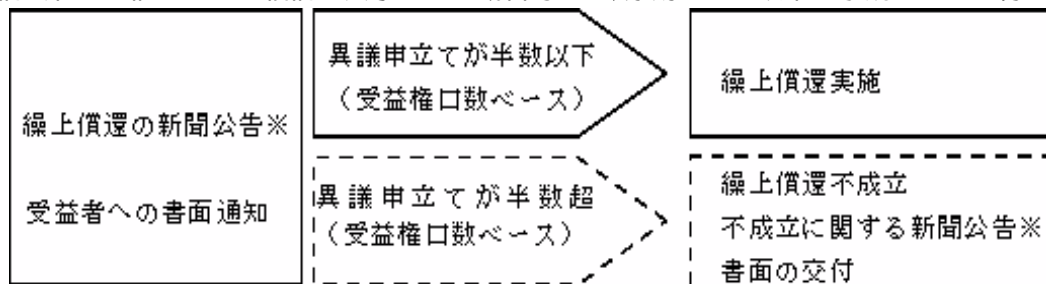
信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合。

受益者のために有利であると認めるとき。

やむを得ない事情が発生したとき。

この場合において、委託会社は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は上記によって信託を終了させる場合等には、原則として以下の手続きにより行います。



受益者の異議申立て

期間は1ヵ月以上。

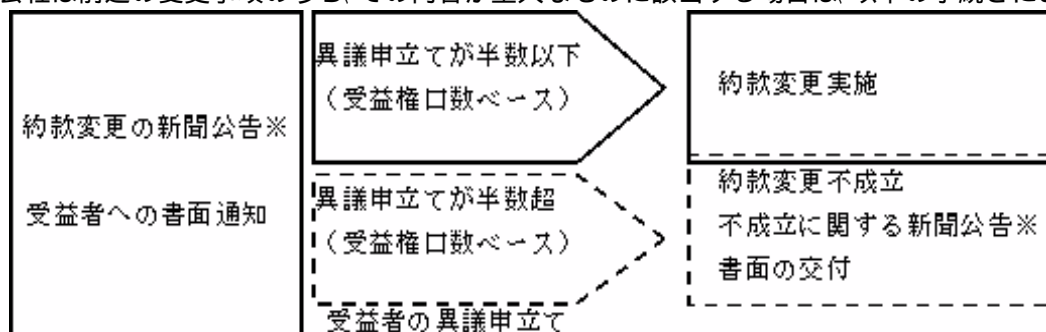
全受益者に書面を通知した場合は、新聞公告を行わない場合があります。

#### 信託約款の変更

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及びその内容を監督官庁に届け出ます。

なお、信託約款の変更を行った場合、運用報告書にてお知らせします。

委託会社は前述の変更事項のうち、その内容が重大なものに該当する場合は、以下の手続きにより行います。



受益者の異議申立て

期間は1ヵ月以上。

全受益者に書面を通知した場合は、新聞公告を行わない場合があります。

#### 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として1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、当該信託財産にかか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/>）



保管

該当事項はありません。

## 第2【財務ハイライト情報】

- (1) 当財務ハイライト情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」（以下「財務諸表」という。）より抜粋しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成20年1月12日から平成21年1月13日まで）及び第3期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12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。  
その監査報告書は、当該財務諸表に添付しております。

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## 1【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年1月13日現在	第3期 平成22年1月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	214,775,611	130,005,962
親投資信託受益証券	5,767,216,104	7,394,681,412
未収入金	-	5,858,000
流動資産合計	5,981,991,715	7,530,545,374
資産合計	5,981,991,715	7,530,545,374
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,738,939	20,957,520
未払受託者報酬	2,543,496	2,638,492
未払委託者報酬	31,975,886	33,170,146
その他未払費用	181,584	188,370
流動負債合計	47,439,905	56,954,528
負債合計	47,439,905	56,954,528
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,297,605,719	10,152,628,435
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	* <sub>3</sub> 3,363,053,909	* <sub>3</sub> 2,679,037,589
(分配準備積立金)	260,793,189	424,807,162
元本等合計	5,934,551,810	7,473,590,846
純資産合計	5,934,551,810	7,473,590,846
負債純資産合計	5,981,991,715	7,530,545,374

## 2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自 平成20年1月12日	至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日	至 平成22年1月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		480,845		90,684
有価証券売買等損益		2,434,709,762		1,026,052,308
営業収益合計		2,434,228,917		1,026,142,992
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		5,391,392		4,928,943
委託者報酬		*1 67,778,454		*1 61,964,907
その他費用		384,922		351,889
営業費用合計		73,554,768		67,245,739
営業利益又は営業損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
経常利益又は経常損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		165,542,580		40,537,557
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		764,699,764		3,363,053,909
剰余金増加額又は欠損金減少額		159,043,213		332,483,263
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		159,043,213		332,483,263
剰余金減少額又は欠損金増加額		415,156,253		566,826,639
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		415,156,253		566,826,639
分配金		*2 -		*2 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,363,053,909		2,679,037,589

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間 末日が休業日のため、平成20年1月 12日から平成21年1月13日までと なっております。	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は前計算期 間末日及び当計算期間末日が休業 日のため、平成21年1月14日から平 成22年1月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年1月13日現在	第 3 期 平成22年1月12日現在
*1 期首元本額	8,740,470,729円	9,297,605,719円
期中追加設定元本額	2,271,286,181円	1,780,961,356円
期中解約元本額	1,714,151,191円	925,938,640円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	9,297,605,719口	10,152,628,435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 3,363,053,909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 2,679,037,589円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12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	1,018,280円	971,671円
*2 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（165,016,567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（48,192,428円）及び分配準備積立金（95,776,622円）より分配対象収益は308,985,617円（1万口当たり332.32円）であります。なお、分配を行っておりません。</p> <p>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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（187,506,924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（101,911,955円）及び分配準備積立金（237,300,238円）より分配対象収益は526,719,117円（1万口当たり518.80円）であります。なお、分配を行っておりません。</p> <p>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。</p>
--	---	---

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,767,216,104	2,347,458,014	7,394,681,412	1,004,679,137
合計	5,767,216,104	2,347,458,014	7,394,681,412	1,004,679,137

## （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）

	第 2 期 平成21年1月13日現在	第 3 期 平成22年1月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6383円 (6,383円)

### 第3【内国投資信託受益証券事務の概要】

#### (1) 受益権の名義書換

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) 受益者集会

該当事項はありません。

#### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

#### (4) 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。

前項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る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。

#### (5) 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。

#### (6) 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ます。

#### (7) 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4【ファンドの詳細情報の項目】

### 第1 ファンドの沿革

### 第2 手続等

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

### 第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
  - (1) 資産の評価
  - (2) 保管
  - (3) 信託期間
  - (4) 計算期間
  - (5) その他
- 2 受益者の権利等

### 第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
  - (1) 貸借対照表
  - (2) 損益及び剰余金計算書
  - (3) 注記表
  - (4) 附属明細表
- 2 ファンドの現況

#### 純資産額計算書

資産総額

負債総額

純資産総額（ - ）

発行済数量

1単位あたり純資産額（ / ）

### 第5 設定及び解約の実績

## 第三部【ファンドの詳細情報】

### 第1【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

### 第2【手続等】

#### 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。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。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、お申込日がニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所の休業日に該当する場合（以下「海外休業日」といいます。）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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

##### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了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。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

- ・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を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。解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までには解約の請求が行われ、かつ、解約の請求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。

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、解約の請求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。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（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お支払いします。

- ・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、解約の請求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。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の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。

## 第3【管理及び運営】

### 1【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（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。）を法令及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（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。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日から無期限ですが、下記(5)イ.の場合には信託を終了することがあります。

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月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. 前記a.の規定にかかわらず、前記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

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、前記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. 委託会社は前記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. 前記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、前記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. 前記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、前記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、後記「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。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、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. 前記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て付記します。

#### 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、前記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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は前記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. 前記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、前記a. ~ e. の規定にしたがいます。
- g. 前記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、新聞公告または書面にて付記します。
- 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。

#### ニ. 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、毎計算期間の末日（原則として1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/>）

## 2【受益者の権利等】

### 収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資されます。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）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### 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）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日。）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かか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。

#### 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。

#### 受益者集会

該当事項はありません。

## 第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、第2期計算期間（平成20年1月12日から平成21年1月13日まで）については改正前の、第3期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12日まで）については改正後の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成20年1月12日から平成21年1月13日まで）及び第3期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12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&lt;育成型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成21年1月13日現在	第3期 平成22年1月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	214,775,611	130,005,962
親投資信託受益証券	5,767,216,104	7,394,681,412
未収入金	-	5,858,000
流動資産合計	5,981,991,715	7,530,545,374
<b>資産合計</b>		
	5,981,991,715	7,530,545,374
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,738,939	20,957,520
未払受託者報酬	2,543,496	2,638,492
未払委託者報酬	31,975,886	33,170,146
その他未払費用	181,584	188,370
流動負債合計	47,439,905	56,954,528
<b>負債合計</b>		
	47,439,905	56,954,528
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,297,605,719	10,152,628,435
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	*3 3,363,053,909	*3 2,679,037,589
(分配準備積立金)	260,793,189	424,807,162
元本等合計	5,934,551,810	7,473,590,846
<b>純資産合計</b>		
	5,934,551,810	7,473,590,846
<b>負債純資産合計</b>		
	5,981,991,715	7,530,545,374

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 2 期		第 3 期	
	自 平成20年 1 月12日	至 平成21年 1 月13日	自 平成21年 1 月14日	至 平成22年 1 月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		480,845		90,684
有価証券売買等損益		2,434,709,762		1,026,052,308
営業収益合計		2,434,228,917		1,026,142,992
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		5,391,392		4,928,943
委託者報酬	*1	67,778,454	*1	61,964,907
その他費用		384,922		351,889
営業費用合計		73,554,768		67,245,739
営業利益又は営業損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
経常利益又は経常損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,507,783,685		958,897,253
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		165,542,580		40,537,557
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		764,699,764		3,363,053,909
剰余金増加額又は欠損金減少額		159,043,213		332,483,263
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		159,043,213		332,483,263
剰余金減少額又は欠損金増加額		415,156,253		566,826,639
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		415,156,253		566,826,639
分配金		*2 -		*2 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,363,053,909		2,679,037,589

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間 末日が休業日のため、平成20年1月 12日から平成21年1月13日までと なっております。	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は前計算期 間末日及び当計算期間末日が休業 日のため、平成21年1月14日から平 成22年1月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 2 期 平成21年1月13日現在	第 3 期 平成22年1月12日現在
*1 期首元本額	8,740,470,729円	9,297,605,719円
期中追加設定元本額	2,271,286,181円	1,780,961,356円
期中解約元本額	1,714,151,191円	925,938,640円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	9,297,605,719口	10,152,628,435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 3,363,053,909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 2,679,037,589円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12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	1,018,280円	971,671円
*2 分配金の計算過程		



	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（165,016,567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（48,192,428円）及び分配準備積立金（95,776,622円）より分配対象収益は308,985,617円（1万口当たり332.32円）であります。なお、分配を行っておりません。</p> <p>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。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（187,506,924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（101,911,955円）及び分配準備積立金（237,300,238円）より分配対象収益は526,719,117円（1万口当たり518.80円）であります。なお、分配を行っておりません。</p> <p>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。</p>
--	---	---

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,767,216,104	2,347,458,014	7,394,681,412	1,004,679,137
合計	5,767,216,104	2,347,458,014	7,394,681,412	1,004,679,137

## （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）

	第 2 期 平成21年1月13日現在	第 3 期 平成22年1月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6383円 (6,383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

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	1,268,381,067	1,546,917,549	

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	1,773,116,897	1,933,761,287	
親投資信託受益証券	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	694,195,892	460,529,554	
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	652,023,646	871,299,198	
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	1,478,983,655	1,896,352,842	
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	977,370,647	685,820,982	
合計		6,844,071,804	7,394,681,412	

## 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-REIT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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,192,708,527	6,144,123,015
株式		145,520,048,562	279,636,813,884
派生商品評価勘定		-	324,456,481
未収入金		-	660,595
未収配当金		164,947,125	215,792,550
差入委託証拠金		1,138,523,214	191,428,081
流動資産合計		156,016,227,428	286,513,274,606
資産合計		156,016,227,428	286,513,274,606
負債の部			
流動負債			

派生商品評価勘定		232,987,333	-
前受金		312,371,214	241,944,081
未払金		-	131,119,706
未払解約金		29,227,000	372,228,000
流動負債合計		574,585,547	745,291,787
負債合計		574,585,547	745,291,787
純資産の部			
元本等			
元本		152,215,619,455	234,321,017,334
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,226,022,426	51,446,965,485
元本等合計		155,441,641,881	285,767,982,819
純資産合計		155,441,641,881	285,767,982,819
負債純資産合計		156,016,227,428	286,513,274,606

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、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。	株式及び新株予約権証券 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	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。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 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20年2月8日から平成21年2月9日までとなっております。	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21年2月10日から平成22年2月8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	91,999,220,127円	152,215,619,455円
同期中追加設定元本額	77,841,184,973円	121,910,897,356円
同期中解約元本額	17,624,785,645円	39,805,499,477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	968,907,124円	1,240,826,388円
D I A M国内株式パッシブ・ ファンド	円	571,853,111円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	22,766,945,494円	27,477,374,032円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	591,561,997円	630,990,480円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,158,682,000円	2,470,316,824円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,247,198,505円	2,663,298,426円
D I A M D C バランス30イ ンデックスファンド	419,279,933円	422,053,974円
D I A M D C バランス50イ ンデックスファンド	1,185,642,117円	1,266,901,924円
D I A M D C バランス70イ ンデックスファンド	856,792,681円	982,497,036円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	138,523,805円	165,580,049円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	878,681,951円	1,268,381,067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)	円	276,749,160円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	12,932,516,408円	12,042,367,860円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投 資家限定)	1,954,812,902円	1,953,730,647円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	228,033,967円	223,706,103円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	808,193,227円	832,965,196円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	247,583,189円	234,305,997円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	323,704,523円	308,472,435円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限 定)	21,701,325,074円	21,326,362,750円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限 定)	6,972,336,458円	6,986,751,720円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	5,931,210,392円	5,617,334,211円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	3,871,851,726円	3,841,880,998円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	8,998,344,203円	8,972,563,967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)	1,292,960,786円	1,294,353,059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)	2,822,820,450円	2,752,665,298円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	2,320,912,753円	2,867,004,337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)	13,968,390,813円	14,738,925,608円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	313,326,020円	243,609,429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)	534,502,143円	545,104,164円
D I A M世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	4,803,799,364円	4,923,564,501円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35V A (適格機関投資家限定)	10,173,189,856円	9,695,713,679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)	480,571,932円	460,058,065円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	17,199,366,114円	42,139,677,496円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	2,123,651,548円	2,974,018,147円
D I A M世界アセットバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	円	5,218,376,675円
D I A M世界アセットバランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	円	25,718,772,412円
D I A Mバランス30V A (適格機関投資家限定)	円	286,039,539円
D I A Mバランス50V A (適格機関投資家限定)	円	93,642円
D I A Mバランス70V A (適格機関投資家限定)	円	144,608円
D I A M世界アセットバランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	円	18,586,676,425円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	円	22,899,615円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	円	49,025,475円
D I A Mバランス20V A (適格機関投資家限定)	円	26,811,895円
D I A Mバランス40V A (適格機関投資家限定)	円	86,893円
D I A Mバランス60V A (適格機関投資家限定)	円	132,017円

(合計)	152,215,619,455円	234,321,017,334円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	152,215,619,455口	234,321,017,334口

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	145,520,048,562	74,396,588,894	279,636,813,884	39,678,759,158
合計	145,520,048,562	74,396,588,894	279,636,813,884	39,678,759,158

(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計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左

5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
--------------------------	--	----

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成21年1月13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	10,189,102,000	-	9,956,850,000	232,987,333
合計		10,189,102,000	-	9,956,850,000	232,987,333

平成22年1月12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	5,793,397,000	-	6,118,425,000	324,456,481
合計		5,793,397,000	-	6,118,425,000	324,456,481

## (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。

## (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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.0212円	1.2196円
(1万口当たり純資産額)	(10,212円)	(12,196円)

[次へ](#)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	189	20,790,000	
日本水産	267,800	269	72,038,200	
マルハニチロホールディングス	531,000	134	71,154,000	
ハウスイ	21,000	115	2,415,000	
サカタのタネ	49,200	1,354	66,616,800	
ホクト	27,200	1,961	53,339,200	
ショーボンドHD	24,000	1,564	37,536,000	
住石ホールディングス	71,400	99	7,068,600	
日鉄鉱業	68,000	450	30,600,000	
三井松島	109,000	159	17,331,000	
国際石油開発帝石	1,214	720,000	874,080,000	
関東天然瓦斯	27,000	503	13,581,000	
石油資源開発	42,000	4,340	182,280,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	121,000	2,662,000	
間組	104,200	87	9,065,400	
東急建設	87,380	240	20,971,200	
コムシスホールディングス	108,300	990	107,217,000	
ミサワホーム	31,300	326	10,203,800	
高松コンストラクショング P	20,300	1,224	24,847,200	
東建コーポレーション	9,970	2,155	21,485,350	
ヤマウラ	8,500	204	1,734,000	
大成建設	1,124,000	183	205,692,000	
大 林 組	690,000	362	249,780,000	
清水建設	696,000	366	254,736,000	
飛鳥建設	717,000	21	15,057,000	
長谷工コーポレーション	1,332,000	76	101,232,000	
松井建設	2,000	351	702,000	
鹿島建設	1,088,000	210	228,480,000	
不動テトラ	182,700	64	11,692,800	
大末建設	96,000	37	3,552,000	
鉄建建設	155,000	83	12,865,000	
安藤建設	86,000	111	9,546,000	
太平工業	35,000	410	14,350,000	
西松建設	326,000	108	35,208,000	
三井住友建設	143,500	77	11,049,500	
大豊建設	73,000	74	5,402,000	
前田建設	178,000	257	45,746,000	
佐田建設	98,000	36	3,528,000	
ナカノフドー建設	22,500	177	3,982,500	

奥村組	237,000	344	81,528,000
大和小田急建設	14,000	249	3,486,000
東鉄工業	33,000	545	17,985,000
イチケン	33,000	109	3,597,000
浅沼組	79,000	68	5,372,000
戸田建設	285,000	330	94,050,000
熊谷組	199,000	62	12,338,000
青木あすなろ建設	18,500	510	9,435,000
北野建設	54,000	223	12,042,000
植木組	30,000	126	3,780,000
三井ホーム	30,000	471	14,130,000
矢作建設	34,000	579	19,686,000
ピーエス三菱	18,500	333	6,160,500
大東建託	106,400	4,650	494,760,000
新日本建設	33,100	150	4,965,000
N I P P O	54,000	685	36,990,000
東亜道路	49,000	129	6,321,000
前田道路	70,000	703	49,210,000
日本道路	74,000	191	14,134,000
東亜建設	220,000	98	21,560,000
若築建設	147,000	48	7,056,000
東洋建設	343,000	48	16,464,000
五洋建設	275,000	98	26,950,000
大林道路	35,000	148	5,180,000
世紀東急	79,000	56	4,424,000
福田組	40,000	168	6,720,000
東北ミサワホーム	13,600	191	2,597,600
住友林業	183,200	772	141,430,400
日本基礎技術	35,900	202	7,251,800
日成ビルド工業	80,000	54	4,320,000
エス・バイ・エル	125,000	49	6,125,000
バコーポレーション	37,600	215	8,084,000
パナホーム	88,000	624	54,912,000
大和ハウス	618,000	1,090	673,620,000
ライト工業	59,500	209	12,435,500
積水ハウス	747,000	896	669,312,000
日特建設	54,000	47	2,538,000
北陸電気工事	2,000	261	522,000
コミュニチュア	17,000	594	10,098,000
ユアテック	44,000	512	22,528,000
西部電気工業	1,000	367	367,000
四電工	2,000	483	966,000
中電工	34,500	1,202	41,469,000
関電工	107,000	633	67,731,000
大明	31,000	702	21,762,000

きんでん	158,000	842	133,036,000
東京エネシス	30,000	623	18,690,000
トーエネック	39,000	549	21,411,000
住友電設	20,100	489	9,828,900
日本電設工業	49,000	752	36,848,000
協和エクシオ	87,500	840	73,500,000
新日本空調	20,400	615	12,546,000
日本工営	84,000	284	23,856,000
東電通	32,000	163	5,216,000
日本電話施設	39,000	285	11,115,000
九電工	51,000	581	29,631,000
三機工業	56,000	688	38,528,000
日 揮	248,000	1,745	432,760,000
中外炉工業	85,000	253	21,505,000
ヤマト	16,000	331	5,296,000
太平電業	32,000	869	27,808,000
高砂熱学	70,400	832	58,572,800
三晃金属	31,000	250	7,750,000
NEC ネットズエスアイ	19,100	1,118	21,353,800
朝日工業社	8,000	381	3,048,000
アタカ大機	4,000	231	924,000
大 気 社	35,700	1,390	49,623,000
ダイダン	25,000	511	12,775,000
日比谷総合設	36,100	833	30,071,300
東芝プラントシステム	36,000	1,185	42,660,000
日本製粉	155,000	468	72,540,000
日清製粉G本社	241,000	1,242	299,322,000
日東富士製粉	8,000	346	2,768,000
昭和産業	112,000	300	33,600,000
鳥越製粉	24,400	814	19,861,600
協同飼料	96,000	119	11,424,000
中部飼料	26,000	822	21,372,000
日本配合飼料	79,000	108	8,532,000
ユニ・チャーム ペットケア	15,300	2,846	43,543,800
東洋精糖	43,000	126	5,418,000
日本甜菜糖	138,000	248	34,224,000
三井製糖	95,000	314	29,830,000
日本M&Aセンター	44	389,500	17,138,000
アコーディア・ゴルフ	619	92,500	57,257,500
パソナグループ	244	61,400	14,981,600
リンクアンドモチベーション	56	41,800	2,340,800
テンプホールディングス	33,900	753	25,526,700
森永製菓	266,000	198	52,668,000
中 村 屋	64,000	497	31,808,000
江崎グリコ	96,000	1,046	100,416,000

名糖産業	12,300	1,292	15,891,600
不二家	153,000	160	24,480,000
山崎製パン	195,000	1,073	209,235,000
第一屋製パン	44,000	118	5,192,000
モロゾフ	30,000	312	9,360,000
森永乳業	225,000	379	85,275,000
ヤクルト	142,400	2,714	386,473,600
明治ホールディングス	78,700	3,530	277,811,000
雪印メグミルク	52,100	1,378	71,793,800
プリマハム	134,000	99	13,266,000
日本ハム	185,000	1,063	196,655,000
伊藤ハム	165,000	339	55,935,000
林兼産業	80,000	120	9,600,000
丸大食品	109,000	289	31,501,000
米久	21,500	858	18,447,000
S Foods	15,500	834	12,927,000
学情	9,300	307	2,855,100
スタジオアリス	11,600	769	8,920,400
シミック	400	19,560	7,824,000
システムプロ	162	41,750	6,763,500
NECフィールドディング	20,100	1,259	25,305,900
新日鉄ソリューションズ	19,500	1,448	28,236,000
総合警備保障	82,600	1,055	87,143,000
日本駐車場開発	2,595	4,120	10,691,400
コア	9,900	691	6,840,900
カカクコム	149	350,000	52,150,000
アイロムホールディングス	545	3,670	2,000,150
ルネサンス	11,000	316	3,476,000
セキュアードキャピタルJ	72	98,500	7,092,000
新日本科学	12,500	541	6,762,500
エムスリー	97	276,500	26,820,500
ディー・エヌ・エー	286	534,000	152,724,000
博報堂DYHLDGS	31,410	4,630	145,428,300
ぐるなび	130	189,200	24,596,000
一休	157	40,200	6,311,400
ジャパンベストレスキューS	47	69,900	3,285,300
ジェイコムホールディングス	23	91,300	2,099,900
パシフィックゴルフGRP	523	67,000	35,041,000
サッポロホールディングス	377,000	540	203,580,000
アサヒビール	462,600	1,764	816,026,400
麒麟HD	1,086,000	1,503	1,632,258,000
宝ホールディングス	209,000	545	113,905,000
オエノンホールディングス	71,000	177	12,567,000
メルシャン	82,000	197	16,154,000
養命酒	3,000	848	2,544,000

三国コカ・コ・ラ	32,900	726	23,885,400
コカ・コーラウエスト	65,600	1,639	107,518,400
コカコーラセントラルジャパン	30,700	1,157	35,519,900
ダイドードリンコ	11,200	2,999	33,588,800
伊藤園	74,000	1,407	104,118,000
キーコーヒー	22,300	1,600	35,680,000
ユニカフェ	6,300	573	3,609,900
ジャパンフーズ	4,200	835	3,507,000
日清オイリオグループ	103,000	485	49,955,000
不二製油	64,600	1,321	85,336,600
J-オイルミルズ	100,000	290	29,000,000
ローソン	65,900	4,140	272,826,000
インターニックス	7,100	330	2,343,000
サンエー	8,000	3,290	26,320,000
キリン堂	9,800	419	4,106,200
ダイユーエイト	1,900	624	1,185,600
カワチ薬品	14,400	1,778	25,603,200
エービーシー・マート	24,600	2,630	64,698,000
ハードオフコーポレーション	9,700	447	4,335,900
高千穂交易	10,000	950	9,500,000
アスクル	19,700	1,666	32,820,200
ゲオ	388	92,600	35,928,800
ポイント	21,040	4,825	101,518,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	123	615,000
伊藤忠食品	5,900	3,075	18,142,500
くらコーポレーション	61	255,900	15,609,900
キャンドウ	115	93,600	10,764,000
エレマテック	15,800	1,042	16,463,600
バル	6,000	1,625	9,750,000
JALUX	7,000	636	4,452,000
エディオン	93,200	950	88,540,000
サーラコーポレーション	24,500	587	14,381,500
トーマンデバイス	3,100	1,649	5,111,900
バルス	96	72,400	6,950,400
あみやき亭	41	188,400	7,724,400
双日	1,566,400	186	291,350,400
アルフレッサホールディングス	55,600	3,770	209,612,000
ハニーズ	16,240	602	9,776,480
キッコーマン	202,000	1,142	230,684,000
味の素	670,000	922	617,740,000
キューピー	137,800	1,017	140,142,600
ハウス食品	98,200	1,356	133,159,200
カゴメ	95,700	1,678	160,584,600
焼津水産化工	13,200	1,086	14,335,200
アリアケジャパン	22,200	1,402	31,124,400

ニチレイ	277,000	343	95,011,000
横浜冷凍	52,000	628	32,656,000
東洋水産	114,000	2,223	253,422,000
日清食品HD	93,800	3,170	297,346,000
永谷園	2,000	866	1,732,000
フジッコ	27,000	1,095	29,565,000
ロックフィールド	13,500	1,245	16,807,500
日本たばこ産業	5,517	326,000	1,798,542,000
わらべや日洋	13,800	1,118	15,428,400
なとり	13,700	819	11,220,300
片倉工業	28,500	830	23,655,000
ゲンゼ	170,000	376	63,920,000
昭栄	39,700	731	29,020,700
神栄	22,000	134	2,948,000
川島織物セルコン	94,000	73	6,862,000
山下医科器械	400	1,179	471,600
ラサ商事	8,600	319	2,743,400
アルペン	17,800	1,404	24,991,200
ビックカメラ	564	33,050	18,640,200
DCM JAPAN HLDGS	117,100	578	67,683,800
あいホールディングス	53,800	293	15,763,400
ユニバース	3,100	1,277	3,958,700
J. フロントリテイリング	552,000	466	257,232,000
ドトール・日レスHD	37,300	1,205	44,946,500
マツモトキヨシHLDGS	39,400	2,028	79,903,200
ココカラファインHD	17,600	1,721	30,289,600
三越伊勢丹HD	406,200	857	348,113,400
東洋紡績	830,000	152	126,160,000
ユニチカ	528,000	76	40,128,000
富士紡ホールディングス	111,000	163	18,093,000
日清紡ホールディングス	163,000	890	145,070,000
倉敷紡績	237,000	152	36,024,000
ダイワボウHD	172,000	205	35,260,000
シキボウ	151,000	151	22,801,000
日東紡績	205,000	166	34,030,000
トヨタ紡織	69,000	2,030	140,070,000
クリエイトSDH	8,200	1,773	14,538,600
バイタルKSKHD	31,300	552	17,277,600
UKCホールディングス	12,700	1,210	15,367,000
日本毛織	85,000	635	53,975,000
大東紡織	39,000	70	2,730,000
トーア紡コーポレーション	93,000	59	5,487,000
ダイドーリミテッド	31,500	648	20,412,000
東京建物不動産販	11,400	297	3,385,800
野村不動産HLDGS	111,900	1,421	159,009,900

ヒューリック	65,000	593	38,545,000
帝国繊維	23,000	454	10,442,000
ブックオフコーポレーション	10,100	1,000	10,100,000
日本コークス工業	201,000	109	21,909,000
ミタチ産業	3,800	518	1,968,400
J F E 商事 H L D G S	157,000	355	55,735,000
あさひ	9,800	1,380	13,524,000
サークルKサンクス	44,200	1,189	52,553,800
日本調剤	3,000	1,990	5,970,000
コスモス薬品	8,800	2,310	20,328,000
シップヘルスケアHD	275	51,700	14,217,500
セブン&アイ・H L D G S	933,200	2,009	1,874,798,800
ツルハホールディングス	17,400	3,355	58,377,000
サンマルクホールディングス	6,700	2,599	17,413,300
フェリシモ	5,900	1,305	7,699,500
トリドール	58	162,300	9,413,400
帝人	870,000	300	261,000,000
東レ	1,546,000	526	813,196,000
三菱レイヨン	574,000	374	214,676,000
クラレ	338,000	1,108	374,504,000
旭化成	1,341,000	487	653,067,000
サカイオーベックス	70,000	84	5,880,000
稲葉製作所	12,700	945	12,001,500
宮地エンジニアリングG	79,000	79	6,241,000
三協・立山H L D G S	312,000	124	38,688,000
トーカロ	12,800	1,579	20,211,200
アルファCO	8,800	729	6,415,200
SUMCO	132,700	1,772	235,144,400
川田テクノロジーズ	5,900	1,530	9,027,000
住江織物	63,000	127	8,001,000
日本フェルト	16,500	392	6,468,000
イチカワ	14,000	183	2,562,000
日本バイリン	29,000	462	13,398,000
エコナック	69,000	42	2,898,000
日東製網	30,000	111	3,330,000
芦森工業	61,000	129	7,869,000
アツギ	231,000	119	27,489,000
ダイニック	45,000	149	6,705,000
共和レザー	16,100	333	5,361,300
セーレン	57,300	640	36,672,000
東海染工	35,000	89	3,115,000
小松精練	41,000	380	15,580,000
ワコールホールディングス	137,000	1,094	149,878,000
ホギメディカル	10,900	4,530	49,377,000
サンエー・インターナショナル	11,600	861	9,987,600

レナウン	42,900	165	7,078,500
クラウドシア	2,600	1,258	3,270,800
I Tホールディングス	69,700	1,155	80,503,500
コーエーテクモHD	46,600	714	33,272,400
特種東海H L D G S	158,000	246	38,868,000
ドワンゴ	131	168,900	22,125,900
ベリサーブ	14	200,200	2,802,800
マクロミル	134	134,200	17,982,800
ティーガイア	188	163,600	30,756,800
GMOペイメントゲートウェイ	53	112,400	5,957,200
ザッパラス	74	142,700	10,559,800
インターネットイニシアティブ	136	161,300	21,936,800
ソネットエンタテインメント	113	195,400	22,080,200
S R Aホールディングス	11,300	817	9,232,100
J B I Sホールディングス	25,500	342	8,721,000
朝日ネット	19,000	281	5,339,000
王子製紙	1,017,000	403	409,851,000
三菱製紙	330,000	118	38,940,000
北越紀州製紙	155,000	481	74,555,000
中越パルプ	95,000	167	15,865,000
巴川製紙	40,000	191	7,640,000
大王製紙	104,000	799	83,096,000
日本製紙G本社	102,600	2,487	255,166,200
レンゴー	183,000	575	105,225,000
トーモク	81,000	217	17,577,000
ザ・パック	16,300	1,258	20,505,400
コ - プケミカル	38,000	143	5,434,000
昭和電工	1,537,000	193	296,641,000
住友化学	1,583,000	420	664,860,000
日本化成	48,000	189	9,072,000
住友精化	48,000	345	16,560,000
日産化学	154,000	1,356	208,824,000
ラサ工業	96,000	92	8,832,000
クレハ	147,000	485	71,295,000
テイカ	40,000	253	10,120,000
石原産業	417,000	80	33,360,000
片倉チツカリン	13,000	291	3,783,000
日本曹達	148,000	339	50,172,000
東ソー	575,000	262	150,650,000
トクヤマ	386,000	558	215,388,000
セントラル硝子	237,000	385	91,245,000
東亜合成	273,000	359	98,007,000
ダイソー	100,000	229	22,900,000
関東電化	55,000	649	35,695,000
電気化学	484,000	423	204,732,000



イビデン	155,400	3,325	516,705,000
信越化学	381,400	5,370	2,048,118,000
日本カ - バイド	56,000	119	6,664,000
堺化学	85,000	423	35,955,000
エア・ウォーター	180,000	1,135	204,300,000
大陽日酸	326,000	972	316,872,000
日本化学工業	92,000	225	20,700,000
日本パ - カライジング	54,000	1,114	60,156,000
高圧ガス	38,000	583	22,154,000
チタン工業	30,000	181	5,430,000
四国化成	36,000	530	19,080,000
戸田工業	39,000	712	27,768,000
ステラ ケミファ	11,800	4,700	55,460,000
保土谷化学	57,000	312	17,784,000
日本触媒	138,000	836	115,368,000
大日精化	90,000	366	32,940,000
カネカ	309,000	616	190,344,000
協和発酵キリン	297,000	984	292,248,000
三菱瓦斯化学	391,000	512	200,192,000
三井化学	895,000	267	238,965,000
J S R	225,800	1,848	417,278,400
東京応化工業	41,100	1,756	72,171,600
三菱ケミカルH L D G S	1,330,000	410	545,300,000
日本合成化学	58,000	690	40,020,000
ダイセル化学	295,000	560	165,200,000
住友ベ - クライト	213,000	475	101,175,000
積水化学	476,000	622	296,072,000
日本ゼオン	214,000	441	94,374,000
アイカ工業	62,100	977	60,671,700
宇部興産	1,041,000	263	273,783,000
積水樹脂	33,000	775	25,575,000
タキロン	60,000	245	14,700,000
旭有機材	83,000	218	18,094,000
日立化成	107,200	1,858	199,177,600
ニチバン	27,000	303	8,181,000
リケンテクノス	49,000	226	11,074,000
大倉工業	60,000	263	15,780,000
積水化成品	65,000	463	30,095,000
群栄化学	70,000	222	15,540,000
タイガース ポリマー	9,100	309	2,811,900
日本カ - リット	20,300	402	8,160,600
日本化薬	175,000	838	146,650,000
イーピーエス	67	348,500	23,349,500
パナソニック電工I S	4,800	2,334	11,203,200
フェイス	795	10,060	7,997,700

