

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年4月11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」または「当ファンド」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。）

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

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））といいますが、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（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：マ資産育成）

### (5)【申込手数料】

ありません。

**(6)【申込単位】**

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24年4月12日から平成25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いずれかの休業日に該当する日（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（受付時間：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、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、

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（受付時間：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、契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

**4 「育成型」(自動けいぞく投資専用)のファンドです。**

信託財産の成長を重視します。分配金は、決算ごとに原則として経費控除後の利子・配当等収益の範囲内から支払われ、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※決算は原則として毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日。)です。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

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

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
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				
	年4回	日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	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))	その他 ( )	アフリカ			その他 (MSCIコクサイ・インデックス、 NOMURA - BPI総合、シティ グループ世界国債 インデックス、東証REIT指数、 S&P先進国REITインデックス)
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。

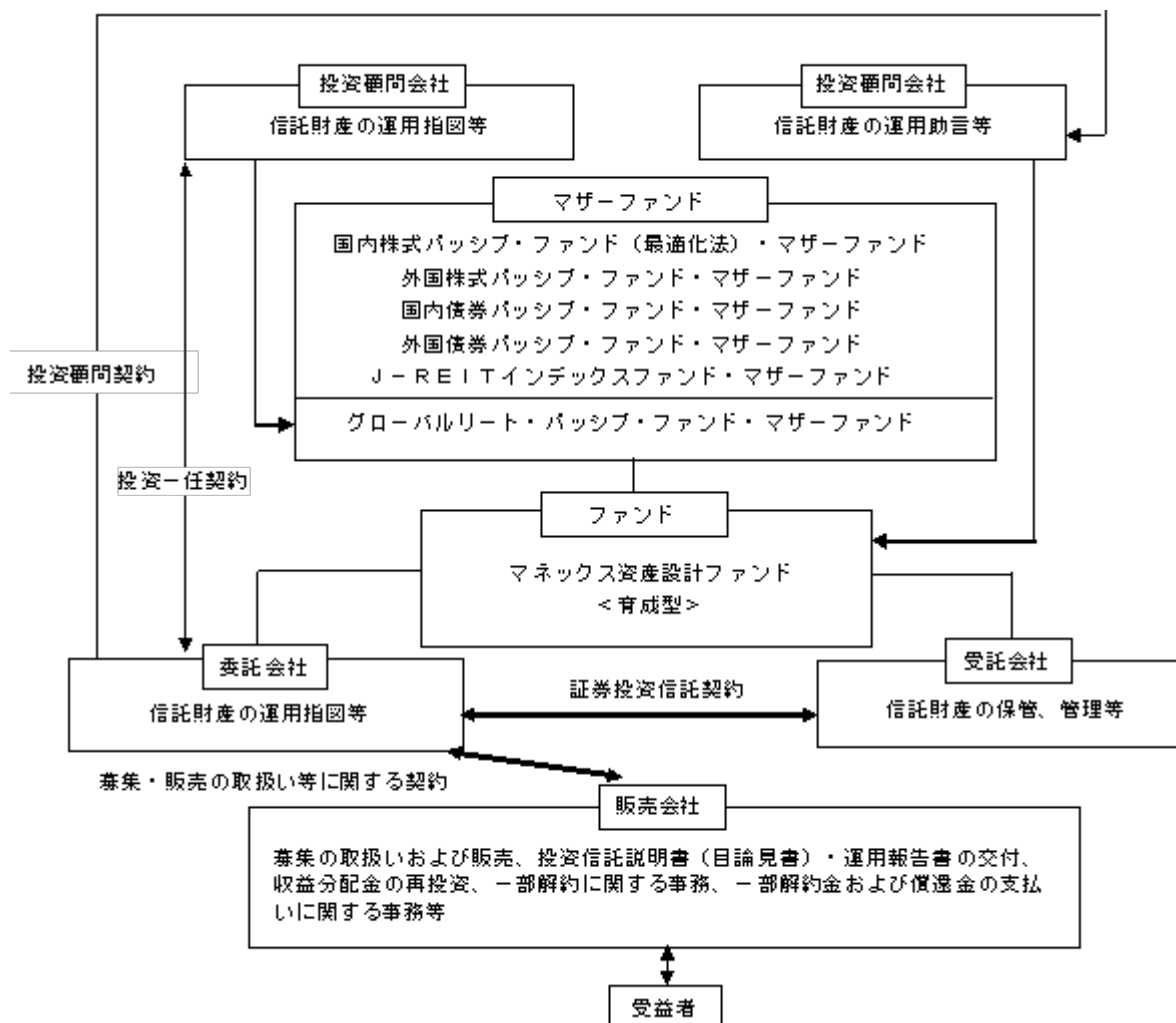
- ・投資信託協会への照会

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

## (2)【ファンドの沿革】

平成19年1月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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



います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、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。

・「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）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

・「投資一任契約」の概要

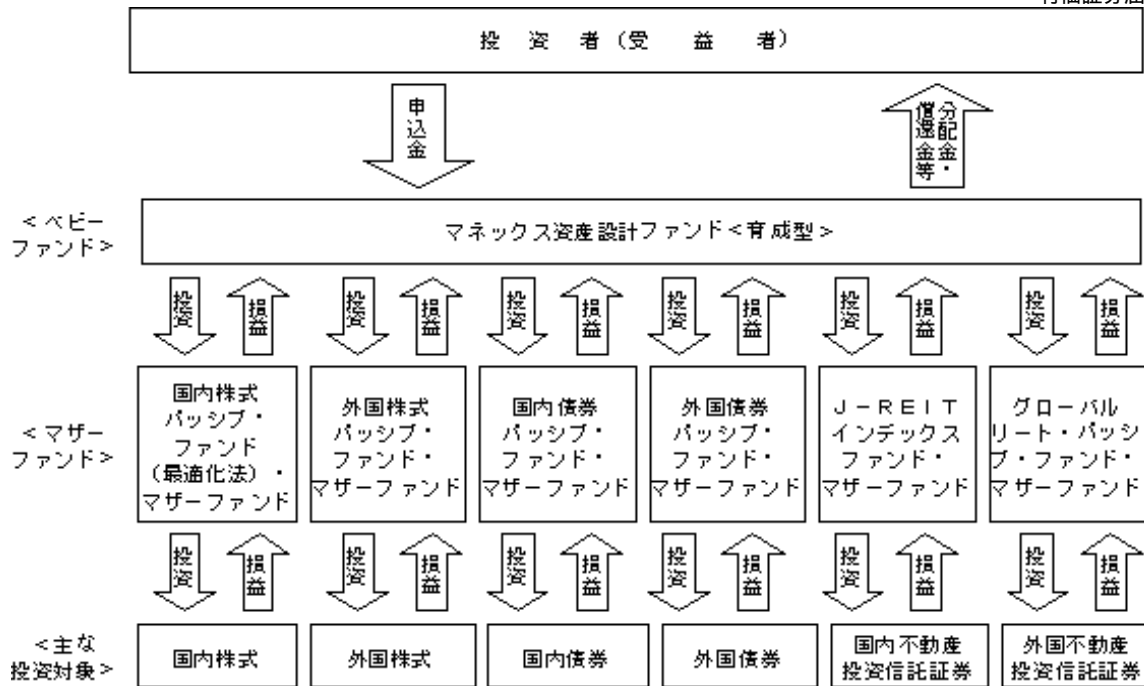
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

## 資本金の額

20億円（平成24年1月31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24年1月31日現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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

## <投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。基本資産配分は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

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

基本資産配分比率については、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

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

リート（REIT）とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

## (2)【投資対象】

### 1. 投資の対象とする資産の種類（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。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

(2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### 2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

- (1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- (2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (5) J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
- (6) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (7) 株券または新株引受権証書
- (8) 国債証券
- (9) 地方債証券
- (10) 特別の法律により法人の発行する債券
- (11) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- (12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- (13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- (14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- (15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- (16) コマーシャル・ペーパー
- (17) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
- (18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
- (19) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
- (20) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- (21) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- (22) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- (23) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- (24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- (26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

(28)外国の者に対する権利で上記(27)の有価証券の性質を有するもの

なお、(7)の証券または証書、(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(8)から(12)までの証券および(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(8)から(12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(19)の証券および(20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

### 3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

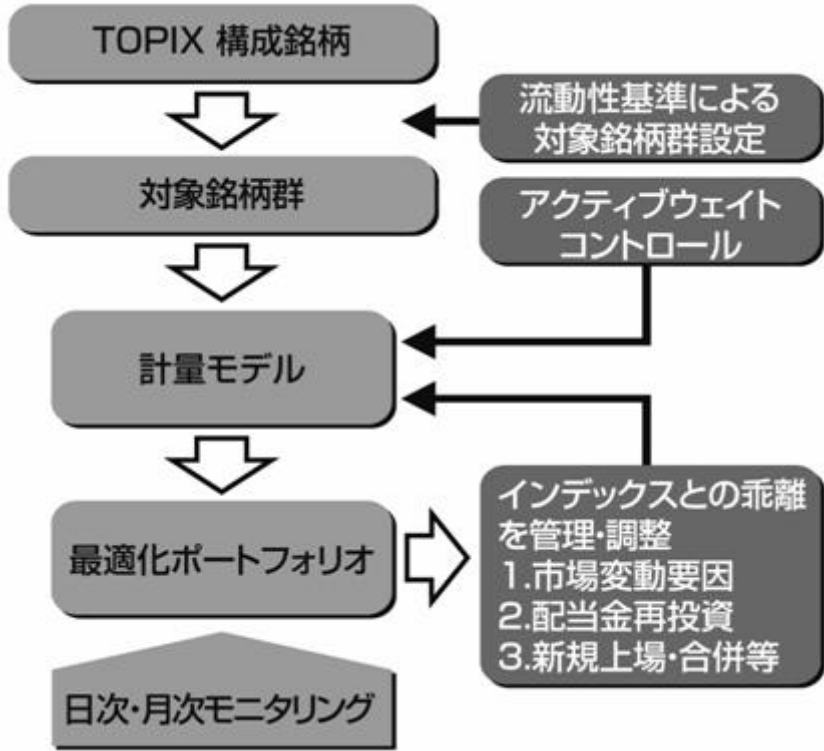
委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

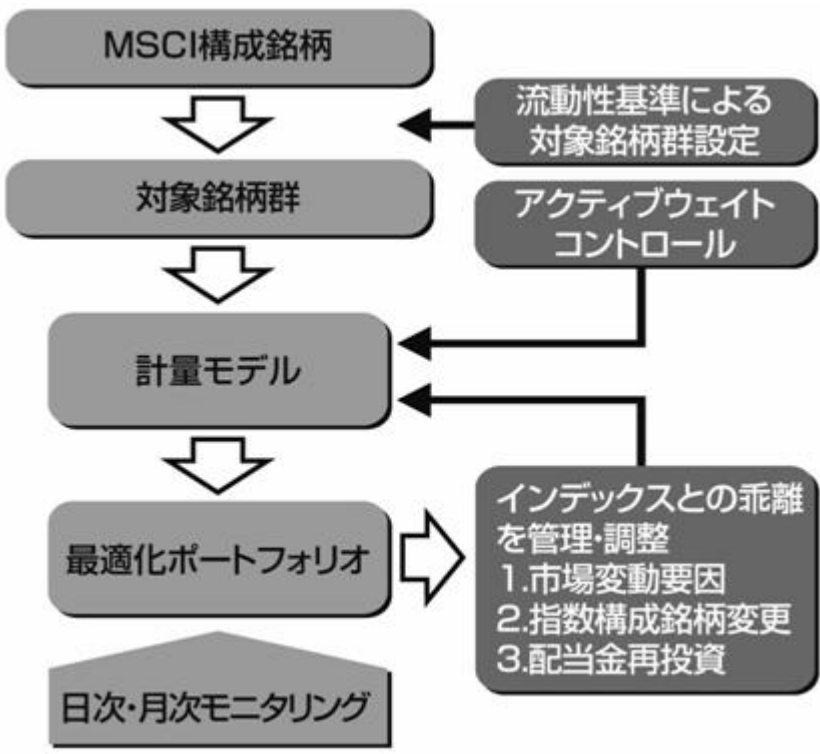
4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

## (参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注）TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2. 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。</li> <li>3. 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。</li> <li>4. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> </ol>

運用プロセス	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定            マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築            インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理            日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。            インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> 
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

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

<p>投資態度</p>	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>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。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> 

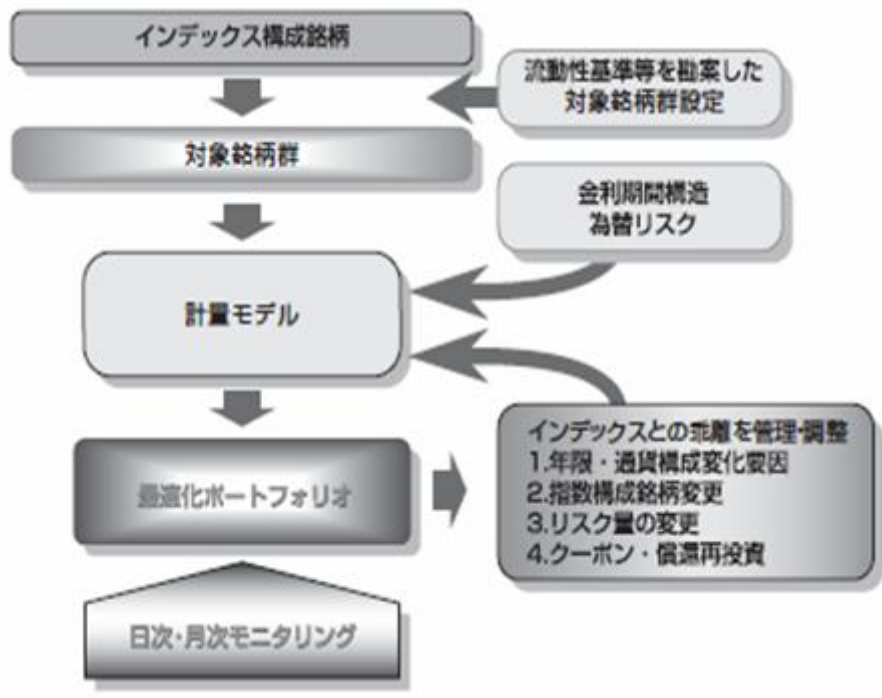


主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>(注)NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p>
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	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 1.債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2.金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン、償還再投資</li> </ul>

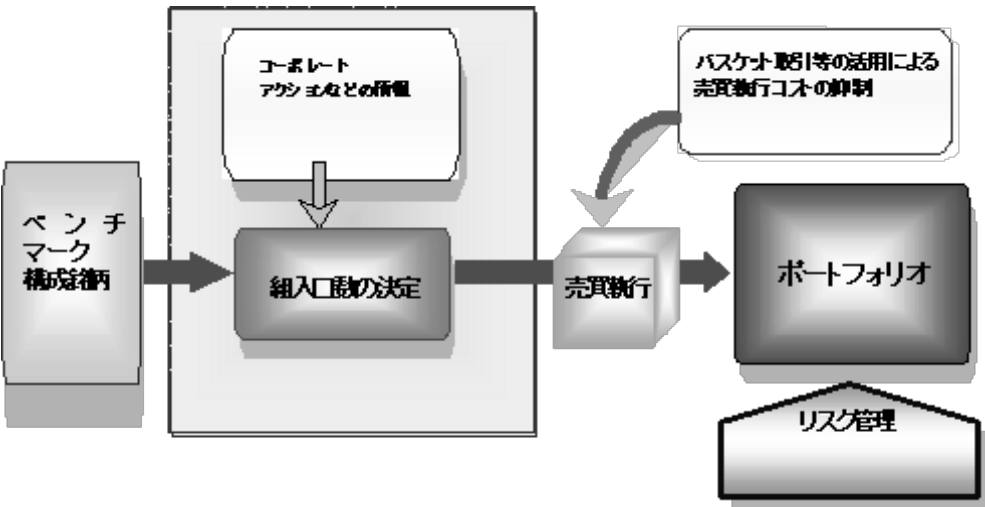
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（注）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>（注）シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。</p> <p>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。</p> </div> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>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。</p>

運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定  シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>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。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理  日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利期間構造為替リスク] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     F --&gt; G[日次・月次モニタリング]     G --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限・通貨構成変化要因 2.指数構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資]     H --&gt; D   </pre>
主な投資制限	<p>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せん。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

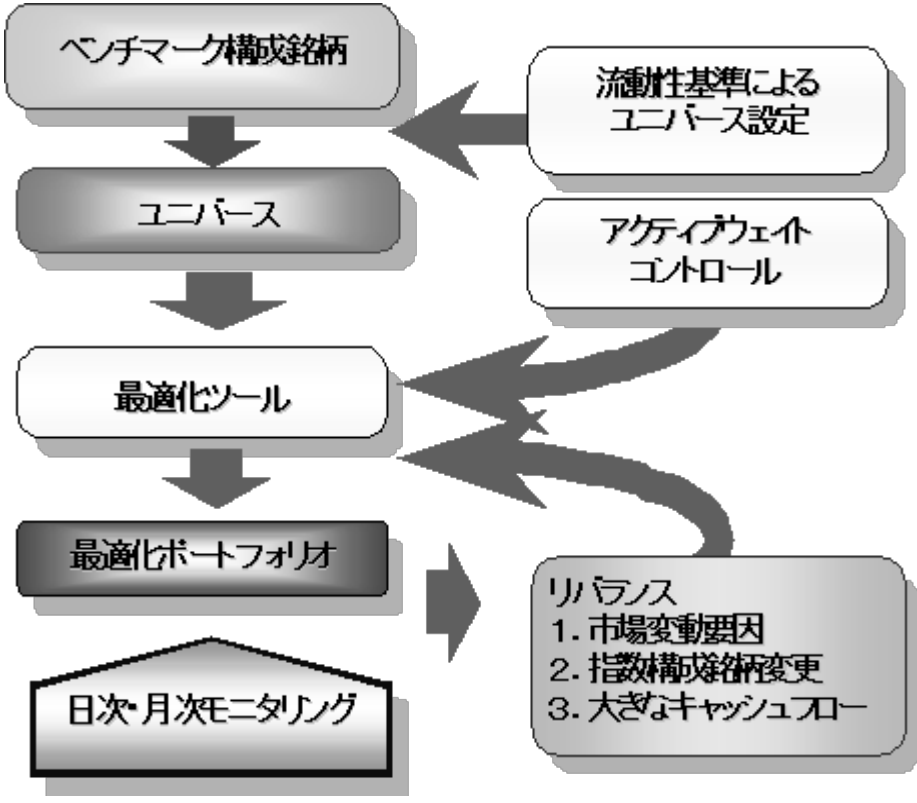
ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
-------	-------------------------------

基本方針	<p>東証 R E I T 指数（配当込み）（注）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（注）東証 R E I T 指数の指数値及び東証 R E I T 指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証 R E I T 指数に関するすべての権利及び東証 R E I T 指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証 R E I T 指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の商標の使用もしくは東証 R E I T 指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証 R E I T 指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証 R E I T 指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>㈱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。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証 R E I T 指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	<p>東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証 R E I T 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います。</li> <li>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。</li> <li>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 R E I T 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。</li> </ol>