アミューズ	6,800	974	6,623,200
野村総合研究所	132,300	1,891	250,179,300
ドリームインキュベータ	73	62,000	4,526,000
サイバネットシステム	202	37,850	7,645,700
T A C	13,800	375	5,175,000
ケネディクス	1,156	32,050	37,049,800
電通	225,100	2,176	489,817,600
インテージ	7,100	1,590	11,289,000
テイクアンドギヴニーズ	709	12,030	8,529,270
びあ	7,100	1,200	8,520,000
シンプレクス・テクノロジー	304	43,700	13,284,800
イオンファンタジー	8,100	1,013	8,205,300
ソースネクスト	31	17,300	536,300
ネクシィーズ	958	2,950	2,826,100
日本精化	20,800	699	14,539,200
A D E K A	99,400	864	85,881,600
日油	203,000	421	85,463,000
ミヨシ油脂	92,000	142	13,064,000
ハリマ化成	9,000	485	4,365,000
花 王	635,600	2,195	1,395,142,000
第一工業製薬	42,000	245	10,290,000
三洋化成	70,000	493	34,510,000
武田薬品	871,300	3,940	3,432,922,000
アステラス製薬	490,100	3,500	1,715,350,000
大日本住友製薬	176,000	977	171,952,000
塩野義製薬	335,900	1,931	648,622,900
田辺三菱製薬	206,000	1,158	238,548,000
わかもと製薬	4,000	315	1,260,000
あすか製薬	27,000	650	17,550,000
日本新薬	57,000	1,092	62,244,000
中外製薬	247,200	1,688	417,273,600
科研製薬	106,000	777	82,362,000
エーザイ	283,700	3,410	967,417,000
ロート製薬	104,000	1,104	114,816,000
小野薬品	115,500	4,045	467,197,500
久光製薬	70,000	3,095	216,650,000
有機合成薬品	17,000	262	4,454,000
持田製薬	93,000	840	78,120,000
大正製薬	199,000	1,605	319,395,000
参天製薬	70,400	2,838	199,795,200
エスエス製薬	53,000	490	25,970,000
扶桑薬品	86,000	282	24,252,000
日本ケミファ	38,000	269	10,222,000
ツムラ	67,700	2,925	198,022,500
テ ル モ	170,700	5,330	909,831,000

みらかホールディングス	47,400	2,584	122,481,600
キッセイ薬品工業	46,000	1,878	86,388,000
生化学工業	43,200	956	41,299,200
栄研化学	17,800	846	15,058,800
日水製薬	10,000	660	6,600,000
鳥居薬品	15,100	1,734	26,183,400
東和薬品	11,400	4,120	46,968,000
沢井製薬	15,100	5,140	77,614,000
ゼリア新薬工業	36,000	865	31,140,000
第一三共	730,400	1,984	1,449,113,600
キョーリン	61,000	1,345	82,045,000
大日本塗料	146,000	96	14,016,000
日本ペイント	215,000	572	122,980,000
関西ペイント	281,000	771	216,651,000
トウベ	29,000	92	2,668,000
中国塗料	66,000	633	41,778,000
日本特殊塗料	21,000	398	8,358,000
藤倉化成	29,700	472	14,018,400
太陽インキ製造	18,400	2,385	43,884,000
D I C	759,000	164	124,476,000
サカタインクス	52,000	375	19,500,000
東洋インキ	223,000	349	77,827,000
アルプス技研	10,500	560	5,880,000
サニックス	32,300	178	5,749,400
ダイオーズ	1,400	467	653,800
日本空調サービス	6,800	717	4,875,600
オリエンタルランド	60,200	6,180	372,036,000
ダスキン	69,600	1,639	114,074,400
パーク24	131,000	994	130,214,000
明光ネットワークジャパン	21,300	589	12,545,700
ファルコバイオシステムズ	13,000	933	12,129,000
クレスコ	5,400	458	2,473,200
フジ・メディア・HD	2,434	136,000	331,024,000
秀英予備校	4,600	500	2,300,000
田谷	900	688	619,200
ラウンドワン	32,100	584	18,746,400
リゾートトラスト	34,400	1,174	40,385,600
オービック	7,320	15,690	114,850,800
ティーディーシーソフトウェア	300	784	235,200
ヤフー	12,820	29,090	372,933,800
ビー・エム・エル	13,000	2,530	32,890,000
ワタベウェディング	6,700	997	6,679,900
トレンドマイクロ	92,900	3,560	330,724,000
もしもしホットライン	15,500	1,709	26,489,500
東急コミュニティー	5,500	2,068	11,374,000

リソー教育	2,558	5,580	14,273,640
日本オラクル	37,400	3,955	147,917,000
アルファシステムズ	6,500	1,761	11,446,500
フューチャーアーキテクト	252	36,350	9,160,200
ウェアハウス	6,900	400	2,760,000
シーエーシー	14,600	665	9,709,000
ソフトバンク・テクノ	5,000	686	3,430,000
トーセ	4,100	653	2,677,300
ユー・エス・エス	31,250	5,930	185,312,500
オービックビジネスC	5,950	3,915	23,294,250
日立ビジネスソリュー	8,400	668	5,611,200
伊藤忠テクノソリュー	33,200	2,706	89,839,200
アイティフォー	26,800	325	8,710,000
東京個別指導学院	14,300	172	2,459,600
東計電算	4,800	1,138	5,462,400
カルチュア・コンビニエンス	85,100	462	39,316,200
エクスネット	18	130,000	2,340,000
テー・オー・ダブリュー	7,700	517	3,980,900
大塚商会	18,600	4,750	88,350,000
総合メディカル	5,200	2,091	10,873,200
サイボウズ	310	35,850	11,113,500
ソフトブレーン	301	5,420	1,631,420
アグレックス	5,300	786	4,165,800
セントラルスポーツ	7,700	864	6,652,800
電通国際情報S	14,800	557	8,243,600
ウェザーニューズ	6,200	1,122	6,956,400
C I J	24,900	300	7,470,000
フルキャストホールディングス	186	5,880	1,093,680
富士フイルムHLDGS	492,100	2,981	1,466,950,100
コニカミノルタHLDGS	508,500	1,007	512,059,500
資生堂	422,200	1,944	820,756,800
ライオン	287,000	454	130,298,000
高砂香料	75,000	446	33,450,000
マンダム	23,100	2,800	64,680,000
ミルボン	11,200	2,150	24,080,000
ファンケル	48,000	1,784	85,632,000
コーセー	35,600	1,917	68,245,200
ドクターシーラボ	166	190,100	31,556,600
エステー	15,600	1,030	16,068,000
コニシ	20,000	928	18,560,000
長谷川香料	31,500	1,334	42,021,000
小林製薬	34,400	3,630	124,872,000
荒川化学工業	19,500	1,094	21,333,000
メック	18,200	626	11,393,200
日本高純度化学	66	335,000	22,110,000

荏原ユーザライト	3,100	1,780	5,518,000	
アース製薬	17,900	2,810	50,299,000	
イハラケミカル	47,000	270	12,690,000	
北興化学	11,000	276	3,036,000	
大成ラミック	7,000	2,174	15,218,000	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
クミアイ化学	51,000	293	14,943,000	
日本農薬	52,000	555	28,860,000	
新日本石油	1,401,000	459	643,059,000	
昭和シエル石油	222,400	774	172,137,600	
コスモ石油	623,000	219	136,437,000	
富士興産	86,000	76	6,536,000	
ニチレキ	34,000	359	12,206,000	
東燃ゼネラル石油	333,000	783	260,739,000	
ユシロ化学	12,500	1,210	15,125,000	
ピーピー・カストロール	12,700	340	4,318,000	
新日鉱ホールディングス	887,500	423	375,412,500	
AOCホールディングス	57,700	559	32,254,300	
出光興産	26,500	6,150	162,975,000	
横浜ゴム	252,000	388	97,776,000	
東洋ゴム	224,000	185	41,440,000	
ブリヂストン	717,700	1,556	1,116,741,200	
住友ゴム	174,000	791	137,634,000	
藤倉ゴム	16,900	324	5,475,600	
オカモト	96,000	375	36,000,000	
アキレス	189,000	141	26,649,000	
フコク	10,800	706	7,624,800	
ニッタ	22,400	1,329	29,769,600	
クリエートメディック	8,600	887	7,628,200	
東海ゴム工業	38,200	935	35,717,000	
三ツ星ベルト	65,000	388	25,220,000	
バンドー化学	89,000	290	25,810,000	
鬼怒川ゴム	50,000	220	11,000,000	
旭硝子	1,135,000	946	1,073,710,000	
日本板硝子	691,000	269	185,879,000	
石塚硝子	35,000	195	6,825,000	
有沢製作所	33,400	660	22,044,000	
日本山村硝子	100,000	302	30,200,000	
日本電気硝子	403,000	1,327	534,781,000	
オハラ	9,600	1,598	15,340,800	
住友大阪セメント	411,000	155	63,705,000	
太平洋セメント	911,000	116	105,676,000	
デイ・シイ	27,500	219	6,022,500	
リゾートソリューション	24,000	154	3,696,000	
日本ヒユ-ム	21,000	278	5,838,000	
日本コンクリ-ト	38,000	134	5,092,000	
東海カーボン	233,000	464	108,112,000	
日本カーボン	122,000	282	34,404,000	

東洋炭素	10,700	4,830	51,681,000
ノリタケ	130,000	257	33,410,000
TOTO	356,000	606	215,736,000
日本碍子	273,000	2,164	590,772,000
日本特殊陶業	203,000	1,077	218,631,000
ダントーホールディングス	40,000	95	3,800,000
MARUWA	6,600	2,029	13,391,400
品川リフラクトリーズ	64,000	213	13,632,000
黒崎播磨	55,000	161	8,855,000
東京窯業	13,000	200	2,600,000
ニッカトー	10,000	408	4,080,000
フジインコーポレーテッド	22,800	1,598	36,434,400
エーアンドエーマテリアル	58,000	71	4,118,000
ニチアス	120,000	362	43,440,000
新日本製鐵	6,509,000	395	2,571,055,000
住友金属工業	4,242,000	282	1,196,244,000
神戸製鋼所	3,208,000	186	596,688,000
日新製鋼	878,000	179	157,162,000
中山製鋼所	116,000	137	15,892,000
合同製鐵	126,000	215	27,090,000
JFEホールディングス	497,100	3,770	1,874,067,000
東京製鐵	113,900	1,128	128,479,200
共英製鋼	23,100	1,844	42,596,400
大和工業	58,200	3,275	190,605,000
東京鐵鋼	48,000	292	14,016,000
大阪製鐵	15,600	1,642	25,615,200
淀川製鋼所	177,000	393	69,561,000
東洋鋼鋳	52,000	480	24,960,000
住友鋼管	15,300	498	7,619,400
丸一鋼管	69,200	1,855	128,366,000
モリ工業	46,000	209	9,614,000
大同特殊鋼	384,000	377	144,768,000
日本高周波	104,000	96	9,984,000
日本金属工業	171,000	164	28,044,000
日本冶金工	136,500	415	56,647,500
山陽特殊鋼	123,000	421	51,783,000
愛知製鋼	132,000	435	57,420,000
日立金属	135,000	964	130,140,000
日本金属	64,000	158	10,112,000
大平洋金属	173,000	719	124,387,000
日本電工	105,000	620	65,100,000
栗本鉄工所	131,000	91	11,921,000
旭テック	129,000	23	2,967,000
日本鑄鉄管	26,000	129	3,354,000
日本製鋼所	355,000	1,273	451,915,000

三菱製鋼	148,000	182	26,936,000
日亜鋼業	35,000	272	9,520,000
日本精線	20,000	263	5,260,000
日本軽金属	566,000	92	52,072,000
大紀アルミニウム	39,000	217	8,463,000
三井金属	675,000	265	178,875,000
東邦亜鉛	120,000	478	57,360,000
三菱マテリアル	1,318,000	248	326,864,000
住友鉱山	599,000	1,457	872,743,000
D O W Aホールディングス	267,000	543	144,981,000
古河機金	419,000	117	49,023,000
大阪チタニウム	24,400	2,808	68,515,200
東邦チタニウム	40,300	1,620	65,286,000
住友軽金属	349,000	82	28,618,000
古河スカイ	102,000	167	17,034,000
古河電工	728,000	419	305,032,000
住友電工	759,400	1,207	916,595,800
フジクラ	346,000	520	179,920,000
三菱電線工業	164,000	78	12,792,000
昭和電線H L D G S	300,000	96	28,800,000
東京特殊電線	37,000	100	3,700,000
タツタ電線	51,000	237	12,087,000
日立電線	194,000	293	56,842,000
沖電線	29,000	121	3,509,000
カナレ電気	3,400	1,075	3,655,000
平河ヒューテック	5,500	665	3,657,500
リョービ	139,000	260	36,140,000
アサヒHD	34,700	1,482	51,425,400
東洋製罐	175,200	1,438	251,937,600
ホッカンホールディングス	62,000	225	13,950,000
コロナ	11,400	1,295	14,763,000
横河ブリッジH L D G S	48,000	711	34,128,000
日本橋梁	9,050	229	2,072,450
駒井鉄工	40,000	183	7,320,000
ハルテック	25,000	102	2,550,000
サクラダ	202,000	26	5,252,000
高田機工	22,000	168	3,696,000
三和ホールディングス	229,000	264	60,456,000
文化シャツタ -	65,000	337	21,905,000
東洋シャツタ -	5,500	597	3,283,500
住生活グループ	299,500	1,620	485,190,000
日本ファイルコン	18,400	485	8,924,000
ノーリツ	37,800	1,226	46,342,800
長府製作所	26,700	2,070	55,269,000
リンナイ	39,900	4,550	181,545,000



ユニプレス	32,800	1,460	47,888,000
ダイニチ工業	13,400	580	7,772,000
日東精工	30,000	233	6,990,000
三洋工業	36,000	132	4,752,000
岡 部	50,100	316	15,831,600
日立ツール	14,900	885	13,186,500
中国工業	38,000	92	3,496,000
東 プ レ	47,700	832	39,686,400
高周波熱錬	36,600	625	22,875,000
東京製綱	157,000	278	43,646,000
パイオラックス	10,800	1,655	17,874,000
日本発条	162,000	843	136,566,000
中央発條	35,000	292	10,220,000
アドバネクス	48,000	74	3,552,000
三浦工業	34,000	2,440	82,960,000
タ ク マ	92,000	229	21,068,000
ツ ガ ミ	73,000	264	19,272,000
オークマ	163,000	540	88,020,000
東芝機械	124,000	401	49,724,000
ア マ ダ	380,000	670	254,600,000
アイダエンジニア	60,300	308	18,572,400
牧野フライス	116,000	436	50,576,000
オーエスジー	102,200	1,031	105,368,200
ダイジェット	22,000	127	2,794,000
旭ダイヤモンド	61,000	687	41,907,000
森精機製作所	93,800	998	93,612,400
ディスコ	22,500	5,450	122,625,000
日東工器	14,800	2,084	30,843,200
豊田自動織機	191,700	2,880	552,096,000
豊和工業	139,000	53	7,367,000
大阪機工	83,000	79	6,557,000
石川製作所	63,000	58	3,654,000
東洋機械金属	13,100	153	2,004,300
オ - エム製作所	21,000	312	6,552,000
津田駒工業	62,000	141	8,742,000
エンシュウ	58,000	74	4,292,000
島精機製作所	29,800	1,965	58,557,000
日本スピンドル	35,000	138	4,830,000
日阪製作所	27,000	955	25,785,000
やまびこ	10,300	964	9,929,200
ペガサスミシン製造	25,700	160	4,112,000
ナプテスコ	94,000	1,158	108,852,000
三井海洋開発	16,600	1,997	33,150,200
レオン自動機	4,000	247	988,000
S M C	74,000	11,360	840,640,000

新川	19,200	1,512	29,030,400
ホソカワミクロン	39,000	342	13,338,000
ユニオンツール	15,400	2,590	39,886,000
オイレス工業	27,500	1,329	36,547,500
サトー	25,900	976	25,278,400
日本エアーテック	7,700	496	3,819,200
日精樹脂工業	20,100	260	5,226,000
ワイエイシイ	10,700	645	6,901,500
小松製作所	1,028,600	2,096	2,155,945,600
住友重機械	490,000	494	242,060,000
日立建機	101,300	2,566	259,935,800
日工	18,000	258	4,644,000
巴工業	9,500	1,250	11,875,000
井関農機	236,000	317	74,812,000
TOWA	25,800	861	22,213,800
丸山製作所	57,000	172	9,804,000
北川鉄工所	112,000	94	10,528,000
シンニッタン	23,500	224	5,264,000
クボタ	946,000	937	886,402,000
荏原実業	6,000	1,231	7,386,000
東洋エンジニア	156,000	305	47,580,000
三菱化工機	71,000	253	17,963,000
月島機械	41,000	577	23,657,000
帝国電機製作所	8,500	1,913	16,260,500
東京機械	77,000	108	8,316,000
新東工業	46,300	722	33,428,600
渋谷工業	14,900	799	11,905,100
アイチ コーポレーション	41,200	367	15,120,400
小森コーポレーション	65,900	1,079	71,106,100
鶴見製作所	14,000	646	9,044,000
住友精密	36,000	284	10,224,000
酒井重工業	48,000	142	6,816,000
荏原製作所	467,000	412	192,404,000
石井鉄工所	38,000	164	6,232,000
西島製作所	22,100	2,188	48,354,800
千代田化工建	192,000	797	153,024,000
ダイキン工業	258,700	3,710	959,777,000
オルガノ	43,000	661	28,423,000
ト - ヨ - カネツ	123,000	177	21,771,000
栗田工業	127,000	3,010	382,270,000
椿本チエイン	127,000	407	51,689,000
大同工業	48,000	151	7,248,000
日本コンベヤ	84,000	80	6,720,000
日機装	69,000	540	37,260,000
木村化工機	21,400	869	18,596,600

新興プランテック	44,300	1,076	47,666,800
アネスト岩田	43,000	314	13,502,000
ダイフク	92,500	611	56,517,500
加藤製作所	53,000	173	9,169,000
油研工業	43,000	131	5,633,000
タダノ	105,000	438	45,990,000
フジテック	63,000	548	34,524,000
シーケーディ	61,400	671	41,199,400
キトー	77	81,000	6,237,000
平和	44,400	978	43,423,200
理想科学工業	19,200	755	14,496,000
SANKYO	64,600	5,000	323,000,000
日本金銭機械	22,100	852	18,829,200
マースエンジニアリング	10,100	2,465	24,896,500
福島工業	7,100	800	5,680,000
キャノンファインテック	18,900	1,207	22,812,300
アピリット	43,000	116	4,988,000
オーイズミ	2,400	204	489,600
ダイコク電機	7,700	1,641	12,635,700
アマノ	65,900	829	54,631,100
JUKI	144,000	109	15,696,000
サンデン	134,000	259	34,706,000
蛇の目ミシン	220,000	59	12,980,000
ブラザー工業	306,100	1,093	334,567,300
シルバー精工	404,000	6	2,424,000
マックス	41,000	947	38,827,000
モリタホールディングス	35,000	432	15,120,000
グローリー	66,800	2,132	142,417,600
大和冷機工業	30,000	443	13,290,000
セガサミーホールディングス	250,000	1,133	283,250,000
日本ピストンリング	90,000	95	8,550,000
リケン	94,000	326	30,644,000
帝国ピストン	29,200	350	10,220,000
ホシザキ電機	47,700	1,369	65,301,300
大豊工業	16,900	659	11,137,100
日本精工	446,000	703	313,538,000
N T N	509,000	433	220,397,000
ジェイテクト	212,800	1,194	254,083,200
不二越	239,000	225	53,775,000
ミネベア	323,000	502	162,146,000
日本トムソン	76,000	521	39,596,000
T H K	147,600	1,855	273,798,000
ユーシン精機	10,700	1,384	14,808,800
前澤給装工業	9,500	1,389	13,195,500
イーグル工業	26,000	468	12,168,000

前澤工業	19,400	182	3,530,800
日本ピラ - 工業	26,000	442	11,492,000
キッツ	106,000	472	50,032,000
日立	4,986,000	296	1,475,856,000
東芝	4,988,000	543	2,708,484,000
三菱電機	2,053,000	752	1,543,856,000
富士電機HLDGS	604,000	173	104,492,000
東洋電機製造	48,000	774	37,152,000
安川電機	260,000	827	215,020,000
シンフォニアテクノロジー	132,000	212	27,984,000
明電舎	218,000	473	103,114,000
オリジン電気	34,000	296	10,064,000
デンヨー	22,800	757	17,259,600
日立工機	63,700	1,085	69,114,500
三桜工業	27,700	547	15,151,900
マキタ	144,200	3,240	467,208,000
東芝テック	148,000	367	54,316,000
芝浦メカトロニクス	35,000	326	11,410,000
マブチモーター	32,300	4,895	158,108,500
日本電産	106,700	8,540	911,218,000
高岳製作所	94,000	307	28,858,000
ダイヘン	120,000	373	44,760,000
JVCケンウッドHD	881,400	44	38,781,600
日新電機	40,000	511	20,440,000
大崎電気	34,000	962	32,708,000
オムロン	263,800	1,824	481,171,200
日東工業	35,800	993	35,549,400
I D E C	31,000	634	19,654,000
エルピーダメモリ	231,300	1,724	398,761,200
ジーエス・ユアサコーポ	426,000	680	289,680,000
サクサホールディングス	62,000	151	9,362,000
メルコホールディングス	11,500	1,673	19,239,500
テクノメディカ	13	291,000	3,783,000
日本電気	2,832,000	255	722,160,000
富士通	2,284,000	610	1,393,240,000
沖電気	758,000	85	64,430,000
岩崎通信機	103,000	77	7,931,000
電気興業	64,000	416	26,624,000
サンケン電気	129,000	289	37,281,000
ナカヨ通信機	18,000	170	3,060,000
アイホン	15,400	1,627	25,055,800
NECエレクトロニクス	54,400	785	42,704,000
セイコーエプソン	176,400	1,543	272,185,200
ワコム	435	208,700	90,784,500
アルバック	38,000	2,283	86,754,000

ピクセラ	9,100	357	3,248,700
ナナオ	18,500	2,261	41,828,500
日本信号	55,100	938	51,683,800
京三製作所	52,000	441	22,932,000
能美防災	27,000	595	16,065,000
ホーチキ	24,000	523	12,552,000
マスプロ電気	17,900	836	14,964,400
日本無線	82,000	191	15,662,000
パナソニック	2,165,400	1,449	3,137,664,600
シャープ	1,062,000	1,198	1,272,276,000
アンリツ	114,000	324	36,936,000
富士通ゼネラル	56,000	291	16,296,000
日立国際電気	55,000	850	46,750,000
ソニー	1,182,400	2,916	3,447,878,400
T D K	114,400	5,880	672,672,000
帝国通信工業	56,000	211	11,816,000
三洋電機	2,333,000	169	394,277,000
宮越商事	5,600	502	2,811,200
ミツミ電機	70,800	1,748	123,758,400
タムラ製作所	61,000	322	19,642,000
アルプス電気	187,100	575	107,582,500
池上通信機	75,000	78	5,850,000
パイオニア	185,600	317	58,835,200
日本電波工業	15,300	1,645	25,168,500
日本トリム	3,150	1,862	5,865,300
ローランド ディー・ジー	9,500	1,252	11,894,000
コロムビアミュージックエンタ	164,000	34	5,576,000
山水電気	957,000	6	5,742,000
フオスタ - 電機	19,500	2,635	51,382,500
クラリオン	128,000	98	12,544,000
S M K	70,000	597	41,790,000
ヨコオ	19,300	516	9,958,800
東光	101,000	119	12,019,000
ティアック	109,000	37	4,033,000
ホシデン	58,700	1,138	66,800,600
ヒロセ電機	38,300	9,940	380,702,000
日本航空電子	48,000	649	31,152,000
T O A	29,000	509	14,761,000
ユニデン	69,000	214	14,766,000
アルパイン	46,400	998	46,307,200
スミダコーポレーション	16,900	709	11,982,100
アイコム	12,300	2,274	27,970,200
船井電機	18,600	4,880	90,768,000
横河電機	237,400	829	196,804,600
新電元工業	77,000	249	19,173,000

山武	60,800	2,120	128,896,000
日本光電工業	40,500	1,529	61,924,500
チノー	45,000	221	9,945,000
共和電業	3,000	257	771,000
日本電子材料	9,200	627	5,768,400
堀場製作所	37,600	2,230	83,848,000
アドバンテスト	161,500	2,490	402,135,000
小野測器	23,000	400	9,200,000
エスベック	22,800	491	11,194,800
サンクス	22,700	324	7,354,800
キーエンス	44,700	20,110	898,917,000
日置電機	11,700	1,604	18,766,800
シスメックス	41,500	5,110	212,065,000
メガチップス	17,900	1,513	27,082,700
OBARA	17,200	837	14,396,400
日本電産コバル電子	24,900	633	15,761,700
ミヤチテクノス	12,000	710	8,520,000
東京電波	7,200	598	4,305,600
澤藤電機	6,000	159	954,000
デンソー	520,200	2,886	1,501,297,200
コーセル	31,700	1,254	39,751,800
日立メディコ	15,000	841	12,615,000
新日本無線	17,000	194	3,298,000
オプテックス	16,400	904	14,825,600
千代田インテグレ	12,600	991	12,486,600
東光電気	15,000	676	10,140,000
スタンレー電気	152,200	1,833	278,982,600
岩崎電気	81,000	175	14,175,000
ウシオ電機	133,500	1,669	222,811,500
岡谷電機	14,400	261	3,758,400
ヘリオステクノH	18,600	307	5,710,200
日本セラミック	15,700	1,139	17,882,300
新神戸電機	19,000	984	18,696,000
日本デジタル研究所	20,100	1,127	22,652,700
古河電池	15,000	709	10,635,000
双信電機	11,800	399	4,708,200
山一電機	21,000	294	6,174,000
函研	16,900	679	11,475,100
日本電子	88,000	355	31,240,000
カシオ	246,400	728	179,379,200
ファナック	229,100	9,250	2,119,175,000
日本シイエムケイ	46,300	655	30,326,500
エンプラス	12,400	1,701	21,092,400
ローム	110,200	6,370	701,974,000
浜松ホトニクス	86,300	2,340	201,942,000

三井ハイテック	31,200	793	24,741,600
新光電気工業	59,500	1,232	73,304,000
京セラ	182,900	8,510	1,556,479,000
協栄産業	7,000	194	1,358,000
日本インター	25,900	255	6,604,500
太陽誘電	89,000	1,273	113,297,000
村田製作所	248,500	4,800	1,192,800,000
ユーシン	26,100	569	14,850,900
双葉電子工業	40,900	1,709	69,898,100
日東電工	191,700	3,520	674,784,000
北陸電気工業	90,000	170	15,300,000
パナソニック電工	387,000	1,133	438,471,000
東海理化電機	55,400	2,003	110,966,200
ニチコン	74,600	1,003	74,823,800
日本ケミコン	112,000	348	38,976,000
K O A	29,800	831	24,763,800
三井造船	917,000	239	219,163,000
日立造船	998,000	141	140,718,000
佐世保重工業	156,000	221	34,476,000
三菱重工業	3,722,000	352	1,310,144,000
川崎重工業	1,720,000	254	436,880,000
I H I	1,619,000	163	263,897,000
日本車輛	87,000	615	53,505,000
日本輸送機	29,000	193	5,597,000
近畿車輛	36,000	714	25,704,000
日産自動車	2,660,300	823	2,189,426,900
いすゞ自動車	1,497,000	199	297,903,000
トヨタ自動車	3,043,800	4,115	12,525,237,000
日野自動車	296,000	335	99,160,000
三菱自動車工業	4,889,000	135	660,015,000
エフテック	8,400	1,237	10,390,800
武蔵精密工業	23,000	2,050	47,150,000
トヨタ車体	43,200	1,782	76,982,400
日産車体	93,000	842	78,306,000
関東自動車	36,100	885	31,948,500
新明和工業	98,000	297	29,106,000
極東開発工業	41,700	347	14,469,900
日信工業	38,600	1,443	55,699,800
トピー工業	195,000	172	33,540,000
ティラド	71,000	220	15,620,000
曙ブレーキ	89,900	531	47,736,900
タチエス	31,100	898	27,927,800
N O K	114,500	1,254	143,583,000
フタバ産業	72,300	785	56,755,500
カヤバ工業	147,000	310	45,570,000

シロキ工業	47,000	194	9,118,000
市光工業	59,000	152	8,968,000
大同メタル工業	33,000	247	8,151,000
プレス工業	109,000	176	19,184,000
カルソニックカンセイ	161,000	273	43,953,000
太平洋工業	49,000	534	26,166,000
ケーヒン	43,500	1,451	63,118,500
河西工業	23,000	277	6,371,000
アイシン精機	195,000	2,675	521,625,000
富士機工	18,000	104	1,872,000
マ ッ ダ	1,440,000	237	341,280,000
ダイハツ	220,000	973	214,060,000
愛知機械	53,000	371	19,663,000
今仙電機製作所	17,100	1,213	20,742,300
本田技研	1,889,700	3,315	6,264,355,500
スズキ	439,100	2,244	985,340,400
富士重工業	749,000	460	344,540,000
ヤマハ発動機	274,100	1,256	344,269,600
ショーワ	50,500	586	29,593,000
小糸製作所	106,000	1,434	152,004,000
T B K	26,000	170	4,420,000
エクセディ	28,600	1,933	55,283,800
ミツバ	41,000	435	17,835,000
豊田合成	66,900	2,858	191,200,200
愛三工業	24,600	913	22,459,800
ヨ ロ ズ	14,400	1,277	18,388,800
エフ・シー・シー	31,000	1,670	51,770,000
新家工業	54,000	128	6,912,000
シマノ	91,700	3,730	342,041,000
タカタ	36,100	2,079	75,051,900
テイ・エス テック	45,000	1,801	81,045,000
小 野 建	18,800	702	13,197,600
はるやま商事	11,900	370	4,403,000
佐鳥電機	17,400	563	9,796,200
カップクリエイト	15,550	2,052	31,908,600
エコートレーディング	5,600	992	5,555,200
伯東	14,400	818	11,779,200
中山福	15,400	562	8,654,800
ライトオン	17,400	712	12,388,800
ナガイレーベン	14,300	1,856	26,540,800
ジーンズメイト	8,300	496	4,116,800
菱食	22,700	2,441	55,410,700
良品計画	24,800	3,480	86,304,000
三城ホールディングス	29,400	790	23,226,000
松田産業	15,100	1,761	26,591,100



メディバルHD	233,700	1,159	270,858,300
アドヴァン	14,500	607	8,801,500
S P K	4,100	1,295	5,309,500
アズワン	13,900	1,622	22,545,800
スズデン	6,100	452	2,757,200
尾家産業	5,800	850	4,930,000
シモジマ	16,400	1,291	21,172,400
ドウシシャ	11,200	1,979	22,164,800
コナカ	28,600	316	9,037,600
高速	14,900	673	10,027,700
ハウス ローゼ	2,000	1,275	2,550,000
G - 7ホールディングス	7,400	536	3,966,400
イオン北海道	11,300	275	3,107,500
コジマ	31,700	596	18,893,200
コーナン商事	20,500	1,052	21,566,000
黒田電気	31,200	1,304	40,684,800
ネットワンシステムズ	448	108,700	48,697,600
エコス	7,600	668	5,076,800
ワタミ	24,700	1,676	41,397,200
マルシェ	7,300	731	5,336,300
ドン・キホーテ	42,300	2,068	87,476,400
丸文	18,600	568	10,564,800
メガネトップ	20,000	1,029	20,580,000
西松屋チェーン	51,100	800	40,880,000
ゼンショー	87,600	661	57,903,600
ハピネット	6,700	1,198	8,026,600
幸楽苑	14,200	1,201	17,054,200
トーマンエレクトロニクス	7,300	954	6,964,200
ユニマットライフ	10,000	942	9,420,000
ハークスレイ	6,200	660	4,092,000
サイゼリヤ	34,600	1,566	54,183,600
エクセル	10,100	1,068	10,786,800
マルカキカイ	8,400	633	5,317,200
アルゴグラフィックス	9,300	930	8,649,000
ガリバーインターナショナル	5,510	5,800	31,958,000
日本エム・ディ・エム	20,200	217	4,383,400
ポプラ	8,500	593	5,040,500
ユナイテッドアローズ	25,100	830	20,833,000
進和	13,300	1,208	16,066,400
エスケイジャパン	5,000	358	1,790,000
ダイトエレクトロン	10,500	417	4,378,500
ハイデイ日高	10,000	1,017	10,170,000
シークス	14,800	1,108	16,398,400
京都きもの友禅	13,900	934	12,982,600
コロワイド	53,000	626	33,178,000

田中商事	8,200	347	2,845,400	
オーハシテクニカ	14,500	545	7,902,500	
壱番屋	8,600	2,153	18,515,800	
マクニカ	9,400	1,353	12,718,200	
白銅	7,900	541	4,273,900	
トップカルチャー	8,000	357	2,856,000	
スギホールディングス	32,600	2,039	66,471,400	
島津製作所	261,000	645	168,345,000	
J M S	35,000	362	12,670,000	
アロカ	12,900	685	8,836,500	
クボテック	57	26,500	1,510,500	
モリテックス	4,800	281	1,348,800	
長野計器	14,500	590	8,555,000	
スター精密	45,300	951	43,080,300	
東京計器	84,000	134	11,256,000	
愛知時計	7,000	273	1,911,000	

[前へ](#) [次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本電産トーソク	7,700	1,104	8,500,800	
東京精密	45,600	1,185	54,036,000	
ニコン	412,800	1,907	787,209,600	
トプコン	47,900	484	23,183,600	
オリンパス	259,400	2,990	775,606,000	
理研計器	20,200	628	12,685,600	
大日本スクリーン	243,000	427	103,761,000	
キヤノン電子	21,400	2,020	43,228,000	
タムロン	20,800	1,023	21,278,400	
HOYA	512,000	2,579	1,320,448,000	
ノーリツ鋼機	18,800	622	11,693,600	
エー・アンド・デイ	18,500	338	6,253,000	
キヤノン	1,373,600	3,950	5,425,720,000	
リコー	658,000	1,371	902,118,000	
日本電産コパル	23,200	1,322	30,670,400	
日本電産サンキョー	56,000	809	45,304,000	
シチズンホールディングス	257,900	565	145,713,500	
リズム時計	116,000	136	15,776,000	
SRIスポーツ	130	85,900	11,167,000	
バンダイナムコHLDGS	257,500	916	235,870,000	
共立印刷	22,000	115	2,530,000	
フランスベッドHLDGS	160,000	138	22,080,000	
パイロットコーポレーション	208	99,600	20,716,800	
エイベックス・グループHD	34,400	781	26,866,400	
トッパン・フォームズ	42,200	990	41,778,000	
フジシールインターナショナル	22,100	1,909	42,188,900	
タカラトミー	70,800	749	53,029,200	
廣濟堂	18,900	197	3,723,300	
アーケ	73,300	61	4,471,300	
レック	7,200	1,774	12,772,800	
アロン化成	14,000	376	5,264,000	
タカノ	10,400	467	4,856,800	
プロネクサス	26,300	580	15,254,000	
ホクシン	18,100	137	2,479,700	
ウッドワン	45,000	226	10,170,000	
大建工業	98,000	219	21,462,000	
きもと	20,100	1,058	21,265,800	
凸版印刷	669,000	790	528,510,000	
大日本印刷	670,000	1,234	826,780,000	
図書印刷	38,000	173	6,574,000	
共同印刷	74,000	252	18,648,000	
日本写真印刷	36,400	4,455	162,162,000	

光村印刷	3,000	308	924,000
藤森工業	16,600	1,274	21,148,400
宝印刷	12,200	720	8,784,000
前澤化成工業	18,600	959	17,837,400
コ ン ビ	14,000	642	8,988,000
アシックス	206,000	899	185,194,000
ツ ツ ミ	10,300	1,850	19,055,000
ジェイ エス ピー	16,300	989	16,120,700
ニ チ ハ	27,800	611	16,985,800
ローランド	17,200	871	14,981,200
エフピコ	11,100	4,080	45,288,000
小松ウオール工業	8,800	1,087	9,565,600
ヤマハ	159,700	1,152	183,974,400
河合楽器	89,000	116	10,324,000
クリナップ	25,600	734	18,790,400
ビジョン	13,400	3,630	48,642,000
天馬	17,700	1,060	18,762,000
パラマウントベッド	23,300	1,909	44,479,700
兼松日産農林	38,000	117	4,446,000
キングジム	19,000	683	12,977,000
リンテック	50,600	1,879	95,077,400
田崎真珠	43,000	99	4,257,000
信越ポリマー	42,700	576	24,595,200
東 リ	63,000	173	10,899,000
イトーキ	50,900	190	9,671,000
任 天 堂	125,100	26,080	3,262,608,000
三菱鉛筆	20,100	1,197	24,059,700
タカラスタンダ - ド	110,000	537	59,070,000
コ ク ヨ	123,200	749	92,276,800
ナカバヤシ	52,000	198	10,296,000
ニ フ コ	51,400	1,919	98,636,600
グローブライド	123,000	109	13,407,000
サンウエーブ	33,000	304	10,032,000
岡村製作所	91,000	459	41,769,000
日本バルカー	96,000	180	17,280,000
M U T O Hホールディングス	29,000	150	4,350,000
伊 藤 忠	1,516,000	777	1,177,932,000
丸 紅	1,790,000	547	979,130,000
スクロール	23,600	316	7,457,600
高 島	42,000	134	5,628,000
F & A アクアホールディングス	18,900	1,015	19,183,500
三陽商会	112,000	288	32,256,000
長瀬産業	122,000	1,105	134,810,000
ナイガイ	77,000	50	3,850,000
蝶 理	158,000	102	16,116,000

豊田通商	208,400	1,454	303,013,600
オンワ - ドホールディングス	153,000	610	93,330,000
三共生興	41,900	254	10,642,600
兼 松	500,000	79	39,500,000
美 津 濃	118,000	465	54,870,000
ツカモトコーポレーション	41,000	75	3,075,000
ファミリーマート	71,700	2,828	202,767,600
ルック	40,000	85	3,400,000
三井物産	1,883,900	1,457	2,744,842,300
日本紙パルプ	122,000	335	40,870,000
東京エレクトロン	186,000	6,000	1,116,000,000
日立ハイテクノロジーズ	70,800	1,889	133,741,200
カメイ	22,000	469	10,318,000
東都水産	40,000	154	6,160,000
スターゼン	83,000	240	19,920,000
セイコーHD	83,000	180	14,940,000
山 善	90,700	332	30,112,400
椿本興業	24,000	190	4,560,000
住友商事	1,196,100	1,041	1,245,140,100
日本ユニシス	56,300	708	39,860,400
内田洋行	52,000	243	12,636,000
三菱商事	1,747,000	2,478	4,329,066,000
第一実業	54,000	257	13,878,000
キャノンマーケティングJPN	77,700	1,411	109,634,700
西華産業	90,000	210	18,900,000
佐藤商事	22,400	490	10,976,000
菱洋エレクトロ	26,600	769	20,455,400
東京産業	24,000	260	6,240,000
ユアサ商事	246,000	84	20,664,000
神鋼商事	61,000	166	10,126,000
阪和興業	234,000	359	84,006,000
カナデン	2,000	512	1,024,000
菱電商事	35,000	465	16,275,000
ニプロ	47,200	1,951	92,087,200
フルサト工業	13,600	515	7,004,000
岩谷産業	244,000	270	65,880,000
すてきナイスグループ	103,000	203	20,909,000
昭光通商	92,000	108	9,936,000
ニチモウ	40,000	153	6,120,000
極東貿易	34,000	130	4,420,000
イ ワ キ	26,000	239	6,214,000
兼松エレクトロニクス	13,300	830	11,039,000
三愛石油	56,000	372	20,832,000
稲畑産業	58,400	357	20,848,800
G S Iクレオス	62,000	102	6,324,000

明和産業	21,700	186	4,036,200
ゴ-ルドウイン	56,000	211	11,816,000
東京スタイル	83,000	721	59,843,000
ユニ・チャ-ム	45,600	9,080	414,048,000
デサント	68,000	459	31,212,000
ヤマトインタ-ナショナル	15,900	332	5,278,800
東邦ホールディングス	60,400	1,162	70,184,800
サンゲツ	40,600	2,094	85,016,400
ミツウロコ	39,100	662	25,884,200
シナネン	57,000	405	23,085,000
伊藤忠エネクス	51,700	422	21,817,400
ザ・トーカイ	56,000	497	27,832,000
サンリオ	65,100	736	47,913,600
サンワ テクノス	11,800	434	5,121,200
リョ-サン	35,700	2,286	81,610,200
新光商事	22,400	749	16,777,600
トーホ-	37,000	353	13,061,000
三信電気	24,600	677	16,654,200
東陽テクニカ	36,800	751	27,636,800
モスフード サービス	31,100	1,510	46,961,000
加賀電子	23,300	953	22,204,900
三益半導体	18,300	1,232	22,545,600
ソーダニツカ	2,000	331	662,000
立花エレテック	14,600	674	9,840,400
木曽路	25,100	1,979	49,672,900
千 趣 会	42,500	497	21,122,500
タカキュー	19,000	159	3,021,000
ケーヨー	44,600	407	18,152,200
アデランスホールディングス	26,700	1,124	30,010,800
上新電機	51,000	744	37,944,000
日本瓦斯	25,500	1,511	38,530,500
ベスト電器	73,500	345	25,357,500
マルエツ	48,000	423	20,304,000
ロイヤルホールディングス	36,700	954	35,011,800
東 天 紅	14,000	159	2,226,000
いなげや	27,000	976	26,352,000
島 忠	52,800	1,903	100,478,400
チヨダ	30,600	1,166	35,679,600
鈴 丹	5,700	220	1,254,000
ライフコーポレーション	15,100	1,699	25,654,900
カ ス ミ	48,700	465	22,645,500
リンガーハット	16,700	1,230	20,541,000
さ が 美	19,000	142	2,698,000
M R M A X	24,500	441	10,804,500
テンアライド	12,000	319	3,828,000

A O K Iホールディングス	21,800	936	20,404,800
オークワ	30,000	900	27,000,000
コメリ	28,000	2,457	68,796,000
青山商事	54,400	1,308	71,155,200
しまむら	24,400	8,390	204,716,000
C F Sコーポレーション	19,500	481	9,379,500
高島屋	292,000	637	186,004,000
丸善	117,000	73	8,541,000
松屋	43,000	853	36,679,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	122,000	573	69,906,000
丸栄	33,000	118	3,894,000
ニッセンHD	46,700	269	12,562,300
パルコ	60,700	776	47,103,200
丸井グループ	257,900	598	154,224,200
クレディセゾン	163,700	1,270	207,899,000
原信ナルスHLDGS	13,400	1,077	14,431,800
セディナ	179,300	185	33,170,500
井筒屋	124,000	42	5,208,000
ダイエー	99,150	352	34,900,800
イズミヤ	75,000	432	32,400,000
イオン	765,000	880	673,200,000
ユニー	175,400	712	124,884,800
イズミ	63,200	1,205	76,156,000
東武ストア	28,000	294	8,232,000
平和堂	43,000	1,188	51,084,000
フジ	26,300	1,834	48,234,200
ヤオコー	10,300	2,843	29,282,900
ゼビオ	24,600	1,650	40,590,000
ケーズホールディングス	37,400	2,825	105,655,000
O L Y M P I C	16,700	640	10,688,000
東日カーライフグループ	35,000	110	3,850,000
新生銀行	1,062,000	110	116,820,000
あおぞら銀行	729,000	109	79,461,000
三菱UFJフィナンシャルG	16,654,200	488	8,127,249,600
りそなホールディングス	625,400	1,013	633,530,200
中央三井トラストHD	1,221,000	338	412,698,000
三井住友フィナンシャルG	1,197,800	2,875	3,443,675,000
第四銀行	305,000	317	96,685,000
北越銀行	247,000	152	37,544,000
西日本シティ銀行	761,000	242	184,162,000
札幌北洋ホール	323,100	367	118,577,700
千葉銀行	857,000	570	488,490,000
横浜銀行	1,502,000	444	666,888,000
常陽銀行	846,000	393	332,478,000
群馬銀行	546,000	497	271,362,000

武蔵野銀行	35,400	2,453	86,836,200
千葉興業銀行	44,800	702	31,449,600
関東つくば銀行	71,900	281	20,203,900
東京都民銀行	41,400	1,234	51,087,600
七十七銀行	367,000	512	187,904,000
青森銀行	164,000	224	36,736,000
秋田銀行	161,000	384	61,824,000
山形銀行	134,000	475	63,650,000
岩手銀行	15,800	5,290	83,582,000
東邦銀行	199,000	297	59,103,000
東北銀行	128,000	144	18,432,000
みちのく銀行	119,000	188	22,372,000
ふくおかフィナンシャルG	884,000	342	302,328,000
静岡銀行	679,000	810	549,990,000
十六銀行	287,000	355	101,885,000
スルガ銀行	228,000	821	187,188,000
八十二銀行	442,000	558	246,636,000
山梨中央銀行	148,000	400	59,200,000
大垣共立銀行	312,000	306	95,472,000
福井銀行	202,000	311	62,822,000
北國銀行	251,000	343	86,093,000
清水銀行	8,200	3,885	31,857,000
滋賀銀行	219,000	557	121,983,000
南都銀行	220,000	530	116,600,000
百五銀行	215,000	431	92,665,000
京都銀行	390,000	799	311,610,000
三重銀行	97,000	264	25,608,000
ほくほくフィナンシャルG	1,534,000	204	312,936,000
広島銀行	644,000	374	240,856,000
山陰合同銀行	141,000	741	104,481,000
中国銀行	192,000	1,189	228,288,000
鳥取銀行	79,000	255	20,145,000
伊予銀行	266,000	786	209,076,000
百十四銀行	255,000	347	88,485,000
四国銀行	172,000	307	52,804,000
阿波銀行	195,000	521	101,595,000
鹿児島銀行	152,000	670	101,840,000
大分銀行	152,000	339	51,528,000
宮崎銀行	124,000	288	35,712,000
肥後銀行	186,000	534	99,324,000
佐賀銀行	136,000	277	37,672,000
十八銀行	149,000	280	41,720,000
沖縄銀行	18,000	3,640	65,520,000
琉球銀行	46,300	1,057	48,939,100
住友信託	1,972,000	497	980,084,000



みずほ信託銀行	1,853,000	93	172,329,000
八千代銀行	12,300	2,207	27,146,100
みずほフィナンシャルG	19,034,200	177	3,369,053,400
紀陽ホールディングス	873,000	116	101,268,000
山口フィナンシャルG	218,000	935	203,830,000
フィデック	120	8,380	1,005,600
芙蓉総合リース	20,100	2,033	40,863,300
興銀リース	32,500	1,755	57,037,500
東京センチュリーリース	54,800	1,086	59,512,800
S B Iホールディングス	20,963	18,630	390,540,690
日本証券金融	96,500	782	75,463,000
大阪証券金融	29,300	199	5,830,700
アイフル	174,400	158	27,555,200
日本アジア投資	149,000	51	7,599,000
ポケットカード	23,500	257	6,039,500
長野銀行	85,000	196	16,660,000
名古屋銀行	211,000	373	78,703,000
愛知銀行	8,500	6,850	58,225,000
第三銀行	146,000	246	35,916,000
中京銀行	98,000	280	27,440,000
東日本銀行	121,000	182	22,022,000
愛媛銀行	148,000	265	39,220,000
トマト銀行	94,000	203	19,082,000
みなと銀行	242,000	114	27,588,000
京葉銀行	192,000	437	83,904,000
関西アーバン銀行	233,000	135	31,455,000
栃木銀行	118,000	412	48,616,000
北日本銀行	7,500	2,633	19,747,500
香川銀行	78,000	336	26,208,000
東和銀行	243,000	63	15,309,000
徳島銀行	64,000	338	21,632,000
福島銀行	295,000	53	15,635,000
大東銀行	151,000	63	9,513,000
武富士	138,040	479	66,121,160
リコーリース	16,200	1,965	31,833,000
イオン クレジットサービス	103,900	1,017	105,666,300
N I Sグループ	142,700	31	4,423,700
アコム	58,590	1,720	100,774,800
プロミス	99,000	977	96,723,000
ジャックス	141,000	232	32,712,000
日立キャピタル	55,200	1,235	68,172,000
オリックス	113,470	7,170	813,579,900
三菱UFJリース	59,290	3,210	190,320,900
ジャフコ	32,000	2,452	78,464,000
大和証券G本社	2,058,000	512	1,053,696,000

野村ホールディングス	4,377,800	778	3,405,928,400
みずほ証券	597,000	300	179,100,000
みずほインベストズ証	544,000	100	54,400,000
岡三証券グループ	199,000	488	97,112,000
丸三証券	72,500	539	39,077,500
東洋証券	88,000	193	16,984,000
東海東京HD	252,000	375	94,500,000
光世証券	62,000	101	6,262,000
水戸証券	64,000	224	14,336,000
いちよし証券	49,400	637	31,467,800
松井証券	138,900	697	96,813,300
だいこう証券ビジ	12,000	394	4,728,000
マネックスG	1,361	38,000	51,718,000
カブドットコム証券	358	98,700	35,334,600
極東証券	29,200	737	21,520,400
岩井証券	20,600	656	13,513,600
フィデアホール	112,700	164	18,482,800
池田泉州HD	747,200	328	245,081,600
三井住友海上HD	495,900	2,505	1,242,229,500
SONY FH	735	262,500	192,937,500
小林洋行	5,200	310	1,612,000
日本興亜損害保険	780,000	562	438,360,000
損害保険ジャパン	1,018,000	626	637,268,000
ニッセイ同和損害保険	259,000	476	123,284,000
あいおい損害保険	556,000	472	262,432,000
富士火災	277,000	100	27,700,000
東京海上HD	887,700	2,706	2,402,116,200
アサックス	33	75,400	2,488,200
NECキャピタルソリューション	8,100	1,252	10,141,200
T&Dホールディングス	401,050	2,150	862,257,500
三井不動産	973,000	1,695	1,649,235,000
三菱地所	1,534,000	1,584	2,429,856,000
平和不動産	166,000	304	50,464,000
東京建物	434,000	368	159,712,000
ダイビル	60,200	657	39,551,400
サンケイビル	40,500	596	24,138,000
東急不動産	431,000	354	152,574,000
京阪神不動産	28,400	440	12,496,000
住友不動産	525,000	1,802	946,050,000
東宝不動産	25,300	556	14,066,800
太平洋興発	80,000	69	5,520,000
有楽土地	31,000	343	10,633,000
大京	254,000	179	45,466,000
テーオーシー	90,500	351	31,765,500
東京楽天地	27,000	380	10,260,000

レオパレス21	152,100	439	66,771,900
フジ住宅	28,300	340	9,622,000
空港施設	24,800	482	11,953,600
明和地所	13,400	443	5,936,200
住友不動産販売	8,410	3,865	32,504,650
ゴールドクレスト	15,790	2,853	45,048,870
東栄住宅	13,900	718	9,980,200
日本エスリード	9,000	730	6,570,000
東急リバブル	21,300	749	15,953,700
飯田産業	11,500	1,604	18,446,000
日神不動産	12,300	360	4,428,000
アーネストワン	38,600	893	34,469,800
タカラレーベン	10,400	585	6,084,000
サンヨーハウジ 名古屋	111	79,500	8,824,500
イオンモール	106,500	1,879	200,113,500
フージャースコーポレーション	273	10,030	2,738,190
サンシティ	537	2,270	1,218,990
ゼクス	81	1,604	129,924
タクトホーム	123	85,900	10,565,700
ランド	11,100	44	488,400
リサ・パートナーズ	305	60,500	18,452,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,451	67,700	98,232,700
サンフロンティア不動産	244	14,200	3,464,800
大和システム	9,200	193	1,775,600
ランドビジネス	156	18,100	2,823,600
東武鉄道	950,000	517	491,150,000
相鉄ホールディングス	337,000	393	132,441,000
東京急行	1,210,000	387	468,270,000
京浜急行	610,000	711	433,710,000
小田急電鉄	707,000	767	542,269,000
京王電鉄	616,000	592	364,672,000
京成電鉄	332,000	541	179,612,000
富士急行	67,000	479	32,093,000
新京成電鉄	23,000	378	8,694,000
東日本旅客鉄道	412,000	6,130	2,525,560,000
西日本旅客鉄道	1,916	328,000	628,448,000
東海旅客鉄道	1,898	674,000	1,279,252,000
アートコーポレーション	5,900	1,420	8,378,000
西日本鉄道	312,000	363	113,256,000
ハマキョウレックス	6,800	2,095	14,246,000
サカイ引越センター	4,500	2,130	9,585,000
近畿鉄道	2,015,000	320	644,800,000
阪急阪神HLDGS	1,498,000	436	653,128,000
南海電鉄	468,000	368	172,224,000
京阪電鉄	502,000	384	192,768,000

名糖運輸	7,300	791	5,774,300
名古屋鉄道	782,000	278	217,396,000
日本通運	938,000	406	380,828,000
ヤマトホールディングス	447,600	1,349	603,812,400
山九	264,000	496	130,944,000
日新	91,000	207	18,837,000
丸運	15,600	230	3,588,000
丸全昭和運輸	74,000	306	22,644,000
センコー	75,000	334	25,050,000
トナミホールディングス	55,000	188	10,340,000
日本梱包運輸	66,000	1,031	68,046,000
日石輸送	12,000	195	2,340,000
福山通運	165,000	439	72,435,000
セイノーホールディングス	168,000	662	111,216,000
神奈川中央交通	5,000	513	2,565,000
日立物流	41,300	1,179	48,692,700
日本郵船	1,594,000	339	540,366,000
商船三井	1,065,000	580	617,700,000
川崎汽船	564,000	321	181,044,000
新和海運	83,000	275	22,825,000
乾汽船	26,100	719	18,765,900
明治海運	21,700	461	10,003,700
飯野海運	106,900	458	48,960,200
共栄タンカー	19,000	216	4,104,000
第一中央汽船	155,000	236	36,580,000
全日本空輸	3,160,000	295	932,200,000
日本航空	3,219,000	37	119,103,000
バスコ	29,000	175	5,075,000
国際航業HLDGS	12,000	236	2,832,000
三菱倉庫	156,000	1,113	173,628,000
三井倉庫	94,000	336	31,584,000
住友倉庫	159,000	424	67,416,000
渋沢倉庫	62,000	304	18,848,000
ヤマタネ	110,000	131	14,410,000
東陽倉庫	30,000	186	5,580,000
日本トランスシティ	51,000	271	13,821,000
ケイヒン	47,000	104	4,888,000
安田倉庫	19,400	612	11,872,800
東洋埠頭	73,000	174	12,702,000
宇徳	15,900	247	3,927,300
上組	263,000	706	185,678,000
サンリツ	1,700	584	992,800
キムラユニティー	4,300	727	3,126,100
キューソー流通システム	7,500	940	7,050,000
郵船航空サービス	18,800	1,304	24,515,200

近鉄エクスプレス	18,600	2,488	46,276,800
東海運	11,400	226	2,576,400
バンテック	109	140,100	15,270,900
東京放送HD	126,100	1,381	174,144,100
日本テレビ放送網	20,520	12,440	255,268,800
テレビ朝日	592	137,700	81,518,400
テレビ東京	9,100	1,833	16,680,300
スカパーJ S A T H D	1,784	37,600	67,078,400
アイ・ティー・シーネットワーク	53	205,800	10,907,400
イー・アクセス	1,175	53,600	62,980,000
NECモバイリング	7,500	2,288	17,160,000
日本電信電話	921,200	3,825	3,523,590,000
KDDI	3,628	513,000	1,861,164,000
光通信	30,000	1,649	49,470,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,397	133,000	2,579,801,000
インボイス	12,897	1,360	17,539,920
GMOインターネット	66,600	369	24,575,400
学研ホールディングス	102,000	226	23,052,000
ゼンリン	30,900	1,076	33,248,400
昭文社	13,600	572	7,779,200
角川グループH L D G S	20,100	2,227	44,762,700
インプレスホールディングス	19,300	190	3,667,000
東京電力	1,393,200	2,445	3,406,374,000
中部電力	745,000	2,286	1,703,070,000
関西電力	913,000	2,137	1,951,081,000
中国電力	327,500	1,827	598,342,500
北陸電力	226,900	2,084	472,859,600
東北電力	554,800	1,915	1,062,442,000
四国電力	245,200	2,525	619,130,000
九州電力	488,200	1,960	956,872,000
北海道電力	206,100	1,752	361,087,200
沖縄電力	15,500	5,010	77,655,000
電源開発	147,000	2,730	401,310,000
東京瓦斯	2,799,000	375	1,049,625,000
大阪瓦斯	2,382,000	326	776,532,000
東邦瓦斯	618,000	510	315,180,000
北海道瓦斯	48,000	247	11,856,000
西部瓦斯	273,000	260	70,980,000
静岡瓦斯	67,500	613	41,377,500
アイネット	12,500	525	6,562,500
松竹	130,000	853	110,890,000
東宝	167,000	1,539	257,013,000
エイチ・アイ・エス	22,700	1,806	40,996,200
東映	87,000	498	43,326,000
葵プロモーション	7,500	497	3,727,500

ベンチャーリンク	84,000	15	1,260,000
NTTデータ	1,444	290,200	419,048,800
共立メンテナンス	10,400	1,395	14,508,000
イチネンホールディングス	24,400	360	8,784,000
建設技術研究所	13,100	461	6,039,100
燦ホールディングス	5,700	1,564	8,914,800
スバル興業	3,000	278	834,000
東京テアトル	86,000	147	12,642,000
ホリプロ	8,000	712	5,696,000
よみうりランド	50,000	309	15,450,000
東京都競馬	170,000	137	23,290,000
常磐興産	77,000	149	11,473,000
カナモト	30,000	417	12,510,000
東京ドーム	170,000	293	49,810,000
D T S	22,400	892	19,980,800
スクウェア・エニックス・HD	59,300	2,059	122,098,700
シーイーシー	12,500	519	6,487,500
カプコン	49,900	1,643	81,985,700
東海観光	96,000	28	2,688,000
日本空港ビルデング	55,900	1,298	72,558,200
トランス・コスモス	28,500	792	22,572,000
乃村工藝社	50,000	259	12,950,000
ジャステック	14,200	462	6,560,400
住商情報システム	24,000	1,364	32,736,000
藤田観光	64,000	366	23,424,000
近畿日本ツーリスト	81,000	79	6,399,000
日本管財	9,200	1,461	13,441,200
白洋舎	5,000	268	1,340,000
セコム	223,100	4,450	992,795,000
C S Kホールディングス	88,900	463	41,160,700
日本システムウエア	3,400	297	1,009,800
セントラル警備保障	10,700	929	9,940,300
アイネス	28,400	699	19,851,600
丹青社	5,000	181	905,000
メイテック	33,600	1,341	45,057,600
T K C	21,800	1,768	38,542,400
アサツー ディ・ケイ	43,200	1,900	82,080,000
富士ソフト	28,900	1,527	44,130,300
応用地質	26,200	776	20,331,200
船井総合研究所	25,400	518	13,157,200
日システム	49,100	955	46,890,500
進学会	14,700	314	4,615,800
丸紅建材リース	28,000	120	3,360,000
コナミ	95,100	1,711	162,716,100
ベネッセホールディングス	78,300	3,885	304,195,500

イオンディライト	18,200	1,276	23,223,200
ナック	6,400	908	5,811,200
福井コンピュータ	1,500	308	462,000
ニチイ学館	48,400	808	39,107,200
ダイセキ	39,900	1,967	78,483,300
元気寿司	7,700	1,189	9,155,300
トラスコ中山	27,200	1,319	35,876,800
ヤマダ電機	106,580	6,240	665,059,200
オートバックスセブン	27,500	2,850	78,375,000
アークランドサカモト	13,800	1,046	14,434,800
ニトリ	42,100	6,660	280,386,000
グルメ杵屋	1,000	547	547,000
愛眼	17,700	513	9,080,100
吉野家ホールディングス	638	101,200	64,565,600
加藤産業	33,900	1,643	55,697,700
イエローハット	22,100	750	16,575,000
富士エレクトロニクス	13,600	845	11,492,000
松屋フーズ	11,900	1,340	15,946,000
J B C Cホールディングス	18,800	585	10,998,000
J Kホールディングス	21,100	374	7,891,400
ユニダックス	6,000	469	2,814,000
サガミチェーン	22,000	803	17,666,000
日伝	9,700	2,395	23,231,500
北沢産業	11,000	200	2,200,000
杉本商事	12,900	823	10,616,700
因幡電機産業	24,200	2,202	53,288,400
住金物産	110,000	194	21,340,000
ブレナス	26,200	1,309	34,295,800
ミニストップ	17,300	1,137	19,670,100
イマージュホールディングス	7,500	240	1,800,000
アークス	27,600	1,278	35,272,800
バロー	42,600	756	32,205,600
ミスミグループ本社	78,600	1,620	127,332,000
江守商事	5,600	717	4,015,200
アルテック	11,500	163	1,874,500
ベルク	9,600	866	8,313,600
大庄	14,400	1,250	18,000,000
タキヒヨー	39,000	482	18,798,000
ファーストリテイリング	46,800	16,050	751,140,000
ソフトバンク	955,600	2,187	2,089,897,200
スズケン	83,000	3,080	255,640,000
サンドラッグ	44,400	2,120	94,128,000
ジェコス	18,900	396	7,484,400
ヤマザワ	6,500	1,300	8,450,000
やまや	4,800	706	3,388,800

ペルーナ	29,400	380	11,172,000	
合計	337,834,509		279,636,813,884	

## 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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		1,859,189,572	2,572,356,182
コール・ローン		268,956,619	426,411,901
株式		175,616,714,659	290,793,652,338
投資信託受益証券		409,511,076	927,703,845
投資証券		1,701,645,395	3,121,341,919
派生商品評価勘定		17,744,449	176,480,770
未収配当金		345,286,491	362,375,318
差入委託証拠金		1,374,242,357	3,105,229,477
流動資産合計		181,593,290,618	301,485,551,750
資産合計		181,593,290,618	301,485,551,750
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		105,250,691	3,076,713
未払金		9,784,908	-
未払解約金		201,296,000	65,519,000
流動負債合計		316,331,599	68,595,713
負債合計		316,331,599	68,595,713
純資産の部			
元本等			
元本		197,183,673,045	225,558,619,520
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	15,906,714,026	75,858,336,517
元本等合計		181,276,959,019	301,416,956,037
純資産合計		181,276,959,019	301,416,956,037
負債純資産合計		181,593,290,618	301,485,551,750

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、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。	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。	(1)先物取引 同左  (2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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20年2月16日から平成21年2月16日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (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21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	124,701,083,143円	197,183,673,045円
同期中追加設定元本額	96,703,815,127円	92,304,482,403円
同期中解約元本額	24,221,225,225円	63,929,535,928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	円	568,168,434円
D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金>	16,560,290,908円	23,213,965,594円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	175,689,561円	150,678,903円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	991,386,929円	913,519,550円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,228,056,438円	1,149,698,004円

D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	229,937,066円	193,050,523円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	541,631,759円	498,948,286円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	354,718,783円	359,110,729円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	102,477,003円	86,729,232円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	659,960,562円	652,023,646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)	631,822,232円	630,981,786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)	4,123,509,093円	7,190,773,220円
グローバル株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	7,525,103,936円	3,887,302,768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)	15,905,789,526円	18,474,923,213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)	円	105,500,784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)	14,891,663,410円	10,727,886,299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)	2,250,386,931円	1,740,569,365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)	262,602,330円	199,270,706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)	1,396,327,777円	1,113,268,685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)	142,487,190円	104,261,122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)	248,487,137円	182,819,516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)	24,990,963,724円	18,997,744,727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)	12,047,030,908円	9,337,734,130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)	4,551,898,323円	3,331,932,857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)	3,901,217,085円	2,993,730,662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)	10,363,500,181円	7,992,567,042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）	7,399,009,299円	5,726,725,789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）	9,683,336,319円	7,325,053,528円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A（適格機関投資家限定）	5,348,131,820円	5,114,656,766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）	5,356,366,572円	4,370,574,948円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	160,554,143円	71,879,037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）	602,491,188円	486,094,615円
D I A M世界バランスファンド55V A（適格機関投資家限定）	24,372,738,008円	19,838,757,391円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35V A（適格機関投資家限定）	4,511,403,629円	3,579,581,887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）	172,067,685円	139,785,636円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A（適格機関投資家限定）	13,203,618,731円	25,019,554,358円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A（適格機関投資家限定）	2,297,016,859円	2,648,519,200円
D I A M世界アセットバランスファンド25V A（適格機関投資家限定）	円	4,649,048,270円
D I A M世界アセットバランスファンド3V A（適格機関投資家限定）	円	15,269,051,444円
D I A Mバランス50V A（適格機関投資家限定）	円	166,823円
D I A Mバランス70V A（適格機関投資家限定）	円	257,809円
D I A M世界アセットバランスファンド4V A（適格機関投資家限定）	円	16,521,517,152円
D I A Mバランス40V A（適格機関投資家限定）	円	78,091円
D I A Mバランス60V A（適格機関投資家限定）	円	156,993円
（合計）	197,183,673,045円	225,558,619,520円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	197,183,673,045口	225,558,619,520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15,906,714,026円であります。	
----------	--	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	175,616,714,659	67,395,978,461	290,793,652,338	74,147,845,756
投資信託受益証券	409,511,076	209,602,024	927,703,845	175,764,065
投資証券	1,701,645,395	1,041,328,042	3,121,341,919	1,002,638,551
合計	177,727,871,130	68,646,908,527	294,842,698,102	75,326,248,372

(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計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	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
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左

5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
--------------------------	--	----

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成21年1月13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	100,652,950	-	100,349,550	303,400
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	197,808,164	-	193,828,800	3,979,364
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	767,386,758	-	754,048,794	13,337,964
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	351,995,423	-	349,219,464	2,775,959
	米ドル S&P 500 FUTURE	1,851,227,113	-	1,786,584,524	64,642,589
	合 計	3,269,070,408	-	3,184,031,132	85,039,276

平成22年1月12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	274,255,371	-	285,261,824	11,006,453
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	415,662,544	-	423,953,942	8,291,398
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,416,138,522	-	1,455,054,656	38,916,134
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	674,129,056	-	693,205,783	19,076,727
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,223,567,116	-	3,321,761,625	98,194,509

合 計	6,003,752,609	-	6,179,237,830	175,485,221
-----	---------------	---	---------------	-------------

## (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。

## (通貨関連)

平成21年1月13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 買建				
	オーストラリアドル	24,264,800	-	24,264,000	800
	カナダドル	44,051,400	-	44,046,000	5,400
	シンガポール・ドル	25,741,716	-	25,740,000	1,716
	ユーロ	172,944,650	-	170,531,800	2,412,850
	英ポンド	79,328,400	-	79,320,000	8,400
	米ドル	225,502,200	-	225,464,400	37,800
合 計		571,833,166	-	569,366,200	2,466,966

平成22年1月12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				
	米ドル	23,997,636	-	23,995,400	2,236
	買建				
	オーストラリアドル	17,135,000	-	17,132,000	3,000
	カナダドル	18,055,600	-	17,852,000	203,600
	ユーロ	106,940,000	-	107,000,000	60,000
	英ポンド	44,679,900	-	44,574,000	105,900
米ドル	158,723,900	-	156,893,000	1,830,900	
合 計		369,532,036	-	367,446,400	2,081,164

## (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。

( 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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	0.9193円	1.3363円
( 1万口当たり純資産額 )	(9,193円)	(13,363円)

[前](#) [次](#)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株 式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	190,570	70.650	13,463,770.500	
	XL CAPITAL LTD-CLASS A	51,004	18.280	932,353.120	
	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	1,385	330.000	457,050.000	
	EVEREST RE GROUP LTD	9,632	84.760	816,408.320	
	PARTNERRE LTD	9,668	72.000	696,096.000	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,979	27.880	557,014.520	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9,102	54.250	493,783.500	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,318	70.620	446,177.160	
	BUNGE LTD	21,999	70.280	1,546,089.720	
	VALIDUS HOLDINGS LTD	13,905	26.370	366,674.850	
	INVESCO LTD	66,224	23.630	1,564,873.120	
	ULTRA PETROLEUM CORP	26,465	51.900	1,373,533.500	
	ACE LTD	53,849	48.010	2,585,290.490	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	73,405	37.290	2,737,272.450	
	WEATHERFORD INTL LTD	110,561	19.790	2,188,002.190	
	NOBLE CORP	39,890	44.160	1,761,542.400	
	TRANSOCEAN LTD	50,198	92.520	4,644,318.960	
	FOSTER WHEELER AG	21,365	34.440	735,810.600	
	TYCO ELECTRONICS LTD	72,714	24.780	1,801,852.920	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	27,142	44.020	1,194,790.840	
	INGERSOLL-RAND PLC	48,633	37.510	1,824,223.830	
	ACCENTURE PLC-CL A	97,108	42.530	4,130,003.240	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	28,704	27.300	783,619.200	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	17,625	28.380	500,197.500	
	COVIDIEN PLC	80,486	49.060	3,948,643.160	
	SEAGATE TECHNOLOGY	78,988	18.350	1,449,429.800	
	GARMIN LTD	20,035	34.290	687,000.150	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23,836	26.020	620,212.720	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	69,478	33.420	2,321,954.760	
	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	34,109	26.570	906,276.130	
	FLEXTRONICS INTL LTD	124,958	7.140	892,200.120	
	AMAZON.COM INC	53,891	130.310	7,022,536.210	
	ABBOTT LABORATORIES	245,503	55.330	13,583,680.990	
	AES CORP	107,013	13.870	1,484,270.310	