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>

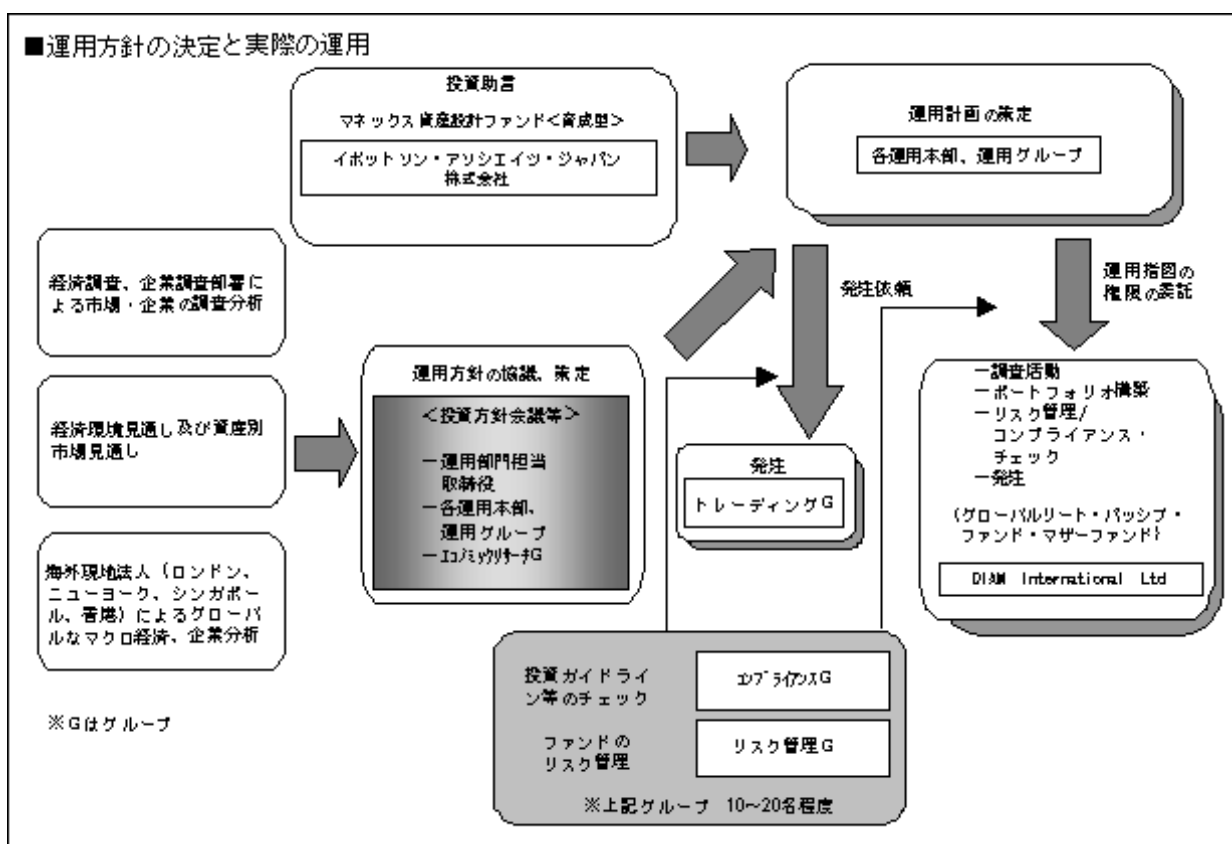
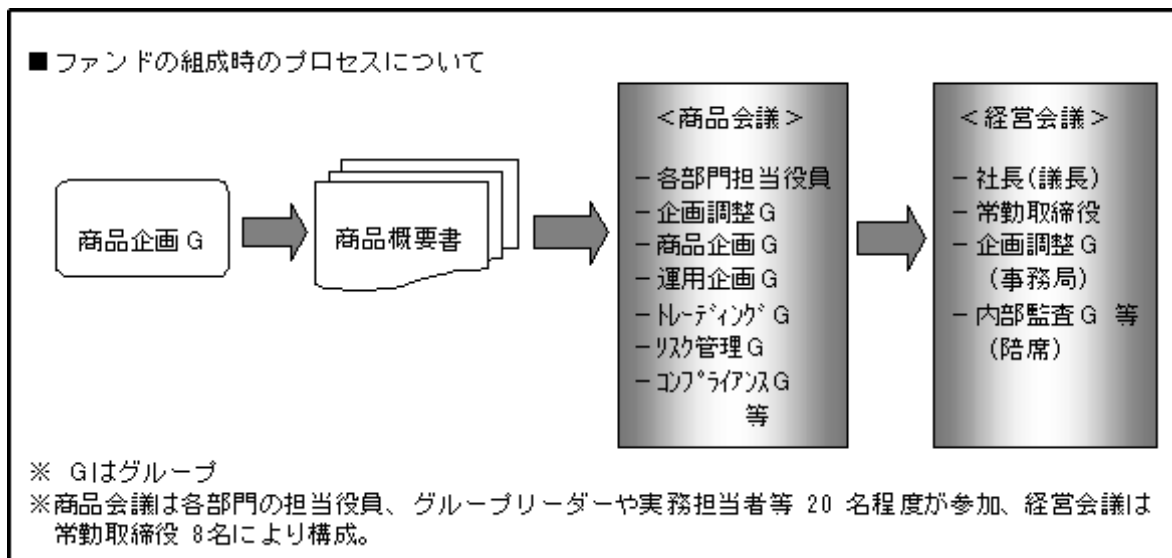
ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	----------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本・円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（注）「Standard &amp; Poor's」、「S&amp;P」、は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社の使用のためにライセンスされているものです。当マザーファンドは、Standard &amp; 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 &amp; 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。</p> <p>当マザーファンドは、The McGraw-Hill Companies, Inc. の一部門であるStandard &amp; Poor's（以下「S&amp;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&amp;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&amp;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&amp;Pのライセンシーに対する唯一の関係は、S&amp;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&amp;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&amp;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&amp;Pは、S&amp;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&amp;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&amp;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。</p> <p>S&amp;Pは、S&amp;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&amp;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&amp;Pは、S&amp;P先進国REITインデックス又はそれらに含まれるデータの使用により、ライセンシー、当マザーファンドの所有者又はその他の人や組織に生じた結果に関して、明示的にも黙示的にも保証しないものとします。また、S&amp;Pは、S&amp;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&amp;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。</p>
主な投資対象	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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 &amp; 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。</p> <p>運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</p> <p>不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。</p>

運用プロセス	<p>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 &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの</li> <li>・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</li> </ul> 
主な投資制限	<p>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。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3)【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

## &lt; ファンドの組成時のプロセスについて &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、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

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

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

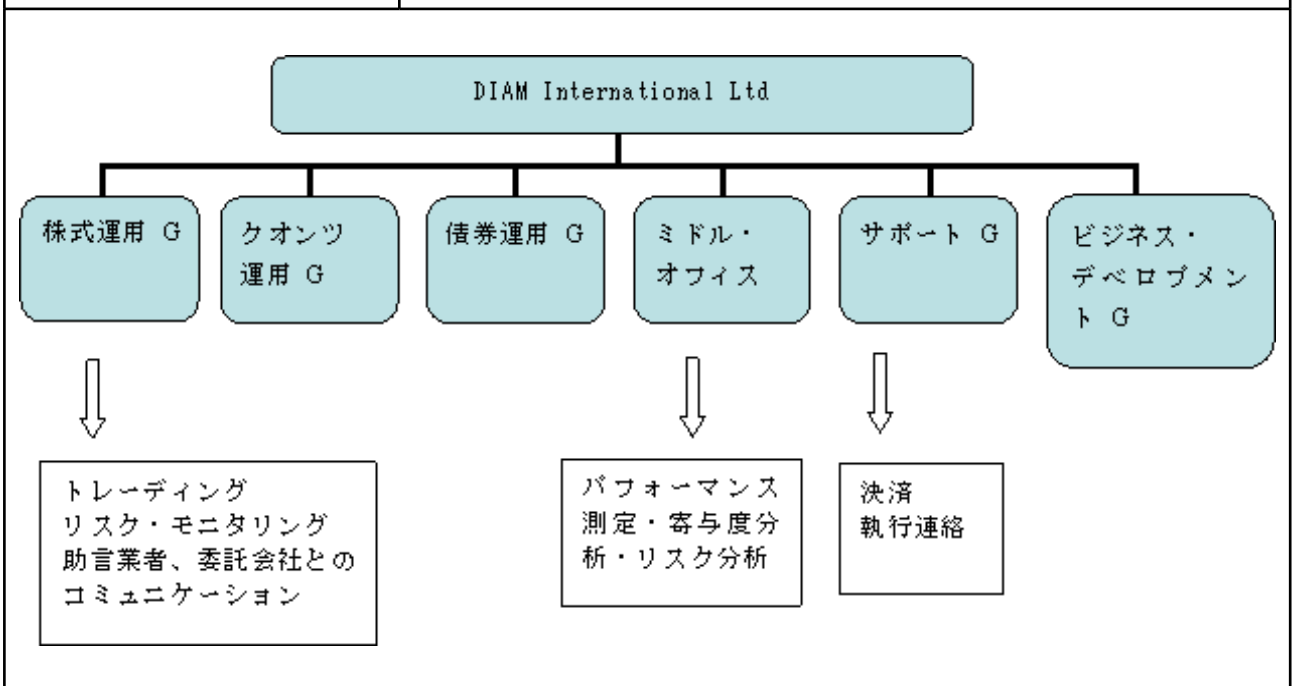
なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

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

## 2)グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。

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



上記運用体制は、平成24年1月31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（毎年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」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

## 収益分配金の再投資

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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

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ますものとしてします。

2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.から6.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1.から6.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ます。）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（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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1.～2.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) 上記1)1.2.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ます。
- 2) 上記1)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、上記2)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) 上記1)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、上記2)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) 上記1)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) 上記1)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) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に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) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 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 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

#### 資産配分リスク

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

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

#### 株価変動リスク

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリーートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリーートの価格は下落し、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。

#### リーートの価格変動リスク

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

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

リートが投資対象とする建物の用途規制等、不動産等に係る規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があり、その結果、当ファンドの基準価額が下がる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、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

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

### 信用リスク

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

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

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

### 流動性リスク

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

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

### < 分配金に関する留意点 >

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

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

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

### < その他の留意点 >

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

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

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

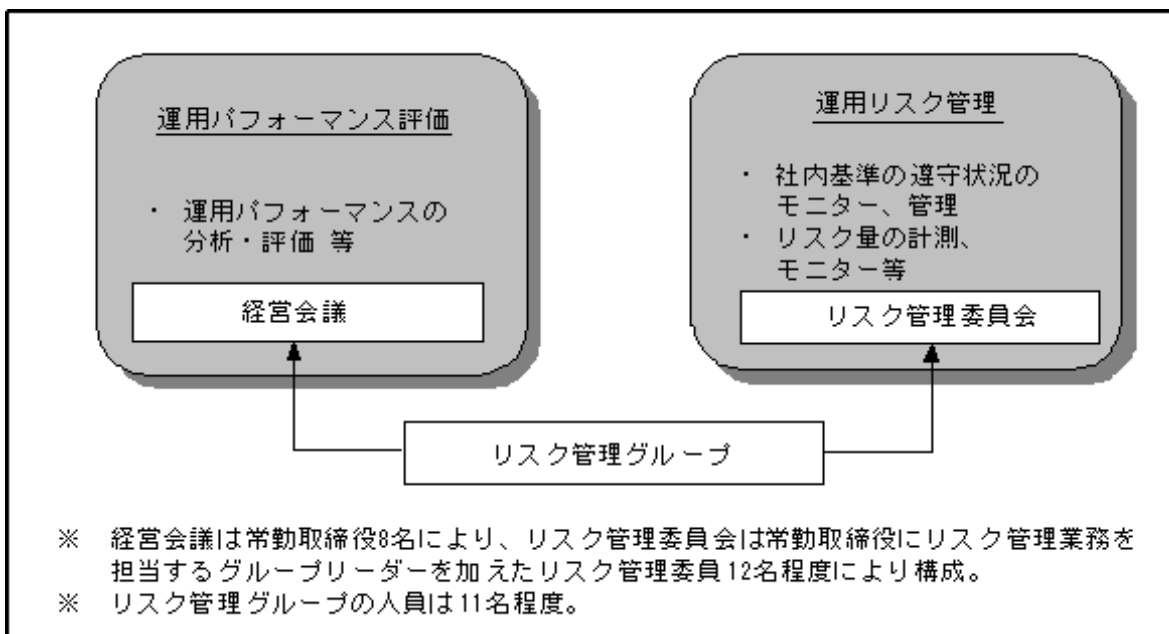
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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

#### < 運用評価・運用リスク管理体制 >

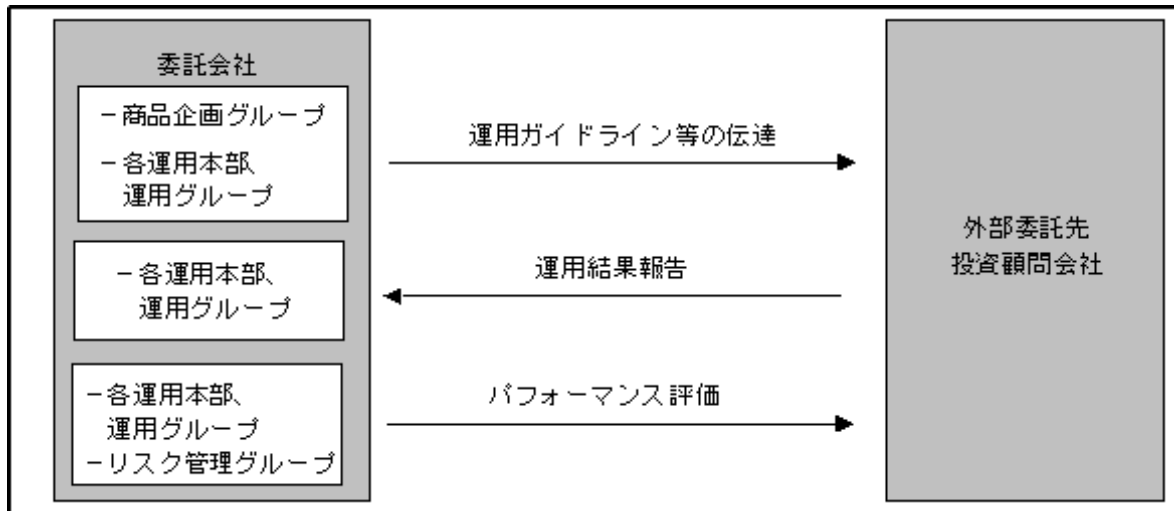




運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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

#### < 外部委託先に関する管理体制 >



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

上記体制は平成24年1月31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	
		総額	信託財産の純資産総額に対して年率0.9975% (税抜0.95%)
毎日	信託報酬	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、販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。

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

信託報酬は日々の基準価額に反映され、毎年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	投資顧問会社が受ける総報酬率
25億円以下の部分	年率0.20%
25億円超75億円以下の部分	年率0.18%
75億円超の部分	年率0.15%

当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）が受ける報酬は、当ファンドまたはマザーファンドから直接的に支払われません。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、上記内容が変更になることがあります。

#### (4)【その他の手数料等】

##### 1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%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ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年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、上記内容が変更になることがあります。

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

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

## (5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

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

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

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

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

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成24年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成24年1月31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	7,536,061,427	98.44
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		119,694,971	1.56
合 計（純資産総額）		7,655,756,398	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24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	247,698,726,514	98.78
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,047,879,515	1.22
合 計（純資産総額）		250,746,606,029	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24年1月31日現在

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

株式	米国	141,610,027,822	53.67
	英国	25,821,007,947	9.79
	カナダ	14,833,630,664	5.62
	スイス	11,496,525,772	4.36
	スウェーデン	3,626,797,518	1.37
	デンマーク	1,261,680,757	0.48
	ノルウェー	914,944,286	0.35
	アイルランド	1,692,244,521	0.64
	オランダ	3,107,068,761	1.18
	ベルギー	1,164,361,384	0.44
	ルクセンブルク	567,696,351	0.22
	フランス	10,289,410,715	3.90
	ドイツ	9,889,933,604	3.75
	ポルトガル	235,410,771	0.09
	スペイン	3,796,850,731	1.44
	イタリア	2,746,907,113	1.04
	フィンランド	1,015,890,449	0.39
	オーストリア	309,552,594	0.12
	ギリシャ	116,640,371	0.04
	香港	3,118,727,670	1.18
	中国	20,455,692	0.01
	シンガポール	2,099,094,858	0.80
	イスラエル	806,680,804	0.31
	オーストラリア	9,927,163,763	3.76
	ニュージーランド	127,789,308	0.05
	パナマ	159,884,860	0.06
	バミューダ諸島	604,096,391	0.23
	オランダ領キュラソー	1,235,763,867	0.47
	ケイマン諸島	283,247,888	0.11
	ガーンジー・チャネル諸島	86,864,799	0.03
	ジャージー・チャネル諸島	785,905,953	0.30
	マン島	86,496,342	0.03
	リベリア	46,454,840	0.02
モーリシャス	36,924,666	0.01	
小計	253,922,133,832	96.24	
投資信託受益証券	シンガポール	64,578,481	0.02
	オーストラリア	795,221,694	0.30
	小計	859,800,175	0.33
投資証券	米国	3,392,054,973	1.29
	英国	312,737,220	0.12
	カナダ	102,959,180	0.04
	オランダ	45,423,601	0.02
	フランス	311,017,351	0.12
	香港	112,250,600	0.04
	小計	4,276,442,926	1.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,779,707,886	1.81
合 計（純資産総額）		263,838,084,818	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24年1月31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	316,740,425,200	76.99
地方債証券	日本	27,694,655,708	6.73
特殊債券	日本	35,178,569,759	8.55
社債券	日本	29,208,091,060	7.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,582,808,193	0.63

合 計（純資産総額）	411,404,549,920	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24年1月31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	147,777,983,126	40.47
	英国	31,118,157,076	8.52
	カナダ	10,778,387,756	2.95
	スウェーデン	2,187,652,710	0.60
	デンマーク	3,047,840,099	0.83
	ノルウェー	1,127,084,528	0.31
	アイルランド	2,365,846,119	0.65
	オランダ	9,555,503,659	2.62
	ベルギー	9,071,013,232	2.48
	フランス	34,270,614,486	9.39
	ドイツ	34,274,758,392	9.39
	スペイン	15,733,957,964	4.31
	イタリア	31,610,700,159	8.66
	フィンランド	2,191,220,626	0.60
	ポーランド	2,646,507,585	0.72
	オーストリア	6,124,450,979	1.68
	シンガポール	1,482,594,870	0.41
	マレーシア	1,764,058,869	0.48
	オーストラリア	5,276,415,736	1.45
	メキシコ	3,113,241,607	0.85
小計	355,517,989,576	97.37	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,612,404,325	2.63
合 計（純資産総額）		365,130,393,901	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24年1月31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	3,324,114,850	98.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		55,640,529	1.65
合 計（純資産総額）		3,379,755,379	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24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資信託受益証券	シンガポール	72,641,582	2.75
	オーストラリア	298,605,254	11.30
	小計	371,246,836	14.04
投資証券	米国	1,702,338,460	64.40
	英国	154,365,099	5.84
	カナダ	87,447,389	3.31
	オランダ	42,167,023	1.60
	ベルギー	22,868,371	0.87
	フランス	126,679,814	4.79
	香港	49,385,930	1.87
	シンガポール	8,374,470	0.32
	ニュージーランド	12,506,889	0.47
	小計	2,206,133,445	83.46

現金・預金・その他の資産（負債控除後）	65,951,852	2.50
合 計（純資産総額）	2,643,332,134	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24年1月31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	2,063,792,005	11,405.99	2,353,958,994	11,417.00	2,356,231,332	30.78
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	1,771,730,656	11,065.96	1,960,590,705	11,330.00	2,007,370,833	26.22
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	1,459,335,753	9,788.02	1,428,401,424	10,079.00	1,470,864,505	19.21
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	813,988,992	11,808.60	961,207,290	12,050.00	980,856,735	12.81
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	505,061,759	7,246.17	365,976,097	7,574.00	382,533,776	5.00
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	482,253,310	6,900.83	332,794,806	7,013.00	338,204,246	4.42

(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24年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.44
合計	98.44

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(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



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	3,116,400	3,415.40	10,643,739,800	2,810.00	8,757,084,000	3.49
2	三菱UFJ フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	17,955,300	434.17	7,795,662,916	349.00	6,266,399,700	2.50
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	2,027,600	3,405.41	6,904,808,800	2,666.00	5,405,581,600	2.16
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,492,900	3,888.24	5,804,747,916	3,290.00	4,911,641,000	1.96
5	三井住友フ ィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,793,700	2,830.76	5,077,536,347	2,425.00	4,349,722,500	1.73
6	日本電信電 話	株式	日本	情報・ 通信業	1,092,200	3,868.22	4,224,867,390	3,810.00	4,161,282,000	1.66
7	みずほフ ィナンシャルG	株式	日本	銀行業	30,466,400	157.10	4,786,340,092	115.00	3,503,636,000	1.40
8	ファナック	株式	日本	電気機 器	250,200	12,386.53	3,099,110,960	12,810.00	3,205,062,000	1.28
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	942,900	3,961.82	3,735,600,314	3,310.00	3,120,999,000	1.24
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,727,400	2,308.59	3,987,856,139	1,739.00	3,003,948,600	1.20
11	三井物産	株式	日本	卸売業	2,047,400	1,466.82	3,003,163,059	1,294.00	2,649,335,600	1.06
12	エヌ・ティ ・ティ・ド コモ	株式	日本	情報・ 通信業	19,544	148,121.25	2,894,881,619	135,400.00	2,646,257,600	1.06
13	小松製作所	株式	日本	機械	1,192,400	2,531.14	3,018,135,765	2,149.00	2,562,467,600	1.02
14	日立	株式	日本	電気機 器	5,396,000	486.82	2,626,891,320	426.00	2,298,696,000	0.92
15	ソフトバン ク	株式	日本	情報・ 通信業	1,074,500	2,961.43	3,182,056,858	2,123.00	2,281,163,500	0.91
16	日本たばこ 産業	株式	日本	食料品	5,970	335,282.35	2,001,635,605	375,000.00	2,238,750,000	0.89
17	日産自動車	株式	日本	輸送用 機器	3,036,000	844.85	2,564,961,604	719.00	2,182,884,000	0.87
18	セブン&ア イ・HLD GS	株式	日本	小売業	992,100	2,151.21	2,134,215,928	2,146.00	2,129,046,600	0.85
19	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,499,300	2,653.55	3,978,461,888	1,391.00	2,085,526,300	0.83
20	東日本旅客 鉄道	株式	日本	陸運業	417,900	5,218.90	2,180,976,463	4,935.00	2,062,336,500	0.82
21	三菱地所	株式	日本	不動産 業	1,660,000	1,564.47	2,597,024,080	1,217.00	2,020,220,000	0.81
22	信越化学	株式	日本	化学	451,400	4,667.06	2,106,712,791	3,960.00	1,787,544,000	0.71
23	KDDI	株式	日本	情報・ 通信業	3,681	486,319.13	1,790,140,706	483,000.00	1,777,923,000	0.71
24	アステラス 製薬	株式	日本	医薬品	558,800	3,206.72	1,791,914,558	3,130.00	1,749,044,000	0.70
25	東京海上H D	株式	日本	保険業	900,400	2,449.15	2,205,216,540	1,909.00	1,718,863,600	0.69
26	国際石油開 発帝石	株式	日本	鉱業	3,274	544,245.88	1,781,861,002	520,000.00	1,702,480,000	0.68
27	パナソニッ ク	株式	日本	電気機 器	2,745,700	1,055.38	2,897,769,463	617.00	1,694,096,900	0.68
28	三菱電機	株式	日本	電気機 器	2,403,000	984.37	2,365,437,300	684.00	1,643,652,000	0.66