	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,529	32.480	471,901.920	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	207,025	129.480	26,805,597.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,835	9.140	903,351.900	
	ADOBE SYSTEMS INC	82,304	36.210	2,980,227.840	
	AGCO CORP	14,077	36.860	518,878.220	
	AIRGAS INC	12,495	48.600	607,257.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	33,020	83.340	2,751,886.800	
	ENERGEN CORP	11,608	48.540	563,452.320	
	ALLERGAN INC	47,419	60.640	2,875,488.160	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	143,176	34.260	4,905,209.760	
	POLO RALPH LAUREN CORP	9,262	85.560	792,456.720	
	ALLSTATE CORP	78,926	31.210	2,463,280.460	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	111,662	42.650	4,762,384.300	
	ALTERA CORPORATION	48,418	22.570	1,092,794.260	
	ALCOA INC	150,389	17.450	2,624,288.050	
	AMGEN INC	160,054	57.020	9,126,279.080	
	HESS CORP	47,649	65.140	3,103,855.860	
	ALLEGHENY ENERGY INC	25,250	23.040	581,760.000	
	FORTUNE BRANDS INC	22,929	45.180	1,035,932.220	
	AMERICAN EXPRESS CO	169,051	41.470	7,010,544.970	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	74,470	35.980	2,679,430.600	
	AFLAC INC	75,197	50.710	3,813,239.870	
	AMERICAN INTL GROUP	19,154	29.630	567,533.020	
	ANALOG DEVICES	44,462	31.310	1,392,105.220	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	77,670	66.310	5,150,297.700	
	QWEST COMMUNICATIONS INTL	252,980	4.690	1,186,476.200	
	AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	13,553	61.300	830,798.900	
	NABORS INDUSTRIES LTD	48,028	25.990	1,248,247.720	
	ARCH COAL INC	26,204	27.380	717,465.520	
	TIME WARNER	186,616	29.170	5,443,588.720	
	VALERO ENERGY CORP	89,172	18.510	1,650,573.720	
	APOLLO GROUP INC	20,538	59.970	1,231,663.860	
	APACHE CORP	54,903	106.910	5,869,679.730	
	APPLE INC	142,024	210.110	29,840,662.640	
	APPLIED MATERIALS INC	207,589	14.870	3,086,848.430	
	ARCHER-DANIELS-MIDLANDCO	90,088	30.860	2,780,115.680	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	32,880	16.880	555,014.400	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	14,880	37.520	558,297.600	
	AMEREN CORP	37,141	27.230	1,011,349.430	
	ARROW ELECTRONICS INC	18,235	29.620	540,120.700	
	AUTODESK INC	33,412	26.250	877,065.000	

	AUTOMATIC DATA PROCESSING	78,389	42.610	3,340,155.290	
	AUTOZONE INC	5,222	155.480	811,916.560	
	AVERY DENNISON CORP	14,419	38.710	558,159.490	
	AVNET INC	23,051	29.720	685,075.720	
	AVON PRODUCTS INC	69,281	30.930	2,142,861.330	
	BMC SOFTWARE INC	30,045	40.070	1,203,903.150	
	BJ SERVICES CO	49,086	21.160	1,038,659.760	
	BAKER HUGHES INC	49,224	46.600	2,293,838.400	
	BALL CORP	14,325	51.800	742,035.000	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,748	3,324.990	5,812,082.520	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	29,902	34.710	1,037,898.420	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	187,321	29.020	5,436,055.420	
	CR BARD INC	16,155	81.260	1,312,755.300	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	94,488	58.830	5,558,729.040	
	BED BATH & BEYOND INC	40,690	41.780	1,700,028.200	
	BECKMAN COULTER INC	10,806	68.570	740,967.420	
	BECTON DICKINSON & CO	37,142	78.410	2,912,304.220	
	AMETEK INC	15,557	39.550	615,279.350	
	NII HOLDINGS INC	24,744	38.270	946,952.880	
	VERIZON COMM INC	449,650	31.880	14,334,842.000	
	WR BERKLEY CORP	21,076	24.600	518,469.600	
	BEST BUY CO INC	55,223	39.230	2,166,398.290	
	YUM! BRANDS INC	72,146	35.320	2,548,196.720	
	FIRSTENERGY CORP	48,814	46.610	2,275,220.540	
	BLACK & DECKER CORP	10,677	72.070	769,491.390	
	SLM CORP	68,934	11.480	791,362.320	
	H&R BLOCK INC	55,766	22.100	1,232,428.600	
	BOEING CO	107,860	60.870	6,565,438.200	
	ROBERT HALF INTL INC	22,574	29.350	662,546.900	
	BORGWARNER INC	17,478	36.450	637,073.100	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	232,724	9.070	2,110,806.680	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	25,890	57.720	1,494,370.800	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	268,938	25.080	6,744,965.040	
	ONEOK INC	14,893	46.410	691,184.130	
	SEMPRA ENERGY	35,960	54.590	1,963,056.400	
	FEDEX CORP	46,541	87.250	4,060,702.250	
	VERISIGN INC	32,898	24.510	806,329.980	
	AMPHENOL CORP	26,079	45.290	1,181,117.910	
	BROWN-FORMAN CORP	11,939	53.640	640,407.960	
	QUANTA SERVICES INC	33,320	20.980	699,053.600	
	BURLINGTONNORTHERN SANTA FE	53,786	99.080	5,329,116.880	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	265,983	1.540	409,613.820	

	CSX CORP	63,568	51.860	3,296,636.480	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	40,115	26.290	1,054,623.350	
	CABOT OIL & GAS CORP	19,209	44.290	850,766.610	
	CAMPBELL SOUP CO	34,722	32.930	1,143,395.460	
	CONSTELLATION BRANDS INC	31,178	15.690	489,182.820	
	CARDINAL HEALTH INC	54,429	32.020	1,742,816.580	
	CATERPILLAR INC	98,217	64.130	6,298,656.210	
	CELGENE CORP	73,214	57.270	4,192,965.780	
	CITRIX SYSTEMS INC	28,981	42.490	1,231,402.690	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	97,095	28.000	2,718,660.000	
	CENTURYTEL INC	46,271	35.200	1,628,739.200	
	CEPHALON INC	12,443	64.360	800,831.480	
	CERNER CORP	10,884	88.700	965,410.800	
	JPMORGAN CHASE & CO	621,821	44.530	27,689,689.130	
	CHUBB CORP	54,711	49.190	2,691,234.090	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	10,777	59.730	643,710.210	
	CIGNA CORP	44,187	37.370	1,651,268.190	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,914	26.800	614,095.200	
	CINTAS CORP	23,420	26.800	627,656.000	
	CISCO SYSTEMS INC	911,974	24.590	22,425,440.660	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	21,675	52.880	1,146,174.000	
	CLOROX COMPANY	21,128	61.340	1,295,991.520	
	COCA-COLA CO/THE	330,222	56.270	18,581,591.940	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	45,581	21.130	963,126.530	
	COLGATE-PALMOLIVECO	78,505	81.150	6,370,680.750	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	48,195	27.980	1,348,496.100	
	AON CORP	38,448	38.050	1,462,946.400	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	128,519	16.080	2,066,585.520	
	COMERICA INC	22,166	32.220	714,188.520	
	NRG ENERGY, INC.	39,988	24.730	988,903.240	
	COMCAST CORP-CL A	305,183	16.810	5,130,126.230	
	CA INC	63,774	23.070	1,471,266.180	
	COMPUTER SCIENCES CORP	24,670	56.850	1,402,489.500	
	CONAGRA FOODS INC	71,068	23.410	1,663,701.880	
	CONSOLIDATED EDISON INC	43,301	45.820	1,984,051.820	
	SARA LEE CORP	101,174	12.050	1,219,146.700	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	39,251	43.740	1,716,838.740	
	MOLSON COORS BREWING CO	24,258	45.010	1,091,852.580	
	CORNING INC	248,964	20.490	5,101,272.360	
	DIRECTV	143,167	33.650	4,817,569.550	
	COVANCE INC	9,828	55.920	549,581.760	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	21,196	25.730	545,373.080	
	SEALED AIR CORP	27,699	21.670	600,237.330	

	BROADCOM CORP-CL A	66,738	30.710	2,049,523.980	
	XTO ENERGY INC	89,518	48.200	4,314,767.600	
	CUMMINS INC	31,016	55.000	1,705,880.000	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	18,116	88.640	1,605,802.240	
	DR HORTON INC	49,200	12.240	602,208.000	
	DANAHER CORP	42,158	77.750	3,277,784.500	
	MOODY'S CORP	33,649	26.680	897,755.320	
	AMERICAN TOWER CORP	62,848	43.980	2,764,055.040	
	IMS HEALTH INC	28,888	21.430	619,069.840	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	46,222	46.480	2,148,398.560	
	TARGET CORP	112,159	50.180	5,628,138.620	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	11,626	104.240	1,211,894.240	
	DEERE & CO	65,857	59.950	3,948,127.150	
	DELL INC	277,822	14.860	4,128,434.920	
	MORGAN STANLEY	193,140	32.040	6,188,205.600	
	REPUBLIC SERVICES INC	60,513	28.920	1,750,035.960	
	DEVRY INC	9,297	56.400	524,350.800	
	THE WALT DISNEY CO	286,447	31.360	8,982,977.920	
	DOLLAR TREE INC	13,346	49.060	654,754.760	
	RR DONNELLEY & SONS CO	31,238	22.920	715,974.960	
	DOVER CORP	27,623	45.390	1,253,807.970	
	DOW CHEMICAL	178,485	30.760	5,490,198.600	
	OMNICOM GROUP	46,523	39.390	1,832,540.970	
	DTE ENERGY CO	27,197	43.770	1,190,412.690	
	DST SYSTEMS INC	6,910	45.260	312,746.600	
	DUKE ENERGY CORP	209,509	17.010	3,563,748.090	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	46,567	38.970	1,814,715.990	
	FLOWSERVE CORP	9,213	108.410	998,781.330	
	DARDEN RESTAURANTS INC	22,329	34.040	760,079.160	
	EBAY INC	169,326	23.450	3,970,694.700	
	EMC CORP/MASS	324,764	17.510	5,686,617.640	
	BANK OF AMERICA CORP	1,366,157	16.930	23,129,038.010	
	EL PASO CORP	106,266	10.770	1,144,484.820	
	CITIGROUP INC	3,348,739	3.630	12,155,922.570	
	EASTMAN CHEMICAL CO	11,841	60.890	720,998.490	
	EATON CORP	23,933	69.070	1,653,052.310	
	EATON VANCE CORP	16,415	31.930	524,130.950	
	DISH NETWORK CORP	31,646	21.230	671,844.580	
	ECOLAB INC	38,559	46.280	1,784,510.520	
	ELECTRONIC ARTS INC	50,822	18.270	928,517.940	
	SALESFORCE.COM INC	19,232	73.650	1,416,436.800	
	EMERSON ELECTRIC CO	119,754	44.730	5,356,596.420	
	ENTERGY CORP	31,265	81.050	2,534,028.250	

EOG RESOURCES INC	40,236	98.140	3,948,761.040
EQUIFAX INC	19,838	31.640	627,674.320
EQT CORP	19,126	44.250	846,325.500
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,316	49.780	961,550.480
EXPEDITORS INTERNATIONAL	32,791	34.790	1,140,798.890
EXPRESS SCRIPTS INC	40,851	90.230	3,685,985.730
EXXON MOBIL CORP	760,697	70.300	53,476,999.100
FMC CORP	11,880	54.440	646,747.200
FPL GROUP INC	62,014	52.600	3,261,936.400
FAMILY DOLLAR STORES	22,967	30.550	701,641.850
ASSURANT INC	17,619	31.590	556,584.210
FASTENAL CO	18,915	46.060	871,224.900
FIFTH THIRD BANCORP	115,282	11.200	1,291,158.400
M&T BANK CORP	12,661	73.140	926,025.540
FISERV INC	24,628	48.920	1,204,801.760
FLIR SYSTEMS INC	25,251	32.570	822,425.070
MACY'S INC	65,836	16.620	1,094,194.320
FORD MOTOR CO	446,448	12.110	5,406,485.280
FOREST LABORATORIES INC	46,383	31.400	1,456,426.200
FRANKLIN RESOURCES INC	25,571	110.410	2,823,294.110
FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	64,109	88.090	5,647,361.810
FIRST AMERICAN CORP	14,232	31.500	448,308.000
GAP INC/THE	77,544	20.620	1,598,957.280
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	20,099	36.060	724,769.940
GENERAL DYNAMICS CORP	50,856	70.730	3,597,044.880
GENERAL MILLS INC	50,363	70.790	3,565,196.770
GENUINE PARTS CO	24,541	38.670	949,000.470
GENZYME CORP-GENL DIVISION	42,070	53.700	2,259,159.000
GILEAD SCIENCES INC	142,430	44.890	6,393,682.700
STARWOOD HOTELS&RESORTS	28,710	37.730	1,083,228.300
GOODRICH CORP	20,936	66.350	1,389,103.600
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	15.930	584,328.330
MCKESSON CORP	42,983	61.460	2,641,735.180
NVIDIA CORP	88,942	18.290	1,626,749.180
GENERAL ELECTRIC CO	1,684,377	16.760	28,230,158.520
VW GRAINGER INC	9,392	100.150	940,608.800
LIFE TECHNOLOGIES CORP	27,938	51.190	1,430,146.220
NUANCE COMMUNICATIONS INC	33,979	16.730	568,468.670
PEPSI BOTTLING GROUP INC	24,179	37.490	906,470.710
HALLIBURTON CO	141,436	33.780	4,777,708.080
HANSEN NATURAL CORP	12,038	40.290	485,011.020
GOLDMAN SACHS GROUP INC	76,768	171.560	13,170,318.080
HARLEY-DAVIDSON INC	38,884	25.170	978,710.280
HARRIS CORP	22,272	49.260	1,097,118.720

	HARSCO CORP	13,902	35.230	489,767.460	
	JEFFERIES GROUP INC NPR	14,558	25.930	377,488.940	
	CONSOL ENERGY INC	28,594	55.120	1,576,101.280	
	HASBRO INC	18,941	31.740	601,187.340	
	HENRY SCHEIN INC	15,366	55.740	856,500.840	
	DENBURY RESOURCES INC	40,999	16.180	663,363.820	
	HJ HEINZ CO	48,904	42.400	2,073,529.600	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,757	46.460	732,070.220	
	HERSHEY FOODS CORP	25,565	36.180	924,941.700	
	HEWLETT-PACKARD CO	378,549	52.430	19,847,324.070	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	26,712	25.970	693,710.640	
	REYNOLDS AMERICAN INC	28,566	53.390	1,525,138.740	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,350	36.740	563,959.000	
	JUNIPER NETWORKS INC	83,227	26.200	2,180,547.400	
	HOLOGIC INC	37,856	14.940	565,568.640	
	UNUM GROUP	48,414	20.960	1,014,757.440	
	HOME DEPOT INC	268,306	28.160	7,555,496.960	
	HORMEL FOODS CORP	12,265	38.160	468,032.400	
	HUDSON CITY BANCORP INC	77,279	14.270	1,102,771.330	
	CENTERPOINT ENERGY INC	55,838	14.340	800,716.920	
	HUMANA INC	27,533	46.950	1,292,674.350	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,239	34.540	526,355.060	
	RED HAD INC	31,656	29.740	941,449.440	
	ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	5,620	101.490	570,373.800	
	PEPSIAMERICAS INC NPR	11,789	29.320	345,653.480	
	BIOGEN IDEC INC	46,554	53.900	2,509,260.600	
	ILLINOIS TOOL WORKS	66,642	49.950	3,328,767.900	
	INTUIT INC	50,471	31.220	1,575,704.620	
	INTEL CORP	883,807	20.950	18,515,756.650	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,788	41.530	572,615.640	
	INTL GAME TECH	49,124	19.790	972,163.960	
	INTERNATIONAL PAPER CO	65,538	26.610	1,743,966.180	
	ITT CORP	26,172	50.800	1,329,537.600	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	74,501	7.470	556,522.470	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,536	41.310	848,342.160	
	RAYONIER INC	13,728	45.370	622,839.360	
	JOHNSON & JOHNSON	434,075	64.220	27,876,296.500	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	60,343	26.170	1,579,176.310	
	JOHNSON CONTROLS INC	106,001	28.980	3,071,908.980	
	KLA-TENCOR CORP	25,031	36.960	925,145.760	
	DEVON ENERGY CORP	68,534	75.080	5,145,532.720	

	NSTAR	18,750	35.900	673,125.000	
	KELLOGG CO	42,336	53.410	2,261,165.760	
	KEYCORP	129,224	6.530	843,832.720	
	KIMBERLY-CLARK CORP	65,472	62.630	4,100,511.360	
	BLACKROCK INC/NEW YORK	3,899	242.810	946,716.190	
	KOHL'S CORP	45,226	52.750	2,385,671.500	
	KROGER CO	97,018	20.340	1,973,346.120	
	LSI CORP	110,142	6.140	676,271.880	
	LAM RESEARCH CORP	20,796	41.430	861,578.280	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	26,381	26.390	696,194.590	
	LEGG MASON INC	21,861	31.550	689,714.550	
	LEGGETT & PLATT INC	20,637	21.090	435,234.330	
	PACTIV CORP	18,686	24.450	456,872.700	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	28,206	25.850	729,125.100	
	ELI LILLY & CO	161,427	35.480	5,727,429.960	
	LIMITED BRANDS	42,170	20.460	862,798.200	
	LINCOLN NATIONAL CORP	45,785	27.390	1,254,051.150	
	LINEAR TECH CORP	37,048	30.640	1,135,150.720	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,732	62.820	6,956,184.240	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	56,715	30.820	1,747,956.300	
	LOCKHEED MARTIN CORP	52,996	75.970	4,026,106.120	
	LOEWS CORP	55,071	37.920	2,088,292.320	
	RANGE RESOURCES CORP	26,908	52.030	1,400,023.240	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,568	50.950	742,239.600	
	LOWE'S COS INC	235,179	23.390	5,500,836.810	
	LUBRIZOL CORP	10,256	76.670	786,327.520	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	95,748	39.130	3,746,619.240	
	IRON MOUNTAIN INC	27,531	24.330	669,829.230	
	SCANA CORP	20,246	37.150	752,138.900	
	MDU RESOURCES GROUP INC	27,660	23.720	656,095.200	
	MGM MIRAGE	39,867	10.900	434,550.300	
	MCCORMICK & CO INC	20,286	37.020	750,987.720	
	MCDONALD'S CORPORATION	171,317	62.320	10,676,475.440	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	51,301	33.760	1,731,921.760	
	MCAFFEE INC	24,325	40.720	990,514.000	
	MANPOWER INC	13,462	59.110	795,738.820	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	9,159	91.430	837,407.370	
	MARSH & MCLENNAN COS	81,786	22.080	1,805,834.880	
	MARSHALL & ILSLEY CORP	82,632	6.860	566,855.520	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	10,852	64.870	703,969.240	
	MASCO CORP	61,569	15.540	956,782.260	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,858	88.930	520,951.940	
	MATTEL INC	58,664	19.900	1,167,413.600	



	METLIFE INC	129,292	38.500	4,977,742.000	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	45,356	19.830	899,409.480	
	MEDTRONIC INC	175,823	45.810	8,054,451.630	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	91,222	10.890	993,407.580	
	CVS CAREMARK CORP	230,291	33.930	7,813,773.630	
	MERCK & CO. INC.	483,145	37.850	18,287,038.250	
	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	33,006	14.960	493,769.760	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	17,498	74.890	1,310,425.220	
	MICROSOFT CORP	1,267,583	30.270	38,369,737.410	
	MICRON TECH INC	135,376	10.900	1,475,598.400	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,390	28.460	779,519.400	
	MILLIPORE CORP	8,184	72.090	589,984.560	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	83,500	21.210	1,771,035.000	
	3M CO	103,598	83.980	8,700,160.040	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	49.430	442,793.940	
	PROGRESS ENERGY INC	43,081	39.290	1,692,652.490	
	CHARLES RIVER LABORATORIES INT	11,470	34.740	398,467.800	
	MOTOROLA INC	366,768	7.680	2,816,778.240	
	MURPHY OIL CORPORATION	29,304	59.590	1,746,225.360	
	MYLAN LABORATORIES	49,968	17.770	887,931.360	
	ILLUMINA INC	19,512	33.820	659,895.840	
	MYRIAD GENETICS INC	15,704	25.570	401,551.280	
	XCEL ENERGY INC	72,212	20.990	1,515,729.880	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	64,993	46.650	3,031,923.450	
	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	37,397	15.040	562,450.880	
	NETAPP INC	51,995	32.940	1,712,715.300	
	SEARS HOLDINGS CORP	9,671	99.440	961,684.240	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	23,027	49.640	1,143,060.280	
	NEWELL RUBBERMAID INC	41,919	15.600	653,936.400	
	DUN & BRADSTREET CORP	9,215	82.150	757,012.250	
	NEWMONT MINING CORP	76,289	50.180	3,828,182.020	
	NIKE INC-CL B	58,384	64.910	3,789,705.440	
	NOBLE ENERGY INC	28,515	75.610	2,156,019.150	
	NORDSTROM INC	26,079	38.350	1,000,129.650	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	57,842	54.230	3,136,771.660	
	NORTHEAST UTILITIES	25,887	26.210	678,498.270	
	NISOURCE INC	40,523	15.210	616,354.830	
	COACH INC	51,124	38.320	1,959,071.680	
	NORTHERN TRUST CORP	33,619	51.040	1,715,913.760	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	48,788	57.500	2,805,310.000	
	WELLS FARGO & CO	767,738	28.800	22,110,854.400	

	NUCOR CORP	48,873	49.640	2,426,055.720	
	MONSANTO CO	85,540	85.010	7,271,755.400	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	70,367	41.700	2,934,303.900	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	127,507	82.960	10,577,980.720	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,142	38.130	729,884.460	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	43,795	10.350	453,278.250	
	OMNICARE INC	16,646	26.190	435,958.740	
	ORACLE CORP	631,441	24.690	15,590,278.290	
	OWENS-ILLINOIS INC	25,046	32.640	817,501.440	
	PACCAR INC	53,988	38.940	2,102,292.720	
	PALL CORP	19,989	37.520	749,987.280	
	EXELON CORP	103,617	48.860	5,062,726.620	
	PARKER HANNIFIN CORP	24,500	57.820	1,416,590.000	
	PATTERSON-UTI ENERGY INC	26,675	17.800	474,815.000	
	PATTERSON COS INC	16,119	30.750	495,659.250	
	PAYCHEX INC	52,389	31.750	1,663,350.750	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	34,075	26.330	897,194.750	
	PPL CORPORATION	60,425	32.120	1,940,851.000	
	PEPSICO INC	246,757	60.700	14,978,149.900	
	PENTAIR INC	15,263	33.880	517,110.440	
	PERRIGO CO	13,437	39.460	530,224.020	
	PFIZER INC	1,277,344	18.830	24,052,387.520	
	CONOCOPHILLIPS	221,884	53.570	11,886,325.880	
	PETSMART INC	22,122	26.780	592,427.160	
	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	15,778	23.310	367,785.180	
	PG&E CORP	57,700	44.450	2,564,765.000	
	PITNEY BOWES INC	34,886	21.940	765,398.840	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,218	52.280	952,437.040	
	ALTRIA GROUP INC	323,519	20.260	6,554,494.940	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	73,878	57.290	4,232,470.620	
	AETNA INC	65,791	32.740	2,153,997.340	
	FLUOR CORP (NEW)	26,557	49.980	1,327,318.860	
	PPG INDUSTRIES INC	26,457	61.680	1,631,867.760	
	PRAXAIR INC	48,227	82.260	3,967,153.020	
	PRECISION CASTPARTS CORP	22,226	116.280	2,584,439.280	
	COSTCO WHOLESALE CORP	68,438	59.350	4,061,795.300	
	T ROWE PRICE GROUP INC	40,145	54.280	2,179,070.600	
	QUEST DIAGNOSTICS	25,363	59.590	1,511,381.170	
	PROCTER & GAMBLE CO	462,170	60.200	27,822,634.000	
	PROGRESSIVE CORP	103,358	17.260	1,783,959.080	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79,087	33.040	2,613,034.480	

	PULTE HOMES INC	52,991	10.970	581,311.270	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	48,779	14.850	724,368.150	
	QUALCOMM INC	261,767	49.290	12,902,495.430	
	QUESTAR CORP	28,600	44.140	1,262,404.000	
	AUTONATION INC	16,132	20.450	329,899.400	
	US BANCORP	298,905	24.320	7,269,369.600	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	61.800	558,424.800	
	ROSS STORES INC	20,294	45.280	918,912.320	
	ROPER INDUSTRIES INC	13,904	52.660	732,184.640	
	ROWAN COS INC	17,226	25.750	443,569.500	
	PEABODY ENERGY CORP	43,044	48.760	2,098,825.440	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,234	49.000	1,138,466.000	
	RAYTHEON COMPANY	61,997	53.000	3,285,841.000	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,445	56.600	760,987.000	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	9,721	67.750	658,597.750	
	FMC TECHNOLOGIES INC	18,561	59.630	1,106,792.430	
	KRAFT FOODS INC-A	230,389	28.800	6,635,203.200	
	SANDISK CORP	35,570	30.490	1,084,529.300	
	SAFEWAY INC	68,425	21.300	1,457,452.500	
	ROCKWELL COLLINS INC	25,877	57.000	1,474,989.000	
	ST JUDE MEDICAL INC	53,866	38.190	2,057,142.540	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	88,033	48.540	4,273,121.820	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	49,548	23.930	1,185,683.640	
	PRICELINE.COM INC	6,427	218.910	1,406,934.570	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	159,071	19.110	3,039,846.810	
	JOY GLOBAL INC	15,251	58.910	898,436.410	
	ZIMMER HOLDINGS INC	33,649	63.360	2,132,000.640	
	SPX CORP	8,540	61.860	528,284.400	
	SEI INVESTMENTS CO	23,592	18.370	433,385.040	
	WELLPOINT INC	76,489	64.310	4,919,007.590	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	48,364	26.340	1,273,907.760	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	29,280	33.340	976,195.200	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,242	25.790	1,295,741.180	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,066	59.630	958,015.580	
	SIGMA-ALDRICH	19,608	51.610	1,011,968.880	
	SMITH INTERNATIONAL INC	38,436	31.030	1,192,669.080	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	72,711	53.490	3,889,311.390	
	ADVANCE AUTO PARTS	14,592	40.240	587,182.080	
	UNITED STATES STEEL CORP	23,198	62.930	1,459,850.140	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	57,599	50.480	2,907,597.520	
	EDISON INTERNATIONAL	50,049	35.170	1,760,223.330	
	SOUTHERN CO	123,187	33.260	4,097,199.620	
	BB&T CORP	109,614	27.340	2,996,846.760	
	SOUTHWEST AIRLINES	35,573	11.460	407,666.580	
	AT&T INC	934,024	26.970	25,190,627.280	
	CHEVRON CORP	317,081	80.880	25,645,511.280	
	MEADWESTVACO CORP	28,338	28.650	811,883.700	
	STANLEY WORKS/THE	10,383	57.070	592,557.810	
	STAPLES INC	110,918	25.450	2,822,863.100	
	STATE STREET CORP	77,441	44.360	3,435,282.760	

	STARBUCKS CORP	115,860	23.210	2,689,110.600	
	STRYKER CORP	47,372	55.250	2,617,303.000	
	DEAN FOODS CO	28,635	18.430	527,743.050	
	SUNOCO INC	17,359	28.370	492,474.830	
	SUN MICROSYSTEMS INC	114,142	9.410	1,074,076.220	
	STERICYCLE INC	12,347	55.350	683,406.450	
	SUNTRUST BANKS INC	79,554	23.270	1,851,221.580	
	SYMANTEC CORP	129,040	18.360	2,369,174.400	
	SUPERVALU INC	36,635	12.920	473,324.200	
	SYNOPSIS INC	22,150	22.120	489,958.000	
	SYSCO CORP	91,489	27.850	2,547,968.650	
	INTUITIVE SURGICAL INC	6,000	311.290	1,867,740.000	
	TELEPHONE & DATA SYSTEMS INC	10,241	34.420	352,495.220	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	199,597	26.000	5,189,522.000	
	TEXTRON INC	42,770	21.470	918,271.900	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	65,666	49.500	3,250,467.000	
	TIFFANY & CO	21,556	46.680	1,006,234.080	
	TOLL BROTHERS INC	19,860	19.950	396,207.000	
	TORCHMARK CORP	14,060	46.160	649,009.600	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25,113	17.000	426,921.000	
	DAVITA INC	16,373	61.790	1,011,687.670	
	TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,657	50.840	440,121.880	
	TYSON FOODS INC	50,331	13.120	660,342.720	
	URS CORP	11,757	48.810	573,859.170	
	MARATHON OIL CORP	113,116	32.700	3,698,893.200	
	UNION PACIFIC CORP	79,593	67.590	5,379,690.870	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	141,089	72.160	10,180,982.240	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	186,725	32.920	6,146,987.000	
	SPRINT NEXTEL CORP	445,183	4.050	1,802,991.150	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	19,570	47.640	932,314.800	
	VF CORP	14,427	75.290	1,086,208.830	
	CBS CORP	95,580	14.090	1,346,722.200	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	27,016	41.830	1,130,079.280	
	VULCAN MATERIALS CO	21,465	52.180	1,120,043.700	
	URBAN OUTFITTERS INC	20,008	33.820	676,670.560	
	WALGREEN CO	155,566	37.050	5,763,720.300	
	WAL-MART STORES INC	369,363	54.210	20,023,168.230	
	WASTE MANAGEMENT INC	73,725	34.670	2,556,045.750	
	WATERS CORP	15,070	62.430	940,820.100	
	WASHINGTON POST	984	455.050	447,769.200	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	14,654	39.770	582,789.580	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,635	61.940	1,154,251.900	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	73,838	65.490	4,835,650.620	

	WESTERN DIGITAL CORP	36,106	45.870	1,656,182.220	
	WEYERHAEUSER CO	33,344	44.400	1,480,473.600	
	WHIRLPOOL CORP	11,229	84.020	943,460.580	
	WYNN RESORTS LTD	10,971	67.680	742,517.280	
	WHOLE FOODS MARKET INC	24,228	29.740	720,540.720	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	26,208	20.280	531,498.240	
	CME GROUP INC	9,650	349.250	3,370,262.500	
	WILLIAMS COS INC	93,331	22.470	2,097,147.570	
	PEPCO HOLDINGS INC	31,737	16.940	537,624.780	
	ALLIANT ENERGY CORP	16,420	32.010	525,604.200	
	WISCONSIN ENERGY CORP	19,790	50.510	999,592.900	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,496	32.830	771,373.680	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	13,393	41.380	554,202.340	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	42,570	18.810	800,741.700	
	CARMAX INC	36,834	23.950	882,174.300	
	XEROX CORP	144,378	8.780	1,267,638.840	
	XILINX INC	45,536	24.740	1,126,560.640	
	YAHOO! INC	208,222	16.740	3,485,636.280	
	CIMAREX ENERGY CO	15,308	54.420	833,061.360	
	TJX COMPANIES INC	65,914	38.490	2,537,029.860	
	HOSPIRA INC	25,465	52.310	1,332,074.150	
	GENWORTH FINANCIAL INC	74,988	13.160	986,842.080	
	PETROHAWK ENERGY CORP	48,540	26.150	1,269,321.000	
	LIBERTY GLOBAL INC	23,697	23.690	561,381.930	
	REGIONS FINANCIAL CORP	185,681	6.320	1,173,503.920	
	GOOGLE INC	38,112	601.110	22,909,504.320	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	34,193	7.190	245,847.670	
	LAS VEGAS SANDS CORP	53,688	18.360	985,711.680	
	MOSAIC CO/THE	25,147	66.310	1,667,497.570	
	NEWS CORP CLASS B	67,118	16.470	1,105,433.460	
	NEWS CORP INC CLASS A	289,252	14.080	4,072,668.160	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	9,826	50.130	492,577.380	
	CELANESE CORP	21,341	34.330	732,636.530	
	WINDSTREAM CORP	70,959	10.860	770,614.740	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	17,825	50.200	894,815.000	
	IHS INC-CLASS A	8,935	55.460	495,535.100	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	18,504	32.670	604,525.680	
	EXPEDIA INC	33,017	24.030	793,398.510	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,560	98.200	644,192.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,959	42.380	1,735,842.420	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	18,684	23.630	441,502.920	

	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	39,979	13.240	529,321.960	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	22,845	20.320	464,210.400	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,182	108.500	1,104,747.000	
	SUNPOWER CORP-CLASS A	7,319	25.780	188,683.820	
	VIACOM INC-CLASS B	85,400	30.180	2,577,372.000	
	MIRANT CORP	24,904	16.160	402,448.640	
	NYSE EURONEXT	42,731	26.470	1,131,089.570	
	VIRGIN MEDIA INC	40,735	17.140	698,197.900	
	MASTERCARD INC	15,504	249.800	3,872,899.200	
	LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	88,253	11.920	1,051,975.760	
	WESTERN UNION CO	111,941	19.970	2,235,461.770	
	SAIC INC	34,008	19.010	646,492.080	
	KBR INC	27,411	20.710	567,681.810	
	FIRST SOLAR INC	7,294	138.240	1,008,322.560	
	SPECTRA ENERGY CORP	101,077	21.060	2,128,681.620	
	TIME WARNER CABLE INC	55,129	42.120	2,322,033.480	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	56,524	16.830	951,298.920	
	TFS FINANCIAL CORP	14,755	12.480	184,142.400	
	DELTA AIR LINES INC	36,277	12.790	463,982.830	
	DISCOVER FINANCIAL	85,989	14.840	1,276,076.760	
	VMWARE INC	6,959	44.830	311,971.970	
	TERADATA CORP	25,597	31.040	794,530.880	
	CALPINE CORP NPR	60,758	12.180	740,032.440	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	306,560	49.440	15,156,326.400	
	VISA INC	72,549	86.750	6,293,625.750	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41,476	28.680	1,189,531.680	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	23.230	667,281.750	
	LORILLARD INC	26,245	78.440	2,058,657.800	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	12,968	45.640	591,859.520	
	LENDER PROCESSING SERVICES	16,352	40.440	661,274.880	
	SUNPOWER CORP-CLASS B	9,542	23.040	219,847.680	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	26,102	28.730	749,910.460	
	CAREFUSION CORP	27,214	26.640	724,980.960	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	32,314	45.590	1,473,195.260	
米ドル小計	銘柄数 : 581	50,264,171		1,681,237,537.340	
	組入時価比率 : 51.48%			(155,178,224,696)	
	合計時価比率 : 52.63%				
英ポンド	XSTRATA PLC	301,557	12.245	3,692,565.460	

	AMEC PLC	51,473	8.075	415,644.470	
	ANTOFAGASTA PLC	60,925	10.200	621,435.000	
	SEVERN TRENT PLC	37,248	10.910	406,375.680	
	BHP BILLITON PLC	347,333	21.045	7,309,622.980	
	BARCLAYS PLC	1,803,772	3.170	5,717,957.240	
	BALFOUR BEATTY PLC	107,252	2.825	302,986.900	
	AUTONOMY CORP PLC	35,740	15.640	558,973.600	
	BRITISH AIRWAYS PLC	81,025	1.980	160,429.500	
	BT GROUP PLC	1,207,987	1.426	1,722,589.460	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	182,526	5.660	1,033,097.160	
	TULLOW OIL PLC	128,978	13.300	1,715,407.400	
	BUNZL PLC	57,272	6.740	386,013.280	
	CABLE & WIRELESS PLC	429,358	1.484	637,167.270	
	CAPITA GROUP PLC	100,129	7.385	739,452.660	
	AVIVA PLC	431,013	4.047	1,744,309.610	
	DIAGEO PLC	389,947	10.640	4,149,036.080	
	SCHRODERS PLC	22,471	13.190	296,392.490	
	NATIONAL GRID PLC	393,308	6.555	2,578,133.940	
	LONMIN	22,925	21.570	494,492.250	
	KINGFISHER PLC	377,279	2.308	870,759.930	
	BAE SYSTEMS PLC	554,307	3.674	2,036,523.910	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	315,284	20.225	6,376,618.900	
	MAN GROUP PLC	271,583	3.140	852,770.620	
	COBHAM PLC	164,685	2.484	409,077.540	
	FIRSTGROUP PLC	69,352	4.224	292,942.840	
	NEXT PLC	30,331	20.520	622,392.120	
	REXAM PLC	145,186	2.839	412,183.050	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	160,623	19.380	3,112,873.740	
	JOHNSON MATTHEY PLC	32,747	16.100	527,226.700	
	SABMILLER PLC	149,759	18.010	2,697,159.590	
	ANGLO AMERICAN PLC	206,790	28.450	5,883,175.500	
	COMPASS GROUP PLC	293,492	4.654	1,365,911.760	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,741,352	7.300	20,011,869.600	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	926,531	0.825	764,388.070	
	CENTRICA PLC	826,464	2.802	2,315,752.120	
	UNILEVER PLC	200,581	19.300	3,871,213.300	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	338,051	2.902	981,024.000	
	CADBURY PLC	221,192	7.810	1,727,509.520	
	INTL POWER PLC	230,321	3.176	731,499.490	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,002	4.945	568,684.890	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	533,353	1.248	665,624.540	



	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	60,197	8.535	513,781.390	
	PEARSON PLC	127,936	8.725	1,116,241.600	
	PRUDENTIAL PLC	396,972	6.265	2,487,029.580	
	RIO TINTO PLC	216,430	36.230	7,841,258.900	
	VODAFONE GROUP PLC	8,321,718	1.378	11,467,327.400	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	95,141	32.440	3,086,374.040	
	REED ELSEVIER PLC	195,942	5.040	987,547.680	
	OLD MUTUAL PLC	851,180	1.117	950,768.060	
	ROLLS ROYCE GROUP	296,149	4.986	1,476,598.910	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,663,886	0.349	929,696.210	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	144,989	11.750	1,703,620.750	
	SERCO GROUP PLC	71,999	5.200	374,394.800	
	BP PLC	2,966,318	6.355	18,850,950.890	
	SAGE GROUP PLC(THE)	195,168	2.300	448,886.400	
	INVENSYS PLC	136,685	3.211	438,895.530	
	SMITHS GROUP PLC	60,962	10.210	622,422.020	
	STANDARD CHARTERED PLC	315,892	15.900	5,022,682.800	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,062,525	0.561	3,401,076.520	
	BG GROUP PLC	527,975	12.230	6,457,134.250	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP PLC	85,912	1.922	165,122.860	
	TESCO PLC	1,245,155	4.178	5,202,257.590	
	3I GROUP PLC	144,594	2.899	419,178.000	
	TOMKINS PLC	145,057	2.104	305,199.920	
	SMITH & NEPHEW PLC	133,911	6.415	859,039.060	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	823,690	12.880	10,609,127.200	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,822	7.130	198,370.860	
	WOLSELEY PLC	47,674	14.260	679,831.240	
	ASTRAZENECA PLC	229,064	29.550	6,768,841.200	
	WHITBREAD PLC	27,936	14.030	391,942.080	
	CARNIVAL PLC	24,039	22.190	533,425.410	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	247,411	3.750	927,791.250	
	BURBERRY GROUP PLC	62,499	6.005	375,306.490	
	INVESTEC PLC	64,219	4.548	292,068.010	
	CAIRN ENERGY	243,410	3.703	901,347.230	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	42,614	9.265	394,818.710	
	VEDANTA RESOURCES PLC	22,500	28.340	637,650.000	
	ICAP PLC	75,629	4.509	341,011.160	
	SAINSBURY (J) PLC	188,748	3.280	619,093.440	
	G4S PLC	185,918	2.665	495,471.470	
	ADMIRAL GROUP PLC	28,516	11.340	323,371.440	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	559,006	19.270	10,772,045.620	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	429,092	18.530	7,951,074.760	
	INMARSAT PLC	67,257	6.840	460,037.880	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	14.920	509,279.280	
	DRAX GROUP PLC	53,749	4.382	235,528.110	
	STANDARD LIFE PLC	351,379	2.111	741,761.060	
	HOME RETAIL GROUP	142,584	2.836	404,368.220	
	EXPERIAN PLC	163,004	6.005	978,839.020	
	THOMAS COOK GROUP PLC	129,781	2.468	320,299.500	
	TUI TRAVEL PLC	96,617	2.710	261,832.070	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	44,279	10.100	447,217.900	
	FRESNILLO PLC NPR	32,309	8.520	275,272.680	
	RESOLUTION LTD	382,893	0.887	339,626.090	
	SHIRE PLC	92,078	12.440	1,145,450.320	
	WPP PLC	190,619	6.160	1,174,213.040	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	13,898	52.750	733,119.500	
	PETROFAC LTD	34,869	9.950	346,946.550	
英ポンド小計	銘柄数 : 99	45,718,434		218,493,128.110	
	組入時価比率 : 10.77%			(32,465,893,906)	
	合計時価比率 : 11.01%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	24,850	61.520	1,528,772.000	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	19,964	20.330	405,868.120	
	BARRICK GOLD CORP	152,141	43.000	6,542,063.000	
	TMX GROUP INC	12,123	31.590	382,965.570	
	TALISMAN ENERGY INC	167,826	19.850	3,331,346.100	
	BANK OF MONTREAL	86,316	53.480	4,616,179.680	
	BANK OF NOVA SCOTIA	158,318	47.000	7,440,946.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	26,121	58.990	1,540,877.790	
	BCE INC	42,327	27.730	1,173,727.710	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	78,039	23.000	1,794,897.000	
	BIOVAIL CORP	28,909	15.840	457,918.560	
	BOMBARDIER INC 'B'	227,443	5.240	1,191,801.320	
	SAPUTO INC	24,714	29.900	738,948.600	
	RESEARCH IN MOTION LTD	80,831	66.670	5,389,002.770	
	CGI GROUP INC	40,664	14.650	595,727.600	
	CAE INC	50,233	9.000	452,097.000	
	CAMECO CORP	63,410	32.950	2,089,359.500	
	ROGERS COMM-CL B	74,123	31.960	2,368,971.080	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	61,228	66.570	4,075,947.960	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,325	74.480	6,652,926.000	
	NEXEN INC	80,732	24.960	2,015,070.720	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	13,933	56.980	793,902.340	

	CANADIAN UTILITIES LTD	14,386	42.580	612,555.880	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	75,134	58.380	4,386,322.920	
	GERDAU AMERISTEEL CORP	34,333	9.440	324,103.520	
	AGRIUM INC	25,945	71.540	1,856,105.300	
	YAMANA GOLD INC	115,341	13.130	1,514,427.330	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,071	24.410	538,753.110	
	OPEN TEXT CORP	11,415	41.920	478,516.800	
	ELDORADO GOLD CORP	81,367	15.530	1,263,629.510	
	EMPIRE CO LTD	5,722	47.700	272,939.400	
	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	20,103	16.090	323,457.270	
	KINROSS GOLD CORP	111,239	21.290	2,368,278.310	
	FINNING INTERNATIONAL INC	25,736	17.300	445,232.800	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	16,791	23.480	394,252.680	
	FORTIS INC	31,331	28.440	891,053.640	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,428	94.750	1,177,553.000	
	TELUS CORP-NON VOTE	32,914	32.930	1,083,858.020	
	GREAT WEST LIFECO INC	47,008	26.910	1,264,985.280	
	IAMGOLD CORP	55,305	17.620	974,474.100	
	IMPERIAL OIL LTD	49,642	40.920	2,031,350.640	
	ENBRIDGE INC	56,408	47.000	2,651,176.000	
	IGM FINANCIAL INC	19,491	42.110	820,766.010	
	IVANHOE MINES LTD/CA	43,340	17.840	773,185.600	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	279,322	20.680	5,776,378.960	
	LOBLAW CO LTD	18,293	33.920	620,498.560	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,259	33.030	437,944.770	
	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	18,156	61.530	1,117,138.680	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	89,390	32.910	2,941,824.900	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,249	396.000	1,286,604.000	
	INMET MINING CORPORATION	9,308	71.050	661,333.400	
	METRO INC	19,905	39.200	780,276.000	
	HUSKY ENERGY INC	43,719	29.760	1,301,077.440	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	31,769	39.380	1,251,063.220	
	NIKO RESOURCES LTD	8,304	104.460	867,435.840	
	ONEX CORP	17,569	24.650	433,075.850	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	15,209	26.560	403,951.040	
	GOLDCORP INC	115,513	43.850	5,065,245.050	
	PETROBANK ENERGY & RESOURCES LTD	15,008	56.200	843,449.600	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	47,003	126.950	5,967,030.850	
	POWER CORP OF CANADA	55,732	28.750	1,602,295.000	
	POWER FINANCIAL CORP	43,069	30.450	1,311,451.050	

	ROYAL BANK OF CANADA	223,929	55.190	12,358,641.510	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	25,493	52.560	1,339,912.080	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	27,956	56.930	1,591,535.080	
	SHAW COMM INC-B	57,931	21.050	1,219,447.550	
	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	56,295	7.550	425,027.250	
	SINO-FOREST CORP	38,059	20.490	779,828.910	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	33,454	44.750	1,497,066.500	
	SUNCOR ENERGY INC	246,557	38.580	9,512,169.060	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	21,775	14.390	313,342.250	
	ENCANA CORP	121,681	35.520	4,322,109.120	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	77,616	42.200	3,275,395.200	
	THOMSON REUTERS CORP	60,964	34.500	2,103,258.000	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,163	64.180	8,738,941.340	
	TRANSCANADA CORP	109,916	35.150	3,863,547.400	
	TRANSALTA CORP	36,501	23.490	857,408.490	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,234	68.970	498,928.980	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	33,251	14.230	473,161.730	
	INTACT FINANCIAL CORP	21,394	37.000	791,578.000	
	SILVER WHEATON CORP	49,901	18.020	899,216.020	
	VITERRA INC NPR	51,938	10.640	552,620.320	
	GROUPE AEROPLAN INC	40,881	11.600	474,219.600	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,995	30.550	610,847.250	
	CI FINANCIAL CORP	26,566	21.050	559,214.300	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	14,658	33.380	489,284.040	
	TIM HORTONS INC	30,037	31.590	948,868.830	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	121,681	26.920	3,275,652.520	
カナダドル小計	銘柄数 : 88	5,046,623		176,465,589.080	
	組入時価比率 : 5.23%			(15,753,083,137)	
	合計時価比率 : 5.34%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	33,938	13.550	459,859.900	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	177,009	54.900	9,717,794.100	
	SYNGENTA AG	14,694	285.800	4,199,545.200	
	LOGITECH INTL-REG	27,879	18.850	525,519.150	
	SYNTHES INC	9,425	136.700	1,288,397.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	549,350	48.830	26,824,760.500	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	81,900	36.790	3,013,101.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	111,504	178.700	19,925,764.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10,296	82.500	849,420.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	916	1,405.000	1,286,980.000	
	SWISS RE-REG	55,749	52.050	2,901,735.450	

	NOVARTIS AG-REG SHS	332,486	54.000	17,954,244.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	7,799	93.950	732,716.050	
	SWISSCOM AG-REG	3,688	392.200	1,446,433.600	
	ABB LTD	353,177	20.880	7,374,335.760	
	ADECCO SA-REG	18,811	61.600	1,158,757.600	
	GEBERIT AG	6,735	185.800	1,251,363.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,731	80.000	618,480.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	2,260.000	309,620.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	19	25,850.000	491,150.000	
	UBS AG-REGISTERED	559,081	17.040	9,526,740.240	
	GIVAUDAN-REG	1,153	879.000	1,013,487.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	23,517	230.200	5,413,613.400	
	HOLCIM LTD-REG	38,146	82.150	3,133,693.900	
	ACTELION	15,527	56.750	881,157.250	
	SONOVA HOLDING AG	7,380	127.500	940,950.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,164	103.800	847,423.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,476	292.000	430,992.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,702	280.200	1,317,500.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	8,840	53.100	469,404.000	
	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	21,408	33.000	706,464.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,952	152.700	756,170.400	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	4,757	93.550	445,017.350	
	ARYZTA AG	13,689	38.850	531,817.650	
	JULIUS BAER GROUP LTD	33,938	36.600	1,242,130.800	
スイスフラン小計	銘柄数 : 35	2,549,973		129,986,539.200	
	組入時価比率 : 3.91%			(11,791,078,971)	
	合計時価比率 : 4.00%				
スウェーデンクローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	11,514	576.000	6,632,064.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	103,093	107.800	11,113,425.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	65,207	96.100	6,266,392.700	
	ERICSSON LM-B SHS	468,771	68.900	32,298,321.900	
	GETINGE AB-B SHS	31,028	138.500	4,297,378.000	
	SKF AB-B SHS	60,871	125.700	7,651,484.700	
	SANDVIK AB	164,125	89.750	14,730,218.750	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	236,371	48.310	11,419,083.010	
	SKANSKA AB-B SHS	63,818	124.100	7,919,813.800	
	SWEDBANK AB	99,558	72.000	7,168,176.000	
	SSAB AB-B	17,621	119.600	2,107,471.600	
	SSAB AB-A	22,177	131.300	2,911,840.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	89,328	101.300	9,048,926.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,734	202.800	15,358,855.200	
	VOLVO AB-A SHS	87,842	66.200	5,815,140.400	

	VOLVO AB-B SHS	153,836	66.900	10,291,628.400	
	HOLMEN AB-B SHS	6,883	190.500	1,311,211.500	
	SCANIA AB	54,641	97.900	5,349,353.900	
	SWEDISH MATCH AB	42,045	151.200	6,357,204.000	
	TELE2 AB-B SHS	46,212	112.500	5,198,850.000	
	NORDEA AB	510,466	73.850	37,697,914.100	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	180.000	6,945,120.000	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	72.500	3,846,487.500	
	INVESTOR AB-B SHS	73,072	135.800	9,923,177.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	80,471	404.100	32,518,331.100	
	ASSA ABLOY AB-B	51,680	142.900	7,385,072.000	
	TELIASONERA AB	356,384	51.250	18,264,680.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	49,159	60.050	2,951,997.950	
	ALFA LAVAL AB	58,635	105.000	6,156,675.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,130	54.000	3,949,020.000	
スウェーデンクローネ 小計	銘柄数 : 30	3,245,311		302,885,315.010	
	組入時価比率 : 1.32%			(3,967,797,627)	
	合計時価比率 : 1.35%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	53,424	10.160	542,787.840	
	OMV AG	25,270	32.630	824,560.100	
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	12,240	31.740	388,497.600	
	VOEST-ALPINE AG	19,157	27.600	528,733.200	
	ERSTE GROUP BANK AG	28,148	28.900	813,477.200	
	IMMOEAST AG	63,435	4.100	260,083.500	
	RAIFFEISEN INT'L BANK	9,099	42.580	387,435.420	
	VIENNA INSURANCE GROUP	5,279	36.500	192,683.500	
	UMICORE	19,625	25.890	508,091.250	
	DELHAIZE GROUP	15,410	54.760	843,851.600	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	25,035	35.530	889,493.550	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	114,219	35.300	4,031,930.700	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VPR	39,408	0.005	197.040	

[前へ](#) [次へ](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	SOLVAY SA	9,576	73.030	699,335.280	
	MOBISTAR SA	4,634	45.505	210,870.170	
	FORTIS	354,785	2.831	1,004,396.330	
	UCB SA	15,173	30.395	461,183.330	
	COLRUYT NV	2,444	169.450	414,135.800	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,906	67.900	876,317.400	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.010	5.160	
	DEXIA	78,609	4.982	391,630.030	
	BELGACOM SA	25,126	26.000	653,276.000	
	NATIONALE A PORTEFEUILLE	6,077	37.800	229,710.600	
	BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD NPR	93,131	5.320	495,456.920	
	ADIDAS AG	31,057	39.850	1,237,621.450	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	56,983	32.170	1,833,143.110	
	COMMERZBANK AG	113,034	6.890	778,804.260	
	FRESENIUS AG	4,536	42.050	190,738.800	
	UNITED INTERNET	16,729	9.905	165,700.740	
	MAN SE	16,568	54.920	909,914.560	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	10,621	32.900	349,430.900	
	GEA GROUP AG	23,382	16.250	379,957.500	
	FRESENIUS SE	12,538	48.830	612,230.540	
	DEUTSCHE POST AG-REG	132,414	14.380	1,904,113.320	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,421	48.350	697,255.350	
	MERCK KGAA	10,090	65.610	662,004.900	
	RWE AG	66,401	68.800	4,568,388.800	
	RWE AG-N VTG PFD	6,189	62.000	383,718.000	
	SAP AG	134,998	34.675	4,681,055.650	
	E.ON AG	301,581	29.360	8,854,418.160	
	HENKEL AG & CO KGAA	21,087	30.605	645,367.630	
	METRO AG	18,358	41.260	757,451.080	
	SIEMENS AG-REG	129,766	67.120	8,709,893.920	
	PUMA AG	738	230.000	169,740.000	
	BAYER AG	130,822	53.810	7,039,531.820	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,890	35.575	992,186.750	
	DAIMLER AG	141,206	37.200	5,252,863.200	
	BASF SE	144,874	43.530	6,306,365.220	
	CELESIO AG	13,447	18.150	244,063.050	
	BEIERSDORF AG	14,698	45.210	664,496.580	
	HOCHTIEF AG	7,332	57.920	424,669.440	

	HEIDELBERGCEMENT AG	21,734	51.500	1,119,301.000	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	30,210	36.655	1,107,347.550	
	ALLIANZ SE	71,354	87.000	6,207,798.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	12.810	475,225.380	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	31,158	108.250	3,372,853.500	
	SALZGITTER	6,089	72.860	443,644.540	
	VOLKSWAGEN AG	6,940	76.110	528,203.400	
	VOLKSWAGEN AG PFD	16,273	66.950	1,089,477.350	
	THYSSENKRUPP AG	54,246	27.400	1,486,340.400	
	TUI AG	18,532	7.080	131,206.560	
	LINDE AG	24,453	83.580	2,043,781.740	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	92,989	52.560	4,887,501.840	
	K & S	27,554	45.680	1,258,666.720	
	SUEDZUCKER AG	13,153	15.125	198,939.120	
	SOLARWORLD AG	14,050	16.360	229,858.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	446,408	10.180	4,544,433.440	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	160,709	4.060	652,478.540	
	DEUTSCHE BOERSE AG	30,390	56.260	1,709,741.400	
	FRAPORT AG	5,722	37.460	214,346.120	
	DEUTSCHE POSTBANK AG	14,493	24.565	356,020.540	
	WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	120.050	293,282.150	
	IBERIA	61,564	2.022	124,482.400	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	45,228	15.675	708,948.900	
	IBERDROLA SA	578,568	6.680	3,864,834.240	
	INDRA SISTEMAS SA	18,259	16.790	306,568.610	
	GAMESA	26,875	12.645	339,834.370	
	REPSOL YPF SA	115,778	18.850	2,182,415.300	
	TELEFONICA S.A	669,960	18.500	12,394,260.000	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,259	37.280	867,095.520	
	BANKINTER S.A.	41,581	7.290	303,125.490	
	ACERINOX SA	23,563	14.935	351,913.400	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	558,967	13.060	7,300,109.020	
	SACYR VALLEHERMOSO	15,197	8.709	132,350.670	
	ACCIONA S.A.	3,675	95.630	351,440.250	
	GAS NATURAL SDG SA	37,078	14.950	554,316.100	
	BANCO DEVALENCIA	42,034	5.510	231,607.340	
	BANCO SANTANDER SA	1,288,184	11.980	15,432,444.320	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	16,835	38.050	640,571.750	
	ZARDOYA OTIS	21,819	13.560	295,865.640	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,160	31.975	164,991.000	
	BANCO POPULAR ESPANOL	132,319	5.792	766,391.640	



	BANCO SABADELL	141,789	4.149	588,282.560	
	INDITEX	34,075	43.945	1,497,425.870	
	MAPFRE SA	108,217	3.054	330,494.710	
	ENAGAS	28,703	15.700	450,637.100	
	GESTEVISION TELECINCO SA	14,976	10.295	154,177.920	
	GRIFOLS SA	22,114	12.120	268,021.680	
	FERROVIAL SA	76,251	8.750	667,196.250	
	CRITERIA CAIXACORP SA	149,185	3.416	509,615.960	
	IBERDROLA RENOVABLES	129,546	3.426	443,824.590	
	EDP RENOVAVEIS SA	38,800	6.966	270,280.800	
	KESKO OYJ-B	8,936	23.210	207,404.560	
	WARTSILA OYJ	14,464	30.140	435,944.960	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	19,134	17.610	336,949.740	
	OUTOKUMPU OYJ	16,671	14.310	238,562.010	
	RAUTARUUKKI OYJ	14,482	17.000	246,194.000	
	UPM-KYMMENE OYJ	75,587	8.670	655,339.290	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	98,362	5.210	512,466.020	
	SAMPO OYJ-A SHS	66,956	17.550	1,175,077.800	
	FORTUM OYJ	70,769	18.860	1,334,703.340	
	NOKIA OYJ	594,183	9.110	5,413,007.130	
	POHJOLA BANK PLC	23,199	7.690	178,400.310	
	ELISA CORP	18,391	15.460	284,324.860	
	METSO OYJ	21,922	26.180	573,917.960	
	SANOMA OYJ	12,269	16.290	199,862.010	
	NESTE OIL OYJ	24,686	13.190	325,608.340	
	KONE OYJ	24,473	29.630	725,134.990	
	ORION OYJ	13,200	15.850	209,220.000	
	AIR LIQUIDE	39,836	81.950	3,264,560.200	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,904	14.480	968,769.920	
	ERAMET	710	247.700	175,867.000	
	AXA	265,983	17.025	4,528,360.570	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	64,229	25.305	1,625,314.840	
	DANONE	86,338	42.580	3,676,272.040	
	SAFRAN SA	30,548	14.915	455,623.420	
	ACCOR SA	22,687	37.585	852,690.890	
	BOUYGUES	35,423	37.540	1,329,779.420	
	BNP PARIBAS	149,750	58.760	8,799,310.000	
	THALES SA	14,934	33.560	501,185.040	
	CAP GEMINI SA	22,923	34.150	782,820.450	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	9,379	60.810	570,336.990	
	CHRISTIAN DIOR	10,461	76.260	797,755.860	
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	24,734	18.355	453,992.570	
	ALCATEL-LUCENT	364,152	2.607	949,344.260	

	NATIXIS	145,960	3.962	578,293.520	
	EIFFAGE	6,803	41.855	284,739.560	
	PUBLICIS GROUPE	19,130	29.445	563,282.850	
	IMERYS SA	5,944	42.190	250,777.360	
	LAFARGE SA	31,193	61.010	1,903,084.930	
	L'OREAL	37,695	78.000	2,940,210.000	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	38,719	81.700	3,163,342.300	
	LAGARDERE S.C.A.	17,407	28.145	489,920.010	
	MICHELIN(CGDE)-B	22,455	58.500	1,313,617.500	
	PERNOD-RICARD	31,276	58.500	1,829,646.000	
	PEUGEOT SA	25,815	26.645	687,840.670	
	RENAULT SA	29,814	39.210	1,169,006.940	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,545	38.540	2,371,944.300	
	SOCIETE GENERALE-A	99,277	52.200	5,182,259.400	
	VINCI S.A.	67,458	41.200	2,779,269.600	
	SODEXO	15,581	40.885	637,029.180	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	36,476	80.700	2,943,613.200	
	VIVENDI SA	193,264	20.900	4,039,217.600	
	TECHNIP-COFLEXIPS.A.	17,197	52.750	907,141.750	
	TELEVISION FRANCAISE(T. F.1)	21,519	13.995	301,158.400	
	TOTAL SA	334,572	46.260	15,477,300.720	
	AIR FRANCE	24,369	12.350	300,957.150	
	VALLOUREC	8,387	134.550	1,128,470.850	
	FRANCE TELECOM SA	295,175	17.295	5,105,051.620	
	HERMES INTL	7,719	95.910	740,329.290	
	BIC	4,918	50.000	245,900.000	
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	41.445	408,730.590	
	PPR	12,233	88.540	1,083,109.820	
	CNP ASSURANCES	5,609	68.490	384,160.410	
	NEOPOST SA	4,710	57.890	272,661.900	
	CARREFOUR SA	99,921	33.980	3,395,315.580	
	ATOS ORIGIN	6,851	34.465	236,119.710	
	SANOFI-AVENTIS	166,804	56.080	9,354,368.320	
	STMICROELECTRONICS NV	109,561	6.349	695,602.780	
	M6-METROPOLE TELEVISION	9,651	19.445	187,663.690	
	EURAZEO	3,663	50.700	185,714.100	
	JC DECAUX INTERNATIONAL	9,237	18.650	172,270.050	
	ESSILOR INTL	31,757	41.290	1,311,246.530	
	CREDIT AGRICOLE SA	147,584	13.385	1,975,411.840	
	ILIAD SA	2,768	86.390	239,127.520	
	BIOMERIEUX	2,078	80.410	167,091.980	
	PAGESJAUNES GROUPE SA	24,382	7.506	183,011.290	
	GDF SUEZ	196,849	30.375	5,979,288.370	

	ALSTOM	31,712	53.690	1,702,617.280	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	22.965	400,739.250	
	ELECTRICITE DE FRANCE	38,661	42.060	1,626,081.660	
	IPSEN SA	4,885	40.710	198,868.350	
	LEGRAND SA	18,550	20.570	381,573.500	
	ADP	5,321	58.070	308,990.470	
	SCOR SE	26,944	17.310	466,400.640	
	BUREAU VERITAS SA	6,777	36.625	248,207.620	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,144	17.000	733,448.000	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	BANK OF PIRAEUS	45,431	8.500	386,163.500	
	ALPHA BANK A.E.	70,735	8.700	615,394.500	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	27,062	16.200	438,404.400	
	NATIONAL BANK OF GREECE	97,164	19.820	1,925,790.480	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	8,042	21.660	174,189.720	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	43,132	10.640	458,924.480	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	54,995	8.710	479,006.450	
	GREEK ORGANIZATION OF FOOTBALL	37,174	15.300	568,762.200	
	PUBLIC POWER CORP	21,485	13.500	290,047.500	
	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	94,560	2.070	195,739.200	
	CRH PLC	112,731	18.450	2,079,886.950	
	KERRY GROUP PLC-A	21,477	21.500	461,755.500	
	ELAN CORPORATION PLC	72,415	5.070	367,144.050	
	ANGLO IRISH BANK CORP	91,316	0.130	11,871.080	
	ASSICURAZIONI GENERALI	185,911	18.810	3,496,985.910	
	BANCA POPOLARE DI MILANO	60,971	5.185	316,134.630	
	INTESA SANPAOLO	1,216,191	3.165	3,849,244.510	
	INTESA SANPAOLO-RNC	137,310	2.440	335,036.400	
	UNICREDIT SPA	2,245,759	2.310	5,187,703.290	
	ENI SPA	413,573	18.560	7,675,914.880	
	MEDIOBANCA SPA	72,798	8.755	637,346.490	
	PIRELLI & C	324,749	0.453	147,111.290	
	SAIPEM	40,564	24.790	1,005,581.560	
	LUXOTTICA GROUP SPA	20,352	18.840	383,431.680	
	MEDIASET SPA	110,462	5.690	628,528.780	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	83,831	0.960	80,477.760	
	AUTOGRILL SPA	17,657	9.150	161,561.550	
	A2A SPA	157,187	1.428	224,463.030	
	MEDIOLANUM SPA	32,441	4.525	146,795.520	
	FIAT SPA	122,538	10.850	1,329,537.300	
	ENEL SPA	1,051,354	4.187	4,402,019.190	
	FINMECCANICA SPA	61,548	11.320	696,723.360	

	ITALCEMENTI SPA	14,012	10.250	143,623.000	
	FONDIARIA - SAI ORD	7,966	11.210	89,298.860	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	336,391	1.301	437,644.690	
	SNAM RETE GAS	208,013	3.422	711,820.480	
	BANCA CARIGE SPA	120,506	1.880	226,551.280	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	87,976	10.390	914,070.640	
	TELECOM ITALIA SPA	1,527,320	1.050	1,603,686.000	
	TELECOM ITALIA-RNC	1,024,637	0.762	780,773.390	
	ATLANTIA SPA	42,404	18.710	793,378.840	
	TERNA SPA	201,779	2.930	591,212.470	
	EXOR SPA	8,976	13.770	123,599.520	
	PARMALAT SPA	273,300	1.890	516,537.000	
	PRYSMIAN SPA	18,375	13.490	247,878.750	
	BANCO POPOLARE SPA	102,590	5.525	566,809.750	
	UNICREDIT SPA RTS	2,245,759	0.107	240,296.210	
	ARCELOR MITTAL (NL)	132,118	33.140	4,378,390.520	
	TENARIS SA	72,436	15.750	1,140,867.000	
	SES FDR	46,821	15.620	731,344.020	
	<i>BOSKALIS WESTMINSTER CT</i>	7,724	28.600	220,906.400	
	REED ELSEVIER NV	119,718	8.350	999,645.300	
	KONINKLIJKE DSM NV	25,452	34.640	881,657.280	
	SBM OFFSHORE NV	23,948	15.005	359,339.740	
	ING GROEP NV-CVA	576,265	7.577	4,366,359.900	
	RANDSTAD HOLDINGS	16,507	37.965	626,688.250	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	186,531	9.303	1,735,297.890	
	HEINEKEN NV	39,572	34.000	1,345,448.000	
	AKZO NOBEL	36,671	44.360	1,626,725.560	
	ASML HOLDING NV	68,825	22.430	1,543,744.750	
	AEGON NV	249,086	4.951	1,233,224.780	
	TNT NV	59,369	22.045	1,308,789.600	
	UNILEVER NV-CVA	257,424	21.995	5,662,040.880	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	153,695	21.230	3,262,944.850	
	WOLTERS KLUWER-CVA	45,768	15.370	703,454.160	
	QIAGEN N.V.	38,295	15.570	596,253.150	
	VOPAK (KON.)	4,437	56.760	251,844.120	
	KONINKLIJKE KPN NV	266,455	11.965	3,188,134.070	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	29.800	559,346.000	
	FUGRO CERT	11,731	44.830	525,900.730	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	83,470	4.910	409,837.700	
	CIMPOR-CIMENTOS	36,205	6.450	233,522.250	
	JERONIMO MARTINS	29,781	7.225	215,167.720	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	88,600	8.473	750,707.800	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	288,478	3.150	908,705.700	

	BRISA	33,394	7.560	252,458.640	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	395,217	0.924	365,180.500	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,532	12.750	274,533.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 266	30,003,882		380,125,883.270	
	組入時価比率 : 16.87%			(50,845,638,146)	
	合計時価比率 : 17.25%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	16,492	404.000	6,662,768.000	
	A P MOLLER A/S	182	41,590.000	7,569,380.000	
	AP MOLLER MAERSK A	108	40,020.000	4,322,160.000	
	DANSKE BANK A/S	72,235	135.700	9,802,289.500	
	NOVOZYMES-B SHS	7,782	557.500	4,338,465.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	67,959	347.100	23,588,568.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	32,544	327.600	10,661,414.400	
	TOPDANMARK A/S	2,455	695.500	1,707,452.500	
	COLOPLAST-B	3,130	485.000	1,518,050.000	
	DSV A/S	32,958	103.500	3,411,153.000	
	WILLIAM DEMANT	3,754	391.200	1,468,564.800	
	H LUNDBECK A/S	11,034	104.000	1,147,536.000	
	TRYGVESTA AS	4,588	338.700	1,553,955.600	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 13	255,221		77,751,757.700	
	組入時価比率 : 0.46%			(1,397,976,603)	
	合計時価比率 : 0.47%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	42,017	144.300	6,063,053.100	
	DNB HOLDING ASA	145,088	67.850	9,844,220.800	
	NORSK HYDRO ASA	103,727	50.300	5,217,468.100	
	TELENOR ASA	129,319	81.100	10,487,770.900	
	ORKLA ASA	116,006	57.600	6,681,945.600	
	STATOIL ASA	179,562	149.200	26,790,650.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	31,516	276.200	8,704,719.200	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	55,856	40.850	2,281,717.600	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 8	803,091		76,071,545.700	
	組入時価比率 : 0.41%			(1,250,616,211)	
	合計時価比率 : 0.42%				
香港ドル	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	99,000	13.420	1,328,580.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	121,000	25.100	3,037,100.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	46,000	46.800	2,152,800.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	591,000	4.640	2,742,240.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	303,000	9.820	2,975,460.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	340,000	30.750	10,455,000.000	

	BANK OF EAST ASIA	239,860	30.450	7,303,737.000	
	CLP HOLDINGS LTD	323,000	53.050	17,135,150.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	113,500	25.700	2,916,950.000	
	PCCW LTD	893,000	2.030	1,812,790.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	133,000	13.780	1,832,740.000	
	LI & FUNG LTD	358,200	34.650	12,411,630.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	217,000	101.800	22,090,600.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	75,000	28.450	2,133,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	159,100	151.200	24,055,920.000	
	MTR CORP	246,000	26.800	6,592,800.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	188,237	57.250	10,776,568.250	
	HANG LUNG GROUP LTD	137,000	39.600	5,425,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	122,900	114.500	14,072,050.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	166,000	59.950	9,951,700.000	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	210,000	43.100	9,051,000.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	206,750	45.400	9,386,450.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	650,943	19.760	12,862,633.680	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	340,000	56.800	19,312,000.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	22.450	1,975,600.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	40.800	4,324,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	603,000	17.140	10,335,420.000	
	NWS HOLDINGS LTD	112,000	14.120	1,581,440.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	369,800	15.320	5,665,336.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.760	3,394,800.000	
	SINO LANDCO	244,000	15.240	3,718,560.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	223,000	117.700	26,247,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	125,500	99.200	12,449,600.000	
	TELEVISION BROADCASTS LTD	40,000	38.550	1,542,000.000	
	WING HANG BANK LTD	26,500	74.000	1,961,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	154,000	24.400	3,757,600.000	
	ASM PACIFIC TECH	26,400	76.700	2,024,880.000	
	SANDS CHINA LTD	320,000	11.060	3,539,200.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 38	8,947,690		294,332,184.930	
	組入時価比率 : 1.16%			(3,502,553,001)	
	合計時価比率 : 1.19%				
シンガポール・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	716,400	1.230	881,172.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,214,640	0.645	783,442.800	
	SINGAPORE TECH ENG	231,000	3.250	750,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,000	3.730	522,200.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.690	963,090.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	270,000	15.340	4,141,800.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	74,000	11.780	871,720.000	
	SEMBCORP MARINE	123,000	3.810	468,630.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	244,000	1.370	334,280.000	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23,000	26.500	609,500.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	128,000	8.480	1,085,440.000	
	CAPITALAND LTD	416,000	4.300	1,788,800.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	169,500	4.490	761,055.000	
	KEPPEL CORP LTD	193,000	8.710	1,681,030.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	287,000	1.620	464,940.000	
	NEPTUNE ORIENT	127,750	1.900	242,725.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	209,200	3.390	709,188.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	397,200	8.800	3,495,360.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,278,867	3.020	3,862,178.340	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	92,400	14.400	1,330,560.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	194,000	19.880	3,856,720.000	
	STARHUB LTD	86,000	2.130	183,180.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	164,800	2.710	446,608.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	213,000	7.110	1,514,430.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	278,000	1.260	350,280.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	215,000	2.440	524,600.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 26	7,746,757		32,623,679.140	
	組入時価比率 : 0.72%			(2,166,538,532)	
	合計時価比率 : 0.73%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	396,476	22.390	8,877,097.640	
	AMCOR LTD	203,274	6.260	1,272,495.240	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	460,430	25.180	11,593,627.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	208,898	5.290	1,105,070.420	
	TELSTRA CORP LTD	696,226	3.350	2,332,357.100	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,360	9.860	535,989.600	
	AMP LTD	325,294	6.450	2,098,146.300	
	ASX LTD	28,239	34.870	984,693.930	
	BHP BILLITON LTD	530,676	44.470	23,599,161.720	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	9.540	202,553.280	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	72,412	3.860	279,510.320	
	COMPUTERSHARE LT	76,498	11.700	895,026.600	
	CSL LIMITED	94,642	31.930	3,021,919.060	
	TRANSURBAN GROUP	194,024	5.540	1,074,892.960	
	COCA-COLA AMATIL LTD	90,830	11.170	1,014,571.100	
	COCHLEAR LTD	8,540	66.230	565,604.200	
	ORIGIN ENERGY LTD	139,381	17.730	2,471,225.130	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	239,664	56.570	13,557,792.480	