29	東 芝	株式	日本	電気機器	5,059,000	492.63	2,492,204,760	323.00	1,634,057,000	0.65
30	伊 藤 忠	株式	日本	卸売業	1,892,300	873.49	1,652,912,935	829.00	1,568,716,700	0.63

(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24年1月31日現在 投資比率(%)
種類	業種	
株式	電気機器	13.34
	輸送用機器	9.87
	銀行業	9.43
	情報・通信業	6.32
	化学	5.92
	卸売業	5.66
	機械	5.23
	医薬品	4.87
	小売業	4.20
	陸運業	4.08
	食料品	3.54
	電気・ガス業	3.09
	建設業	2.50
	不動産業	2.25
	保険業	2.24
	サービス業	1.89
	鉄鋼	1.80
	その他製品	1.59
	精密機器	1.37
	非鉄金属	1.19
	ガラス・土石製品	1.14
	証券、商品先物取引業	1.03
	繊維製品	0.94
	石油・石炭製品	0.86
	その他金融業	0.80
	鉱業	0.77
	ゴム製品	0.76
金属製品	0.70	
パルプ・紙	0.40	
海運業	0.37	
空運業	0.29	
倉庫・運輸関連業	0.24	
水産・農林業	0.11	
合計		98.78

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 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24年1月31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	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ ・周辺 機器	146,445	27,680.18	4,053,624,613	34,600.90	5,067,129,357	1.92
2	EXXON MOBIL CO RP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	768,734	6,365.67	4,893,510,189	6,529.73	5,019,622,541	1.90
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	188,631	12,607.23	2,378,113,659	14,703.15	2,773,469,888	1.05
4	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,190,444	2,056.52	2,448,169,465	2,261.61	2,692,322,198	1.02
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	316,981	7,400.30	2,345,755,505	7,898.46	2,503,660,418	0.95
6	GENERAL ELECTR IC CO	株式	米国	コング ロマリ ット	1,674,890	1,560.27	2,613,274,594	1,443.58	2,417,841,056	0.92
7	NESTLE SA-REGI STERED	株式	スイ ス	食品	520,668	4,295.65	2,236,609,934	4,434.75	2,309,033,454	0.88
8	JOHNSON & JOHN SON	株式	米国	医薬品	433,650	4,670.82	2,025,500,781	5,018.93	2,176,458,908	0.82
9	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	938,099	2,176.76	2,042,020,903	2,240.99	2,102,269,728	0.80
10	PROCTER & GAMB LE CO	株式	米国	家庭用 品	433,519	4,907.18	2,127,356,528	4,827.98	2,093,020,975	0.79
11	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,234,363	1,448.14	1,787,528,191	1,648.28	2,034,576,339	0.77
12	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀 行	2,814,047	807.36	2,271,957,464	633.37	1,782,330,837	0.68
13	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀 行	792,899	2,456.52	1,947,770,841	2,234.12	1,771,427,549	0.67
14	GOOGLE INC	株式	米国	インタ ーネット ソフト ウェア・ サービ ス	40,088	46,733.63	1,873,457,914	44,123.96	1,768,841,397	0.67
15	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金 融サー ビス	614,581	3,378.52	2,076,373,845	2,826.82	1,737,312,198	0.66
16	INTEL CORP	株式	米国	半導体 ・半導 体製造 装置	828,563	1,655.00	1,371,275,674	2,042.40	1,692,258,065	0.64
17	COCA-COLA CO/T HE	株式	米国	飲料	326,562	4,870.72	1,590,591,835	5,152.59	1,682,641,663	0.64
18	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通 信サー ビス	8,030,030	213.59	1,715,098,095	206.28	1,656,436,676	0.63
19	BP PLC	株式	英国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	2,988,566	561.82	1,679,040,390	550.40	1,644,909,356	0.62

20	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL -W/I	株式	米国	タバコ	277,132	4,689.17	1,299,518,353	5,720.86	1,585,433,928	0.60
21	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	503,068	3,691.72	1,857,184,874	3,056.54	1,537,649,376	0.58
22	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	368,120	4,416.47	1,625,792,590	4,153.00	1,528,800,593	0.58
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	569,445	2,523.39	1,436,933,321	2,676.36	1,524,039,991	0.58
24	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	487,173	2,510.23	1,222,916,525	2,970.42	1,447,107,546	0.55
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	110,723	11,734.35	1,299,262,590	12,945.81	1,433,398,699	0.54
26	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	300,767	4,184.36	1,258,516,305	4,682.09	1,408,219,366	0.53
27	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	637,175	2,482.93	1,582,061,188	2,184.47	1,391,888,398	0.53
28	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	799,241	1,441.78	1,152,329,644	1,714.00	1,369,898,474	0.52
29	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	334,286	4,195.26	1,402,416,641	4,000.51	1,337,313,450	0.51
30	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	864,224	1,402.81	1,212,345,869	1,493.23	1,290,484,339	0.49

(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24年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.64
	商業銀行	7.15
	医薬品	6.54
	金属・鉱業	4.04
	保険	3.89
	各種電気通信サービス	3.02
	化学	2.87
	食品	2.81
	コンピュータ・周辺機器	2.75
	メディア	2.50
	ソフトウェア	2.48
	食品・生活必需品小売り	2.29
	情報技術サービス	2.26
	飲料	2.24
	コングロマリット	2.13
	各種金融サービス	2.11
	機械	1.93
	電力	1.86
	資本市場	1.83
	航空宇宙・防衛	1.78
	半導体・半導体製造装置	1.71
	ホテル・レストラン・レジャー	1.64
	タバコ	1.63

エネルギー設備・サービス	1.63
家庭用品	1.45
通信機器	1.45
専門小売り	1.45
総合公益事業	1.35
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.34
ヘルスケア機器・用品	1.29
インターネットソフトウェア・サービス	1.00
繊維・アパレル・贅沢品	0.99
自動車	0.97
バイオテクノロジー	0.91
無線通信サービス	0.90
陸運・鉄道	0.87
電気設備	0.80
不動産管理・開発	0.61
複合小売り	0.60
航空貨物・物流サービス	0.58
インターネット販売・カタログ販売	0.53
消費者金融	0.44
商業サービス・用品	0.43
建設・土木	0.42
専門サービス	0.38
自動車部品	0.37
電子装置・機器・部品	0.32
建設資材	0.31
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.31
パーソナル用品	0.28
商社・流通業	0.23
紙製品・林産品	0.20
運送インフラ	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.18
容器・包装	0.17
建設関連製品	0.16
ガス	0.16
家庭用耐久財	0.16
販売	0.13
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.09
水道	0.08
各種消費者サービス	0.08
レジャー用品	0.07
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
事務用電子機器	0.06
不動産投資信託	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
株式計	96.24
投資信託受益証券	0.33
投資証券	1.62
合計	98.19

(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24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	313回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.21	6,578,615,000	103.77	6,744,790,000	1.30	2021/ 3/20	1.64
2	293回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	108.27	5,413,300,000	1.80	2018/ 6/20	1.32
3	305回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,100,000,000	101.39	5,170,808,000	104.79	5,344,341,000	1.30	2019/ 12/20	1.30
4	285回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,900,000,000	105.87	5,187,519,000	106.85	5,235,552,000	1.70	2017/ 3/20	1.27
5	315回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.52	5,076,125,000	102.68	5,134,100,000	1.20	2021/ 6/20	1.25
6	93回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.02	5,001,182,000	100.90	5,045,050,000	0.50	2015/ 12/20	1.23
7	99回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.09	5,004,325,000	100.36	5,018,200,000	0.40	2016/ 9/20	1.22
8	70回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	100.76	4,937,338,000	0.80	2013/ 3/20	1.20
9	312回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,700,000,000	99.61	4,681,762,000	103.14	4,847,768,000	1.20	2020/ 12/20	1.18
10	306回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	102.18	4,598,292,000	105.38	4,742,100,000	1.40	2020/ 3/20	1.15
11	75回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,600,000,000	102.03	4,693,334,000	101.59	4,673,186,000	1.10	2013/ 9/20	1.14
12	310回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	97.56	4,390,410,000	101.70	4,576,320,000	1.00	2020/ 9/20	1.11
13	317回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.49	4,522,160,000	101.55	4,569,615,000	1.10	2021/ 9/20	1.11
14	81回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.28	4,557,600,000	101.41	4,563,315,000	0.80	2014/ 3/20	1.11
15	89回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.47	4,476,220,000	100.57	4,525,605,000	0.40	2015/ 6/20	1.10
16	97回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.29	4,512,925,000	100.43	4,519,395,000	0.40	2016/ 6/20	1.10
17	289回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,100,000,000	104.60	4,288,761,000	106.22	4,355,184,000	1.50	2017/ 12/20	1.06
18	72回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.81	4,317,920,000	101.89	4,279,548,000	1.50	2013/ 6/20	1.04

19	296回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	106.41	4,256,560,000	1.50	2018/ 9/20	1.03
20	301回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	103.02	3,914,570,000	106.54	4,048,672,000	1.50	2019/ 6/20	0.98
21	288回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,600,000,000	105.57	3,800,412,000	107.21	3,859,668,000	1.70	2017/ 9/20	0.94
22	87回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	100.28	3,810,630,000	100.89	3,833,668,000	0.50	2014/ 12/20	0.93
23	266回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.46	3,828,057,000	1.40	2014/ 12/20	0.93
24	286回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	106.40	3,723,840,000	107.59	3,765,755,000	1.80	2017/ 6/20	0.92
25	282回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,400,000,000	105.85	3,598,841,000	106.34	3,615,594,000	1.70	2016/ 9/20	0.88
26	78回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.62	3,556,545,000	101.45	3,550,785,000	0.90	2013/ 12/20	0.86
27	85回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	100.94	3,532,935,000	101.40	3,548,965,000	0.70	2014/ 9/20	0.86
28	88回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	99.96	3,498,520,000	100.90	3,531,465,000	0.50	2015/ 3/20	0.86
29	83回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	3,400,000,000	101.59	3,454,204,000	101.78	3,460,350,000	0.90	2014/ 6/20	0.84
30	297回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,200,000,000	102.65	3,284,672,000	105.81	3,385,824,000	1.40	2018/ 12/20	0.82

(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24年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	76.99
地方債証券	6.73
特殊債券	8.55
社債券	7.10
合計	99.37

(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24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,055,200,000	108.13	3,303,435,000	107.70	3,290,297,640	4.00	2014/ 2/15	0.90
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,055,200,000	108.55	3,316,297,392	107.23	3,275,968,752	4.25	2013/ 11/15	0.90
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	3,055,200,000	101.13	3,089,612,497	101.20	3,091,709,640	1.00	2013/ 7/15	0.85
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,673,300,000	110.70	2,959,209,435	110.29	2,948,355,837	4.75	2014/ 5/15	0.81
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,673,300,000	107.98	2,886,736,272	106.32	2,842,252,560	4.25	2013/ 8/15	0.78
6	US T N/B 0.125 08/31/13	国債 証券	米国	2,673,300,000	99.79	2,667,738,390	99.91	2,671,000,962	0.13	2013/ 8/31	0.73
7	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,444,160,000	105.84	2,586,875,025	104.46	2,553,267,302	3.50	2013/ 5/31	0.70
8	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,291,400,000	109.63	2,512,107,648	111.01	2,543,614,398	4.25	2014/ 11/15	0.70
9	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,444,160,000	106.23	2,596,528,934	103.89	2,539,237,824	3.88	2013/ 2/15	0.70
10	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,291,400,000	103.81	2,378,748,168	105.75	2,423,155,500	2.63	2014/ 6/30	0.66
11	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,138,640,000	109.34	2,338,282,044	110.09	2,354,492,935	4.25	2014/ 8/15	0.64
12	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,215,020,000	106.11	2,350,335,572	104.48	2,314,164,295	3.63	2013/ 5/15	0.63
13	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,291,400,000	98.41	2,255,058,396	100.52	2,303,200,710	0.50	2013/ 10/15	0.63
14	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,138,640,000	102.64	2,195,185,642	105.58	2,257,933,339	2.38	2014/ 9/30	0.62
15	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,138,640,000	101.14	2,162,934,950	101.37	2,167,960,754	1.38	2013/ 3/15	0.59
16	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,009,800,000	107.04	2,151,336,145	107.86	2,167,770,280	4.25	2014/ 1/4	0.59
17	US T N/B 3.125 05/15/21	国債 証券	米国	1,909,500,000	104.44	1,994,352,435	112.03	2,139,231,945	3.13	2021/ 5/15	0.59
18	US T N/B 3.625 02/15/21	国債 証券	米国	1,833,120,000	102.06	1,870,864,690	116.49	2,135,438,150	3.63	2021/ 2/15	0.58
19	US T N/B 3.25 06/30/16	国債 証券	米国	1,909,500,000	105.54	2,015,243,130	111.57	2,130,429,150	3.25	2016/ 6/30	0.58
20	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	1,909,310,000	107.72	2,056,708,732	109.67	2,093,940,277	4.25	2014/ 7/4	0.57
21	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フランス	1,909,310,000	105.39	2,012,279,691	105.43	2,012,985,533	4.00	2013/ 10/25	0.55
22	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	1,909,500,000	101.55	1,939,020,870	105.16	2,008,106,580	2.13	2014/ 11/30	0.55



23	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債 証券	ドイツ	1,808,820,000	104.61	1,892,116,161	109.61	1,982,647,602	3.25	2015/ 7/4	0.54
24	US T N/B 1.75 03/31/14	国債 証券	米国	1,909,500,000	102.90	1,964,787,178	103.30	1,972,589,880	1.75	2014/ 3/31	0.54
25	US T N/B 3.625 02/15/20	国債 証券	米国	1,680,360,000	101.66	1,708,186,762	116.59	1,959,182,135	3.63	2020/ 2/15	0.54
26	US T N/B 1.75 04/15/13	国債 証券	米国	1,909,500,000	101.96	1,946,926,200	101.93	1,946,334,255	1.75	2013/ 4/15	0.53
27	US T N/B 0.75 12/15/13	国債 証券	米国	1,909,500,000	100.92	1,927,072,365	101.01	1,928,805,045	0.75	2013/ 12/15	0.53
28	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタ リア	1,909,310,000	102.91	1,964,870,921	100.50	1,918,856,550	4.25	2014/ 8/1	0.53
29	US T N/B 2.625 08/15/20	国債 証券	米国	1,756,740,000	92.67	1,627,988,525	108.44	1,904,956,154	2.63	2020/ 8/15	0.52
30	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	1,708,330,000	106.54	1,820,037,297	109.92	1,877,796,336	3.75	2015/ 1/4	0.51

(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24年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.37
合計	97.37

(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24年1月31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	670	785,585.35	526,342,185	684,000.00	458,280,000	13.56
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資 証券	日本	539	754,028.55	406,421,391	667,000.00	359,513,000	10.64
3	日本リテールファンド投資法人	投資 証券	日本	2,070	123,632.34	255,918,952	110,500.00	228,735,000	6.77
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資 証券	日本	2,316	91,918.86	212,884,091	83,000.00	192,228,000	5.69
5	森トラスト総合リート投資法人	投資 証券	日本	266	775,094.81	206,175,220	656,000.00	174,496,000	5.16
6	アドバンス・レジデンス投資法人	投資 証券	日本	1,079	163,078.71	175,961,926	137,500.00	148,362,500	4.39

7	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	日本	787	213,142.10	167,742,829	181,900.00	143,155,300	4.24
8	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	336	505,384.62	169,809,231	407,500.00	136,920,000	4.05
9	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	214	719,295.35	153,929,205	609,000.00	130,326,000	3.86
10	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	214	580,903.27	124,313,299	502,000.00	107,428,000	3.18
11	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	313	398,896.72	124,854,672	325,000.00	101,725,000	3.01
12	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	163	718,094.58	117,049,416	617,000.00	100,571,000	2.98
13	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	177	516,223.99	91,371,647	487,500.00	86,287,500	2.55
14	大和証券オフィス投資法人	投資証券	日本	436	250,250.95	109,109,413	172,000.00	74,992,000	2.22
15	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	187	489,267.82	91,493,082	381,000.00	71,247,000	2.11
16	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	316	288,684.16	91,224,195	224,000.00	70,784,000	2.09
17	福岡リート投資法人	投資証券	日本	135	565,401.36	76,329,183	505,000.00	68,175,000	2.02
18	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	208	407,449.23	84,749,440	318,500.00	66,248,000	1.96
19	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	255	275,423.37	70,232,959	252,200.00	64,311,000	1.90
20	トップリート投資法人	投資証券	日本	171	446,933.43	76,425,616	350,500.00	59,935,500	1.77
21	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	166	410,901.86	68,209,709	347,000.00	57,602,000	1.70
22	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	107	662,076.60	70,842,196	526,000.00	56,282,000	1.67
23	プレミア投資法人	投資証券	日本	217	314,778.05	68,306,836	252,800.00	54,857,600	1.62
24	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	日本	1,465	35,197.37	51,564,141	35,100.00	51,421,500	1.52
25	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	103	417,059.05	42,957,082	391,500.00	40,324,500	1.19
26	積水ハウス・S I 投資法人	投資証券	日本	127	342,358.03	43,479,470	301,000.00	38,227,000	1.13
27	M I D リート投資法人	投資証券	日本	202	223,283.52	45,103,272	184,800.00	37,329,600	1.10
28	阪急リート投資法人	投資証券	日本	94	401,003.37	37,694,317	332,500.00	31,255,000	0.92
29	平和不動産リート投資法人	投資証券	日本	766	45,471.88	34,831,458	39,200.00	30,027,200	0.89
30	いちご不動産投資法人	投資証券	日本	928	33,646.57	31,224,020	30,650.00	28,443,200	0.84

(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24年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.35
合計	98.35

(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24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	17,484	9,840.80	172,056,533	10,350.25	180,963,837	6.85
2	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	8,678	9,533.75	82,733,896	10,476.28	90,913,165	3.44
3	WESTFIELD GROUP	投資信託 受益証券	オーストラリア	116,200	632.89	73,542,050	699.43	81,273,394	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	17,800	4,465.94	79,493,707	4,529.33	80,622,145	3.05
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	5,230	13,953.04	72,974,381	14,772.03	77,257,717	2.92
6	VENTAS INC	投資証券	米国	17,102	4,147.43	70,929,416	4,434.62	75,840,919	2.87
7	HCP INC	投資証券	米国	22,200	2,903.20	64,451,124	3,180.46	70,606,283	2.67
8	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	8,750	7,547.11	66,037,193	7,832.77	68,536,729	2.59
9	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	10,429	6,148.59	64,123,645	6,095.89	63,574,014	2.41
10	PROLOGIS INC	投資証券	米国	25,729	2,235.64	57,520,848	2,413.61	62,099,720	2.35
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	5,138	9,953.84	51,142,838	10,302.13	52,932,367	2.00
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	41,168	1,110.57	45,719,748	1,247.29	51,348,245	1.94
13	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	米国	11,201	3,819.00	42,776,619	4,339.91	48,611,350	1.84
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	投資証券	米国	34,963	1,081.90	37,826,476	1,204.51	42,113,374	1.59
15	LINK REIT/THE	投資証券	香港	135,000	266.94	36,036,225	275.80	37,233,000	1.41
16	THE MACERICH COMPANY	投資証券	米国	8,820	3,837.33	33,845,261	4,157.36	36,667,945	1.39
17	STOCKLAND	投資信託 受益証券	オーストラリア	130,140	262.08	34,107,378	271.82	35,374,525	1.34
18	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	英国	43,200	829.68	35,842,336	818.28	35,349,569	1.34
19	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資信託 受益証券	オーストラリア	151,200	205.28	31,038,971	205.28	31,038,971	1.17
20	GPT GROUP	投資信託 受益証券	オーストラリア	121,000	251.53	30,435,614	249.10	30,141,076	1.14
21	KIMCO REALTY	投資証券	米国	21,199	1,322.90	28,044,191	1,396.99	29,614,795	1.12
22	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	米国	5,510	4,858.53	26,770,510	5,316.05	29,291,424	1.11
23	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券	米国	4,030	6,819.97	27,484,480	7,255.34	29,239,005	1.11
24	UDR INC	投資証券	米国	13,779	1,884.29	25,963,695	1,971.37	27,163,477	1.03
25	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	英国	45,200	608.15	27,488,586	587.86	26,571,395	1.01
26	SL GREEN	投資証券	米国	4,225	5,226.68	22,082,737	5,556.65	23,476,825	0.89