	BORAL LIMITED	87,034	5.910	514,370.940	
	RIO TINTO LIMITED	69,393	80.000	5,551,440.000	
	CSR LIMITED	224,708	1.965	441,551.220	
	ARISTOCRAT LEISU	57,018	4.100	233,773.800	
	ARROW ENERGY LTD/AUSTRALIA NPR	116,718	4.450	519,395.100	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	314,419	4.110	1,292,262.090	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	37,106	11.450	424,863.700	
	ONESTEEL LIMITED	200,304	3.640	729,106.560	
	ENERGY RESOURCES OF AUST	9,075	23.000	208,725.000	
	NUFARM LTD	33,483	10.800	361,616.400	
	FOSTER'S GROUP LTD	294,491	5.450	1,604,975.950	
	OZ MINERALS LTD	460,007	1.260	579,608.820	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	59,593	8.550	509,520.150	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP	385,989	1.515	584,773.330	
	ORICA LTD	56,732	26.250	1,489,215.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	362,918	1.720	624,218.960	
	LEIGHTON HLDGS LTD	25,030	41.270	1,032,988.100	
	BLUESCOPE STEEL LTD	305,105	3.300	1,006,846.500	
	MAP GROUP	111,121	3.060	340,030.260	
	MACQUARIE GROUP LTD	52,461	48.900	2,565,342.900	
	WORLEYPARSONS LTD	24,901	30.040	748,026.040	
	SUNCORP-METWAY LTD	203,413	8.860	1,802,239.180	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	149,724	6.640	994,167.360	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	331,886	27.250	9,043,893.500	
	NEWCREST MINING LTD	75,483	36.820	2,779,284.060	
	PALADIN ENERGY LTD	117,788	4.410	519,445.080	
	INCITEC PIVOT LTD	263,697	3.780	996,774.660	
	TOLL HOLDINGS LTD	112,768	9.040	1,019,422.720	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	2.940	526,374.660	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	161,314	24.980	4,029,623.720	
	SANTOS LTD	136,464	14.400	1,965,081.600	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,965	25.400	583,311.000	
	SONIC HEALTHCARE	60,146	15.080	907,001.680	
	TABCORP HOLDINGS LTD	102,257	7.140	730,114.980	
	WESFARMERS LTD	161,379	31.550	5,091,507.450	
	ALUMINA LIMITED	430,569	2.060	886,972.140	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	81,986	49.280	4,040,270.080	
	WOOLWORTHS LTD	189,669	28.000	5,310,732.000	
	METCASH LTD	118,626	4.470	530,258.220	
	TATTS GROUP LTD	168,506	2.430	409,469.580	



	GOODMAN FIELDER LTD	180,002	1.590	286,203.180	
	AGL ENERGY LTD	70,357	14.100	992,033.700	
	BRAMBLES LTD	219,012	7.180	1,572,506.160	
	ASCIANO GROUP	400,609	1.900	761,157.100	
	WESFARMERS LTD-PPS	22,170	31.560	699,685.200	
	CROWN LTD	74,398	7.810	581,048.380	
オーストラリアドル小計	銘柄数：64	11,162,929		143,902,962.690	
	組入時価比率：4.09%			(12,328,166,814)	
	合計時価比率：4.18%				
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,249	2.020	339,862.980	
	FLETCHER BUILDING LTD	103,959	8.440	877,413.960	
	SKY CITY ENTERTA	53,685	3.400	182,529.000	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	290,074	2.550	739,688.700	
ニュージーランドドル小計	銘柄数：4	615,967		2,139,494.640	
	組入時価比率：0.05%			(146,084,694)	
	合計時価比率：0.05%				
合計				290,793,652,338	
				(290,793,652,338)	

(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

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	345,800.00	643,188.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	283,906.00	579,168.240	
シンガポール・ドル小計	銘柄数：2	629,706.00	1,222,356.240	
	組入時価比率：0.03%		(81,176,678)	
	合計時価比率：0.03%			
	MIRVAC GROUP	428,782.00	709,634.210	
	CFS RETAIL PROPERTY	264,580.00	506,670.700	
	GPT GROUP	1,461,184.00	891,322.240	
	LEND LEASE GROUP	73,201.00	752,506.280	
	STOCKLAND	398,740.00	1,602,934.800	
	WESTFIELD GROUP	325,839.00	4,121,863.350	
	DEXUS PROPERTY GROUP	832,859.00	716,258.740	
	GOODMAN GROUP	906,352.00	580,065.280	
オーストラリアドル小計	銘柄数：8	4,691,537.00	9,881,255.600	
	組入時価比率：0.28%		(846,527,167)	
	合計時価比率：0.29%			
投資信託受益証券計			927,703,845	
			(927,703,845)	

投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	21,973.00	1,497,899.410
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	88,695.00	1,561,918.950
	AMB PROPERTY CORP	26,008.00	667,885.440
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,758.00	1,026,763.840
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	503,906.740
	EQUITY RESIDENTIAL	45,075.00	1,498,743.750
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,826.00	592,754.160
	HCP INC	47,144.00	1,450,149.440
	HEALTH CARE REIT INC	18,110.00	799,918.700
	KIMCO REALTY	59,010.00	833,811.300
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,813.00	545,918.110
	HOST HOTELS & RESORTS INC	101,106.00	1,251,692.280
	PLUM CREEK TIMBER CO	26,545.00	1,029,680.550
	REGENCY	14,052.00	503,202.120
	PROLOGIS	74,000.00	1,042,660.000
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,319.00	3,399,267.300
	PUBLIC STORAGE	20,726.00	1,642,950.020
	VENTAS INC	24,483.00	1,075,783.020
	VORNADO REALTY TRUST	26,039.00	1,815,439.080
米ドル小計	銘柄数 : 19	713,799.00	22,740,344.210
	組入時価比率 : 0.70%		(2,098,933,771)
	合計時価比率 : 0.71%		
	BRITISH LAND CO PLC	136,395.00	645,693.930
	HAMMERSON PLC	99,626.00	398,504.000
	LAND SECURITIES GROUP PLC	119,364.00	815,256.120
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	73,060.00	360,258.860
	SEGRO PLC	122,102.00	428,211.710
英ポンド小計	銘柄数 : 5	550,547.00	2,647,924.620
	組入時価比率 : 0.13%		(393,455,119)
	合計時価比率 : 0.13%		
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	46,036.00	593,864.400
カナダドル小計	銘柄数 : 1	46,036.00	593,864.400
	組入時価比率 : 0.02%		(53,014,275)
	合計時価比率 : 0.02%		
	GECINA SA	3,258.00	238,681.080
	ICADE EMGP	3,628.00	270,286.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	13,688.00	2,125,062.000
	KLEPIERRE	13,151.00	374,540.480
	FONCIERE DES REGIONS	3,284.00	236,349.480
	CORIO NV	9,364.00	423,627.360
ユーロ小計	銘柄数 : 6	46,373.00	3,668,546.400
	組入時価比率 : 0.16%		(490,704,766)
	合計時価比率 : 0.17%		
	LINK REIT/THE	371,500.00	7,162,520.000

香港ドル小計	銘柄数： 1	371,500.00	7,162,520.000	
	組入時価比率： 0.03%		(85,233,988)	
	合計時価比率： 0.03%			
投資証券計			3,121,341,919	
			(3,121,341,919)	
合計			4,049,045,764	
			(4,049,045,764)	

(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 581銘柄	51.48%	52.63%
米ドル	投資証券 19銘柄	0.70%	0.71%
英ポンド	株式 99銘柄	10.77%	11.01%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.13%	0.13%
カナダドル	株式 88銘柄	5.23%	5.34%
カナダドル	投資証券 1銘柄	0.02%	0.02%
スイスフラン	株式 35銘柄	3.91%	4.00%
スウェーデンクローネ	株式 30銘柄	1.32%	1.35%
ユーロ	株式 266銘柄	16.87%	17.25%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.16%	0.17%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	0.46%	0.47%
ノルウェークローネ	株式 8銘柄	0.41%	0.42%
香港ドル	株式 38銘柄	1.16%	1.19%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.03%	0.03%
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	0.72%	0.73%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.03%	0.03%
オーストラリアドル	株式 64銘柄	4.09%	4.18%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 8銘柄	0.28%	0.29%
ニュージーランドドル	株式 4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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,386,084,185	2,238,319,284
国債証券		186,077,472,400	324,705,205,200
地方債証券		14,950,467,933	27,958,147,835
特殊債券		24,934,298,135	41,014,304,995
社債券		19,447,349,960	34,659,908,870
未収利息		722,947,146	1,195,791,165
前払費用		45,629,609	127,553,687
流動資産合計		248,564,249,368	431,899,231,036
資産合計		248,564,249,368	431,899,231,036
負債の部			
流動負債			
未払解約金		18,789,000	85,005,000
流動負債合計		18,789,000	85,005,000
負債合計		18,789,000	85,005,000
純資産の部			
元本等			
元本		230,660,804,354	395,927,275,552
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		17,884,656,014	35,886,950,484
元本等合計		248,545,460,368	431,814,226,036
純資産合計		248,545,460,368	431,814,226,036
負債純資産合計		248,564,249,368	431,899,231,036

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
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。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 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20年2月15日から平成21年2月16日までとなっております。	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21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	206,022,402,240円	230,660,804,354円
同期中追加設定元本額	111,781,251,678円	215,610,719,211円
同期中解約元本額	87,142,849,564円	50,344,248,013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	円	1,824,116,896円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	5,068,576,676円	6,232,955,987円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,024,563,623円	2,318,497,606円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,103,818,097円	3,790,241,056円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,236,935,719円	1,567,218,354円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,100,494,716円	1,156,985,205円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,047,832,558円	1,150,240,290円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	148,900,624円	143,168,911円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	249,245,034円	232,580,739円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,597,678,607円	1,773,116,897円
みずほエマージングボンドオープン	29,420,418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	28,698,739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)	19,419,364,576円	12,116,969,942円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	円	965,093,932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)	15,485,332,238円	15,332,889,720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)	779,457,379円	828,418,092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)	531,075,698円	554,359,759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)	1,209,716,448円	1,325,437,707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)	617,743,134円	621,575,580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)	430,663,603円	436,227,505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)	32,482,916,746円	33,933,459,295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)	10,436,372,017円	11,117,500,057円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	15,787,099,724円	15,912,085,048円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,795,328,102円	6,114,571,382円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,977,725,861円	9,515,878,790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)	1,935,655,430円	2,060,661,767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)	7,060,375,945円	7,318,982,638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)	6,952,018,354円	9,139,064,178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)	13,936,342,628円	15,631,368,941円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	317,688,496円	783,958,661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)	1,067,802,637円	1,126,530,795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 )	14,388,106,796円	15,678,200,004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 )	7,832,993,787円	7,986,849,859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 )	1,618,991,252円	1,611,800,193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 )	45,767,617,391円	119,163,807,979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 )	2,175,192,373円	3,154,090,366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 )	円	11,074,816,824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 )	円	36,398,250,474円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	2,431,050,511円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	248,342円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	153,067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 )	円	32,877,012,542円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	円	79,834,602円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	円	121,329,487円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	285,129,457円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	325,837円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	円	233,397円
( 合 計 )	230,660,804,354円	395,927,275,552円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数		
	230,660,804,354口	395,927,275,552口

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
--	----------------------------	----------------------------



種類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	186,077,472,400	3,671,046,400	324,705,205,200	115,989,800
地方債証券	14,950,467,933	244,646,498	27,958,147,835	293,301,622
特殊債券	24,934,298,135	299,645,272	41,014,304,995	342,547,955
社債券	19,447,349,960	22,820,970	34,659,908,870	508,510,440
合計	245,409,588,428	4,238,159,140	428,337,566,900	1,028,370,217

(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計算期間  
末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.0775円	1.0906円
(1万口当たり純資産額)	(10,775円)	(10,906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

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	277回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,008,610,000	
	278回 利付国庫債券(2年)	2,300,000,000	2,306,923,000	
	279回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,009,690,000	
	280回 利付国庫債券(2年)	3,300,000,000	3,311,352,000	
	281回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,010,770,000	
	282回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,106,913,000	
	283回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,007,080,000	
	284回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,007,200,000	
	285回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,002,340,000	
	286回 利付国庫債券(2年)	3,700,000,000	3,709,805,000	
	287回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,504,140,000	
	54回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,943,914,000	
	57回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,089,350,000	
	60回 利付国庫債券(5年)	6,300,000,000	6,410,754,000	

6 1 回	利付国庫債券(5年)	6,300,000,000	6,426,567,000	
6 3 回	利付国庫債券(5年)	7,500,000,000	7,667,400,000	
6 4 回	利付国庫債券(5年)	6,200,000,000	6,396,230,000	
6 6 回	利付国庫債券(5年)	5,800,000,000	5,935,952,000	
6 8 回	利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,049,720,000	
6 9 回	利付国庫債券(5年)	3,800,000,000	3,872,352,000	
7 0 回	利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,372,412,000	
7 2 回	利付国庫債券(5年)	5,600,000,000	5,826,968,000	
7 5 回	利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,650,865,000	
7 8 回	利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,100,600,000	
8 1 回	利付国庫債券(5年)	7,500,000,000	7,616,925,000	
8 3 回	利付国庫債券(5年)	6,500,000,000	6,624,085,000	
8 5 回	利付国庫債券(5年)	7,400,000,000	7,469,338,000	
8 7 回	利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	999,510,000	
2 回	利付国庫債券(40年)	300,000,000	289,344,000	
2 2 9 回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,116,225,000	
2 3 2 回	利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,167,273,000	
2 3 5 回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,740,528,000	
2 3 7 回	利付国庫債券(10年)	1,540,000,000	1,584,382,800	
2 4 0 回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	821,456,000	
2 4 3 回	利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,432,816,000	
2 4 6 回	利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,930,647,000	
2 4 7 回	利付国庫債券(10年)	700,000,000	711,676,000	
2 5 0 回	利付国庫債券(10年)	2,060,000,000	2,073,616,600	
2 5 4 回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,426,489,000	
2 5 6 回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,598,700,000	
2 5 8 回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,554,480,000	
2 6 0 回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,939,132,000	
2 6 3 回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,837,727,000	
2 6 6 回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,483,997,000	
2 6 9 回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,075,480,000	
2 7 0 回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,111,990,000	
2 7 2 回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,751,992,000	
2 7 4 回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,141,090,000	
2 7 7 回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,315,148,000	
2 8 0 回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,532,683,000	
2 8 2 回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,487,209,000	
2 8 4 回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,433,562,000	
2 8 5 回	利付国庫債券(10年)	5,900,000,000	6,220,193,000	
2 8 6 回	利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,512,364,000	
2 8 8 回	利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	5,046,816,000	
2 8 9 回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,448,135,000	
2 9 0 回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,304,160,000	
2 9 3 回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,796,890,000	
2 9 6 回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,622,445,000	

	297回 利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	6,096,720,000	
	299回 利付国庫債券(10年)	7,300,000,000	7,332,996,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	6,400,000,000	6,521,152,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	7,600,000,000	7,655,404,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	497,810,000	
	1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	110,749,000	
	2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	104,166,000	
	3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	204,824,000	
	4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	224,664,000	
	5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	200,874,000	
	6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	207,278,000	
	7回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	305,406,000	
	8回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	463,590,000	
	11回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	361,532,000	
	12回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	292,368,000	
	13回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	286,773,000	
	14回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	513,750,000	
	15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	209,034,000	
	16回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	418,188,000	
	17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	205,118,000	
	18回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	825,256,200	
	19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	201,290,000	
	20回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	313,224,000	
	21回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	502,445,000	
	22回 利付国庫債券(30年)	470,000,000	490,163,000	
	23回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	417,264,000	
	24回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	626,046,000	
	25回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	601,998,000	
	26回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,227,240,000	
	27回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,251,168,000	
	28回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,356,030,000	
	29回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,738,386,000	
	30回 利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	1,904,978,000	
	31回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,470,945,000	
	37回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	691,092,000	
	39回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	445,672,000	
	40回 利付国庫債券(20年)	720,000,000	784,411,200	
	42回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	891,464,000	
	43回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	983,375,600	
	45回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	986,301,000	
	46回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	537,880,000	
	47回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,021,563,500	
	48回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	551,880,000	
	50回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,020,464,200	
	51回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	839,848,000	

	5 2 回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	794,332,500	
	5 4 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	854,928,000	
	5 5 回 利付国庫債券(20年)	810,000,000	846,036,900	
	5 7 回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	856,252,900	
	5 8 回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	926,505,000	
	6 0 回 利付国庫債券(20年)	990,000,000	956,993,400	
	6 1 回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	823,752,000	
	6 2 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	888,020,000	
	6 4 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,018,800,000	
	6 5 回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,321,086,000	
	6 7 回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,420,622,000	
	7 0 回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,561,258,500	
	7 2 回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,501,373,500	
	7 3 回 利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,417,702,700	
	7 5 回 利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,586,554,200	
	7 8 回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,552,774,500	
	8 1 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,722,610,000	
	8 3 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,844,010,000	
	8 5 回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,889,923,000	
	8 8 回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,988,920,000	
	9 0 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,854,288,000	
	9 2 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,027,840,000	
	9 3 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	998,080,000	
	9 4 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	809,704,000	
	9 5 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,078,880,000	
	9 7 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,045,560,000	
	9 9 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,011,780,000	
	1 0 0 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,038,360,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,201,241,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,301,541,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,396,736,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,316,960,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,731,590,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(20年)	2,800,000,000	2,784,488,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	496,510,000	
国債証券計			324,705,205,200	
地方債証券	5 8 2 回 東京都公募公債	100,000,000	102,610,000	
	5 8 3 回 東京都公募公債	200,000,000	205,400,000	
	5 8 5 回 東京都公募公債	228,000,000	234,023,760	
	5 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	205,186,000	
	5 9 5 回 東京都公募公債	300,000,000	304,122,000	
	6 0 0 回 東京都公募公債	400,000,000	406,756,000	
	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	153,230,320	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	211,128,000	

6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	169,647,675	
6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	208,208,000	
6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,881,000	
6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	207,666,000	
6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	208,930,000	
6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	207,124,000	
6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,070,216	
6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	206,438,000	
6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,295,000	
6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,651,000	
6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	512,905,380	
6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,407,896	
6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,856,000	
6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	212,292,000	
6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	212,548,000	
6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	158,200,500	
6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	105,662,000	
6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	210,044,560	
6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	306,021,000	
1 2 年度 3 回 北海道公募公債	100,000,000	101,373,000	
1 3 年度 1 回 北海道公募公債	100,000,000	101,641,000	
1 3 年度 2 回 北海道公募公債	100,000,000	101,796,000	
1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	206,844,820	
1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	100,000,000	102,611,000	
1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	202,274,805	
1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	106,713,000	
1 9 年度 4 回 北海道公募公債	200,000,000	211,188,000	
2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	201,082,000	
2 7 回 1 号 宮城県公募公債	125,820,000	128,676,114	
1 1 8 回 神奈川県公募公債	145,090,000	148,170,260	
1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,587,000	
1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	186,040,898	
1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	105,402,000	
1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,126,000	
1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,999,706	
1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,360,000	
1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,040,000	
1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	298,332,000	
2 3 回 神奈川県公募公債 5 年	100,000,000	101,713,000	
2 4 6 回 大阪府公募公債	100,000,000	101,761,000	
2 5 1 回 大阪府公募公債	110,100,000	112,147,860	
2 5 2 回 大阪府公募公債	100,000,000	101,021,000	
2 6 1 回 大阪府公募公債	129,000,000	133,583,370	
2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	205,206,000	
2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	103,477,000	

286回 大阪府公募公債	200,000,000	206,822,000	
289回 大阪府公募公債	200,000,000	210,224,000	
293回 大阪府公募公債	200,000,000	213,752,000	
301回 大阪府公募公債	100,000,000	104,783,000	
310回 大阪府公募公債	240,000,000	246,302,400	
25回 大阪府公募公債 5年	200,000,000	203,900,000	
26回 大阪府公募公債 5年	120,000,000	122,190,000	
15年度3回 京都府公募公債	219,300,000	227,876,823	
16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	104,112,000	
18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	104,782,000	
14年度5回 兵庫県公募公債	100,000,000	101,124,000	
15年度1回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,782,000	
16年度8回 兵庫県公募公債	111,500,000	117,771,875	
17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,610,000	
17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	318,934,620	
17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	109,959,150	
18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	126,358,800	
18年度2回 兵庫県公募公債 5年	200,000,000	202,932,000	
14年度3回 静岡県公募公債	147,610,000	151,512,808	
15年度1回 静岡県公募公債	268,500,000	269,233,005	
15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	120,152,743	
18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	137,421,856	
15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	314,116,704	
16年度2回 愛知県公募公債	200,000,000	209,260,000	
18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	171,445,659	
20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	102,586,000	
13年度1回 広島県公募公債	100,000,000	102,273,000	
16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	208,336,000	
14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,473,000	
15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	104,151,000	
17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,262,000	
18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	211,478,000	
21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	442,384,800	
16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	135,258,177	
17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,598,000	
17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	104,004,000	
18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	111,846,800	
15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	103,538,000	
16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	105,910,000	
16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	206,442,000	
17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	206,192,000	
19年度5回 千葉県公募公債	100,000,000	105,337,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	199,826,000	
13年度1回 新潟県公募公債	110,000,000	112,042,700	
13年度1回 長野県公募公債	121,500,000	123,814,575	

	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,642,000	
	3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,273,000	
	8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	417,012,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	218,177,400	
	11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,444,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,646,200	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,572,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	136,009,900	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,183,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,163,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,221,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,232,800	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,178,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,194,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,230,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,312,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,899,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,152,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,539,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,601,000	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	181,821,800	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,249,100	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,367,000	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	170,247,216	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,674,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,424,000	
	61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,902,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,879,000	
	75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,260,000	
	80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	706,356,000	
	14年度3回 大阪市公募公債	146,500,000	149,703,955	
	14年度6回 大阪市公募公債	116,800,000	119,507,424	
	17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	102,413,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	207,972,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	103,847,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,195,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	160,138,500	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	142,597,800	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,628,000	
	12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	206,168,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	372,348,530	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,485,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	107,716,572	
	13年度7回 神戸市公募公債	129,300,000	132,519,570	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	107,334,240	

	13年度3回 横浜市公募公債	100,000,000	101,825,000	
	14年度1回 横浜市公募公債	100,000,000	102,662,000	
	14年度3回 横浜市公募公債	153,500,000	156,376,590	
	14年度5回 横浜市公募公債	281,100,000	284,790,843	
	16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	208,804,000	
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,621,000	
	14年度5回 札幌市公募公債	106,000,000	107,373,760	
	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,993,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	104,220,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	100,994,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	103,371,000	
	14年度2回 北九州市公募公債	100,000,000	101,815,000	
	14年度1回 福岡市公募公債	200,000,000	205,176,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	105,320,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,570,000	
	14年度1回 仙台市公募公債	100,000,000	102,556,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,660,000	
地方債証券計			27,958,147,835	
特殊債券	4回 政保日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,588,000	

[前](#) [次](#)



種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	107,794,620	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	129,761,610	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,002,000	
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,256,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,929,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,191,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	212,818,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,910,000	
	12回 日本道路・機構承継債	100,000,000	102,654,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,830,000	
	313回 政保道路債	220,000,000	226,045,600	
	314回 政保道路債	200,000,000	204,074,000	
	315回 政保道路債	300,000,000	303,522,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	134,419,560	
	322回 政保道路債	106,000,000	110,344,940	
	323回 政保道路債	200,000,000	208,284,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	207,568,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	208,558,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	104,724,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	314,631,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	246,465,780	
	338回 政保道路債	264,000,000	275,916,960	
	339回 政保道路債	301,000,000	312,943,680	
	342回 政保道路債	100,000,000	101,325,000	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	426,860,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	313,977,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	411,864,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	717,087,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,014,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	219,270,260	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,300,640	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,441,000	
	10回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,482,000	
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	322,973,000	
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	130,853,540	
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,931,000	
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	397,001,250	
	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,510,000	
	29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,430,000	
	30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,069,000	
	33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	311,746,050	
	36回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	365,678,880	

	4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	351,627,920	
	4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,992,000	
	5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,848,000	
	6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	165,633,660	
	6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	412,877,620	
	7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	606,762,000	
	8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,421,000	
	1 6 回 日本道路・機構承継債	430,000,000	437,284,200	
	2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,708,000	
	4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	311,913,000	
	5 回 公営企業債券	100,000,000	101,196,000	
	8 0 5 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,860,000	
	8 0 7 回 政保公営企業債券	100,000,000	102,113,000	
	8 1 2 回 政保公営企業債券	230,000,000	236,249,100	
	8 1 5 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,573,280	
	8 1 6 回 政保公営企業債券	365,000,000	375,216,350	
	8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	109,870,810	
	8 1 9 回 政保公営企業債券	156,000,000	160,265,040	
	8 2 0 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,628,000	
	8 2 1 回 政保公営企業債券	405,000,000	414,302,850	
	8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	202,956,000	
	8 2 4 回 政保公営企業債券	300,000,000	304,500,000	
	8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	211,003,800	
	8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	410,100,000	
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	308,981,300	
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	215,596,710	
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	448,532,640	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	625,422,000	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	104,363,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,032,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,002,000	
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	272,807,640	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	310,203,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,773,200	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,891,000	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,852,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,025,200	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,579,000	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,634,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	211,826,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	106,973,140	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	107,998,620	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	300,000,000	314,823,000	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	661,005,870	
	4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,938,000	

6回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	201,540,000	
12回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	312,606,000	
14回	公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,863,000	
15回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	309,486,000	
17回	公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,410,000	
20回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,284,000	
24回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	318,810,000	
191回	政保首都高速道路債券	113,000,000	119,365,290	
142回	政保阪神高速道路債	100,000,000	103,978,000	
148回	政保阪神高速道路債	107,000,000	110,513,880	
5回	阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	104,944,000	
162回	政保中小企業債券	126,000,000	128,556,540	
171回	政保中小企業債券	161,000,000	164,271,520	
173回	政保中小企業債券	100,000,000	101,486,000	
176回	政保中小企業債券	100,000,000	104,351,000	
180回	政保中小企業債券	142,000,000	149,998,860	
185回	政保中小企業債券	200,000,000	201,932,000	
186回	政保中小企業債券	104,000,000	107,447,600	
10回	中小企業債券	100,000,000	100,897,000	
26回	中小企業債券	400,000,000	420,844,000	
15回	国際協力銀行債券	200,000,000	209,804,000	
8回	国際協力銀行債券	300,000,000	302,160,000	
12回	国際協力銀行債券	200,000,000	208,462,000	
2回	都市再生債券	100,000,000	106,512,000	
19回	都市再生機構債券	200,000,000	211,722,000	
2回	本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	104,991,000	
36回	政保関西国際空港債	100,000,000	101,549,000	
4回	政保中部国際空港債券	300,000,000	308,292,000	
6回	政保中部国際空港債券	100,000,000	103,810,000	
108回	政保預金保険機構債券	100,000,000	101,942,000	
121回	政保預金保険機構債券	200,000,000	203,060,000	
125回	政保預金保険機構債券	200,000,000	202,794,000	
140回	政保預金保険機構債券	300,000,000	304,092,000	
143回	政保預金保険機構債券	280,000,000	284,606,000	
8回	政保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,026,000	
11回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,506,000	
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	198,159,000	203,570,722	
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	135,414,000	138,036,969	
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	205,119,000	209,570,082	
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	223,920,000	229,703,853	
4回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	131,724,000	132,390,523	
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,147,000	81,406,646	
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	316,512,000	325,450,298	
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	249,696,000	254,719,883	
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	422,390,000	431,281,309	

	8回 政保国民生活債券	300,000,000	304,482,000	
	14回 政保国民生活債券	132,000,000	137,719,560	
	27回 国民生活金融公庫債券	200,000,000	204,834,000	
	8回 日本学生支援機構債	200,000,000	204,028,000	
	673号 利附商工債	100,000,000	101,868,000	
	674号 利附商工債	200,000,000	204,494,000	
	676号 利附商工債	100,000,000	101,900,000	
	678号 利附商工債	200,000,000	204,120,000	
	680号 利附商工債	110,000,000	112,585,000	
	683号 利附商工債	100,000,000	102,244,000	
	685号 利附商工債	100,000,000	102,858,000	
	691号 利附商工債	200,000,000	205,692,000	
	692号 利附商工債	200,000,000	204,582,000	
	704号 利附商工債	200,000,000	206,040,000	
	706号 利付商工債	300,000,000	309,102,000	
	671号 利附農林債	300,000,000	304,494,000	
	672号 利附農林債	300,000,000	304,986,000	
	673号 利附農林債	100,000,000	101,620,000	
	675号 利附農林債	100,000,000	101,955,000	
	677号 利附農林債	200,000,000	203,570,000	
	681号 利附農林債	300,000,000	306,285,000	
	684号 利附農林債	250,000,000	255,410,000	
	688号 利附農林債	200,000,000	204,704,000	
	694号 利附農林債	400,000,000	407,872,000	
	695号 利附農林債	200,000,000	203,982,000	
	698号 利附農林債	300,000,000	309,720,000	
	701号 利附農林債	200,000,000	206,212,000	
	709号 利附農林債	300,000,000	305,766,000	
	195回 利附しんきん中金債	200,000,000	201,662,000	
	196回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,001,000	
	200回 利附しんきん中金債	100,000,000	102,171,000	
	203回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,982,000	
	204回 利附信金中金債	100,000,000	101,968,000	
	208回 利附信金中金債	150,000,000	153,061,500	
	210回 利附信金中金債	100,000,000	102,284,000	
	215回 利附信金中金債	200,000,000	205,892,000	
	217回 利附信金中金債	200,000,000	205,280,000	
	222回 利附信金中金債	200,000,000	205,990,000	
	226回 利附信金中金債	300,000,000	308,718,000	
	229回 利附信金中金債	200,000,000	206,302,000	
	233回 利附信金中金債	300,000,000	308,943,000	
	236回 利附信金中金債	300,000,000	302,901,000	
	679号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,808,000	
	97号 利附商工債（3年）	100,000,000	100,770,000	
	108号 利附商工債（3年）	200,000,000	203,098,000	

	1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,999,500	
	2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,396,530	
	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,238,200	
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,308,000	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	312,570,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	208,178,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	210,949,500	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	273,879,550	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	123,678,360	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	316,902,000	
特殊債券計			41,014,304,995	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,542,000	
	11回 メリルリンチ円貨社債	100,000,000	99,655,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	95,435,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	102,405,000	
	15回 シティグループ円貨社債	100,000,000	96,343,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	192,930,000	
	7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	100,654,000	
	1回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,965,000	
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	103,696,000	
	25回 三菱化学社債	100,000,000	103,307,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	102,566,000	
	2回 花王社債	100,000,000	104,770,000	
	19回 新日本石油社債	100,000,000	102,802,000	
	8回 旭硝子社債	100,000,000	100,463,000	
	48回 新日本製鐵社債	100,000,000	102,089,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	104,148,000	
	4回 神戸製鋼所社債	100,000,000	105,416,000	
	11回 豊田自動織機社債	100,000,000	101,897,000	
	12回 日立製作所社債	100,000,000	100,062,000	
	7回 パナソニック社債	100,000,000	103,107,000	
	16回 ソニー社債	100,000,000	101,750,000	
	17回 ソニー社債	100,000,000	103,685,000	
	19回 ソニー社債	100,000,000	103,079,000	
	4回 デンソー社債	100,000,000	101,779,000	
	15回 三菱重工業社債	100,000,000	101,653,000	
	6回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,782,000	
	7回 トヨタ自動車社債	300,000,000	308,655,000	
	45回 三井物産社債	100,000,000	100,839,000	
	29回 住友商事社債	100,000,000	102,842,000	
	16回 三菱商事社債	100,000,000	109,396,000	
	14回 クレディセゾン社債	100,000,000	94,425,000	
	12回 三菱UFJフィナンシャルG社債	100,000,000	101,058,000	
	1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	208,744,000	

	3回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,680,000	
	6回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,612,000	
	7回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	105,699,000	
	9回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,058,000	
	11回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,416,000	
	13回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,745,000	
	14回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	103,308,000	
	15回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,124,000	
	2回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,974,000	
	82回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,530,000	
	84回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,762,000	
	92回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,870,000	
	100回 三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,962,000	
	106回 三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	303,150,000	
	3回2号 三菱東京UFJ銀行社債（劣後）	200,000,000	203,668,000	
	3回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	208,566,000	
	6回 東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,535,000	
	8回 東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	102,763,000	
	11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	100,000,000	105,892,000	
	5回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,797,000	
	4回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,271,000	
	5回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,805,000	
	37回 三井住友銀行社債	200,000,000	203,894,000	
	41回 三井住友銀行社債	100,000,000	102,477,000	
	45回 三井住友銀行社債	200,000,000	205,014,000	
	6回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,221,000	
	7回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,490,000	
	9回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,300,000	
	1回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,712,000	
	6回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,652,000	
	10回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,313,000	
	14回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,553,000	
	18回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	203,240,000	
	19回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,205,000	
	23回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	105,617,000	
	26回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,241,000	
	39回 アコム社債	100,000,000	96,103,000	
	106回 オリックス社債	100,000,000	98,952,000	
	115回 オリックス社債	100,000,000	97,086,000	
	118回 オリックス社債	100,000,000	93,362,000	
	6回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,263,000	
	7回 野村ホールディングス社債	100,000,000	101,986,000	
	9回 野村ホールディングス社債	100,000,000	101,432,000	
	13回 野村ホールディングス社債	100,000,000	102,147,000	
	15回 野村ホールディングス社債	100,000,000	104,093,000	

	3回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,546,000	
	24回 三井不動産社債	100,000,000	103,420,000	
	53回 三菱地所社債	100,000,000	102,657,000	
	41回 小田急電鉄社債	100,000,000	107,395,000	
	18回 京王電鉄社債	100,000,000	106,105,000	
	2回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	242,178,000	
	7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,621,000	
	19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,120,000	
	25回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	303,432,000	
	31回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,232,000	
	35回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	202,702,000	
	41回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,343,000	
	3回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,154,000	
	10回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,191,000	
	1回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	116,547,000	
	2回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	237,052,000	
	6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,462,000	
	10回 東海旅客鉄道社債	190,000,000	193,832,300	
	19回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,842,000	
	23回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,118,000	
	43回 日本電信電話社債	200,000,000	203,144,000	
	44回 日本電信電話社債	100,000,000	102,310,000	
	47回 日本電信電話社債	400,000,000	405,652,000	
	48回 日本電信電話社債	400,000,000	417,740,000	
	50回 日本電信電話社債	100,000,000	104,395,000	
	2回 K D D I 社債	100,000,000	101,792,000	
	8回 N T T ドコモ社債	100,000,000	101,306,000	
	16回 N T T ドコモ社債	200,000,000	205,414,000	
	441回 東京電力社債	200,000,000	228,336,000	
	455回 東京電力社債	200,000,000	212,518,000	
	457回 東京電力社債	100,000,000	106,008,000	
	473回 東京電力社債	300,000,000	312,453,000	
	487回 東京電力社債	500,000,000	510,125,000	
	489回 東京電力社債	300,000,000	305,958,000	
	491回 東京電力社債	217,000,000	222,194,980	
	493回 東京電力社債	500,000,000	513,145,000	
	495回 東京電力社債	200,000,000	205,282,000	
	496回 東京電力社債	300,000,000	308,277,000	
	498回 東京電力社債	300,000,000	306,099,000	
	501回 東京電力社債	200,000,000	203,172,000	
	502回 東京電力社債	200,000,000	203,424,000	
	505回 東京電力社債	100,000,000	101,122,000	
	507回 東京電力社債	300,000,000	310,827,000	
	510回 東京電力社債	200,000,000	206,924,000	
	511回 東京電力社債	100,000,000	104,436,000	

	5 1 4 回 東京電力社債	300,000,000	313,053,000	
	5 1 5 回 東京電力社債	200,000,000	207,566,000	
	5 1 6 回 東京電力社債	100,000,000	103,671,000	
	5 1 7 回 東京電力社債	100,000,000	103,286,000	
	5 1 8 回 東京電力社債	300,000,000	309,825,000	
	5 1 9 回 東京電力社債	372,000,000	388,602,360	
	5 2 2 回 東京電力社債	300,000,000	321,189,000	
	5 2 7 回 東京電力社債	500,000,000	519,640,000	
	5 3 5 回 東京電力社債	500,000,000	522,265,000	
	5 3 6 回 東京電力社債	200,000,000	207,144,000	
	5 4 1 回 東京電力社債	500,000,000	510,855,000	
	5 4 2 回 東京電力社債	500,000,000	514,160,000	
	4 0 7 回 中部電力社債	100,000,000	114,163,000	
	4 0 9 回 中部電力社債	300,000,000	355,416,000	
	4 5 7 回 中部電力社債	100,000,000	101,995,000	
	4 6 0 回 中部電力社債	200,000,000	204,242,000	
	4 6 2 回 中部電力社債	100,000,000	101,530,000	
	4 6 3 回 中部電力社債	200,000,000	202,536,000	
	4 6 7 回 中部電力社債	100,000,000	104,318,000	
	4 6 8 回 中部電力社債	100,000,000	103,762,000	
	4 7 1 回 中部電力社債	300,000,000	308,958,000	
	4 7 6 回 中部電力社債	100,000,000	106,851,000	
	4 7 8 回 中部電力社債	100,000,000	105,951,000	
	4 8 0 回 中部電力社債	200,000,000	210,248,000	
	4 8 4 回 中部電力社債	200,000,000	207,216,000	
	4 8 7 回 中部電力社債	140,000,000	143,684,800	
	4 1 0 回 関西電力社債	300,000,000	316,725,000	
	4 2 7 回 関西電力社債	100,000,000	103,584,000	
	4 2 9 回 関西電力社債	200,000,000	205,508,000	
	4 3 1 回 関西電力社債	100,000,000	102,661,000	
	4 3 2 回 関西電力社債	300,000,000	307,902,000	
	4 3 3 回 関西電力社債	200,000,000	206,280,000	
	4 4 1 回 関西電力社債	200,000,000	207,790,000	
	4 4 6 回 関西電力社債	200,000,000	210,916,000	
	2 9 8 回 中国電力社債	200,000,000	235,214,000	
	3 1 0 回 中国電力社債	200,000,000	230,036,000	
	3 3 4 回 中国電力社債	112,000,000	114,236,640	
	3 3 7 回 中国電力社債	219,000,000	224,783,790	
	3 4 1 回 中国電力社債	100,000,000	104,161,000	
	3 5 0 回 中国電力社債	200,000,000	208,772,000	
	2 4 5 回 北陸電力社債	200,000,000	232,298,000	
	2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	107,591,000	
	2 6 4 回 北陸電力社債	100,000,000	101,521,000	
	2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	211,594,000	
	3 6 8 回 東北電力社債	300,000,000	353,193,000	



	375回 東北電力社債	100,000,000	115,625,000	
	380回 東北電力社債	300,000,000	350,169,000	
	401回 東北電力社債	100,000,000	101,468,000	
	405回 東北電力社債	100,000,000	102,015,000	
	408回 東北電力社債	100,000,000	102,638,000	
	411回 東北電力社債	200,000,000	204,682,000	
	420回 東北電力社債	100,000,000	103,265,000	
	427回 東北電力社債	200,000,000	207,126,000	
	432回 東北電力社債	500,000,000	536,675,000	
	249回 四国電力社債	200,000,000	205,172,000	
	257回 四国電力社債	200,000,000	207,128,000	
	369回 九州電力社債	300,000,000	306,447,000	
	374回 九州電力社債	300,000,000	311,013,000	
	382回 九州電力社債	100,000,000	103,812,000	
	383回 九州電力社債	100,000,000	103,895,000	
	387回 九州電力社債	200,000,000	209,830,000	
	257回 北海道電力社債	200,000,000	235,858,000	
	282回 北海道電力社債	200,000,000	207,082,000	
	284回 北海道電力社債	500,000,000	518,475,000	
	286回 北海道電力社債	100,000,000	104,200,000	
	7回 沖縄電力社債	100,000,000	102,842,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	103,862,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	205,956,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	104,116,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	104,198,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	107,067,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	206,822,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,051,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	102,044,000	
	社債券計		34,659,908,870	
	合計		428,337,566,900	

## 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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		6,407,319,363	8,754,854,193
コール・ローン		278,720,242	829,004,858
国債証券		288,232,591,008	414,062,710,146
派生商品評価勘定		-	163,614
未収利息		4,400,304,312	5,630,641,835
前払費用		217,032,842	590,569,720
流動資産合計		299,535,967,767	429,867,944,366
資産合計		299,535,967,767	429,867,944,366
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		393,273	2,779,825
未払解約金		68,261,000	104,591,000
流動負債合計		68,654,273	107,370,825
負債合計		68,654,273	107,370,825
純資産の部			
元本等			
元本		260,422,854,222	335,169,742,026
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		39,044,459,272	94,590,831,515
元本等合計		299,467,313,494	429,760,573,541
純資産合計		299,467,313,494	429,760,573,541
負債純資産合計		299,535,967,767	429,867,944,366

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
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。	国債証券 同左
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。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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20年2月2日から平成21年2月23日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (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21年2月24日から平成22年2月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	242,099,924,618円	260,422,854,222円
同期中追加設定元本額	105,958,371,413円	120,575,225,781円
同期中解約元本額	87,635,441,809円	45,828,337,977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	円	1,165,084,751円
D I A M 外国債券インデックスファンド< D C 年金 >	2,510,271,389円	2,892,804,144円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	220,196,414円	240,750,333円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	761,587,886円	903,680,241円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	792,794,357円	984,056,228円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	285,763,112円	285,812,801円

D I A M D C バランス50インデックスファンド	547,789,280円	560,246,962円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	340,051,271円	360,492,481円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	219,505,871円	194,440,327円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,409,221,581円	1,478,983,655円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	20,868,909,416円	15,894,236,590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)	3,968,896,263円	3,614,726,895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)	5,901,262,819円	9,040,424,911円
D I A M外国債券パッシブファンド2(適格機関投資家向け)	2,066,624,626円	2,004,335,773円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	1,316,631,738円	949,684,594円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	円	252,351,204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)	54,943,466,549円	52,784,792,346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)	2,765,892,318円	2,845,500,184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)	470,836,754円	477,145,190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)	714,876,865円	758,119,594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)	219,002,327円	213,579,570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)	95,379,349円	93,883,178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)	28,798,434,971円	29,116,510,158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)	6,167,327,135円	6,358,949,534円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	12,246,373,194円	11,982,751,626円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,566,268,229円	5,696,783,101円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,959,385,391円	8,179,518,861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)	2,855,131,008円	2,955,843,543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）	8,730,755,788円	8,829,018,555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）	8,214,643,255円	10,454,546,887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）	45,298,468,587円	49,089,637,827円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	320,214,088円	286,126,637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）	952,165,907円	984,955,979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）	6,354,134,156円	6,761,320,436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）	16,114,987,928円	15,870,367,238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）	286,171,339円	281,671,446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）	10,139,433,061円	25,564,335,534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）	円	31,281,753,790円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	円	781,876,050円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	円	213,915円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	円	131,359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）	円	22,603,573,775円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	円	20,982,089円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	円	73,422,378円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	円	199,011円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	円	120,345円
（合計）	260,422,854,222円	335,169,742,026円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	260,422,854,222口	335,169,742,026口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	288,232,591,008	13,451,229,993	414,062,710,146	4,423,594,443
合計	288,232,591,008	13,451,229,993	414,062,710,146	4,423,594,443

(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計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成21年1月13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 買建				
	カナダドル	36,781,917	-	36,778,410	3,507
	ユーロ	404,523,136	-	404,496,000	27,136
	英ポンド	73,508,760	-	73,503,200	5,560
	米ドル	237,184,160	-	236,827,090	357,070
合 計		751,997,973	-	751,604,700	393,273

平成22年1月12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 買建				
	カナダドル	34,035,183	-	33,651,020	384,163
	ユーロ	295,557,636	-	295,721,250	163,614
	英ポンド	39,764,977	-	39,670,860	94,117
	米ドル	251,945,995	-	249,644,450	2,301,545
合 計		621,303,791	-	618,687,580	2,616,211

## （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。

## （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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.1499円	1.2822円
（1万口当たり純資産額）	（11,499円）	（12,822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

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.25 01/15/11	25,000,000.00	25,976,500.000	
	US T N/B 0.875 02/28/11	20,000,000.00	20,100,600.000	
	US T N/B 0.875 03/31/11	30,000,000.00	30,142,800.000	
	US T N/B 4.875 04/30/11	40,000,000.00	42,224,800.000	
	US T N/B 0.875 05/31/11	25,000,000.00	25,113,250.000	
	US T N/B 1.125 06/30/11	35,000,000.00	35,270,550.000	
	US T N/B 5.0 08/15/11	36,000,000.00	38,477,520.000	
	US T N/B 1.0 09/30/11	35,000,000.00	35,112,000.000	
	US T N/B 4.5 11/30/11	28,000,000.00	29,902,880.000	
	US T N/B 4.75 01/31/12	15,000,000.00	16,158,900.000	
	US T N/B 1.125 01/15/12	27,000,000.00	27,069,390.000	
	US T N/B 4.875 02/15/12	25,000,000.00	27,000,000.000	
	US T N/B 4.5 03/31/12	32,000,000.00	34,394,880.000	
	US T N/B 4.5 04/30/12	20,000,000.00	21,529,600.000	
	US T N/B 1.875 06/15/12	25,000,000.00	25,395,500.000	
	US T N/B 4.375 08/15/12	35,000,000.00	37,802,450.000	
	US T N/B 1.375 09/15/12	27,000,000.00	27,004,050.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	44,000,000.00	47,241,480.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	34,224,960.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,825,840.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,931,250.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	43,415,600.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,002,800.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,715,950.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	30,393,600.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,371,040.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	27,916,840.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	32,498,400.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	17,000,000.00	18,174,020.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	13,000,000.00	13,941,460.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	10,000,000.00	10,769,500.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	10,000,000.00	10,894,500.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	21,000,000.00	22,794,660.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	19,228,000.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	15,000,000.00	18,632,700.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	20,000,000.00	20,159,200.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	18,000,000.00	19,873,080.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	19,726,400.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	17,715,460.000	

	US T N/B 2.75 11/30/16	12,000,000.00	11,611,800.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	13,007,760.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,491,510.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	12,000,000.00	13,058,400.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	14,717,500.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	18,000,000.00	17,921,160.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	15,000,000.00	15,280,050.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	10,000,000.00	10,247,600.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	17,000,000.00	17,056,950.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	9,808,190.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	25,000,000.00	23,095,500.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	25,000,000.00	23,742,000.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	9,450,000.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	22,000,000.00	21,685,400.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	20,000,000.00	19,278,000.000	
	US T N/B 8.5 02/15/20	2,000,000.00	2,778,280.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	9,924,110.000	
	US T N/B 7.875 02/15/21	3,000,000.00	4,040,610.000	
	US T N/B 8.125 05/15/21	5,000,000.00	6,853,500.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	12,000,000.00	16,353,720.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	3,888,510.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	4,000,000.00	5,126,560.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	8,000,000.00	9,547,440.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	3,000,000.00	4,003,800.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,046,460.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	6,000,000.00	7,599,840.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	3,000,000.00	3,501,780.000	
	US T N/B 6.75 08/15/26	3,000,000.00	3,774,600.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	3,687,630.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,245,070.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	3,000,000.00	3,650,850.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	8,000,000.00	9,493,120.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	3,327,870.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	4,000,000.00	4,309,040.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	4,000,000.00	4,310,920.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	4,000,000.00	4,772,480.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	5,000,000.00	6,066,000.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	7,000,000.00	7,673,190.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	10,000,000.00	9,724,200.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	6,000,000.00	6,053,880.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	6,000,000.00	6,291,060.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	6,000,000.00	5,686,860.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	9,000,000.00	8,700,390.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	10,000,000.00	8,071,000.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	15,000,000.00	13,863,150.000	

	US T N/B 4.5 08/15/39	15,000,000.00	14,452,650.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	13,000,000.00	12,268,750.000	
米ドル小計	銘柄数 : 86	1,446,000,000.00	1,531,661,550.000	
	組入時価比率 : 32.90%		(141,372,361,065)	
	合計時価比率 : 34.14%			
	UK TREASURY 4.25 03/07/11	9,500,000.00	9,886,650.000	
	UK TREASURY 9.0 07/12/11	3,000,000.00	3,361,800.000	
	UK TREASURY 3.25 12/07/11	6,000,000.00	6,231,600.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	11,000,000.00	11,818,400.000	
	UK TREASURY 5.25 06/07/12	9,000,000.00	9,740,700.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	10,000,000.00	10,701,000.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,607,800.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	9,842,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	8,000,000.00	8,765,600.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	8,682,400.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	2,500,000.00	3,147,500.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	9,000,000.00	9,306,900.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,017,300.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	4,500,000.00	4,884,750.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,800,000.00	8,108,100.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	7,000,000.00	6,815,900.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	4,000,000.00	4,220,400.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	5,000,000.00	6,754,500.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,000,000.00	2,925,300.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	7,500,000.00	8,005,500.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	5,000,000.00	4,907,500.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,500,000.00	5,444,550.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	6,254,400.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	7,000,000.00	6,840,400.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,000,000.00	3,018,900.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	8,000,000.00	7,748,000.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	7,500,000.00	7,899,000.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,500,000.00	3,394,650.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	8,000,000.00	8,136,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,700,000.00	6,569,350.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	5,500,000.00	5,410,350.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,500,000.00	6,433,700.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,500,000.00	2,349,000.000	
英債券小計	銘柄数 : 33	204,500,000.00	215,230,700.000	
	組入時価比率 : 7.44%		(31,981,129,713)	
	合計時価比率 : 7.72%			
	CANADA 6.0 06/01/11	7,000,000.00	7,486,920.000	
	CANADA 3.75 09/01/11	7,000,000.00	7,296,310.000	
	CANADA 1.25 12/01/11	3,000,000.00	2,997,600.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	9,500,000.00	10,312,915.000	

	CANADA 2.0 09/01/12	7,000,000.00	7,044,800.000	
	CANADA 5.25 06/01/13	10,000,000.00	11,012,200.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	11,021,900.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	6,777,750.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	5,500,000.00	5,957,050.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	5,000,000.00	5,272,150.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,000,000.00	5,235,250.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	4,500,000.00	4,756,545.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	8,000,000.00	8,090,000.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,500,000.00	2,445,050.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	2,700,000.00	3,809,241.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,700,000.00	2,634,847.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,500,000.00	3,661,325.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	5,000,000.00	6,001,950.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	5,800,000.00	7,098,330.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	6,000,000.00	6,843,000.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	4,000,000.00	3,906,600.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 21	118,700,000.00	129,661,733.000	
	組入時価比率 : 2.69%		(11,574,902,905)	
	合計時価比率 : 2.80%			
	SWEDEN 5.25 03/15/11	13,000,000.00	13,752,700.000	
	SWEDEN 5.5 10/08/12	26,000,000.00	28,673,580.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	32,000,000.00	37,707,520.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	20,000,000.00	21,832,400.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	18,058,860.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	23,000,000.00	23,960,250.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	35,000,000.00	37,613,100.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	23,000,000.00	26,287,620.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	14,815,360.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 9	206,000,000.00	222,701,390.000	
	組入時価比率 : 0.68%		(2,917,388,209)	
	合計時価比率 : 0.70%			
	AUSTRIA 5.25 01/04/11	4,000,000.00	4,171,800.000	
	AUSTRIA 5.0 07/15/12	5,000,000.00	5,410,550.000	
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,000,000.00	2,114,000.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	7,000,000.00	7,472,500.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,103,500.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	4,000,000.00	4,102,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	5,000,000.00	5,227,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	2,000,000.00	2,116,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	5,000,000.00	5,392,500.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	5,000,000.00	5,250,000.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	4,000,000.00	4,014,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,000,000.00	3,840,000.000	

	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.00	2,682,000.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	3,000,000.00	3,737,670.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,300,000.00	3,168,000.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/11	9,000,000.00	9,545,400.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/12	9,000,000.00	9,779,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	7,000,000.00	7,429,100.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	7,000,000.00	7,490,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	2,000,000.00	2,126,800.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	9,000,000.00	9,672,300.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,185,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,240,500.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	5,059,500.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	4,000,000.00	4,190,800.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	4,000,000.00	4,562,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,150,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	4,000,000.00	4,100,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	4,000,000.00	4,029,200.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,000,000.00	5,745,000.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	6,000,000.00	6,540,120.000	
	DEUTSCHLAND 5.25 01/04/11	6,000,000.00	6,268,200.000	
	BUNDESUBL 3.5 04/08/11	15,000,000.00	15,475,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/11	17,000,000.00	17,992,800.000	
	BUNDESUBL 3.5 10/14/11	7,000,000.00	7,282,800.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 01/04/12	17,000,000.00	18,225,700.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	16,000,000.00	17,352,000.000	
	BUNDESUBL 4.25 10/12/12	10,000,000.00	10,720,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	18,000,000.00	19,441,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	18,000,000.00	19,105,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	16,000,000.00	17,256,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,518,100.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	9,000,000.00	9,520,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	12,000,000.00	12,408,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	10,000,000.00	10,429,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	12,000,000.00	12,836,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	10,000,000.00	10,500,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	8,000,000.00	8,646,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.00	7,423,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	10,000,000.00	10,765,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	10,000,000.00	10,362,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	11,000,000.00	11,176,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,000,000.00	2,977,800.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	4,000,000.00	5,057,600.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	5,000,000.00	6,495,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	6,500,000.00	7,743,450.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	5,000,000.00	5,433,500.000	

	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	4,000,000.00	5,134,400.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	7,500,000.00	8,897,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	8,500,000.00	9,236,100.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	10,000,000.00	9,781,300.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	6,000,000.00	6,134,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,000,000.00	4,442,000.000	
	SPAIN 5.4 07/30/11	10,000,000.00	10,623,200.000	
	SPAIN 5.35 10/31/11	8,500,000.00	9,089,985.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	11,000,000.00	11,868,890.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	11,000,000.00	12,290,520.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	9,000,000.00	9,562,140.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	6,000,000.00	6,387,600.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	6,500,000.00	7,050,420.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	3,000,000.00	3,058,200.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,420,000.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.00	6,967,100.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	5,000,000.00	5,097,500.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	8,000,000.00	9,045,440.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	6,158,700.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,000,000.00	6,313,200.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,000,000.00	4,109,000.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	6,500,000.00	6,758,050.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	7,000,000.00	8,165,220.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	6,000,000.00	6,812,160.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	6,000,000.00	5,482,260.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	5,000,000.00	5,070,000.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,000,000.00	1,963,800.000	
	FINLAND 5.75 02/23/11	2,000,000.00	2,109,600.000	
	FINLAND 4.25 09/15/12	3,000,000.00	3,193,500.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	3,000,000.00	3,335,700.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,545,750.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	3,000,000.00	3,219,000.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	3,000,000.00	3,111,000.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,134,800.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	1,300,000.00	1,294,605.000	
	FRANCE OAT 6.5 04/25/11	16,000,000.00	17,126,400.000	
	FR TREASURY 1.5 09/12/11	8,000,000.00	8,052,000.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	14,000,000.00	14,931,000.000	
	FRANCE OAT 5.0 04/25/12	16,000,000.00	17,280,000.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	18,000,000.00	19,486,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	17,000,000.00	18,113,500.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	16,000,000.00	17,020,800.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,059,500.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	12,000,000.00	12,802,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	9,000,000.00	9,596,700.000	

	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	9,000,000.00	9,371,700.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	11,000,000.00	11,129,800.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	10,000,000.00	10,199,000.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,212,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,401,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,557,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	10,000,000.00	10,494,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	7,000,000.00	7,438,550.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	13,000,000.00	13,793,000.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,000,000.00	5,652,400.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,000,000.00	6,092,400.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	10,000,000.00	10,031,000.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,885,600.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	8,000,000.00	8,249,600.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	5,000,000.00	6,131,500.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,000,000.00	9,364,000.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	9,752,000.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,500,000.00	6,998,550.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	10,000,000.00	9,604,000.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,000,000.00	4,156,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	6,000,000.00	5,689,800.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.8 03/20/11	5,000,000.00	5,042,450.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.9 08/20/11	8,000,000.00	8,060,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.25 05/18/12	5,000,000.00	5,077,500.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.1 08/20/12	5,000,000.00	5,059,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 05/20/13	6,000,000.00	6,052,200.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.5 05/20/14	5,000,000.00	4,888,500.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.5 08/20/14	4,000,000.00	4,152,600.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.7 07/20/15	2,000,000.00	1,905,400.000	
	HELLENICREPUBLIC 3.6 07/20/16	3,000,000.00	2,775,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.3 07/20/17	7,000,000.00	6,663,300.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 07/20/18	4,000,000.00	3,792,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 6.0 07/19/19	6,000,000.00	6,206,100.000	
	HELLENICREPUBLIC 6.5 10/22/19	4,000,000.00	4,300,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.9 10/22/22	4,000,000.00	4,010,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.7 03/20/24	4,000,000.00	3,522,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 5.3 03/20/26	3,000,000.00	2,733,300.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.5 09/20/37	4,000,000.00	3,068,000.000	
	HELLENICREPUBLIC 4.6 09/20/40	3,000,000.00	2,340,000.000	
	IRISH 4.0 11/11/11	1,500,000.00	1,550,160.000	
	IRISH 3.9 03/05/12	2,000,000.00	2,069,940.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	3,207,750.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	3,098,940.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	3,131,130.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,979,870.000	

	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,922,660.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	3,263,100.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,921,010.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,978,280.000	
	ITALY BTPS 3.5 03/15/11	8,000,000.00	8,227,920.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/11	10,000,000.00	10,599,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/11	15,000,000.00	15,679,650.000	
	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	18,000,000.00	19,220,400.000	
	ITALY BTPS 4.0 04/15/12	10,000,000.00	10,487,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 10/15/12	14,000,000.00	14,855,400.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	12,000,000.00	12,928,800.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	15,000,000.00	15,993,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	15,000,000.00	15,681,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	15,000,000.00	15,990,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	9,000,000.00	9,572,400.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	11,000,000.00	11,437,800.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	14,487,200.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	10,000,000.00	10,431,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	8,964,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	11,000,000.00	11,740,300.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	8,000,000.00	8,490,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	10,000,000.00	10,378,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	10,000,000.00	10,562,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	10,000,000.00	10,296,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	9,000,000.00	9,405,900.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,000,000.00	4,078,800.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	11,000,000.00	10,733,800.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.00	7,307,300.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	5,000,000.00	7,400,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	4,000,000.00	4,245,520.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	4,000,000.00	5,255,200.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	11,000,000.00	13,453,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	12,000,000.00	12,860,400.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	13,000,000.00	15,115,100.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	7,000,000.00	7,933,100.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,500,000.00	8,793,250.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,000,000.00	8,017,200.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	8,000,000.00	8,292,800.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,000,000.00	3,084,300.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/11	10,000,000.00	10,585,000.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/12	6,000,000.00	6,138,600.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/12	6,000,000.00	6,500,400.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,526,400.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,398,300.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	2,000,000.00	2,014,400.000	



	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,174,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,310,000.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,430,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	5,000,000.00	5,235,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	6,000,000.00	6,234,000.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,181,200.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	5,256,900.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	5,000,000.00	4,828,000.000	
	PORTUGUESE 5.15 06/15/11	4,000,000.00	4,215,640.000	
	PORTUGUESE 5.0 06/15/12	3,000,000.00	3,211,800.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	3,300,960.000	
	PORTUGUESE 4.375 06/16/14	4,000,000.00	4,226,800.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	2,007,400.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	5,175,000.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	2,080,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	3,126,480.000	
	PORTUGUESE 4.75 06/14/19	2,000,000.00	2,106,860.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	2,891,100.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	2,000,000.00	2,103,800.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	2,704,200.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 212	1,505,100,000.00	1,597,327,450.000	
	組入時価比率 : 49.72%		(213,658,519,712)	
	合計時価比率 : 51.60%			
	DENMARK 6.0 11/15/11	27,000,000.00	29,203,740.000	
	DENMARK 4.0 11/15/12	13,000,000.00	13,733,200.000	
	DENMARK 5.0 11/15/13	31,000,000.00	33,921,750.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	28,000,000.00	29,470,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	25,000,000.00	26,052,500.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	23,000,000.00	23,777,400.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	11,000,000.00	14,685,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	37,000,000.00	38,873,680.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 8	195,000,000.00	209,717,270.000	
	組入時価比率 : 0.88%		(3,770,716,515)	
	合計時価比率 : 0.91%			
	NORWAY 6.0 05/16/11	16,000,000.00	16,784,000.000	
	NORWAY 6.5 05/15/13	27,000,000.00	29,805,840.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	18,000,000.00	19,137,600.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	17,000,000.00	17,396,100.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 4	78,000,000.00	83,123,540.000	
	組入時価比率 : 0.32%		(1,366,550,998)	
	合計時価比率 : 0.33%			
	POLAND 4.25 05/24/11	10,000,000.00	9,965,000.000	
	POLAND 01/25/12	6,000,000.00	5,446,680.000	

	POLAND 4.75 04/25/12	19,000,000.00	18,952,500.000	
	POLAND 5.25 04/25/13	11,000,000.00	10,980,530.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	10,000,000.00	9,879,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	12,000,000.00	12,038,880.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	15,000,000.00	15,360,000.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,366,400.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	8,000,000.00	7,567,440.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	10,500,000.00	10,153,500.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 10	113,500,000.00	111,709,930.000	
	組入時価比率 : 0.86%		(3,681,959,293)	
	合計時価比率 : 0.89%			
	SINGAPORE 3.625 07/01/11	3,000,000.00	3,133,590.000	
	SINGAPORE 2.625 04/01/12	4,000,000.00	4,171,000.000	
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	2,000,000.00	2,090,920.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,423,920.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	2,000,000.00	2,202,720.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,767,875.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	2,876,160.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,000,000.00	995,220.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,518,105.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	22,800,000.00	24,179,510.000	
	組入時価比率 : 0.37%		(1,605,761,259)	
	合計時価比率 : 0.39%			
	MALAYSIA 3.756 04/28/11	10,000,000.00	10,182,700.000	
	MALAYSIA 3.718 06/15/12	22,500,000.00	22,950,000.000	
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	2,000,000.00	2,031,100.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,763,620.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,094,010.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	6,884,080.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,031,640.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	1,000,000.00	1,005,400.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,273,050.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,110,260.000	
マレーシアリングgit小計	銘柄数 : 10	76,500,000.00	77,325,860.000	
	組入時価比率 : 0.50%		(2,133,420,477)	
	合計時価比率 : 0.52%			
合計			414,062,710,146	
			(414,062,710,146)	

(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。

## 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 86銘柄	32.90%	34.14%
英ポンド	国債証券 33銘柄	7.44%	7.72%
カナダドル	国債証券 21銘柄	2.69%	2.80%
スウェーデンクローネ	国債証券 9銘柄	0.68%	0.70%
ユーロ	国債証券 212銘柄	49.72%	51.60%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	0.88%	0.91%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.32%	0.33%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.86%	0.89%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.37%	0.39%
マレーシアリングgit	国債証券 10銘柄	0.50%	0.52%

(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-REIT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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,693,672	2,180,777
投資証券		3,886,712,900	3,405,110,700
未収入金		-	14,634,300
未収配当金		98,295,769	59,680,497
流動資産合計		3,988,702,341	3,481,606,274
資産合計		3,988,702,341	3,481,606,274
負債の部			
流動負債			
未払解約金		15,000	14,675,000
流動負債合計		15,000	14,675,000
負債合計		15,000	14,675,000
純資産の部			
元本等			
元本		6,889,410,246	5,226,243,410
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	2,900,722,905	1,759,312,136
元本等合計		3,988,687,341	3,466,931,274
純資産合計		3,988,687,341	3,466,931,274
負債純資産合計		3,988,702,341	3,481,606,274

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、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。	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20年6月7日から平成21年6月8日までとなっております。	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21年6月9日から平成22年6月7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	11,407,773,374円	6,889,410,246円
同期中追加設定元本額	4,127,083,127円	1,254,925,144円
同期中解約元本額	8,645,446,255円	2,918,091,980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>	173,770,268円	92,615,805円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,101,619,929円	694,195,892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）	2,551,902,247円	1,491,628,555円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	593,062,407円	492,957,176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）	1,868,756,714円	1,924,727,594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）	600,298,681円	530,118,388円
（合計）	6,889,410,246円	5,226,243,410円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	6,889,410,246口	5,226,243,410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2,900,722,905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1,759,312,136円であります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資証券	3,886,712,900	2,340,753,887	3,405,110,700	43,398,691
合計	3,886,712,900	2,340,753,887	3,405,110,700	43,398,691

(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計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	0.5790円	0.6634円
（1万口当たり純資産額）	(5,790円)	(6,634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

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	193	94,377,000	
	M I Dリート投資法人	227	45,422,700	
	日本コマース投資法人	318	40,576,800	
	森ヒルズリート投資法人	197	56,873,900	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	155	55,877,500	
	産業ファンド投資法人	98	23,294,600	
	日本ビルファンド投資法人	670	489,100,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	604	440,316,000	
	日本リテールファンド投資法人	477	195,331,500	
	オリックス不動産投資法人	311	141,194,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	772	138,574,000	
	プレミア投資法人	162	48,195,000	
	東急リアル・エステート投資法人	209	104,500,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	120	75,360,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	377	189,631,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	249	121,761,000	
	森トラスト総合リート投資法人	225	173,250,000	
	日本レジデンシャル投資法人	305	67,100,000	
	東京グロースリート投資法人	67	6,063,500	
	フロンティア不動産投資法人	198	132,462,000	
	クレッシェンド投資法人	163	19,804,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	151	105,096,000	
	福岡リート投資法人	132	65,472,000	
	プロスペクト・リート投資法人	93	7,114,500	
	ジャパン・シングルレジデンス投資法人	69	6,969,000	
	ケネディクス不動産投資法人	289	72,683,500	
	ジョイント・リート投資法人	129	23,465,100	
	ラサールジャパン投資法人	149	17,135,000	
	F C レジデンシャル投資法人	40	7,600,000	
	D A オフィス投資法人	489	97,848,900	
	阪急リート投資法人	105	37,380,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	94	31,678,000	
	エルシーピー投資法人	113	7,571,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	131	17,056,200	
	トップリート投資法人	191	75,540,500	
	ジャパン・オフィス投資法人	203	18,330,900	
	ビ・ライフ投資法人	61	24,796,500	

	日本ホテルファンド投資法人	52	6,988,800	
	日本賃貸住宅投資法人	288	45,964,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	191	77,355,000	
合計		9,067	3,405,110,700	

## 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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		62,722,086	45,233,205
コール・ローン		60,186,213	12,574,001
新株予約権証券		-	287,918
投資信託受益証券		1,256,332,274	1,359,052,284
投資証券		5,723,679,832	5,843,071,641
未収配当金		76,119,114	38,126,574
流動資産合計		7,179,039,519	7,298,345,623
資産合計		7,179,039,519	7,298,345,623
負債の部			
流動負債			
未払解約金		7,000	2,161,000
流動負債合計		7,000	2,161,000
負債合計		7,000	2,161,000
純資産の部			
元本等			
元本		15,713,809,346	10,398,034,421
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	8,534,776,827	3,101,849,798
元本等合計		7,179,032,519	7,296,184,623
純資産合計		7,179,032,519	7,296,184,623
負債純資産合計		7,179,039,519	7,298,345,623

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
----	----------------------------	----------------------------



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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、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。	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	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。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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20年11月7日から平成21年11月6日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左  (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21年11月7日から平成22年11月8日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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	15,439,118,319円	15,713,809,346円
同期中追加設定元本額	3,909,683,658円	5,796,358,442円
同期中解約元本額	3,634,992,631円	11,112,133,367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>	95,637,011円	128,496,819円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	620,275,378円	977,370,647円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	14,557,853,138円	9,038,715,155円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	440,043,819円	253,451,800円
（合計）	15,713,809,346円	10,398,034,421円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	15,713,809,346口	10,398,034,421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8,534,776,827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3,101,849,798円であります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日		自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
新株予約権証券	-	-	287,918	122,896
投資信託受益証券	1,256,332,274	163,706,643	1,359,052,284	111,131,485
投資証券	5,723,679,832	1,029,910,739	5,843,071,641	497,017,873
合計	6,980,012,106	1,193,617,382	7,202,411,843	608,272,254

（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計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

区分	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	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、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 取引の時価等に関する事項

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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	0.4569円	0.7017円
（1万口当たり純資産額）	（4,569円）	（7,017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

種類	銘柄	証券数又は口数	評価額	備考
新株予約権証券	FONCIERE DES REGIONS-CW10(Expire2010/12/31)	3,500.00	2,152.500	
ユーロ小計	銘柄数 : 1	3,500.00	2,152.500	
	組入時価比率 : 0.00%		(287,918)	
	合計時価比率 : 0.00%			
新株予約権証券計			287,918	
			(287,918)	
投資信託受益証券	FORTUNE REAL ESTATE INVESTME	478,000.00	1,539,160.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	478,000.00	1,539,160.000	
	組入時価比率 : 0.25%		(18,316,004)	
	合計時価比率 : 0.25%			
	CAPITAMALL TRUST	550,000.00	1,023,000.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	268,000.00	546,720.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	290,000.00	336,400.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	380,000.00	539,600.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 4	1,488,000.00	2,445,720.000	
	組入時価比率 : 2.23%		(162,420,265)	
	合計時価比率 : 2.26%			
	ARDENT LEISURE GROUP	109,974.00	195,753.720	
	BUNNINGS WAREHOUSE	112,500.00	198,562.500	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	378,300.00	363,168.000	
	MIRVAC GROUP	554,854.00	918,283.370	
	ING OFFICE FUND	665,080.00	419,000.400	
	MACQUARIE COUNTRYWIDE TRUST	402,400.00	239,428.000	
	CFS RETAIL PROPERTY	433,300.00	829,769.500	
	GPT GROUP	1,590,000.00	969,900.000	
	ING INDUSTRIAL FUND	531,600.00	260,484.000	
	ABACUS PROPERTY GR	344,600.00	151,624.000	
	VALAD PROPERTY GROUP	370,000.00	46,250.000	
	MACQUARIE OFFICE TRUST	878,400.00	272,304.000	
	STOCKLAND	483,140.00	1,942,222.800	
	WESTFIELD GROUP	402,900.00	5,096,685.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	1,036,400.00	891,304.000	
	GOODMAN GROUP	1,349,762.00	863,847.680	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	235,900.00	95,539.500	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 17	9,879,110.00	13,754,126.470	