27	GOODMAN GROUP	投資信託 受益証券	オース トラリ ア	445,762	50.31	22,424,860	52.34	23,329,088	0.88
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC	投資証券	米国	2,060	10,538.15	21,708,586	10,965.88	22,589,706	0.85
29	REALTY INCOME CORP	投資証券	米国	8,100	2,558.73	20,725,713	2,775.65	22,482,759	0.85
30	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	投資証券	米国	3,900	5,263.35	20,527,049	5,503.94	21,465,377	0.81

(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24年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	14.04
投資証券	83.46
合計	97.50

(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24年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1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
第4期末（平成23年1月11日現在）	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5期末（平成24年1月11日現在）	7,492	7,492	0.6688	0.6688
平成23年1月末	7,737	-	0.7217	-
2月末	7,853	-	0.7315	-
3月末	7,780	-	0.7257	-
4月末	7,869	-	0.7312	-
5月末	7,816	-	0.7218	-
6月末	7,811	-	0.7191	-
7月末	7,710	-	0.7062	-
8月末	7,526	-	0.6856	-
9月末	7,377	-	0.6702	-
10月末	7,619	-	0.6879	-
11月末	7,397	-	0.6644	-
12月末	7,505	-	0.6708	-
平成24年1月末	7,655	-	0.6804	-

**【分配の推移】**

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-
第5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
第4期	1.86
第5期	7.42

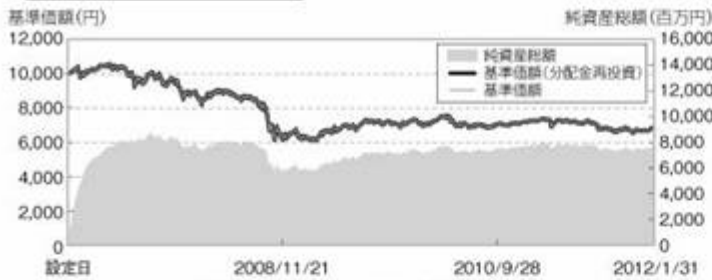
(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2012年1月31日

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2007年1月26日)～2012年1月31日)



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

## 分配の推移(税引前)

第1期	(2008.01.11)	0円
第2期	(2009.01.13)	0円
第3期	(2010.01.12)	0円
第4期	(2011.01.11)	0円
第5期	(2012.01.11)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30.78
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.22
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.21
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.81
5	グローバルリートパッシブ・ファンド・マザーファンド	5.00
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.42

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	日本	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.22
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	3.49
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	銀行業	2.50
3	本田技研	日本	輸送用機器	2.16
4	キヤノン	日本	電気機器	1.96
5	三井住友フィナンシャルG	日本	銀行業	1.73

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	電気機器	13.34
2	輸送用機器	9.87
3	銀行業	9.43
4	情報・通信業	6.32
5	化学	5.92

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
株式	米国	53.67
	英国	9.79
	カナダ	5.62
	スイス	4.36
	フランス	3.90
	その他	18.90
	小計	96.24
投資信託受益証券	オーストラリア	0.30
	シンガポール	0.02
小計	0.33	
投資証券	米国	1.29
	英国	0.12
	フランス	0.12
	香港	0.04
	カナダ	0.04
	その他	0.02
	小計	1.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.81
合計(純資産総額)		100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	1.92
2	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	1.90
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技術サービス	1.05
4	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア	1.02
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ガス・消耗燃料	0.95

## 組入上位5業種(株式)

順位	業種	投資比率(%)
1	石油・ガス・消耗燃料	10.64
2	商業銀行	7.15
3	医薬品	6.54
4	金属鉱業	4.04
5	保険	3.89

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2012年1月31日

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	日本	76.99
地方債証券	日本	6.73
特殊債券	日本	8.55
社債券	日本	7.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.63
合計(純資産総額)		100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	313回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2021/3/20	1.64
2	293回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.80	2018/6/20	1.32
3	305回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.30	2019/12/20	1.30
4	285回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.70	2017/3/20	1.27
5	315回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.20	2021/6/20	1.25

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	米国	40.47
	ドイツ	9.39
	フランス	9.39
	イタリア	8.66
	英国	8.52
	その他	20.94
	小計	97.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.63
合計(純資産総額)		100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.90
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.90
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債証券	米国	1.00	2013/7/15	0.85
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	米国	4.75	2014/5/15	0.81
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/8/15	0.78

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資証券	日本	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.65
合計(純資産総額)		100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	13.56
2	ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	10.64
3	日本リートファンド投資法人	日本	6.77
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	5.69
5	森トラスト総合リート投資法人	日本	5.16

### ■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

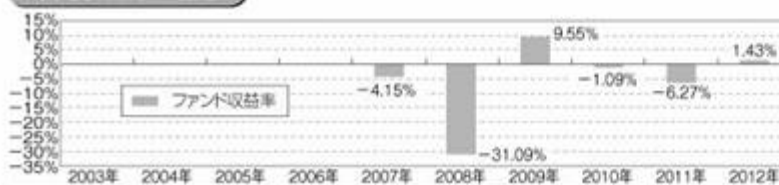
#### ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資信託受益証券	オーストラリア	11.30
	シンガポール	2.75
投資証券	小計	14.04
	米国	64.40
	英国	5.84
	フランス	4.79
	カナダ	3.31
	香港	1.87
	その他	3.25
	小計	83.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.50
合計(純資産総額)		100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	6.85
2	PUBLIC STORAGE	米国	3.44
3	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	米国	3.05
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.92

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2007年は設定日から年末までの収益率、および2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

**(4)【設定及び解約の実績】**

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1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
第4期	1,561,559,539	1,016,414,248
第5期	1,553,939,256	1,049,226,063

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

- ・お申込みの方法

お申込みの際は、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、お申込日が海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に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（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

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、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、委託会社に販売会社の定める単位をもって解約を請求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、

・解約価額

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

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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

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します。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令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します。

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は受益証券を発行しません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は平成19年1月26日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には信託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. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとしします。

#### (5)【その他】

##### イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約し

ようとする旨を監督官庁に届出ます。

- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a. およびb. の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e. の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d. からf. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d. 」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、委託会社は下記「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. 上記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に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. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. からe. の規定にしたがいます。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

## 八. 関係法人との契約の更改

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

## 二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## ホ. 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として毎年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/>）

## 4【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。

### 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ます。）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には、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。

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（平成22年1月13日から平成23年1月11日まで）及び第5期計算期間（平成23年1月12日から平成24年1月11日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成23年1月11日現在	第5期 平成24年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	156,961,105	164,302,185
親投資信託受益証券	7,630,985,734	7,370,644,902
未収入金	429,000	211,000
流動資産合計	7,788,375,839	7,535,158,087
<b>資産合計</b>		
	7,788,375,839	7,535,158,087
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	22,942,204	4,634,019
未払受託者報酬	2,757,658	2,772,613
未払委託者報酬	34,668,266	34,856,313
その他未払費用	196,884	188,057
流動負債合計	60,565,012	42,451,002
<b>負債合計</b>		
	60,565,012	42,451,002
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,697,773,726	11,202,486,919
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	*3 2,969,962,899	*3 3,709,779,834
(分配準備積立金)	506,941,979	582,398,171
元本等合計	7,727,810,827	7,492,707,085
<b>純資産合計</b>		
	7,727,810,827	7,492,707,085
<b>負債純資産合計</b>		
	7,788,375,839	7,535,158,087

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 4 期 自 平成22年 1 月13日 至 平成23年 1 月11日	第 5 期 自 平成23年 1 月12日 至 平成24年 1 月11日
営業収益		
受取利息	76,739	87,617
有価証券売買等損益	58,318,678	511,725,832
営業収益合計	58,241,939	511,638,215
営業費用		
受託者報酬	5,450,296	5,607,377
委託者報酬	* <sub>1</sub> 68,519,148	* <sub>1</sub> 70,493,889
その他費用	389,126	380,332
営業費用合計	74,358,570	76,481,598
営業損失( )	132,600,509	588,119,813
経常損失( )	132,600,509	588,119,813
当期純損失( )	132,600,509	588,119,813
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	21,801,443	22,699,705
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,679,037,589	2,969,962,899
剰余金増加額又は欠損金減少額	269,768,799	291,795,799
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	269,768,799	291,795,799
剰余金減少額又は欠損金増加額	449,895,043	466,192,626
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	449,895,043	466,192,626
分配金	* <sub>2</sub> -	* <sub>2</sub> -
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,969,962,899	3,709,779,834



## (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 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	第 5 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11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前計算 期間末日が休業日のため、平成22 年1月13日から平成23年1月11日 までとなっております。	

## (追加情報)

第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	第 5 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する 会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品 の時価等の開示に関する適用指針」 （企業会計基準適用指針第19号 平 成20年3月10日）を適用しており ます。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第 4 期 平成23年1月11日現在	第 5 期 平成24年1月11日現在
*1 期首元本額	10,152,628,435円	10,697,773,726円
期中追加設定元本額	1,561,559,539円	1,553,939,256円
期中解約元本額	1,016,414,248円	1,049,226,063円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	10,697,773,726口	11,202,486,919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 2,969,962,899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 3,709,779,834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 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	第 5 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日

*1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	862,311円	758,846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（121,601,309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（171,026,607円）及び分配準備積立金（385,340,670円）より分配対象収益は677,968,586円（1万口当たり633.75円）であります。なお、分配を行っておりません。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（122,141,657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（251,018,220円）及び分配準備積立金（460,256,514円）より分配対象収益は833,416,391円（1万口当たり743.96円）であります。なお、分配を行っておりません。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>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	第5期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 平成23年1月11日現在	第5期 平成24年1月11日現在

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	第 4 期 平成23年1月11日現在	第 5 期 平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	57,343,823	492,553,991
合計	57,343,823	492,553,991

## （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 4 期 平成23年1月11日現在	第 5 期 平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7224円 (7,224円)	0.6688円 (6,688円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,452,916,419	1,421,969,299	
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	2,054,399,443	2,343,248,004	
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	480,093,400	331,312,455	
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	810,799,004	957,310,384	
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	1,764,418,944	1,952,329,561	
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	503,071,359	364,475,199	
合計		7,065,698,569	7,370,644,902	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況  
貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,235,740,681	8,167,025,073
株式	*2	273,490,260,816	240,208,368,152
派生商品評価勘定		88,010,774	73,235,934
未収入金		1,809,821	-
未収配当金		242,914,800	275,024,850
流動資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009
資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009

負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	49,141,051
前受金		91,270,000	18,071,000
未払金		-	878,667
未払解約金		82,007,000	59,935,000
流動負債合計		173,277,000	128,025,718
負債合計		173,277,000	128,025,718
純資産の部			
元本等			
元本		228,379,687,941	254,010,406,324
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*4	47,505,771,951	5,414,778,033
元本等合計		275,885,459,892	248,595,628,291
純資産合計		275,885,459,892	248,595,628,291
負債純資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。	株式 同左
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22年2月9日から平成23年2月7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23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。

## （追加情報）

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用していません。	

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	234,321,017,334円	228,379,687,941円
同期中追加設定元本額	45,220,534,775円	66,418,443,179円
同期中解約元本額	51,161,864,168円	40,787,724,796円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,610,616,769円	2,701,746,053円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,041,338,140円	1,057,501,374円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	30,980,898,025円	34,316,155,026円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	722,475,195円	936,995,181円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,771,259,234円	3,425,810,539円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,910,270,200円	3,457,055,475円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	444,286,655円	525,549,744円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,359,305,055円	1,549,301,539円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	1,035,187,638円	1,165,543,224円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	148,204,667円	132,245,304円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,331,163,776円	1,452,916,419円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,953,804円	20,312,409円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	256,259,608円	280,428,799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）	10,254,954,694円	11,221,617,726円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,750,725,206円	1,825,986,372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）	203,242,674円	221,224,066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）	769,278,546円	846,811,544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）	219,367,345円	231,792,696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）	288,653,665円	305,439,044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）	19,349,603,643円	21,135,260,399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）	6,436,035,294円	6,973,194,770円

D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,022,227,148円	5,515,819,691円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	3,398,318,782円	3,602,818,118円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	7,952,582,764円	8,266,263,783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)	1,205,187,236円	1,276,613,232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)	2,530,767,385円	2,798,733,260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)	2,587,872,007円	2,860,749,528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)	13,926,600,072円	15,940,632,519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)	215,786,345円	222,287,324円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド (適格機関投資家向け)	295,865,972円	円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	4,759,493,521円	5,180,128,773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)	8,845,496,943円	9,604,697,727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)	458,251,539円	488,514,372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)	39,854,696,261円	44,336,116,313円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	2,696,756,649円	2,888,855,576円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	4,823,978,728円	5,478,086,307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)	24,121,903,458円	27,076,022,500円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	276,688,196円	315,394,843円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	91,930円	106,653円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	144,867円	163,481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)	21,026,822,765円	23,768,412,878円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	200,129,538円	267,316,165円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	77,583,539円	98,488,565円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	209,143,853円	241,043,818円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	86,168円	101,120円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	132,442円	152,075円
(合 計)	228,379,687,941円	254,010,406,324円

*2 差入代用有価証券	株式 1,727,500,000円	株式 1,313,000,000円
*3 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	228,379,687,941口	254,010,406,324口
*4 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,414,778,033円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左



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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	14,689,435,088	60,210,126,168
合計	14,689,435,088	60,210,126,168

(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)

(株式関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,266,376,000	-	2,354,580,000	88,010,774
	TOPIX 先物				
合 計		2,266,376,000	-	2,354,580,000	88,010,774

平成24年1月11日現在
--------------

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX 先物	8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,094,883
合計		8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,094,883

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2080円 (12,080円)	0.9787円 (9,787円)

[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	180	19,800,000	
日本水産	311,300	266	82,805,800	
マルハニチロホールディングス	535,000	139	74,365,000	
ハウスイ	23,000	111	2,553,000	
サカタのタネ	40,200	1,107	44,501,400	
ホクト	27,600	1,670	46,092,000	
ショーボンドHD	24,000	1,835	44,040,000	
ミライト・ホールディングス	77,000	579	44,583,000	
住石ホールディングス	79,400	91	7,225,400	
日鉄鉱業	69,000	318	21,942,000	
三井松島	175,000	152	26,600,000	
国際石油開発帝石	3,274	510,000	1,669,740,000	
日本海洋掘削	6,700	2,203	14,760,100	
関東天然瓦斯	28,000	391	10,948,000	
石油資源開発	38,400	3,080	118,272,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	165,000	3,630,000	
間組	103,100	198	20,413,800	
東急建設	95,320	194	18,492,080	
コムシスホールディングス	131,400	811	106,565,400	
ミサワホーム	26,000	670	17,420,000	
高松コンストラクションGP	20,500	1,235	25,317,500	
東建コーポレーション	10,060	2,574	25,894,440	
ヤマウラ	8,500	230	1,955,000	
大成建設	1,363,000	205	279,415,000	
大林組	808,000	355	286,840,000	
清水建設	825,000	336	277,200,000	
飛鳥建設	165,000	80	13,200,000	
長谷工コーポレーション	1,681,500	54	90,801,000	
松井建設	2,000	308	616,000	
鹿島建設	1,263,000	250	315,750,000	
不動テトラ	190,900	156	29,780,400	
大末建設	93,000	45	4,185,000	
鉄建建設	153,000	110	16,830,000	
安藤建設	91,000	113	10,283,000	
太平工業	47,000	413	19,411,000	
西松建設	353,000	150	52,950,000	
三井住友建設	168,500	56	9,436,000	
大豊建設	80,000	105	8,400,000	
前田建設	167,000	302	50,434,000	
佐田建設	93,000	64	5,952,000	
ナカノフドー建設	20,500	169	3,464,500	
奥村組	257,000	319	81,983,000	
大和小田急建設	14,000	209	2,926,000	
東鉄工業	35,000	699	24,465,000	
イチケン	31,000	136	4,216,000	
浅沼組	86,000	65	5,590,000	
戸田建設	290,000	293	84,970,000	
熊谷組	201,000	77	15,477,000	
青木あすなる建設	19,000	410	7,790,000	
北野建設	61,000	189	11,529,000	

植木組	34,000	197	6,698,000
三井ホーム	35,000	400	14,000,000
矢作建設	33,600	395	13,272,000
ピーエス三菱	17,700	356	6,301,200
大東建託	102,300	6,780	693,594,000
新日本建設	32,200	222	7,148,400
N I P P O	63,000	796	50,148,000
東亜道路	52,000	189	9,828,000
前田道路	78,000	869	67,782,000
日本道路	81,000	262	21,222,000
東亜建設	237,000	149	35,313,000
若築建設	146,000	113	16,498,000
東洋建設	406,000	75	30,450,000
五洋建設	342,000	251	85,842,000
大林道路	34,000	210	7,140,000
世紀東急	81,000	51	4,131,000
福田組	41,000	262	10,742,000
住友林業	185,600	669	124,166,400
日本基礎技術	31,000	278	8,618,000
日成ビルド工業	79,000	193	15,247,000
エス・パイ・エル	137,000	181	24,797,000
バコーポレーション	35,400	283	10,018,200
パナホーム	101,000	534	53,934,000
大和ハウス	672,000	931	625,632,000
ライト工業	57,000	450	25,650,000
積水ハウス	758,000	698	529,084,000
日特建設	66,000	110	7,260,000
北陸電気工事	15,000	209	3,135,000
ユアテック	37,000	399	14,763,000
西部電気工業	1,000	350	350,000
四電工	6,000	322	1,932,000
中電工	39,400	830	32,702,000
関電工	124,000	363	45,012,000
きんでん	180,000	642	115,560,000
東京エネシス	30,000	454	13,620,000
トーエネック	39,000	425	16,575,000
住友電設	19,000	459	8,721,000
日本電設工業	49,000	742	36,358,000
協和エクシオ	88,500	737	65,224,500
新日本空調	22,500	414	9,315,000
日本工営	85,000	282	23,970,000
日本電話施設	47,000	249	11,703,000
九電工	50,000	474	23,700,000
三機工業	62,000	415	25,730,000
日揮	251,000	1,886	473,386,000
中外炉工業	87,000	261	22,707,000
ヤマト	16,000	310	4,960,000
太平電業	35,000	618	21,630,000
高砂熱学	77,700	636	49,417,200
三晃金属	30,000	219	6,570,000
N E C ネットズエスアイ	22,700	1,141	25,900,700
朝日工業社	30,000	335	10,050,000
アタカ大機	18,000	247	4,446,000
大気社	41,400	1,709	70,752,600
ダイダン	25,000	546	13,650,000
日比谷総合設	33,400	829	27,688,600
東芝プラントシステム	44,000	789	34,716,000
日本製粉	170,000	345	58,650,000
日清製粉G本社	244,500	930	227,385,000

日東富士製粉	8,000	294	2,352,000
昭和産業	113,000	243	27,459,000
鳥越製粉	24,500	676	16,562,000
協同飼料	98,000	98	9,604,000
中部飼料	24,300	499	12,125,700
日本配合飼料	83,000	114	9,462,000
東洋精糖	43,000	91	3,913,000
日本甜菜糖	152,000	166	25,232,000
三井製糖	96,000	253	24,288,000
ネクスト	9,700	291	2,822,700
日本M&Aセンター	50	399,500	19,975,000
ノバレーゼ	49	49,850	2,442,650
アコーディア・ゴルフ	1,019	55,300	56,350,700
パソナグループ	249	71,200	17,728,800
リンクアンドモチベーション	51	39,600	2,019,600
テンプホールディングス	34,400	748	25,731,200
森永製菓	267,000	182	48,594,000
中村屋	64,000	394	25,216,000
江崎グリコ	98,000	863	84,574,000
名糖産業	12,500	1,010	12,625,000
不二家	155,000	162	25,110,000
山崎製パン	197,000	1,018	200,546,000
第一屋製パン	43,000	83	3,569,000
モロゾフ	43,000	278	11,954,000
カルビー	14,500	3,770	54,665,000
森永乳業	228,000	300	68,400,000
ヤクルト	144,500	2,479	358,215,500
明治ホールディングス	79,900	3,170	253,283,000
雪印メグミルク	58,200	1,450	84,390,000
プリマハム	152,000	130	19,760,000
日本ハム	205,000	937	192,085,000
伊藤ハム	149,000	319	47,531,000
林兼産業	89,000	66	5,874,000
丸大食品	130,000	280	36,400,000
米久	23,800	755	17,969,000
S Foods	17,500	670	11,725,000
学情	8,900	256	2,278,400
スタジオアリス	11,500	1,208	13,892,000
シミックホールディングス	8,200	1,233	10,110,600
システナ	282	54,300	15,312,600
NECフィールドینگ	20,400	997	20,338,800
新日鉄ソリューションズ	15,700	1,541	24,193,700
総合警備保障	91,500	826	75,579,000
日本駐車場開発	2,605	3,555	9,260,775
コア	9,000	668	6,012,000
カクコム	39,000	2,725	106,275,000
アイロムホールディングス	542	2,822	1,529,524
ルネサンス	11,800	397	4,684,600
新日本科学	15,600	194	3,026,400
エムスリー	197	349,000	68,753,000
ベストプライダル	54	70,000	3,780,000
ディー・エヌ・エー	112,500	1,899	213,637,500
博報堂DYHLDGS	31,910	4,400	140,404,000
ぐるなび	17,500	821	14,367,500
一休	182	32,800	5,969,600
ジャパンベストレスキューS	37	71,700	2,652,900
ジェイコムホールディングス	4,300	720	3,096,000
PGMホールディングス	350	47,800	16,730,000
サッポロホールディングス	442,000	283	125,086,000

アサヒグループホールディング	505,400	1,711	864,739,400
麒麟HD	1,081,000	940	1,016,140,000
宝ホールディングス	228,000	489	111,492,000
オエノンホールディングス	72,000	179	12,888,000
養命酒	3,000	745	2,235,000
三国コカ・コ・ラ	29,100	687	19,991,700
コカ・コーラウエスト	91,600	1,346	123,293,600
コカコーラセントラルジャパン	31,000	998	30,938,000
ダイドードリンコ	12,600	3,125	39,375,000
伊藤園	82,100	1,326	108,864,600
キーコーヒー	23,900	1,422	33,985,800
ユニカフェ	6,100	353	2,153,300
ジャパンフーズ	4,000	782	3,128,000
日清オイリオグループ	105,000	328	34,440,000
不二製油	65,400	1,075	70,305,000
J-オイルミルズ	102,000	223	22,746,000
ローソン	74,800	4,655	348,194,000
インターニックス	9,800	371	3,635,800
サンエー	8,000	3,065	24,520,000
麒麟堂	10,100	498	5,029,800
ダイユーエイト	3,600	923	3,322,800
カワチ薬品	16,500	1,612	26,598,000
エービーシー・マート	33,700	2,811	94,730,700
ハードオフコーポレーション	11,400	563	6,418,200
高千穂交易	10,100	853	8,615,300
アスクル	18,600	1,095	20,367,000
ゲオホールディングス	391	81,000	31,671,000
ポイント	19,990	3,105	62,068,950
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	116	580,000
伊藤忠食品	6,000	2,728	16,368,000
くらコーポレーション	12,300	1,024	12,595,200
キャンドウ	128	83,600	10,700,800
エレマテック	19,000	1,281	24,339,000
パル	6,900	3,385	23,356,500
JALUX	7,700	736	5,667,200
エディオン	94,200	618	58,215,600
サーラコーポレーション	20,500	466	9,553,000
トーマンデバイス	3,500	1,760	6,160,000
あみやき亭	40	189,000	7,560,000
東京エレクトロンデバイス	48	136,400	6,547,200
ひらまつ	100	65,400	6,540,000
双日	1,590,400	123	195,619,200
ゲンキー	1,700	1,650	2,805,000
アルフレッサホールディングス	62,100	3,240	201,204,000
ハニーズ	20,760	1,237	25,680,120
キッコーマン	220,000	878	193,160,000
味の素	710,000	930	660,300,000
キュービー	137,400	1,113	152,926,200
ハウス食品	95,900	1,467	140,685,300
カゴメ	104,600	1,532	160,247,200
焼津水産化工	13,500	706	9,531,000
アリアケジャパン	24,700	1,480	36,556,000
ニチレイ	303,000	374	113,322,000
横浜冷凍	56,000	634	35,504,000
東洋水産	116,000	1,878	217,848,000
日清食品HD	105,300	3,010	316,953,000
永谷園	7,000	878	6,146,000
フジッコ	30,000	968	29,040,000
ロックフィールド	13,600	1,305	17,748,000

日本たばこ産業	5,970	395,500	2,361,135,000
わらべや日洋	15,200	1,049	15,944,800
なとり	13,500	845	11,407,500
片倉工業	31,600	705	22,278,000
グンゼ	188,000	221	41,548,000
昭栄	43,300	314	13,596,200
神栄	27,000	153	4,131,000
山下医科器械	2,200	960	2,112,000
ラサ商事	11,500	360	4,140,000
アルペン	15,100	1,389	20,973,900
アルコニックス	6,200	1,500	9,300,000
ビックカメラ	895	42,850	38,350,750
DCMホールディングス	122,500	626	76,685,000
Monotaro	13,400	835	11,189,000
あいホールディングス	42,100	329	13,850,900
J. フロントリテイリング	560,000	365	204,400,000
ドトール・日レスHD	37,900	1,016	38,506,400
マツモトキヨシHLDGS	43,900	1,545	67,825,500
物語コーポレーション	2,500	1,277	3,192,500
ココカラファイン	24,700	1,987	49,078,900
三越伊勢丹HD	471,200	807	380,258,400
東洋紡績	1,064,000	105	111,720,000
ユニチカ	554,000	41	22,714,000
富士紡ホールディングス	110,000	166	18,260,000
日清紡ホールディングス	160,000	675	108,000,000
倉敷紡績	259,000	147	38,073,000
ダイワボウHD	229,000	176	40,304,000
シキボウ	162,000	106	17,172,000
日東紡績	185,000	258	47,730,000
トヨタ紡織	83,900	792	66,448,800
クリエイトSDH	10,000	1,635	16,350,000
バイタルKSKHD	44,700	575	25,702,500
UKCホールディングス	13,900	762	10,591,800
丸善CHIHD	6,700	214	1,433,800
TOKAIホールディングス	115,900	393	45,548,700
日本毛織	86,000	582	50,052,000
大東紡織	38,000	64	2,432,000
トーア紡コーポレーション	106,000	54	5,724,000
ダイドーリミテッド	31,300	689	21,565,700
東京建物不動産販	9,200	210	1,932,000
野村不動産HLDGS	113,600	1,100	124,960,000
常和ホールディングス	4,400	1,318	5,799,200
ヒューリック	76,900	879	67,595,100
帝国繊維	23,000	464	10,672,000
ブックオフコーポレーション	14,100	683	9,630,300
日本コークス工業	202,000	108	21,816,000
ミタチ産業	3,800	370	1,406,000
JFE商事HLDGS	159,000	317	50,403,000
あさひ	13,700	1,559	21,358,300
サークルKサンクス	51,500	1,293	66,589,500
日本調剤	2,990	2,654	7,935,460
コスモス薬品	11,900	4,015	47,778,500
シップヘルスケアHD	30,800	1,808	55,686,400
ソフトクリエイト	2,600	1,089	2,831,400
セブン&アイ・HLDGS	992,100	2,158	2,140,951,800
ツルハホールディングス	21,200	4,310	91,372,000
サンマルクホールディングス	6,800	2,958	20,114,400
フェリシモ	6,600	1,011	6,672,600
トリドール	20,400	721	14,708,400

クスリのアオキ	3,400	1,416	4,814,400
帝人	1,028,000	227	233,356,000
東レ	1,826,000	550	1,004,300,000
クラレ	400,100	1,092	436,909,200
旭化成	1,465,000	467	684,155,000
サカイオーベックス	70,000	120	8,400,000
稲葉製作所	12,400	936	11,606,400
宮地エンジニアリングG	81,000	207	16,767,000
三協・立山HLDGS	340,000	142	48,280,000
トーカロ	14,100	1,598	22,531,800
アルファCO	8,500	924	7,854,000
SUMCO	153,700	553	84,996,100
川田テクノロジーズ	5,900	1,228	7,245,200
住江織物	69,000	139	9,591,000
日本フェルト	15,000	392	5,880,000
イチカワ	14,000	148	2,072,000
日本バイリン	32,000	326	10,432,000
エコナックホールディングス	73,000	30	2,190,000
日東製網	31,000	147	4,557,000
芦森工業	61,000	107	6,527,000
アツギ	196,000	93	18,228,000
ダイニック	47,000	138	6,486,000
共和レザー	13,400	291	3,899,400
セーレン	62,700	452	28,340,400
東海染工	35,000	85	2,975,000
小松精練	39,000	352	13,728,000
ワコールホールディングス	150,000	971	145,650,000
ホギメディカル	15,900	3,175	50,482,500
レナウン	54,100	141	7,628,100
クラウドシア	3,000	1,020	3,060,000
TSIホールディングス	112,300	391	43,909,300
デジタルハーツ	19	146,800	2,789,200
ITホールディングス	71,900	882	63,415,800
グリー	103,600	2,282	236,415,200
コーエーテクモHD	47,000	615	28,905,000
三菱総合研究所	9,200	1,408	12,953,600
ボルテージ	2,100	983	2,064,300
特種東海製紙	158,000	177	27,966,000
ダウンゴ	118	127,600	15,056,800
ベリサーブ	13	130,000	1,690,000
マクロミル	27,600	760	20,976,000
ティーガイア	152	142,300	21,629,600
GMOペイメントゲートウェイ	51	319,000	16,269,000
ザッパラス	130	81,100	10,543,000
インターネットイニシアティブ	139	256,500	35,653,500
ソネットエンタテインメント	133	284,900	37,891,700
SRAホールディングス	12,400	791	9,808,400
JBISホールディングス	24,500	234	5,733,000
朝日ネット	20,000	354	7,080,000
王子製紙	1,112,000	385	428,120,000
三菱製紙	362,000	70	25,340,000
北越紀州製紙	156,500	505	79,032,500
中越パルプ	98,000	138	13,524,000
巴川製紙	43,000	163	7,009,000
大王製紙	106,000	515	54,590,000
日本製紙G本社	121,500	1,586	192,699,000
レンゴー	202,000	540	109,080,000
トーモク	79,000	215	16,985,000
ザ・パック	15,900	1,118	17,776,200



コ - プケミカル	38,000	110	4,180,000
昭和電工	1,564,000	160	250,240,000
住友化学	1,730,000	289	499,970,000
日本化成	49,000	132	6,468,000
住友精化	47,000	319	14,993,000
日産化学	191,500	724	138,646,000
ラサ工業	101,000	121	12,221,000
クレハ	163,000	390	63,570,000
テイカ	43,000	299	12,857,000
石原産業	422,000	91	38,402,000
片倉チツカリン	13,000	191	2,483,000
日本曹達	150,000	335	50,250,000
東ソー	673,000	208	139,984,000
トクヤマ	391,000	243	95,013,000
セントラル硝子	241,000	376	90,616,000
東亜合成	315,000	311	97,965,000
ダイソー	101,000	241	24,341,000
関東電化	56,000	280	15,680,000
電気化学	529,000	281	148,649,000
イビデン	157,500	1,558	245,385,000
信越化学	451,400	3,680	1,661,152,000
日本カ - バイド	77,000	111	8,547,000
堺 化 学	78,000	286	22,308,000
エア・ウォーター	205,000	1,009	206,845,000
大陽日酸	331,000	536	177,416,000
日本化学工業	102,000	130	13,260,000
日本パ - カライジング	59,000	944	55,696,000
高压ガス	38,000	493	18,734,000
チタン工業	29,000	383	11,107,000
四国化成	34,000	420	14,280,000
戸田工業	33,000	680	22,440,000
ステラ ケミファ	11,900	2,215	26,358,500
保土谷化学	51,000	237	12,087,000
日本触媒	183,000	842	154,086,000
大日精化	91,000	325	29,575,000
カネカ	314,000	407	127,798,000
協和発酵キリン	345,000	912	314,640,000
三菱瓦斯化学	433,000	408	176,664,000
三井化学	1,068,000	231	246,708,000
J S R	229,100	1,456	333,569,600
東京応化工業	45,200	1,559	70,466,800
三菱ケミカルH L D G S	1,573,500	419	659,296,500
日本合成化学	51,000	450	22,950,000
ダイセル	327,000	464	151,728,000
住友ベ - クライト	216,000	429	92,664,000
積水化学	524,000	643	336,932,000
日本ゼオン	235,000	644	151,340,000
アイカ工業	68,200	1,055	71,951,000
宇部興産	1,055,000	209	220,495,000
積水樹脂	36,000	769	27,684,000
タキロン	59,000	264	15,576,000
旭有機材	91,000	210	19,110,000
日立化成	108,800	1,360	147,968,000
ニチバン	22,000	250	5,500,000
リケンテクノス	44,000	217	9,548,000
大倉工業	61,000	238	14,518,000
積水化成品	65,000	288	18,720,000
群栄化学	70,000	201	14,070,000
タイガース ポリマー	12,300	287	3,530,100

日本カ - リット	20,500	396	8,118,000
日本化薬	177,000	726	128,502,000
イーピーエス	135	138,400	18,684,000
パナソニック電工 I S	5,500	2,013	11,071,500
フェイス	801	8,200	6,568,200
アミューズ	7,200	993	7,149,600
野村総合研究所	134,200	1,689	226,663,800
ドリームインキュベータ	79	57,700	4,558,300
サイバネットシステム	196	19,180	3,759,280
T A C	13,900	163	2,265,700
ケネディクス	2,731	9,590	26,190,290
電通	228,400	2,338	533,999,200
インテージ	7,000	1,427	9,989,000
テイクアンドギヴニーズ	1,235	4,960	6,125,600
ぴあ	7,600	804	6,110,400
シンプレクスホールディング	394	25,930	10,216,420
イオンファンタジー	8,200	1,310	10,742,000
ソースネクスト	59	14,570	859,630
ネクシィーズ	952	1,894	1,803,088
メディカルシステムネットワーク	3,900	856	3,338,400
日本精化	21,700	516	11,197,200
A D E K A	108,600	756	82,101,600
日油	201,000	385	77,385,000
ミヨシ油脂	88,000	105	9,240,000
ハリマ化成	21,600	620	13,392,000
花 王	667,700	2,107	1,406,843,900
第一工業製薬	46,000	222	10,212,000
三洋化成	79,000	501	39,579,000
武田薬品	942,900	3,275	3,087,997,500
アステラス製薬	558,800	3,125	1,746,250,000
大日本住友製薬	178,500	886	158,151,000
塩野義製薬	393,100	974	382,879,400
田辺三菱製薬	251,400	1,191	299,417,400
わかもと製薬	7,000	223	1,561,000
あすか製薬	30,000	455	13,650,000
日本新薬	53,000	930	49,290,000
中外製薬	292,500	1,204	352,170,000
科研製薬	99,000	1,005	99,495,000
エーザイ	309,900	3,180	985,482,000
ロート製薬	106,000	981	103,986,000
小野薬品	123,200	4,310	530,992,000
久光製薬	78,100	3,275	255,777,500
有機合成薬品	18,000	178	3,204,000
持田製薬	89,000	873	77,697,000
参天製薬	84,500	3,165	267,442,500
扶桑薬品	86,000	200	17,200,000
日本ケミファ	39,000	285	11,115,000
ツムラ	68,700	2,246	154,300,200
日医工	42,600	1,704	72,590,400
テ ル モ	170,000	3,535	600,950,000
みらかホールディングス	65,500	3,035	198,792,500
キッセイ薬品工業	46,800	1,590	74,412,000
生化学工業	48,300	837	40,427,100
栄研化学	19,700	1,052	20,724,400

[次へ](#)

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日水製薬	10,900	693	7,553,700	
鳥居薬品	17,300	1,448	25,050,400	
東和薬品	12,800	3,105	39,744,000	
沢井製薬	16,500	7,930	130,845,000	
ゼリア新薬工業	36,000	1,358	48,888,000	
第一三共	846,800	1,476	1,249,876,800	
キョーリン製薬HD	62,000	1,347	83,514,000	
大幸薬品	11,700	789	9,231,300	
ダイト	7,000	1,237	8,659,000	
大塚ホールディングス	499,500	2,194	1,095,903,000	
大正製薬HD	60,500	6,310	381,755,000	
大日本塗料	147,000	83	12,201,000	
日本ペイント	238,000	548	130,424,000	
関西ペイント	285,000	689	196,365,000	
トウベ	22,000	90	1,980,000	
中国塗料	77,000	491	37,807,000	
日本特殊塗料	20,000	307	6,140,000	
藤倉化成	31,700	393	12,458,100	
太陽ホールディングス	20,700	2,028	41,979,600	
D I C	960,000	139	133,440,000	
サカタックス	47,000	337	15,839,000	
東洋インキSCホールディン	227,000	284	64,468,000	
アルプス技研	11,400	627	7,147,800	
サニックス	36,300	218	7,913,400	
ダイオーズ	4,700	490	2,303,000	
日本空調サービス	6,700	720	4,824,000	
オリエンタルランド	67,900	8,220	558,138,000	
ダスキン	75,500	1,506	113,703,000	
パーク24	122,500	1,004	122,990,000	
明光ネットワークジャパン	22,900	702	16,075,800	
ファルコSDホールディングス	13,600	900	12,240,000	
クレスコ	6,000	658	3,948,000	
フジ・メディア・HD	2,470	114,200	282,074,000	
秀英予備校	4,100	302	1,238,200	
田谷	900	663	596,700	
ラウンドワン	78,300	471	36,879,300	
リゾートトラスト	38,600	1,134	43,772,400	
オービック	7,420	14,500	107,590,000	
ティーディーシーソフトウェア	4,800	771	3,700,800	
ヤフー	17,366	24,420	424,077,720	
ビー・エム・エル	16,500	1,811	29,881,500	
ワタベウェディング	7,500	703	5,272,500	
トレンドマイクロ	104,700	2,228	233,271,600	
もしもしホットライン	41,500	692	28,718,000	
東急コミュニティー	6,500	2,451	15,931,500	
リソー教育	2,585	4,905	12,679,425	
日本オラクル	37,900	2,515	95,318,500	
アルファシステムズ	6,400	1,233	7,891,200	
フューチャーアーキテクト	286	30,050	8,594,300	
ウェアハウス	5,500	241	1,325,500	
シーエーシー	16,300	623	10,154,900	
ソフトバンク・テクノ	5,700	595	3,391,500	
トーセ	6,000	520	3,120,000	
ユー・エス・エス	32,740	7,140	233,763,600	
オービックビジネスC	6,000	3,625	21,750,000	

日立ビジネスソリュー	7,700	1,004	7,730,800
伊藤忠テクノソリュー	27,900	3,520	98,208,000
アイティフォー	26,300	264	6,943,200
東京個別指導学院	17,000	140	2,380,000
東計電算	4,500	1,036	4,662,000
エクスネット	18	114,000	2,052,000
テー・オー・ダブリュー	8,500	463	3,935,500
大塚商会	18,900	5,330	100,737,000
総合メディカル	5,700	2,565	14,620,500
サイボウズ	433	22,700	9,829,100
ソフトブレーン	333	7,830	2,607,390
アグレックス	6,800	747	5,079,600
セントラルスポーツ	8,000	1,013	8,104,000
電通国際情報S	14,600	748	10,920,800
ウェザーニューズ	7,100	2,007	14,249,700
C I J	24,200	307	7,429,400
WOWOW	73	202,500	14,782,500
フルキャストホールディングス	198	17,240	3,413,520
富士フイルムHLDGS	537,600	1,889	1,015,526,400
コニカミノルタHLDGS	634,500	540	342,630,000
資生堂	418,000	1,401	585,618,000
ライオン	291,000	461	134,151,000
高砂香料	83,000	356	29,548,000
マンダム	25,200	1,977	49,820,400
ミルボン	13,500	2,382	32,157,000
ファンケル	63,400	1,048	66,443,200
コーセー	40,700	1,940	78,958,000
ドクターシーラボ	151	403,000	60,853,000
ポーラ・オルビスHD	25,600	2,092	53,555,200
エステー	15,700	987	15,495,900
コニシ	18,200	1,021	18,582,200
長谷川香料	32,200	1,219	39,251,800
小林製薬	35,000	4,085	142,975,000
荒川化学工業	20,000	672	13,440,000
メック	18,500	276	5,106,000
日本高純度化学	72	202,800	14,601,600
荏原ユーザライト	3,500	1,932	6,762,000
アース製薬	18,200	2,891	52,616,200
イハラケミカル	44,000	300	13,200,000
北興化学	11,000	220	2,420,000
大成ラミック	7,200	2,429	17,488,800
クミアイ化学	59,000	303	17,877,000
日本農薬	58,000	315	18,270,000
昭和シエル石油	225,000	515	115,875,000
コスモ石油	696,000	212	147,552,000
富士興産	89,000	75	6,675,000
ニチレキ	35,000	382	13,370,000
東燃ゼネラル石油	380,000	772	293,360,000
ユシロ化学	13,700	864	11,836,800
ビービー・カストロール	9,800	325	3,185,000
AOCホールディングス	58,300	487	28,392,100
MORESCO	5,500	758	4,169,000
出光興産	29,800	8,070	240,486,000
JXホールディングス	2,792,700	451	1,259,507,700
横浜ゴム	307,000	428	131,396,000
東洋ゴム	190,000	181	34,390,000
ブリヂストン	788,700	1,723	1,358,930,100
住友ゴム	196,200	917	179,915,400
藤倉ゴム	15,500	281	4,355,500