	組入時価比率：16.15%		(1,178,316,015)	
	合計時価比率：16.36%			
投資信託受益証券計			1,359,052,284	
			(1,359,052,284)	
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,800.00	556,600.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	30,700.00	2,092,819.000	
	CEDAR SHOPPING CENTERS INC	14,800.00	107,744.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7,900.00	109,494.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	15,200.00	302,328.000	
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	26,915.00	457,285.850	
	AGREE REALTY CORP	4,300.00	99,502.000	
	BRE PROPERTIES -CL A	9,900.00	332,640.000	
	NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	24,700.00	865,241.000	
	SL GREEN	16,205.00	801,013.150	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	4,200.00	150,024.000	
	AMB PROPERTY CORP	27,800.00	713,904.000	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,278.00	1,390,533.440	
	LEXINGTON REALTY TRUST	18,521.00	118,904.820	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,200.00	491,904.000	
	CBL & ASSOCIATES	26,382.00	275,428.080	
	MACK CALI	16,200.00	582,066.000	
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	11,600.00	140,012.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,900.00	490,289.000	
	COUSINS PROPERTIES INC	12,556.00	103,587.000	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	9,800.00	215,894.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,100.00	120,933.000	
	DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY CO	27,482.00	257,506.340	
	DUKE REALTY TRUST	44,500.00	588,290.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,200.00	603,072.000	
	EQUITY RESIDENTIAL	54,100.00	1,798,825.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,900.00	866,364.000	
	FIRST INDUSTRIAL RT	12,500.00	69,750.000	
	GLIMCHER REALTY TRUST	11,800.00	39,412.000	
	FELCOR LODGING TR INC	16,700.00	66,800.000	
	HOME PROPERTIES INC	9,000.00	412,470.000	
	HCP INC	63,400.00	1,950,184.000	
	HRPT PROPERTIES TRUST	49,100.00	320,623.000	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.00	123,830.000	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,300.00	488,223.000	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	24,000.00	63,120.000	
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23,600.00	590,944.000	
	HEALTH CARE REIT INC	26,401.00	1,166,132.170	
	EAST GROUP	8,400.00	314,580.000	
	KIMCO REALTY	69,399.00	980,607.870	

	KILROY REALTY CORP	11,000.00	350,900.000	
	LTC PROPERTIES INC	7,100.00	191,487.000	
	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	26,800.00	586,920.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	24,700.00	802,009.000	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	30,500.00	352,275.000	
	THE MACERICH COMPANY	19,057.00	627,547.010	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,400.00	316,992.000	
	ACADIA REALTY TRUST	13,085.00	220,089.700	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	131,968.00	1,633,763.840	
	MID AMERICA	5,100.00	247,197.000	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	21,100.00	180,827.000	
	PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	107,212.000	
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500.00	96,075.000	
	GETTY REALTY CORP	7,300.00	169,944.000	
	POST PROPERTIES, INC	9,800.00	186,200.000	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	51,968.000	
	REALTY INCOME CORP	19,500.00	531,180.000	
	REGENCY	15,400.00	551,474.000	
	UDR INC	34,879.00	557,715.210	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,600.00	426,416.000	
	SAUL CENTERS INC	3,600.00	124,884.000	
	PROLOGIS	99,400.00	1,400,546.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	58,804.00	4,510,266.800	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	4,400.00	159,896.000	
	PUBLIC STORAGE	22,738.00	1,802,441.260	
	SUN COMMUNITIES INC	7,400.00	151,922.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	2,100.00	71,988.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	6,500.00	256,230.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,700.00	151,246.000	
	VENTAS INC	34,200.00	1,502,748.000	
	VORNADO REALTY TRUST	29,239.00	2,038,543.080	
	WASHINGTON REIT	12,500.00	342,375.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	21,900.00	467,346.000	
	CAPLEASE INC	16,700.00	76,820.000	
	BIOMED REALTY TRUST INC	24,000.00	370,320.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	8,609.00	230,462.930	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,500.00	226,005.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.00	79,743.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22,340.00	218,038.400	
	U-STORE-IT TRUST	18,400.00	134,320.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,000.00	859,350.000	
	INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.00	42,189.000	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	41,106.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	22,300.00	207,390.000	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST	13,000.00	133,640.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	28,000.00	406,280.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	45,000.00	230,850.000	
米ドル小計	銘柄数 : 87	1,805,558.00	45,644,017.950	
	組入時価比率 : 57.74%		(4,212,942,857)	
	合計時価比率 : 58.49%			
	BRITISH LAND CO PLC	188,200.00	890,938.800	
	DERWENT LONDON PLC	18,400.00	246,192.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.00	35,600.000	
	HAMMERSON PLC	150,200.00	600,800.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,600.00	1,042,258.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	230,670.00	53,054.100	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	56,504.00	278,621.220	
	SHAFTESBURY PLC	63,000.00	248,850.000	
	SEGRO PLC	153,090.00	536,886.630	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	62,400.00	183,580.800	
英ポンド小計	銘柄数 : 10	1,085,064.00	4,116,781.550	
	組入時価比率 : 8.38%		(611,712,571)	
	合計時価比率 : 8.49%			
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	11,100.00	219,003.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,900.00	129,139.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	13,300.00	168,910.000	
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	17,300.00	124,560.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.00	74,304.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	1,200.00	23,544.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	8,000.00	127,600.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	21,000.00	123,270.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800.00	102,480.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 9	86,300.00	1,092,810.000	
	組入時価比率 : 1.34%		(97,555,149)	
	合計時価比率 : 1.35%			
	BEFIMMO	1,104.00	68,823.360	
	COFINIMMO SA	2,700.00	266,517.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	1,934.00	65,175.800	
	GECINA SA	1,400.00	102,564.000	
	ICADE EMGP	1,200.00	89,400.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	18,580.00	2,884,545.000	
	KLEPIERRE	8,800.00	250,624.000	
	SILIC	2,194.00	185,831.800	
	FONCIERE DES REGIONS	3,500.00	251,895.000	
	MERCIALYS	4,565.00	115,859.700	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES	8,300.00	244,850.000	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL	6,000.00	76,020.000	
	VASTNED RETAIL	5,200.00	247,702.000	
	CORIO NV	13,400.00	606,216.000	

	WERELDHAVE NV	4,200.00	278,250.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 15	83,077.00	5,734,273.660	
	組入時価比率 : 10.51%		(767,016,445)	
	合計時価比率 : 10.65%			
	LINK REIT/THE	428,000.00	8,251,840.000	
	GZI REAL ESTATE INVESTMENT TRU	393,000.00	1,186,860.000	
	CHAMPION REIT	80,000.00	261,600.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 3	901,000.00	9,700,300.000	
	組入時価比率 : 1.58%		(115,433,570)	
	合計時価比率 : 1.60%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	148,600.00	159,002.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	200,000.00	210,000.000	
	ING PROPERTY TRUST	245,000.00	193,550.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 3	593,600.00	562,552.000	
	組入時価比率 : 0.53%		(38,411,051)	
	合計時価比率 : 0.53%			
投資証券計			5,843,071,641	
			(5,843,071,641)	
合計			7,202,411,843	
			(7,202,411,843)	

(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 87銘柄	57.74%	58.49%
英ポンド	投資証券 10銘柄	8.38%	8.49%
カナダドル	投資証券 9銘柄	1.34%	1.35%
ユーロ	新株予約権証券 1銘柄	0.00%	0.00%
ユーロ	投資証券 15銘柄	10.51%	10.65%
香港ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.25%	0.25%
香港ドル	投資証券 3銘柄	1.58%	1.60%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	2.23%	2.26%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 17銘柄	16.15%	16.36%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.53%	0.53%

(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22年2月5日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	7,151,284,448円
負債総額	19,436,104円
純資産総額（ - ）	7,131,848,344円
発行済数量	10,191,715,583口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6998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22年2月5日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	273,941,894,257円
負債総額	8,576,468,271円
純資産総額（ - ）	265,365,425,986円
発行済数量	232,795,973,042口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1399円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年2月5日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	276,766,055,423円
負債総額	457,507,647円
純資産総額（ - ）	276,308,547,776円
発行済数量	233,964,723,530口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1810円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年2月5日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	427,510,501,972円
負債総額	70,238,000円
純資産総額（ - ）	427,440,263,972円
発行済数量	391,593,540,030口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0915円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成22年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	416,289,840,072円
負債総額	4,239,961,990円
純資産総額（ - ）	412,049,878,082円
発行済数量	339,505,684,277口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2137円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成22年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	3,462,918,515円
負債総額	457,000円
純資産総額（ - ）	3,462,461,515円
発行済数量	5,166,400,149口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6702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22年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	6,345,427,306円
負債総額	100,535,000円
純資産総額（ - ）	6,244,892,306円
発行済数量	9,873,832,979口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6325円

## 第5【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期	12,252,099,717	3,511,628,988
第2期	2,271,286,181	1,714,151,191
第3期	1,780,961,356	925,938,640

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

## 第四部【特別情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

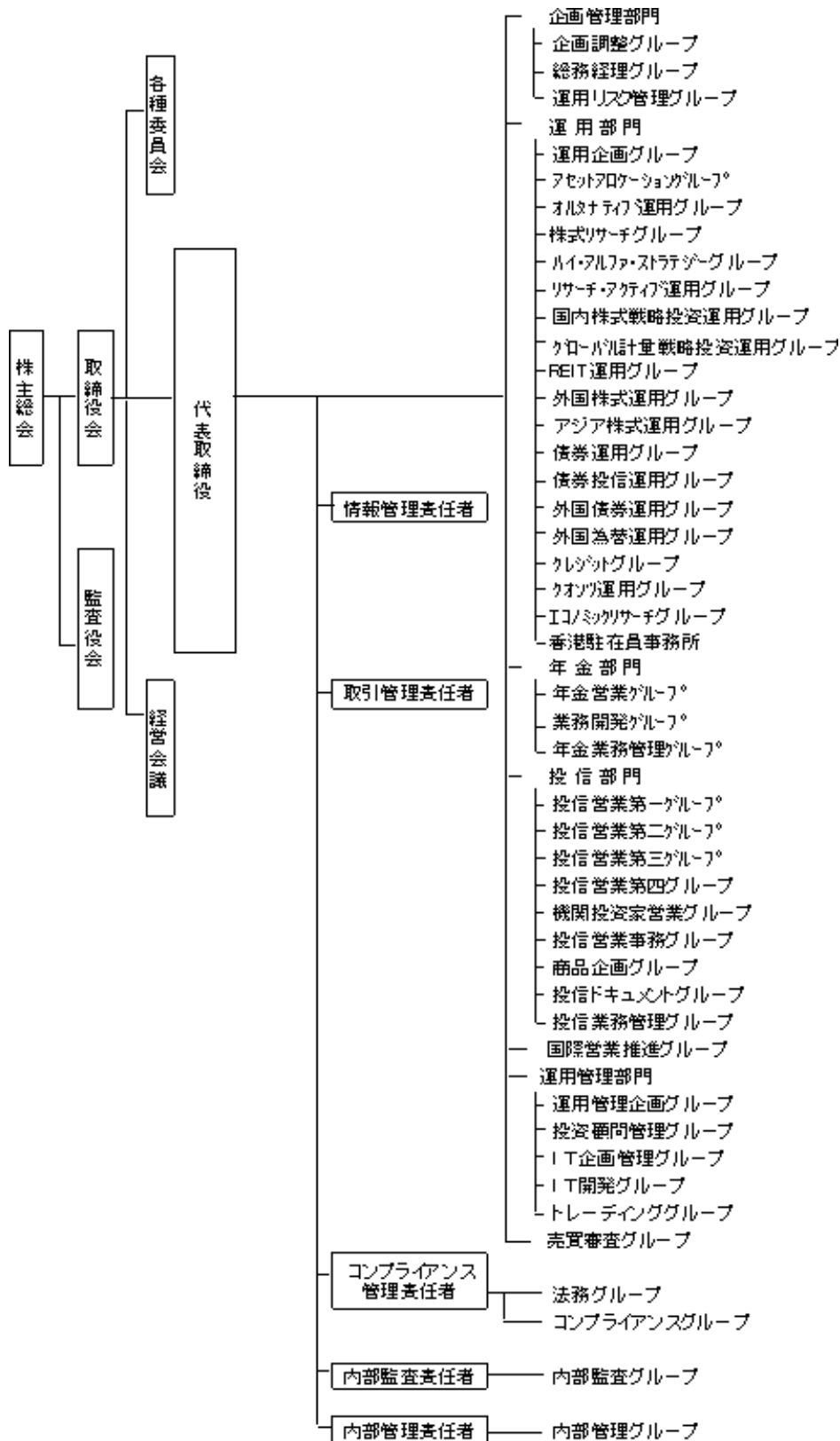
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

##### 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22年1月29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、代表取締役を選任し、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、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

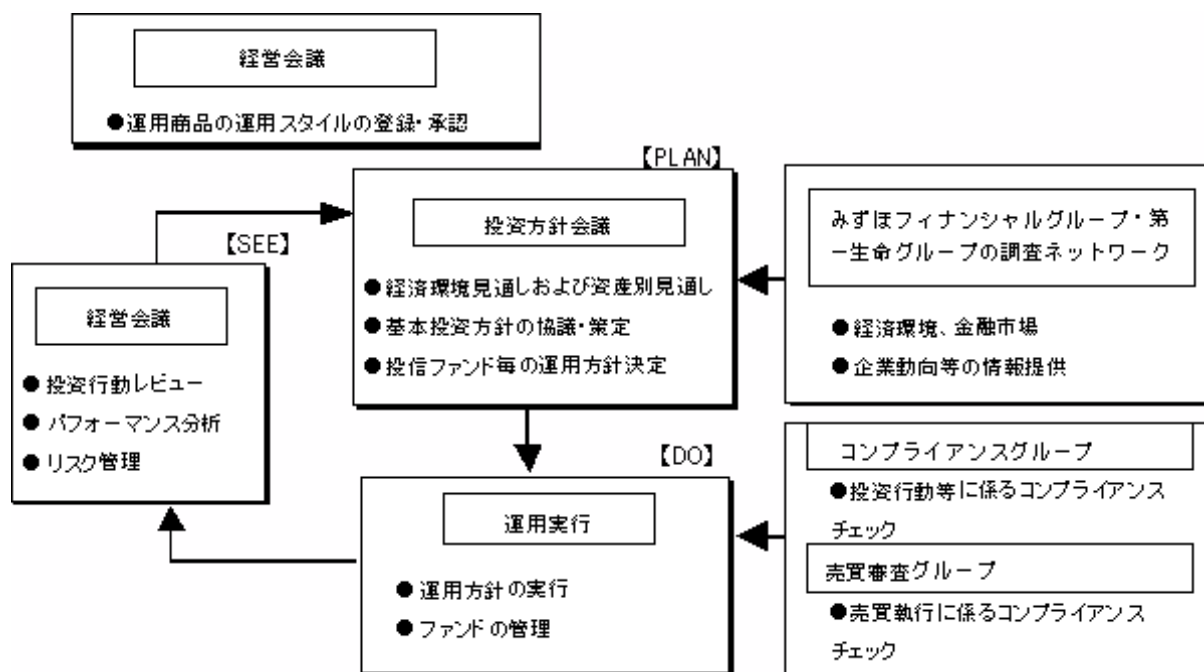
## 投資運用の意思決定機構

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登録および承認は、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、委員長は社長とします。

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回の経営会議において、検討・評価されます。



上記体制は平成22年1月29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22年1月29日現在、委託会社の運用する投資信託は281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	19	94,145,604,881
追加型株式投資信託	247	3,852,185,069,316
単位型公社債投資信託	14	118,013,883,237
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	1,568,460,149
合計	281	4,065,913,017,583

### 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24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第2条により改正前の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表およ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23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表および第25期中間会計期間（自平成21年4月1日至平成21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監査および中間監査を受けております。

なお、新日本有限責任監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成20年7月1日をもって新日本監査法人から名称変更しております。



## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	13,267,152	12,558,999
前払費用	64,301	54,242
未収委託者報酬	3,423,783	2,254,741
未収運用受託報酬	-	1,046,291
未収投資助言報酬	-	2
未収収益	2 1,933,135	197,045
未収消費税等	-	98,402
繰延税金資産	553,910	369,826
その他	43,115	23,865
流動資産計	19,285,400	16,855,752
固定資産		
有形固定資産	488,486	501,481
建物	1 335,163	1 283,511
器具備品	1 153,323	1 201,169
建設仮勘定	-	16,799
無形固定資産	616,621	721,812
商標権	1 2,104	1 1,335
ソフトウェア	1 606,677	1 555,121
ソフトウェア仮勘定	-	157,595
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 691	1 611
投資その他の資産	5,842,772	4,051,090
投資有価証券	3,097,362	498,041
関係会社株式	1,261,144	1,661,144
繰延税金資産	233,849	442,390
長期差入保証金	1,194,310	1,169,961
その他	83,032	306,478
貸倒引当金	26,925	26,925
固定資産計	6,947,880	5,274,384
資産合計	26,233,280	22,130,137

（単位：千円）

	第23期 （平成20年3月31日現在）	第24期 （平成21年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	162,809	37,445
未払金	2,186,170	1,293,636
未払収益分配金	8,470	8,201
未払償還金	50,930	48,993
未払手数料	1,527,000	931,529
その他未払金	599,769	304,912
未払費用	2 1,653,424	2 1,040,620
未払法人税等	2,575,999	179,557
未払消費税等	316,821	-
賞与引当金	687,832	618,303
その他	-	20,741
流動負債計	7,583,058	3,190,304
固定負債		
役員退職慰労引当金	179,237	145,732
退職給付引当金	334,280	404,437
固定負債計	513,518	550,169
負債合計	8,096,577	3,740,474
（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	13,718,238	13,962,732
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	7,040,000	10,040,000
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	6,054,944	3,299,438
株主資本合計	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	10,012	1,547
評価・換算差額等合計	10,012	1,547
純資産合計	18,136,703	18,389,662
負債・純資産合計	26,233,280	22,130,137

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	32,833,957		24,552,133	
顧問料	6,804,888		-	
運用受託報酬	-		4,509,994	
投資助言報酬	-		1,228,096	
その他営業収益	863,734		697,007	
営業収益計		40,502,581		30,987,232
営業費用				
支払手数料	14,748,737		10,967,681	
広告宣伝費	830,858		488,151	
公告費	3,293		-	
受益証券発行費	2,167		-	
調査費	6,268,709		5,076,631	
調査費	2,415,829		2,506,175	
委託調査費	3,852,880		2,570,455	
委託計算費	345,695		325,174	
営業雑経費	1,143,457		812,013	
通信費	33,290		35,872	
印刷費	1,041,499		732,985	
協会費	22,173		25,313	
諸会費	41		41	
支払販売手数料	46,452		17,800	
営業費用計		23,342,919		17,669,652
一般管理費				
給料	4,082,147		4,587,983	
役員報酬	1 223,147		1 234,353	
給料・手当	3,258,097		3,647,502	
賞与	600,902		706,127	
交際費	44,264		44,085	
寄付金	4,010		4,462	
旅費交通費	309,129		308,237	
租税公課	103,549		82,762	
不動産賃借料	754,728		801,086	
退職給付費用	88,449		106,223	
固定資産減価償却費	337,808		330,412	
福利厚生費	23,757		22,556	
修繕費	16,394		6,755	
賞与引当金繰入	687,832		618,303	
役員退職慰労引当金繰入	60,123		42,570	
役員退職金	528		13,175	
機器リース料	1,207		973	
事務委託費	279,797		247,087	
消耗品費	76,448		84,099	
器具備品費	10,563		6,094	
諸経費	204,099		177,386	
一般管理費計		7,084,837		7,484,253
営業利益		10,074,823		5,833,325

（単位：千円）

	第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）		第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	92,575		4,558	
受取利息	59,127		59,458	
時効成立分配金	298		164	
為替差益	14,223		-	
雑収入	7,064		5,482	
先物利益	-		180,422	
営業外収益計		173,289		250,086
営業外費用				
為替差損	-		24,553	
時効成立後支払分配金	557		517	
投資信託解約損	109,677		38,254	
営業外費用計		110,234		63,325
経常利益		10,137,878		6,020,086
特別利益				
関係会社株式売却益	39,215		-	
貸倒引当金戻入益	123		-	
特別利益計		39,338		-
特別損失				
固定資産除却損	2	10,466	2	14,476
ゴルフ会員権売却損		5,200		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,000
投資有価証券評価損		-		484,009
退職給付費用		106,395		-
特別損失計		122,062		504,485
税引前当期純利益		10,055,154		5,515,600
法人税、住民税及び事業税		4,252,414		2,301,373
法人税等調整額		172,622		30,266
法人税等合計		4,079,792		2,271,106
当期純利益		5,975,362		3,244,494

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	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	4,640,000	7,040,000
	当期変動額	2,400,000	3,000,000
	当期末残高	7,040,000	10,040,000
	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	4,843,582	6,054,944
	当期変動額		
	剰余金の配当	2,364,000	3,000,000
	別途積立金の積立	2,400,000	3,000,000
	当期純利益	5,975,362	3,244,494
	当期末残高	6,054,944	3,299,438
	株主資本合計		
	前期末残高	14,535,353	18,146,716
	当期変動額	3,611,362	244,494
	当期末残高	18,146,716	18,391,210
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	992	10,012
	当期変動額(純額)	11,004	8,464
	当期末残高	10,012	1,547
純資産合計			
	前期末残高	14,536,346	18,136,703
	当期変動額	3,600,357	252,958
	当期末残高	18,136,703	18,389,662

[次へ](#)

## 重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：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</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却しております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 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。</p> <p>4. 外貨建の資産およ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。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 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</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 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。</p> <p>(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。</p> <p>(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</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p>

<p style="text-align: center;">第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(会計方針の変更)</p> <p>従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。</p> <p>この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。</p> <p>この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。</p> <p>なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(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。</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>税抜方式によっております。</p>	<p>5. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>(3) 同左</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法</p> <p>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。</p> <p>7. 消費税等の処理方法</p> <p>同左</p>

## 会計方針の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、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の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、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。</p>

## 表示方法の変更

第23期（平成20年3月31日現在）	第24期（平成21年3月31日現在）
<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>（貸借対照表） 前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>（損益計算書） 前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>	<p>（貸借対照表）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</li> <li>前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</li> </ol> <p>（損益計算書） 前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>



## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第23期（平成20年3月31日現在）			第24期（平成21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	373,021千円		建物	426,679千円	
器具備品	229,532千円		器具備品	290,397千円	
商標権	5,582千円		商標権	6,351千円	
ソフトウェア	653,371千円		ソフトウェア	648,713千円	
電話施設利用権	905千円		電話施設利用権	985千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産およ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およ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	未収収益	379,257千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円
流動負債	未払費用	641,087千円	流動負債	未払費用	345,744千円

## （損益計算書関係）

第23期 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	第24期 （自平成20年4月1日 至平成21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 3,634千円	建物 2,251千円
器具備品 5,271千円	器具備品 9,818千円
ソフトウェア 1,560千円	ソフトウェア 2,406千円

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29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20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20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21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

## (リース取引関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)				第24期 (自平成20年4月1日 至平成21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および期末残高相当額				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および期末残高相当額			
	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	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円	減価償却累計額相当額	52,335千円	-	52,335千円
期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円	期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円
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 期末残高相当額	22,595千円	39,602千円	62,197千円	未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		25,173千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		20,191千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,754千円		支払利息相当額		1,501千円	
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 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

(有価証券関係)

## 第23期（平成20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で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（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	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
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）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

## 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）
574,322	3,196	112,873

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

## 貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

## 8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

## 第24期（平成21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で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

## 4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（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	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	146,101	146,101	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	271,802	269,192	2,610
小計	417,904	415,294	2,610
合計	417,904	415,294	2,610

## 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）
3,021,000	20,615	58,869

## 7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

## 8. その他有価証券のうち満期があるものおよび満期保有目的の債券の今後の償還予定額

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 第23期（平成20年3月31日現在）

## 1．取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価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．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20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	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

## （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。

## 第24期（平成21年3月31日現在）

## 1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を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。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	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。
(5)取引に係るリスク管理体制	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。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価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. 取引の時価等に関する事項

## (1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21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	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
	合計	148,527	-	150,782	2,255

(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24期(平成21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	212,667	-	230,215	17,547
	合計	212,667	-	230,215	17,547

(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。

## （退職給付関係）

## 第23期（平成20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

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成20年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		334,280
	退職給付引当金		334,280
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		165,213
	確定拠出年金	拠出額	29,631
	退職給付費用		194,844

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第23期 (平成20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

## 第24期（平成21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

当社は、原則法を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成21年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務		431,448
	未認識数理計算上の差異		27,011
	退職給付引当金		404,437
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		71,958
	確定拠出年金	拠出額	34,264
	退職給付費用		106,223

## 3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第24期 (平成21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. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	197,866	19,218
未払事業所税	5,714	6,269
賞与引当金	279,947	251,649
未払法定福利費	27,884	27,146
未払確定拠出年金掛金	2,610	2,667
減価償却超過額	-	7,579
減価償却超過額（一括償却資産）	10,139	8,559
繰延資産償却超過額（税法上）	27,940	46,274
その他（未払金等）	1,807	461
退職給付引当金	136,052	164,605
役員退職慰労引当金	72,949	59,313
ゴルフ会員権評価損	3,135	5,577
投資有価証券評価損	-	196,991
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	6,871	1,062
繰延税金資産合計	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	<u>-</u>	<u>-</u>
差引繰延税金資産の純額	<u>787,759</u>	<u>812,216</u>

## 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23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24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。

（関連当事者との取引）

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

## (1)親会社および法人主要株主等

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				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名， 出向3名， 転籍2名	資産の運用および 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	833,702	未収 収益	219,740
								販売手数料 の支払	46,452	-	-
								保険料の支 払	5,707	-	-

## 取引条件およ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。

## (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	1,096,514	未払費用	456,913
	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	466,450	未払費用	184,052

## 取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を助言した個別契約により決定しております。
- （注2）上記の取引金額および期末残高には、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				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	2,104,660	未払手数料	145,839
	株式会社みずほコーポレート銀行	東京都千代田区	10,709億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	739,368	未払手数料	137,112
	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 業務委託料の支払	340,983 16,800	未払費用 -	153,240 -

## 取引条件およ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。

## 第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

## （追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

## (1)親会社および法人主要株主等

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				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名、 出向3名、 転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

## 取引条件およ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。

## (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	933,784	未払費用	236,518
	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	324,748	未払費用	109,093

## 取引条件およ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) 上記の取引金額および期末残高には、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				
兄弟会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	6,500億円	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	1,531,236	未払手数料	96,917
								預金の引出(純額)	300,370	現金・預金	322,365
								受取利息	894	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	10,709億円	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	701,162	未払手数料	91,628
								預金の引出(純額)	1,034,219	現金・預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収収益	4,158
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	299,054	未払費用	117,438	
							業務委託料の支払	17,550	未払費用	2,677	

## 取引条件およ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。

## (1株当たり情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭	1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25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、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	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、新株引受権付社債およ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23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,975,362千円	3,244,494千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

## (重要な後発事象)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。 (出資の総額400,000千円、資本金400,000千円)	平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management (HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。 当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。  <子会社の概要> 商号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設立年月日：平成21年3月19日 資本金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出資の総額：500,000千円 出資比率：当社100%

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	
現金・預金	10,803,774
前払費用	87,625
未収委託者報酬	3,140,781
未収運用受託報酬	1,453,060
未収投資助言報酬	261,117
未収収益	235,649
繰延税金資産	453,470
その他	54,240
流動資産計	16,489,720
固定資産	
有形固定資産	704,558
建物	1 260,612
器具備品	1 330,061
建設仮勘定	113,884
無形固定資産	848,262
商標権	1 951
ソフトウェア	1 561,904
ソフトウェア仮勘定	277,687
電話加入権	7,148
電話施設利用権	1 571
投資その他の資産	6,281,022
投資有価証券	2,046,821
関係会社株式	2,161,144
繰延税金資産	275,421
長期差入保証金	1,171,581
その他	652,978
貸倒引当金	26,925
固定資産計	7,833,843
資産合計	24,323,563

（単位：千円）

	第25期中間会計期間末 （平成21年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	104,759
未払金	2,018,968
未払収益分配金	534,811
未払償還金	50,425
未払手数料	1,275,982
その他未払金	157,750
未払費用	1,571,027
未払法人税等	985,116
未払消費税等	78,006
前受収益	4,749
賞与引当金	613,388
その他	15,176
	流動負債計
	5,391,192
固定負債	
退職給付引当金	448,442
役員退職慰労引当金	137,263
	固定負債計
	585,706
負債合計	5,976,898
（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	13,655,387
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	11,650,000
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	1,382,093
	株主資本計
	18,083,865
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	262,800
	評価・換算差額等計
	262,800
純資産合計	18,346,665
負債・純資産合計	24,323,563

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	14,018,274	
運用受託報酬	2,081,446	
投資助言報酬	507,261	
その他営業収益	345,980	
	営業収益計	16,952,963
営業費用		
支払手数料	7,634,536	
広告宣伝費	69,199	
公告費	1,531	
調査費	2,406,583	
調査費	1,289,713	
委託調査費	1,116,870	
委託計算費	178,892	
営業雑経費	352,091	
通信費	16,109	
印刷費	318,417	
協会費	10,612	
諸会費	18	
支払販売手数料	6,933	
	営業費用計	10,642,834
一般管理費		
給料	2,035,715	
役員報酬	121,117	
給料・手当	1,914,598	
交際費	22,193	
寄付金	3,450	
旅費交通費	125,038	
租税公課	42,954	
不動産賃借料	397,351	
退職給付費用	65,809	
固定資産減価償却費	1	183,213
福利厚生費	13,579	
修繕費	2,400	
賞与引当金繰入	613,388	
役員退職慰労引当金繰入	27,176	
役員退職金	1,854	
機器リース料	1,349	
事務委託費	130,563	
消耗品費	41,117	
器具備品費	1,672	
諸経費	50,382	
	一般管理費計	3,759,211
営業利益		2,550,918



（単位：千円）

	第25期中間会計期間 （自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	2,126	
受取利息	9,892	
雑収入	2,506	
投資信託解約益	313,059	
営業外収益計		327,583
営業外費用		
為替差損	4,492	
時効成立後支払分配金	255	
先物損失	627,442	
営業外費用計		632,189
経常利益		2,246,312
特別損失		
固定資産除却損	3,566	
特別損失計		3,566
税引前中間純利益		2,242,746
法人税、住民税及び事業税		1,022,198
法人税等調整額		98,107
法人税等合計		924,091
中間純利益		1,318,654

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第25期中間会計期間 (自 平成21年4月 1日 至 平成21年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	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	
	前期末残高	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	
	前期末残高	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	
	前期末残高	10,040,000
	当中間期変動額	1,610,000
	当中間期末残高	11,650,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	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	
	前期末残高	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	
	前期末残高	3,299,438
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,626,000
	別途積立金の積立	1,610,000
	中間純利益	1,318,654
	当中間期末残高	1,382,093
	株主資本合計	
	前期末残高	18,391,210
	当中間期変動額	307,345
	当中間期末残高	18,083,865
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
	当中間期変動額（純額）	264,347
	当中間期末残高	262,800
純資産合計		
	前期末残高	18,389,662
	当中間期変動額	42,997
	当中間期末残高	18,346,665

[前](#) [次](#)

## 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：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. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
3. 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 … 8～18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
4. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権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。  (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。
5. 外貨建ての資産およ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。
6. 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. 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：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 … 450,639千円 器具備品 … 333,347千円 商標権 … 6,735千円 ソフトウェア … 587,503千円 電話施設利用権 … 1,025千円

(中間損益計算書関係)

項目	第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	105,587千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21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	前事業年度末 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

(リース取引関係)

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21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 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「3. 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および中間期末残高相当額		
	器具備品	
取得価額相当額	90,601千円	
減価償却累計額相当額	63,699千円	
中間期末残高相当額	26,901千円	
未経過リース料中間期末残高相当額		
	1年以内	1年超
	21,658千円	6,401千円
	合計	
	28,059千円	
当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額		
支払リース料	12,048千円	
減価償却費相当額	11,363千円	
支払利息相当額	506千円	

第25期中間会計期間(自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)

## 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

1年以内	1年超	合計
1,609千円	2,279千円	3,888千円

## (有価証券関係)

## 第25期中間会計期間末(平成21年9月30日現在)

- 満期保有目的の債券で時価のあるもの  
該当事項はありません。
- 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの  
該当事項はありません。
- その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
株式	146,101	244,571	98,469
債券	-	-	-
その他(投資信託)	1,374,802	1,719,503	344,700
合計	1,520,904	1,964,075	443,170

## 4. 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

非上場株式(店頭売買株式を除く) 中間貸借対照表計上額

82,746千円

## (デリバティブ取引関係)

デリバティブ取引の契約額等、時価および評価損益の状況

## 1. 通貨関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末(平成21年9月30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)
通貨	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	225,100	-	217,745	7,355
	ユーロ	100,785	-	101,717	931
	英ポンド	32,363	-	30,779	1,583
	香港ドル	25,341	-	25,414	72
	豪ドル	92,700	-	94,588	1,888
シンガポールドル	14,175	-	14,295	120	
	合計	490,466	-	484,540	5,926

## 2. 株式関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末(平成21年9月30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)
株式	株価指数先物取引				
	売建	1,478,223	-	1,474,023	4,199
	合計	1,478,223	-	1,474,023	4,199

## 3. 不動産投資信託関連

対象物の種類	取引の種類	第25期中間会計期間末（平成21年9月30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）
不動産 投資信託	REIT指数先物取引 売建	114,492	-	112,752	1,740
	合計	114,492	-	112,752	1,740

## （持分法損益等）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）
該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）	
1株当たり純資産額	764,444円38銭
1株当たり中間純利益金額	54,943円95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いません。	

## （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25期中間会計期間 （自平成21年4月1日 至平成21年9月30日）
中間純利益	1,318,654千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,318,654千円
期中平均株式数	24,000株

## （重要な後発事象）

第25期中間会計期間（自平成21年4月1日 至平成21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) 自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれ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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれ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。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は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又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若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又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更  
当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟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21年3月末日現在 247,231百万円
- 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21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21年3月末日現在 3,750万円

## 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21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)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の送付
- (7)その他上記に付帯する業務

## 3【資本関係】

該当事項はありません。



### 第3【その他】

- 1 交付目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載するほか、届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し、「ファンドの概要」として、冒頭に記載します。また、目論見書の表紙裏に金融商品の販売等に関する法律に係る重要事項を記載することがあります。
- 2 交付目論見書の巻末に用語説明を掲載します。  
なお、交付目論見書の巻末に信託約款を掲載し、届出書本文第二部「ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」の詳細な内容については、当該約款を参照することで、届出書の内容の記載とすることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成22年2月24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<育成型>の平成21年1月14日から平成22年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成22年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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21年6月29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	山本禎良	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内正彦	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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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21年12月24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期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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21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21年4月1日から平成21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。

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21年2月26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 佐々木 貴司 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<育成型>の平成20年1月12日から平成21年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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している。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、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成21年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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\(前期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成20年6月13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

### 新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印  
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第23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20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

(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。