オカモト	93,000	302	28,086,000
アキレス	205,000	108	22,140,000
フコク	10,600	673	7,133,800
ニッタ	24,800	1,392	34,521,600
クリエートメディック	7,000	808	5,656,000
東海ゴム工業	46,500	853	39,664,500
三ツ星ベルト	67,000	402	26,934,000
バンドー化学	90,000	291	26,190,000
鬼怒川ゴム	55,000	650	35,750,000
旭硝子	1,239,000	632	783,048,000
日本板硝子	1,079,000	139	149,981,000
石塚硝子	31,000	142	4,402,000
有沢製作所	42,000	287	12,054,000
日本山村硝子	100,000	200	20,000,000
日本電気硝子	483,000	752	363,216,000
オハラ	9,500	774	7,353,000
住友大阪セメント	511,000	225	114,975,000
太平洋セメント	1,478,000	158	233,524,000
デイ・シイ	25,500	249	6,349,500
リゾートソリューション	23,000	145	3,335,000
日本ヒュ-ム	21,000	328	6,888,000
日本コンクリ-ト	40,000	233	9,320,000
東海カーボン	218,000	392	85,456,000
日本カーボン	115,000	205	23,575,000
東洋炭素	13,900	3,090	42,951,000
ノリタケ	130,000	224	29,120,000
TOTO	389,000	623	242,347,000
日本碍子	327,000	902	294,954,000
日本特殊陶業	217,000	948	205,716,000
ダントーホールディングス	39,000	82	3,198,000
MARUWA	7,400	3,415	25,271,000
品川リフラクトリーズ	63,000	234	14,742,000
黒崎播磨	54,000	245	13,230,000
東京窯業	30,000	182	5,460,000
ニッカトー	9,200	474	4,360,800
フジミインコーポレーテッド	23,000	943	21,689,000
エーアンドエ-マテリアル	53,000	79	4,187,000
ニチアス	112,000	421	47,152,000
新日本製鐵	6,602,000	186	1,227,972,000
住友金属工業	4,661,000	133	619,913,000
神戸製鋼所	3,486,000	119	414,834,000
日新製鋼	890,000	115	102,350,000
中山製鋼所	128,000	80	10,240,000
合同製鐵	140,000	197	27,580,000
JFEホールディングス	595,900	1,353	806,252,700
東京製鐵	127,100	630	80,073,000
共英製鋼	26,800	1,529	40,977,200
大和工業	57,400	2,266	130,068,400
東京鐵鋼	51,000	249	12,699,000
大阪製鐵	15,700	1,480	23,236,000
淀川製鋼所	179,000	346	61,934,000
東洋鋼鈹	60,000	273	16,380,000
住友鋼管	16,700	618	10,320,600
丸一鋼管	77,200	1,779	137,338,800
モリ工業	40,000	259	10,360,000
大同特殊鋼	421,000	489	205,869,000
日本高周波	99,000	86	8,514,000
日本金属工業	195,000	66	12,870,000
日本冶金工	184,500	121	22,324,500

山陽特殊製鋼	124,000	413	51,212,000
愛知製鋼	133,000	398	52,934,000
日立金属	164,000	841	137,924,000
日本金属	63,000	138	8,694,000
大平洋金属	175,000	367	64,225,000
日本電工	90,000	337	30,330,000
栗本鉄工所	127,000	168	21,336,000
旭テック	225,000	32	7,200,000
日本鑄鉄管	27,000	176	4,752,000
日本製鋼所	388,000	518	200,984,000
三菱製鋼	151,000	202	30,502,000
日亜鋼業	40,000	197	7,880,000
日本精線	19,000	367	6,973,000
日本軽金属	568,000	103	58,504,000
大紀アルミニウム	39,000	342	13,338,000
三井金属	683,000	196	133,868,000
東邦亜鉛	142,000	282	40,044,000
三菱マテリアル	1,569,000	211	331,059,000
住友鉱山	651,000	992	645,792,000
DOWAホールディングス	300,000	488	146,400,000
古河機金	425,000	65	27,625,000
大阪チタニウム	24,700	3,225	79,657,500
東邦チタニウム	40,800	1,254	51,163,200
住友軽金属	604,000	72	43,488,000
古河スカイ	101,000	175	17,675,000
古河電工	791,000	172	136,052,000
住友電工	888,600	825	733,095,000
フジクラ	377,000	222	83,694,000
昭和電線HLDGS	326,000	75	24,450,000
東京特殊電線	35,000	80	2,800,000
タツタ電線	47,000	351	16,497,000
日立電線	198,000	167	33,066,000
沖電線	27,000	158	4,266,000
カナレ電気	3,500	1,200	4,200,000
平河ヒューテック	4,400	721	3,172,400
リョービ	141,000	277	39,057,000
アサヒHD	35,100	1,543	54,159,300
東洋製罐	177,900	1,017	180,924,300
ホッカンホールディングス	61,000	222	13,542,000
コロナ	11,500	1,180	13,570,000
横河ブリッジHLDGS	52,000	553	28,756,000
日本橋梁	10,350	492	5,092,200
駒井ハルテック	50,000	233	11,650,000
サクラダ	222,000	34	7,548,000
高田機工	23,000	203	4,669,000
三和ホールディングス	251,000	252	63,252,000
文化シャッター-	66,000	283	18,678,000
東洋シャッター-	7,500	359	2,692,500
住生活グループ	327,000	1,476	482,652,000
日本フィルコン	18,800	413	7,764,400
ノーリツ	49,400	1,378	68,073,200
長府製作所	24,300	1,995	48,478,500
リンナイ	40,500	5,480	221,940,000
ユニプレス	38,200	2,252	86,026,400
ダイニチ工業	12,800	712	9,113,600
日東精工	34,000	200	6,800,000
三洋工業	33,000	156	5,148,000
岡部	50,800	389	19,761,200
日立ツール	14,600	845	12,337,000

中国工業	38,000	88	3,344,000
東プレ	48,400	780	37,752,000
高周波熱錬	33,500	626	20,971,000
東京製綱	158,000	179	28,282,000
バイオラックス	10,800	1,706	18,424,800
日本発条	181,900	673	122,418,700
中央発條	28,000	281	7,868,000
アドバネクス	51,000	63	3,213,000
三浦工業	37,400	2,156	80,634,400
タクマ	85,000	346	29,410,000
ツガミ	61,000	549	33,489,000
オークマ	151,000	478	72,178,000
東芝機械	137,000	384	52,608,000
アマダ	355,000	480	170,400,000
アイダエンジニア	65,100	360	23,436,000
牧野フライス	125,000	467	58,375,000
オーエスジー	110,700	982	108,707,400
ダイジェット	29,000	145	4,205,000
旭ダイヤモンド	61,700	943	58,183,100
森精機製作所	132,400	676	89,502,400
ディスコ	25,300	4,155	105,121,500
日東工器	14,700	1,809	26,592,300
豊田自動織機	218,800	2,123	464,512,400
豊和工業	130,000	66	8,580,000
大阪機工	98,000	89	8,722,000
石川製作所	55,000	63	3,465,000
東洋機械金属	20,400	199	4,059,600
津田駒工業	60,000	191	11,460,000
エンシュウ	62,000	90	5,580,000
島精機製作所	32,800	1,320	43,296,000
日阪製作所	32,000	836	26,752,000
やまびこ	9,900	868	8,593,200
ペガサスミシン製造	24,700	218	5,384,600
ナプテスコ	104,300	1,397	145,707,100
三井海洋開発	20,800	1,281	26,644,800
レオン自動機	21,000	189	3,969,000
S M C	75,100	12,250	919,975,000
新川	19,600	368	7,212,800
ホソカワミクロン	39,000	344	13,416,000
ユニオンツール	13,800	1,320	18,216,000
オイレス工業	27,900	1,489	41,543,100
サト - ホールディングス	26,400	956	25,238,400
日本エアーテック	6,800	353	2,400,400
日精樹脂工業	20,000	316	6,320,000
ワイエイシイ	10,500	613	6,436,500
小松製作所	1,192,400	1,852	2,208,324,800
住友重機械	642,000	452	290,184,000
日立建機	128,300	1,312	168,329,600
日工	33,000	293	9,669,000
巴工業	9,500	1,355	12,872,500
井関農機	258,000	169	43,602,000
T O W A	23,600	423	9,982,800
丸山製作所	57,000	180	10,260,000
北川鉄工所	115,000	147	16,905,000
シンニッタン	23,200	334	7,748,800
クボタ	1,151,000	642	738,942,000
荏原実業	6,400	1,201	7,686,400
東洋エンジニア	144,000	292	42,048,000
三菱化工機	78,000	134	10,452,000

月島機械	38,000	612	23,256,000
帝国電機製作所	8,500	1,370	11,645,000
東京機械	82,000	51	4,182,000
新東工業	54,900	690	37,881,000
渋谷工業	14,400	848	12,211,200
アイチ コーポレーション	41,800	331	13,835,800
小森コーポレーション	71,600	513	36,730,800
鶴見製作所	14,000	556	7,784,000
住友精密	35,000	458	16,030,000
酒井重工業	49,000	160	7,840,000
荏原製作所	410,000	262	107,420,000
石井鉄工所	37,000	155	5,735,000
西島製作所	29,000	956	27,724,000
千代田化工建	214,000	801	171,414,000
ダイキン工業	306,200	1,996	611,175,200
オルガノ	48,000	587	28,176,000
ト・ヨ・カネツ	135,000	151	20,385,000
栗田工業	138,700	2,026	281,006,200
椿本チエイン	128,000	397	50,816,000
大同工業	51,000	131	6,681,000
日本コンベヤ	80,000	79	6,320,000
日 機 装	78,000	667	52,026,000
木村化工機	22,900	299	6,847,100
新興プランテック	55,100	630	34,713,000
アネスト岩田	42,000	316	13,272,000
ダイフク	110,500	387	42,763,500
加藤製作所	57,000	246	14,022,000
油研工業	44,000	165	7,260,000
タダノ	116,000	471	54,636,000
フジテック	70,000	489	34,230,000
シーケーディ	67,200	555	37,296,000
キトー	102	55,900	5,701,800
平和	52,000	1,337	69,524,000
理想科学工業	17,200	1,066	18,335,200
SANKYO	72,800	3,815	277,732,000
日本金銭機械	22,300	594	13,246,200
マースエンジニアリング	13,600	1,330	18,088,000
福島工業	7,500	935	7,012,500
オーイズミ	8,500	263	2,235,500
ダイコク電機	11,300	741	8,373,300
ア マ ノ	72,900	669	48,770,100
JUKI	144,000	176	25,344,000
サンデン	125,000	225	28,125,000
蛇の目マシン	233,000	55	12,815,000
ブラザー工業	310,500	958	297,459,000
マックス	38,000	947	35,986,000
モリタホールディングス	40,000	451	18,040,000
グローリー	71,700	1,625	116,512,500
大和冷機工業	35,000	393	13,755,000
セガサミーホールディングス	258,200	1,715	442,813,000
日本ピストンリング	91,000	157	14,287,000
リ ケ ン	87,000	289	25,143,000
T P R	26,500	910	24,115,000
ホシザキ電機	48,400	1,796	86,926,400
大豊工業	16,900	688	11,627,200
日本精工	535,000	496	265,360,000
N T N	556,000	295	164,020,000
ジェイテクト	229,700	746	171,356,200
不 二 越	241,000	329	79,289,000



ミネベア	357,000	320	114,240,000
日本トムソン	77,000	436	33,572,000
T H K	159,700	1,508	240,827,600
ユーシン精機	12,000	1,450	17,400,000
前澤給装工業	9,400	1,048	9,851,200
イーグル工業	30,000	615	18,450,000
前澤工業	17,400	204	3,549,600
日本ピラ - 工業	25,000	579	14,475,000
キッツ	98,700	311	30,695,700
日立	5,396,000	417	2,250,132,000
東芝	5,059,000	314	1,588,526,000
三菱電機	2,403,000	722	1,734,966,000
富士電機	724,000	220	159,280,000
東洋電機製造	42,000	301	12,642,000
安川電機	282,000	635	179,070,000
シンフォニア テクノロジー	145,000	158	22,910,000
明電舎	238,000	261	62,118,000
オリジン電気	35,000	234	8,190,000
デンヨー	22,700	1,027	23,312,900
日立工機	64,400	590	37,996,000
三桜工業	30,600	529	16,187,400
マキタ	156,600	2,454	384,296,400
東芝テック	150,000	279	41,850,000
芝浦メカトロニクス	42,000	197	8,274,000
マブチモーター	32,800	3,215	105,452,000
日本電産	129,900	6,980	906,702,000
宮越ホールディングス	8,400	194	1,629,600
高岳製作所	95,000	175	16,625,000
ダイヘン	142,000	269	38,198,000
J V C ケンウッド	144,800	284	41,123,200
第一精工	5,600	2,052	11,491,200
日新電機	48,000	445	21,360,000
大崎電気	35,000	733	25,655,000
オムロン	267,600	1,580	422,808,000
日東工業	36,200	913	33,050,600
I D E C	31,500	808	25,452,000
エルピーダメモリ	324,400	313	101,537,200
ジーエス・ユアサ コーポ	463,000	406	187,978,000
サクサホールディングス	61,000	115	7,015,000
メルコホールディングス	13,200	1,984	26,188,800
テクノメディカ	13	280,100	3,641,300
日本電気	3,303,000	164	541,692,000
富士通	2,317,000	428	991,676,000
沖電気	927,000	73	67,671,000
岩崎通信機	107,000	76	8,132,000
電気興業	74,000	333	24,642,000
サンケン電気	121,000	253	30,613,000
ナカヨ通信機	24,000	282	6,768,000
アイホン	14,000	1,514	21,196,000
ルネサスエレクトロニクス	62,200	448	27,865,600
セイコーエプソン	163,900	985	161,441,500
ワコム	472	119,200	56,262,400
アルバック	44,100	973	42,909,300
アクセル	11,200	1,538	17,225,600
ピクセラ	9,900	171	1,692,900
ナナオ	20,300	1,579	32,053,700
日本信号	56,000	458	25,648,000
京三製作所	52,000	341	17,732,000
能美防災	31,000	520	16,120,000

ホーチキ	19,000	392	7,448,000
日本無線	62,000	216	13,392,000
パナソニック	2,745,700	644	1,768,230,800
シャープ	1,160,000	664	770,240,000
アンリツ	115,000	821	94,415,000
富士通ゼネラル	57,000	458	26,106,000
日立国際電気	55,000	645	35,475,000
ソニー	1,499,300	1,350	2,024,055,000
T D K	125,700	3,280	412,296,000
帝国通信工業	59,000	123	7,257,000
ミツミ電機	84,800	551	46,724,800
タムラ製作所	80,000	184	14,720,000
アルプス電気	189,500	524	99,298,000
池上通信機	76,000	55	4,180,000
パイオニア	340,500	342	116,451,000
日本電波工業	18,500	895	16,557,500
日本トリム	2,750	1,836	5,049,000
ローランド ディー・ジー	10,500	834	8,757,000
日本コロムビア	235,000	28	6,580,000
山水電気	1,498,000	2	2,996,000
フオスタ - 電機	22,700	1,061	24,084,700
クラリオン	147,000	136	19,992,000
S M K	77,000	239	18,403,000
ヨコオ	20,000	354	7,080,000
東光	109,000	136	14,824,000
ティアック	131,000	29	3,799,000
ホシデン	65,200	529	34,490,800
ヒロセ電機	41,800	6,690	279,642,000
日本航空電子	55,000	522	28,710,000
T O A	27,000	474	12,798,000
ユニデン	70,000	251	17,570,000
アルパイン	46,800	865	40,482,000
スミダコーポレーション	14,700	467	6,864,900
アイコム	13,300	1,983	26,373,900
船井電機	21,500	1,970	42,355,000

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
横河電機	260,800	709	184,907,200	
新電元工業	85,000	330	28,050,000	
山武	61,700	1,625	100,262,500	
日本光電工業	47,900	1,911	91,536,900	
チノール	47,000	199	9,353,000	
共和電業	3,000	228	684,000	
日本電子材料	10,400	366	3,806,400	
堀場製作所	44,400	2,283	101,365,200	
アドバンテスト	178,600	692	123,591,200	
小野測器	23,000	210	4,830,000	
エスベック	25,100	482	12,098,200	
パナソニック電工SUNX	21,200	381	8,077,200	
キーエンス	53,600	18,430	987,848,000	
日置電機	11,700	1,325	15,502,500	
シスメックス	84,600	2,474	209,300,400	
メガチップス	19,700	1,223	24,093,100	
OBARA GROUP	17,100	863	14,757,300	
日本電産コパル電子	24,900	463	11,528,700	
ミヤチテクノス	11,700	606	7,090,200	
東京電波	7,000	375	2,625,000	
澤藤電機	14,000	220	3,080,000	
デンソー	593,700	2,115	1,255,675,500	
コーセル	35,000	1,129	39,515,000	
日立メディコ	18,000	818	14,724,000	
新日本無線	18,000	211	3,798,000	
オプテックス	16,600	996	16,533,600	
千代田インテグレ	11,700	943	11,033,100	
東光電気	15,000	292	4,380,000	
スタンレー電気	161,100	1,143	184,137,300	
岩崎電気	88,000	155	13,640,000	
ウシオ電機	145,800	1,095	159,651,000	
岡谷電機	12,900	340	4,386,000	
ヘリオステクノH	21,900	148	3,241,200	
日本セラミック	15,800	1,380	21,804,000	
新神戸電機	18,000	1,707	30,726,000	
日本デジタル研究所	20,100	774	15,557,400	
古河電池	17,000	332	5,644,000	
双信電機	11,800	318	3,752,400	
山一電機	23,600	173	4,082,800	
図研	15,700	521	8,179,700	
日本電子	90,000	206	18,540,000	
カシオ	229,000	442	101,218,000	
ファナック	250,200	11,970	2,994,894,000	
日本シイエムケイ	51,800	279	14,452,200	
エンプラス	12,100	1,623	19,638,300	
ローム	118,400	3,620	428,608,000	
浜松ホトニクス	93,800	2,707	253,916,600	
三井ハイテック	31,700	312	9,890,400	
新光電気工業	80,500	553	44,516,500	
京セラ	199,800	6,120	1,222,776,000	
協栄産業	29,000	144	4,176,000	
太陽誘電	107,800	610	65,758,000	
村田製作所	252,100	3,955	997,055,500	
ユーシン	33,400	612	20,440,800	
双葉電子工業	41,200	1,258	51,829,600	

日東電工	207,400	2,824	585,697,600	
北陸電気工業	97,000	108	10,476,000	
東海理化電機	56,200	1,183	66,484,600	
ニチコン	75,600	743	56,170,800	
日本ケミコン	138,000	246	33,948,000	
K O A	30,300	698	21,149,400	
三井造船	929,000	121	112,409,000	
日立造船	950,500	103	97,901,500	
佐世保重工業	156,000	130	20,280,000	
三菱重工業	4,028,000	334	1,345,352,000	
川崎重工業	1,746,000	196	342,216,000	
I H I	1,642,000	188	308,696,000	
日本車輛	88,000	288	25,344,000	
日本輸送機	32,000	209	6,688,000	
近畿車輛	36,000	241	8,676,000	
日産自動車	3,036,000	679	2,061,444,000	
いすゞ自動車	1,519,000	371	563,549,000	
トヨタ自動車	3,116,485	2,626	8,183,889,610	*
日野自動車	343,000	467	160,181,000	
三菱自動車工業	5,374,000	91	489,034,000	
エフテック	8,300	882	7,320,600	
武蔵精密工業	23,200	1,675	38,860,000	
日産車体	70,000	787	55,090,000	
新明和工業	108,000	331	35,748,000	
極東開発工業	41,700	559	23,310,300	
日信工業	43,900	1,085	47,631,500	
トピー工業	180,000	195	35,100,000	
ティラド	87,000	259	22,533,000	
曙ブレーキ	121,800	338	41,168,400	
タチエス	31,300	1,351	42,286,300	
N O K	116,200	1,385	160,937,000	
フタバ産業	67,800	422	28,611,600	
カヤバ工業	166,000	381	63,246,000	
シロキ工業	53,000	211	11,183,000	
市光工業	58,000	131	7,598,000	
大同メタル工業	37,000	828	30,636,000	
プレス工業	110,000	366	40,260,000	
カルソニックカンセイ	143,000	451	64,493,000	
太平洋工業	49,000	370	18,130,000	
ケーヒン	49,600	1,300	64,480,000	
河西工業	29,000	379	10,991,000	
アイシン精機	197,800	2,191	433,379,800	
富士機工	28,000	198	5,544,000	
マツダ	1,993,000	131	261,083,000	
ダイハツ	223,000	1,428	318,444,000	
愛知機械	54,000	270	14,580,000	
今仙電機製作所	17,500	868	15,190,000	
本田技研	2,027,600	2,473	5,014,254,800	
スズキ	502,400	1,571	789,270,400	
富士重工業	759,000	485	368,115,000	
ヤマハ発動機	391,400	970	379,658,000	
ショーワ	51,100	451	23,046,100	
小糸製作所	120,000	1,104	132,480,000	
T B K	24,000	374	8,976,000	
エクセディ	32,600	2,293	74,751,800	
ミツバ	44,000	589	25,916,000	
豊田合成	67,900	1,203	81,683,700	
愛三工業	24,900	609	15,164,100	
ヨロズ	14,400	1,759	25,329,600	

エフ・シー・シー	39,300	1,581	62,133,300
新家工業	58,000	118	6,844,000
シマノ	91,000	3,625	329,875,000
タカタ	43,400	1,589	68,962,600
テイ・エス テック	50,700	1,228	62,259,600
小野 建	20,600	646	13,307,600
はるやま商事	11,100	402	4,462,200
佐島電機	17,500	456	7,980,000
カップクリエイト	17,450	1,797	31,357,650
エコトレーディング	5,900	707	4,171,300
伯東	14,600	747	10,906,200
コンドーテック	17,400	483	8,404,200
中山福	14,400	597	8,596,800
ライトオン	17,700	584	10,336,800
ナガイレーベン	31,400	1,001	31,431,400
ジーンズメイト	7,800	172	1,341,600
三菱食品	21,700	2,118	45,960,600
良品計画	25,100	3,725	93,497,500
三城ホールディングス	29,300	632	18,517,600
松田産業	17,400	1,206	20,984,400
メディパルHD	255,400	813	207,640,200
アドヴァン	14,300	713	10,195,900
S P K	5,800	1,335	7,743,000
アズワン	15,500	1,580	24,490,000
スズデン	8,000	520	4,160,000
尾家産業	6,800	828	5,630,400
シモジマ	14,600	1,010	14,746,000
ドウシシャ	11,300	2,324	26,261,200
コナカ	27,700	611	16,924,700
高速	14,100	645	9,094,500
ハウス ローゼ	2,700	1,255	3,388,500
G - 7ホールディングス	6,000	371	2,226,000
イオン北海道	17,400	367	6,385,800
コジマ	31,600	503	15,894,800
コーナン商事	25,200	1,297	32,684,400
黒田電気	29,300	809	23,703,700
ネットワンシステムズ	534	215,900	115,290,600
エコス	8,400	473	3,973,200
ワタミ	28,000	1,825	51,100,000
マルシェ	6,800	705	4,794,000
ドン・キホーテ	45,900	2,749	126,179,100
丸文	18,700	324	6,058,800
メガネトップ	33,900	894	30,306,600
西松屋チェーン	51,800	601	31,131,800
ゼンショーホールディングス	90,300	1,040	93,912,000
ハピネット	12,600	663	8,353,800
幸楽苑	14,900	1,215	18,103,500
トーメンエレクトロニクス	10,700	941	10,068,700
ハークスレイ	6,600	533	3,517,800
サイゼリヤ	35,000	1,203	42,105,000
エクセル	11,400	770	8,778,000
マルカキカイ	7,900	668	5,277,200
アルゴグラフィックス	8,800	1,024	9,011,200
ガリバーインターナショナル	7,190	2,725	19,592,750
日本エム・ディ・エム	20,400	241	4,916,400
ポプラ	7,600	472	3,587,200
ユナイテッドアローズ	25,500	1,485	37,867,500
進和	14,300	880	12,584,000
エスケイジャパン	5,500	243	1,336,500

ダイトエレクトロン	10,600	424	4,494,400
ハイデイ日高	10,500	1,304	13,692,000
シークス	15,000	983	14,745,000
京都きもの友禅	16,700	897	14,979,900
コロワイド	79,000	562	44,398,000
田中商事	7,400	433	3,204,200
オーハシテクニカ	13,400	598	8,013,200
壱番屋	9,600	2,244	21,542,400
マクニカ	12,100	1,790	21,659,000
白銅	7,900	783	6,185,700
トップカルチャー	9,200	359	3,302,800
スギホールディングス	42,500	2,271	96,517,500
島津製作所	287,000	646	185,402,000
J M S	37,000	236	8,732,000
クボテック	52	21,800	1,133,600
モリテックス	5,300	322	1,706,600
長野計器	17,100	787	13,457,700
ブイ・テクノロジー	34	314,000	10,676,000
スター精密	38,700	692	26,780,400
東京計器	85,000	144	12,240,000
愛知時計	26,000	280	7,280,000
日本電産トーソク	11,600	890	10,324,000
東京精密	43,100	1,512	65,167,200
ニコン	418,700	1,679	702,997,300
トプコン	55,500	377	20,923,500
オリンパス	283,300	1,230	348,459,000
理研計器	19,600	552	10,819,200
大日本スクリー - ン	227,000	653	148,231,000
キヤノン電子	22,000	1,883	41,426,000
タムロン	21,000	1,885	39,585,000
HOYA	584,300	1,651	964,679,300
ノーリツ鋼機	21,900	361	7,905,900
エー・アンド・デイ	23,400	254	5,943,600
キヤノン	1,492,900	3,285	4,904,176,500
リコー	723,000	640	462,720,000
日本電産コパル	18,900	857	16,197,300
日本電産サンキョー	57,000	509	29,013,000
シチズンホールディングス	287,400	462	132,778,800
リズム時計	117,000	141	16,497,000
大研医器	3,800	826	3,138,800
パラマウントベッドHD	20,600	2,331	48,018,600
SHOBI	3,700	487	1,801,900
SRIスポーツ	15,700	839	13,172,300
バンダイナムコHLDGS	257,400	1,094	281,595,600
共立印刷	28,000	208	5,824,000
フランスベッドHLDGS	162,000	145	23,490,000
パイロットコーポレーション	212	149,300	31,651,600
エイベックス・グループHD	44,800	975	43,680,000
トッパン・フォームズ	51,500	572	29,458,000
フジシールインターナショナル	26,900	1,418	38,144,200
タカラトミー	78,900	534	42,132,600
廣濟堂	20,300	195	3,958,500
アーク	81,600	74	6,038,400
レック	7,600	1,225	9,310,000
タカノ	9,800	452	4,429,600
プロネクサス	27,100	383	10,379,300
ホクシン	17,700	153	2,708,100
ウッドワン	40,000	286	11,440,000
大建工業	99,000	248	24,552,000

きもと	20,500	491	10,065,500
凸版印刷	731,000	568	415,208,000
大日本印刷	732,000	761	557,052,000
図書印刷	38,000	130	4,940,000
共同印刷	82,000	180	14,760,000
日本写真印刷	40,300	939	37,841,700
光村印刷	3,000	247	741,000
藤森工業	18,100	1,111	20,109,100
宝印刷	14,200	571	8,108,200
前澤化成工業	18,100	799	14,461,900
アシックス	223,700	843	188,579,100
ツツミ	12,100	1,825	22,082,500
ジェイエスピー	16,300	1,181	19,250,300
ニチハ	27,900	840	23,436,000
ローランド	24,800	688	17,062,400
エフピコ	11,100	5,170	57,387,000
小松ウオール工業	9,100	811	7,380,100
ヤマハ	176,600	684	120,794,400
河合楽器	90,000	146	13,140,000
クリナップ	28,300	497	14,065,100
ビジョン	21,200	3,150	66,780,000
天馬	20,300	694	14,088,200
兼松日産農林	38,000	164	6,232,000
キングジム	20,300	594	12,058,200
リンテック	45,600	1,362	62,107,200
田崎真珠	50,000	48	2,400,000
信越ポリマー	49,500	334	16,533,000
東リ	66,000	148	9,768,000
イトーキ	51,600	169	8,720,400
任天堂	137,400	10,500	1,442,700,000
三菱鉛筆	20,500	1,377	28,228,500
タカラスタンダード	111,000	610	67,710,000
コクヨ	125,200	552	69,110,400
ナカバヤシ	52,000	186	9,672,000
ニフコ	56,200	2,119	119,087,800
グローブライド	118,000	87	10,266,000
岡村製作所	84,000	568	47,712,000
日本バルカー	98,000	200	19,600,000
MUTOHホールディングス	29,000	208	6,032,000
伊藤忠	1,892,300	780	1,475,994,000
丸紅	2,075,000	478	991,850,000
スクロール	32,800	277	9,085,600
高島	41,000	195	7,995,000
F&Aアクアホールディングス	18,100	770	13,937,000
三陽商会	123,000	182	22,386,000
長瀬産業	134,500	862	115,939,000
ナイガイ	71,000	47	3,337,000
蝶理	141,000	90	12,690,000
豊田通商	264,500	1,359	359,455,500
オンワードホールディングス	155,000	581	90,055,000
三共生興	40,600	274	11,124,400
兼松	504,000	76	38,304,000
美津濃	119,000	405	48,195,000
ツカモトコーポレーション	41,000	93	3,813,000
ファミリーマート	72,800	3,160	230,048,000
ルック	41,000	203	8,323,000
三井物産	2,047,400	1,213	2,483,496,200
日本紙パルプ	123,000	283	34,809,000
東京エレクトロン	202,100	4,075	823,557,500

日立ハイテクノロジーズ	71,900	1,728	124,243,200
カメイ	31,000	793	24,583,000
東都水産	40,000	139	5,560,000
スターゼン	81,000	235	19,035,000
セイコーHD	139,000	152	21,128,000
山 善	91,600	572	52,395,200
椿本興業	25,000	211	5,275,000
住友商事	1,400,000	1,049	1,468,600,000
日本ユニシス	57,000	492	28,044,000
内田洋行	55,000	212	11,660,000
三菱商事	1,727,400	1,583	2,734,474,200
第一実業	50,000	337	16,850,000
キャノンマーケティングJPN	79,000	893	70,547,000
西華産業	89,000	207	18,423,000
佐藤商事	20,900	451	9,425,900
菱洋エレクトロ	26,800	896	24,012,800
東京産業	25,500	245	6,247,500
ユアサ商事	245,000	116	28,420,000
神鋼商事	60,000	185	11,100,000
阪和興業	238,000	345	82,110,000
カナデン	2,000	505	1,010,000
菱電商事	36,000	443	15,948,000
ニプロ	95,700	654	62,587,800
フルサト工業	14,200	642	9,116,400
岩谷産業	265,000	257	68,105,000
すてきナイスグループ	104,000	160	16,640,000
昭光通商	88,000	121	10,648,000
ニチモウ	37,000	170	6,290,000
極東貿易	29,000	213	6,177,000
イワキ	36,000	184	6,624,000
兼松エレクトロニクス	15,200	798	12,129,600
三愛石油	57,000	347	19,779,000
稲畑産業	63,900	470	30,033,000
G S Iクレオス	61,000	105	6,405,000
明和産業	19,200	216	4,147,200
ゴ - ルドウイン	57,000	356	20,292,000
ユニ・チャ - ム	138,900	3,840	533,376,000
デサント	63,000	417	26,271,000
ヤマトインタ - ナショナル	15,500	376	5,828,000
東邦ホールディングス	76,000	1,088	82,688,000
サンゲツ	42,100	2,089	87,946,900
ミツウロコグループ	38,600	486	18,759,600
シナネン	52,000	343	17,836,000
伊藤忠エネクス	52,600	437	22,986,200
サンリオ	59,800	3,965	237,107,000
サンワ テクノス	11,500	706	8,119,000
リョーサン	38,600	1,618	62,454,800
新光商事	26,200	606	15,877,200
トーホー	52,000	315	16,380,000
三信電気	33,900	649	22,001,100
東陽テクニカ	34,900	824	28,757,600
モスフード サービス	31,200	1,538	47,985,600
加賀電子	25,700	807	20,739,900
三益半導体	21,100	668	14,094,800
ソーダニツカ	2,000	338	676,000
立花エレテック	14,500	718	10,411,000
木曽路	27,200	1,448	39,385,600
千 趣 会	42,600	522	22,237,200
タカキユー	18,500	139	2,571,500



ケーヨー	44,600	500	22,300,000
アデランス	30,100	990	29,799,000
上新電機	51,000	849	43,299,000
日本瓦斯	22,700	1,209	27,444,300
ベスト電器	74,000	183	13,542,000
マルエツ	48,000	287	13,776,000
ロイヤルホールディングス	39,900	920	36,708,000
東天紅	17,000	116	1,972,000
いなげや	26,700	929	24,804,300
島忠	53,500	1,773	94,855,500
チヨダ	31,100	1,384	43,042,400
ライフコーポレーション	14,900	1,455	21,679,500
カスミ	48,700	513	24,983,100
リンガーハット	21,600	1,049	22,658,400
さが美	20,000	89	1,780,000
MR MAX	24,000	322	7,728,000
テナアライド	18,700	274	5,123,800
AOKIホールディングス	21,900	1,288	28,207,200
オークワ	34,000	1,209	41,106,000
コメリ	32,400	2,381	77,144,400
青山商事	65,300	1,392	90,897,600
しまむら	27,500	7,980	219,450,000
CFSコーポレーション	19,000	371	7,049,000
高島屋	321,000	553	177,513,000
松屋	47,700	438	20,892,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	123,000	596	73,308,000
丸栄	40,000	89	3,560,000
ニッセンHD	47,100	352	16,579,200
パルコ	43,000	577	24,811,000
丸井グループ	309,400	589	182,236,600
クレディセゾン	193,700	1,514	293,261,800
原信ナルスHLDGS	13,200	1,320	17,424,000
井筒屋	126,000	45	5,670,000
ダイエー	146,750	267	39,182,250
イズミヤ	83,000	400	33,200,000
イオン	836,000	1,016	849,376,000
ユニー	177,900	694	123,462,600
イズミ	71,000	1,378	97,838,000
東武ストア	31,000	265	8,215,000
平和堂	43,600	982	42,815,200
フジ	26,500	1,842	48,813,000
ヤオコー	10,400	2,601	27,050,400
ゼビオ	28,500	1,844	52,554,000
ケーズホールディングス	59,100	3,095	182,914,500
Palta	24,900	1,003	24,974,700
OLYMPIC	15,800	729	11,518,200
日産東京販売HD	35,000	132	4,620,000
新生銀行	1,848,000	81	149,688,000
あおぞら銀行	739,000	214	158,146,000
三菱UFJフィナンシャルG	17,955,300	336	6,032,980,800
りそなホールディングス	2,064,000	343	707,952,000
三井住友トラストHD	4,650,000	228	1,060,200,000
三井住友フィナンシャルG	1,793,700	2,233	4,005,332,100
第四銀行	309,000	254	78,486,000
北越銀行	248,000	158	39,184,000
西日本シティ銀行	831,000	223	185,313,000
札幌北洋ホール	356,800	276	98,476,800
千葉銀行	935,000	497	464,695,000
横浜銀行	1,523,000	362	551,326,000

常陽銀行	914,000	340	310,760,000
群馬銀行	542,000	418	226,556,000
武蔵野銀行	38,200	2,585	98,747,000
千葉興業銀行	44,800	413	18,502,400
筑波銀行	98,400	257	25,288,800
東京都民銀行	45,000	973	43,785,000
七十七銀行	372,000	324	120,528,000
青森銀行	178,000	236	42,008,000
秋田銀行	163,000	226	36,838,000
山形銀行	145,000	386	55,970,000
岩手銀行	16,000	3,410	54,560,000
東邦銀行	200,000	232	46,400,000
東北銀行	132,000	122	16,104,000
みちのく銀行	119,000	145	17,255,000
ふくおかフィナンシャルG	962,000	324	311,688,000
静岡銀行	716,000	808	578,528,000
十六銀行	298,000	252	75,096,000
スルガ銀行	231,000	706	163,086,000
八十二銀行	437,000	446	194,902,000
山梨中央銀行	145,000	323	46,835,000
大垣共立銀行	316,000	252	79,632,000
福井銀行	205,000	240	49,200,000
北國銀行	284,000	291	82,644,000
清水銀行	8,100	2,909	23,562,900
滋賀銀行	223,000	533	118,859,000
南都銀行	221,000	438	96,798,000
百五銀行	214,000	312	66,768,000
京都銀行	424,000	665	281,960,000
三重銀行	98,000	175	17,150,000
ほくほくフィナンシャルG	1,661,000	153	254,133,000
広島銀行	700,000	364	254,800,000
山陰合同銀行	141,000	588	82,908,000
中国銀行	194,000	1,088	211,072,000
鳥取銀行	75,000	147	11,025,000
伊予銀行	254,000	762	193,548,000

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
百十四銀行	260,000	366	95,160,000	
四国銀行	171,000	300	51,300,000	
阿波銀行	210,000	526	110,460,000	
鹿児島銀行	153,000	543	83,079,000	
大分銀行	153,000	222	33,966,000	
宮崎銀行	157,000	193	30,301,000	
肥後銀行	184,000	443	81,512,000	
佐賀銀行	144,000	190	27,360,000	
十八銀行	151,000	204	30,804,000	
沖縄銀行	18,000	3,390	61,020,000	
琉球銀行	50,000	975	48,750,000	
八千代銀行	12,400	1,844	22,865,600	
みずほフィナンシャルG	30,466,400	110	3,351,304,000	
紀陽ホールディングス	947,000	119	112,693,000	
山口フィナンシャルG	237,000	741	175,617,000	
フィデック	141	8,350	1,177,350	
芙蓉総合リース	22,600	2,711	61,268,600	
興銀リース	33,000	1,745	57,585,000	
東京センチュリーリース	63,600	1,473	93,682,800	
S B Iホールディングス	25,031	5,520	138,171,120	
日本証券金融	98,000	362	35,476,000	
大阪証券金融	28,500	154	4,389,000	
アイフル	215,800	108	23,306,400	
日本アジア投資	171,000	54	9,234,000	
ポケットカード	24,200	262	6,340,400	
長野銀行	81,000	157	12,717,000	
名古屋銀行	214,000	250	53,500,000	
愛知銀行	8,600	4,515	38,829,000	
第三銀行	135,000	160	21,600,000	
中京銀行	99,000	203	20,097,000	
東日本銀行	113,000	164	18,532,000	
大光銀行	84,000	257	21,588,000	
愛媛銀行	150,000	228	34,200,000	
トマト銀行	95,000	129	12,255,000	
みなと銀行	215,000	145	31,175,000	
京葉銀行	195,000	379	73,905,000	
関西アーバン銀行	331,000	126	41,706,000	
栃木銀行	119,000	278	33,082,000	
北日本銀行	7,400	1,972	14,592,800	
東和銀行	236,000	88	20,768,000	
福島銀行	284,000	41	11,644,000	
大東銀行	154,000	63	9,702,000	
リコーリース	16,300	1,732	28,231,600	
イオン クレジットサービス	105,400	1,225	129,115,000	
アコム	47,660	1,356	64,626,960	
ジャックス	144,000	228	32,832,000	
オリコ	341,500	70	23,905,000	
日立キャピタル	46,600	1,075	50,095,000	
オリックス	123,370	6,570	810,540,900	
三菱UFJリース	60,130	3,120	187,605,600	
ジャフコ	28,800	1,367	39,369,600	
トモニホールディングス	182,200	338	61,583,600	
大和証券G本社	2,350,000	251	589,850,000	
野村ホールディングス	5,133,700	259	1,329,628,300	
岡三証券グループ	202,000	249	50,298,000	

丸三証券	80,100	245	19,624,500
東洋証券	90,000	106	9,540,000
東海東京HD	272,000	215	58,480,000
光世証券	60,000	57	3,420,000
水戸証券	71,000	96	6,816,000
いちよし証券	53,700	341	18,311,700
松井証券	140,700	379	53,325,300
NK S Jホールディングス	496,000	1,523	755,408,000
だいこう証券ビジ	14,800	258	3,818,400
マネックスG	1,898	11,200	21,257,600
カブドットコム証券	96,600	233	22,507,800
極東証券	32,000	415	13,280,000
岩井コスモホールディング	22,600	235	5,311,000
フィデアホール	136,300	204	27,805,200
池田泉州HD	976,800	113	110,378,400
MS & A D	708,900	1,455	1,031,449,500
SONY F H	227,100	1,160	263,436,000
小林洋行	5,200	177	920,400
第一生命	12,684	75,300	955,105,200
東京海上HD	900,400	1,772	1,595,508,800
アサックス	32	83,200	2,662,400
NECキャピタルソリューション	8,000	1,176	9,408,000
T & Dホールディングス	864,300	725	626,617,500
三井不動産	1,052,000	1,132	1,190,864,000
三菱地所	1,660,000	1,175	1,950,500,000
平和不動産	225,500	156	35,178,000
東京建物	452,000	258	116,616,000
ダイビル	69,900	452	31,594,800
サンケイビル	40,900	300	12,270,000
東急不動産	477,000	293	139,761,000
京阪神ビルディング	28,600	344	9,838,400
住友不動産	568,000	1,349	766,232,000
東宝不動産	25,500	399	10,174,500
太平洋興発	82,000	78	6,396,000
大京	364,000	158	57,512,000
テーオーシー	92,200	359	33,099,800
東京楽天地	27,000	285	7,695,000
レオパレス21	183,200	165	30,228,000
フジ住宅	30,400	373	11,339,200
空港施設	25,000	308	7,700,000
明和地所	13,400	345	4,623,000
住友不動産販売	8,560	3,075	26,322,000
ゴールドクレスト	21,350	1,229	26,239,150
東栄住宅	16,000	818	13,088,000
リロ・ホールディング	7,600	2,015	15,314,000
日本エスリード	10,200	668	6,813,600
東急リパブル	21,500	594	12,771,000
飯田産業	26,800	561	15,034,800
日神不動産	13,800	428	5,906,400
アーネストワン	39,100	822	32,140,200
タカラレーベン	27,100	495	13,414,500
サンヨーハウジ名古屋	102	77,100	7,864,200
イオンモール	108,100	1,671	180,635,100
フージャースコーポレーション	362	32,150	11,638,300
タクトホーム	124	62,900	7,799,600
ランド	24,700	16	395,200
トーセイ	224	19,770	4,428,480
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,474	52,100	76,795,400
サンフロンティア不動産	211	8,620	1,818,820

ランドビジネス	160	14,450	2,312,000
東武鉄道	1,365,000	400	546,000,000
相鉄ホールディングス	386,000	238	91,868,000
東京急行	1,415,000	380	537,700,000
京浜急行	618,000	705	435,690,000
小田急電鉄	771,000	752	579,792,000
京王電鉄	672,000	543	364,896,000
京成電鉄	387,000	572	221,364,000
富士急行	66,000	456	30,096,000
新京成電鉄	23,000	348	8,004,000
東日本旅客鉄道	417,900	4,835	2,020,546,500
西日本旅客鉄道	209,000	3,345	699,105,000
東海旅客鉄道	2,086	652,000	1,360,072,000
西日本鉄道	312,000	370	115,440,000
ハマキョウレックス	6,800	2,246	15,272,800
サカイ引越センター	4,300	1,630	7,009,000
近畿鉄道	2,172,000	308	668,976,000
阪急阪神HLDGS	1,613,000	325	524,225,000
南海電鉄	502,000	342	171,684,000
京阪電鉄	540,000	377	203,580,000
名糖運輸	10,500	610	6,405,000
名古屋鉄道	840,000	209	175,560,000
日本通運	951,000	298	283,398,000
ヤマトホールディングス	488,900	1,247	609,658,300
山九	291,000	286	83,226,000
日新	91,000	191	17,381,000
丸運	12,500	192	2,400,000
丸全昭和運輸	81,000	249	20,169,000
センコー	96,000	304	29,184,000
トナミホールディングス	50,000	167	8,350,000
日本梱包運輸	71,900	789	56,729,100
日石輸送	28,000	187	5,236,000
福山通運	146,000	471	68,766,000
セイノーホールディングス	186,000	600	111,600,000
神奈川中央交通	25,000	418	10,450,000
日立物流	50,000	1,338	66,900,000
日本郵船	1,903,000	178	338,734,000
商船三井	1,259,000	261	328,599,000
川崎汽船	742,000	126	93,492,000
NSユニテッド海運	103,000	114	11,742,000
乾汽船	27,700	256	7,091,200
明治海運	21,500	224	4,816,000
飯野海運	116,200	329	38,229,800
共栄タンカー	21,000	117	2,457,000
第一中央汽船	156,000	93	14,508,000
全日本空輸	3,204,000	216	692,064,000
パスコ	22,000	275	6,050,000
国際航業HLDGS	14,000	206	2,884,000
三菱倉庫	171,000	825	141,075,000
三井倉庫	112,000	288	32,256,000
住友倉庫	176,000	368	64,768,000
渋沢倉庫	58,000	218	12,644,000
ヤマタネ	118,000	112	13,216,000
東陽倉庫	40,000	170	6,800,000
日本トランスシティ	50,000	255	12,750,000
ケイヒン	45,000	88	3,960,000
安田倉庫	20,700	484	10,018,800
東洋埠頭	72,000	130	9,360,000
宇徳	17,500	243	4,252,500

上組	266,000	655	174,230,000
サンリツ	1,700	510	867,000
キムラユニティー	4,800	679	3,259,200
キューソー流通システム	8,000	852	6,816,000
郵船ロジスティクス	18,800	1,005	18,894,000
近鉄エクスプレス	21,400	2,213	47,358,200
東海運	16,400	216	3,542,400
バンテック	28	231,400	6,479,200
東京放送HD	142,200	995	141,489,000
日本テレビ放送網	20,820	11,650	242,553,000
テレビ朝日	601	125,900	75,665,900
スカパーJ S A T H D	1,803	38,850	70,046,550
テレビ東京HD	15,200	1,025	15,580,000
アイ・ティー・シーネットワーク	20,700	496	10,267,200
イー・アクセス	1,803	17,150	30,921,450
NECモバイルリング	8,600	2,608	22,428,800
日本電信電話	1,092,200	3,925	4,286,885,000
KDDI	3,681	496,500	1,827,616,500
光通信	21,800	1,984	43,251,200
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,544	141,900	2,773,293,600
GMOインターネット	70,300	286	20,105,800
学研ホールディングス	72,000	147	10,584,000
ゼンリン	34,300	696	23,872,800
昭文社	14,200	590	8,378,000
角川グループHLDGS	22,400	2,598	58,195,200
インプレスホールディングス	19,300	97	1,872,100
東京電力	1,918,500	202	387,537,000
中部電力	792,000	1,479	1,171,368,000
関西電力	980,800	1,218	1,194,614,400
中国電力	332,200	1,395	463,419,000
北陸電力	235,400	1,456	342,742,400
東北電力	600,500	768	461,184,000
四国電力	221,300	2,274	503,236,200
九州電力	530,800	1,121	595,026,800
北海道電力	224,900	1,123	252,562,700
沖縄電力	14,400	3,240	46,656,000
電源開発	149,000	2,070	308,430,000
東京瓦斯	2,900,000	350	1,015,000,000
大阪瓦斯	2,332,000	306	713,592,000
東邦瓦斯	611,000	489	298,779,000
北海道瓦斯	44,000	272	11,968,000
西部瓦斯	272,000	212	57,664,000
静岡瓦斯	62,500	518	32,375,000
アイネット	10,800	465	5,022,000
松竹	156,000	756	117,936,000
東宝	169,600	1,349	228,790,400
エイチ・アイ・エス	25,500	2,223	56,686,500
東映	99,000	367	36,333,000
葵プロモーション	7,500	406	3,045,000
NTTデータ	1,464	243,800	356,923,200
共立メンテナンス	12,500	1,467	18,337,500
イチネンホールディングス	26,500	399	10,573,500
建設技術研究所	14,000	530	7,420,000
アインファーマシーズ	13,100	3,560	46,636,000
燦ホールディングス	5,800	1,417	8,218,600
スバル興業	3,000	253	759,000
東京テアトル	96,000	104	9,984,000
ホリプロ	9,000	1,046	9,414,000
よみうりランド	55,000	242	13,310,000

東京都競馬	195,000	106	20,670,000
常磐興産	78,000	85	6,630,000
カナモト	32,000	644	20,608,000
東京ドーム	201,000	191	38,391,000
D T S	24,500	945	23,152,500
スクウェア・エニックス・HD	77,400	1,460	113,004,000
シーイーシー	15,700	369	5,793,300
カプコン	45,400	1,630	74,002,000
東海観光	108,000	20	2,160,000
日本空港ビルデング	75,700	1,028	77,819,600
トランス・コスモス	32,600	970	31,622,000
乃村工藝社	48,000	238	11,424,000
ジャステック	15,900	448	7,123,200
S C S K	48,200	1,210	58,322,000
藤田観光	65,000	260	16,900,000
近畿日本ツーリスト	79,000	85	6,715,000
日本管財	9,400	1,431	13,451,400
トーカイ	10,100	1,707	17,240,700
白洋舎	5,000	211	1,055,000
セコム	243,700	3,445	839,546,500
日本システムウエア	9,100	309	2,811,900
セントラル警備保障	11,600	790	9,164,000
アイネス	28,600	539	15,415,400
丹青社	24,000	195	4,680,000
メイテック	39,300	1,500	58,950,000
T K C	20,000	1,607	32,140,000
アサツー ディ・ケイ	43,800	2,059	90,184,200
富士ソフト	32,000	1,380	44,160,000
応用地質	26,600	928	24,684,800
船井総合研究所	26,800	541	14,498,800
N S D	45,800	593	27,159,400
進学会	12,700	285	3,619,500
丸紅建材リース	24,000	153	3,672,000
コナミ	107,100	2,106	225,552,600
ベネッセホールディングス	77,800	3,760	292,528,000
イオンディライト	28,300	1,529	43,270,700
ナック	6,400	1,484	9,497,600
福井コンピュータ	1,500	364	546,000
ニチイ学館	49,000	955	46,795,000
ダイセキ	40,400	1,285	51,914,000
日鐵商事	51,000	205	10,455,000
元気寿司	7,500	976	7,320,000
トラスコ中山	30,000	1,448	43,440,000
ヤマダ電機	115,330	5,200	599,716,000
オートバックスセブン	28,100	3,670	103,127,000
アークランドサカモト	15,400	1,488	22,915,200
ニトリホールディングス	46,950	7,250	340,387,500
グルメ杵屋	15,000	444	6,660,000
愛眼	19,400	370	7,178,000
吉野家ホールディングス	645	107,000	69,015,000
加藤産業	34,200	1,460	49,932,000
イノテック	13,900	515	7,158,500
イエローハット	22,300	1,206	26,893,800
富士エレクトロニクス	12,100	1,106	13,382,600
松屋フーズ	11,500	1,625	18,687,500
J B C Cホールディングス	18,600	520	9,672,000
J Kホールディングス	22,000	362	7,964,000
サガミチェーン	28,000	528	14,784,000
日伝	9,900	2,366	23,423,400

北沢産業	11,000	156	1,716,000
杉本商事	13,200	706	9,319,200
因幡電機産業	28,100	2,190	61,539,000
住金物産	112,000	205	22,960,000
ブレナス	26,600	1,278	33,994,800
ミニストップ	17,600	1,411	24,833,600
アークス	32,500	1,518	49,335,000
パロー	47,100	1,205	56,755,500
ミスミグループ本社	87,600	1,701	149,007,600
江守商事	5,100	883	4,503,300
アルテック	11,500	197	2,265,500
ベルク	11,600	1,245	14,442,000
大庄	11,400	1,050	11,970,000
タキヒヨー	36,000	436	15,696,000
ファーストリテイリング	55,400	14,590	808,286,000
ソフトバンク	1,074,500	2,189	2,352,080,500
スズケン	91,200	2,158	196,809,600
サンドラッグ	45,100	2,346	105,804,600
ジェコス	17,000	316	5,372,000
ヤマザワ	6,200	1,338	8,295,600
やまや	3,600	1,140	4,104,000
ペルーナ	29,350	578	16,964,300
合計	369,223,759		240,208,368,152

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)



## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		4,879,699,361	1,772,064,269
コール・ローン		32,888,316	147,974,661
株式		272,428,796,276	256,151,315,535
投資信託受益証券		874,593,729	837,461,150
投資証券		3,408,513,729	4,207,565,600
派生商品評価勘定		65,505,002	65,636,265
未収入金		-	44,393,879
未収配当金		334,311,908	410,545,051
差入委託証拠金		1,546,882,393	665,362,488
流動資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898
資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		38,469,437	530,178
未払金		90,614,999	-
未払解約金		151,113,000	24,364,000
流動負債合計		280,197,436	24,894,178
負債合計		280,197,436	24,894,178
純資産の部			
元本等			
元本		218,946,599,573	223,825,007,857
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		64,344,393,705	40,452,416,863
元本等合計		283,290,993,278	264,277,424,720
純資産合計		283,290,993,278	264,277,424,720
負債純資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
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。	(1)先物取引 同左

	(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。	(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22年2月16日から平成23年2月15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23年2月16日から平成24年2月15日までとなっております。

## (追加情報)

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	225,558,619,520円	218,946,599,573円
同期中追加設定元本額	58,766,187,799円	58,808,343,556円
同期中解約元本額	65,378,207,746円	53,929,935,272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	449,309,260円	1,160,905,075円
D I A M 外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	28,399,848,603円	32,471,102,298円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	176,140,694円	206,051,376円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	990,180,130円	1,129,874,746円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,235,372,366円	1,349,118,541円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	203,263,880円	218,830,130円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	520,238,727円	556,210,749円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	367,609,658円	395,187,328円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	84,318,046円	73,937,118円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	758,783,644円	810,799,004円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	83,852,177円	152,569,044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)	618,457,817円	575,714,000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)	6,123,852,190円	5,746,716,635円
D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド(適格機関投資家限定)	17,296,875,235円	16,543,915,689円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	99,933,771円	100,143,177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)	9,408,940,283円	9,371,248,475円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,600,344,297円	1,524,049,561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)	185,451,338円	184,616,196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)	1,054,945,626円	1,059,991,991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)	99,908,449円	96,638,946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)	175,894,362円	169,861,698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)	17,662,021,759円	17,638,143,945円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,825,117,749円	8,728,538,484円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,049,289,705円	3,068,245,521円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,715,959,778円	2,630,100,383円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,271,925,509円	6,896,514,050円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	5,490,772,309円	5,376,282,397円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	6,930,556,787円	7,067,524,414円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,735,244,023円	4,782,528,160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)	4,252,778,602円	4,430,149,513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)	68,116,711円	57,674,003円

D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	264,757,976円	円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	19,210,077,485円	19,356,115,653円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	3,329,303,835円	3,198,492,340円
D I A Mグローバル分散ファンドVA（適格機関投資家限定）	138,987,345円	145,100,301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）	24,321,797,768円	24,662,404,063円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,470,487,028円	2,411,197,220円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	4,423,500,876円	4,574,947,245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）	14,650,854,548円	15,063,905,369円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	168,745円	179,384円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	264,627円	274,212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）	19,200,854,775円	19,838,954,865円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	79,229円	84,710円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	161,851円	169,848円
（合計）	218,946,599,573円	223,825,007,857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	218,946,599,573口	223,825,007,857口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) 派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2) 派生商品評価勘定 同左 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	35,359,431,353	15,824,531,452
投資信託受益証券	12,764,072	70,079,991
投資証券	646,973,221	28,825,338
合計	35,993,640,502	15,865,786,105

(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)

## (株式関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	283,495,470	-	280,215,690	3,279,780
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	466,412,712	-	467,818,499	1,405,787
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,325,999,007	-	1,296,872,623	29,126,384
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	688,876,255	-	695,188,380	6,312,125
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,384,732,390	-	3,435,800,863	51,068,473
	合 計	6,149,515,834	-	6,175,896,055	26,380,221

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	130,902,590	-	130,420,080	482,510
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	174,080,419	-	179,836,567	5,756,148
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	561,166,620	-	576,085,160	14,918,540
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	312,970,197	-	323,399,822	10,429,625
	米ドル S&P 500 FUTURE	1,696,068,454	-	1,730,544,008	34,475,554
	合 計	2,875,188,280	-	2,940,285,637	65,097,357

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (通貨関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	オーストラリアドル	8,277,500	-	8,218,000	59,500
	カナダドル	16,719,800	-	16,674,000	45,800
	ユーロ	53,848,500	-	53,615,000	233,500
	英ポンド	25,788,200	-	25,796,000	7,800
	米ドル	154,617,863	-	154,233,656	384,207
	買建				
	ノルウェークローネ	87,932,263	-	87,872,400	59,863
合 計		347,184,126	-	346,409,056	655,344

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	19,600,120	-	19,598,000	2,120
	英ポンド	11,888,780	-	11,888,000	780
	米ドル	30,756,000	-	30,752,000	4,000
	買建				
	ユーロ	39,226,920	-	39,196,000	30,920
	英ポンド	11,876,250	-	11,888,000	11,750
	米ドル	53,795,000	-	53,816,000	21,000
合 計		167,143,070	-	167,138,000	8,730

## (注) 時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
  3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2939円 (12,939円)	1.1807円 (11,807円)

[前](#) [次](#)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	EVEREST RE GROUP LTD	8,102	86.470	700,579.940	
	PARTNERRE LTD	7,570	65.050	492,428.500	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,784	31.190	398,732.960	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	73.470	623,980.710	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,065	37.430	1,162,762.950	
	BUNGE LTD	19,670	58.860	1,157,776.200	
	INVESCO LTD	81,821	21.620	1,768,970.020	
	ULTRA PETROLEUM CORP	22,514	28.950	651,780.300	
	ACE LTD	52,602	70.800	3,724,221.600	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	73,611	48.930	3,601,786.230	
	WEATHERFORD INTL LTD	134,715	15.950	2,148,704.250	
	NOBLE CORP	40,324	30.960	1,248,431.040	
	GARMIN LTD	20,043	40.760	816,952.680	
	TE CONNECTIVITY LTD	76,170	34.160	2,601,967.200	
	SCHLUMBERGER LTD	220,588	70.750	15,606,601.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY	71,207	18.600	1,324,450.200	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	22,783	56.360	1,284,049.880	
	XL GROUP PLC	53,089	20.290	1,077,175.810	
	INGERSOLL-RAND PLC	59,310	33.130	1,964,940.300	
	ACCENTURE PLC-CL A	104,286	52.630	5,488,572.180	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	33,560	38.990	1,308,504.400	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	27,146	16.760	454,966.960	
	COVIDIEN PLC	75,986	46.120	3,504,474.320	
	HERBALIFE LTD	21,823	54.520	1,189,789.960	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	27.020	604,626.540	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	51,048	36.950	1,886,223.600	
	NIELSEN HOLDINGS NV	16,327	29.600	483,279.200	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	80,171	33.480	2,684,125.080	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,408	5.970	659,135.760	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,354	30.650	1,052,950.100	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	1,027,000	0.655	672,685.000	
	AMAZON.COM INC	59,294	179.340	10,633,785.960	
	ABBOTT LABORATORIES	254,338	56.110	14,270,905.180	
	AES CORP	124,754	12.700	1,584,375.800	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,815	44.960	666,082.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	194,570	181.310	35,277,486.700	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	5.710	532,640.220	
	ADOBE SYSTEMS INC	81,219	29.200	2,371,594.800	
	AGCO CORP	14,077	49.840	701,597.680	
	AIRGAS INC	12,208	79.690	972,855.520	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,175	87.310	2,983,819.250	
	ENERGEN CORP	12,554	52.390	657,704.060	
	ALLERGAN INC	47,692	88.970	4,243,157.240	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	149,018	47.140	7,024,708.520	
	RALPH LAUREN CORP	9,673	147.320	1,425,026.360	
ALLSTATE CORP	84,600	28.690	2,427,174.000		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	121,377	56.580	6,867,510.660		
ALTERA CORPORATION	50,199	37.680	1,891,498.320		

	ALCOA INC	165,402	9.440	1,561,394.880	
	AMGEN INC	127,761	65.670	8,390,064.870	
	HESS CORP	47,762	58.560	2,796,942.720	
	BEAM INC	23,016	51.220	1,178,879.520	
	AMERICAN EXPRESS CO	181,425	48.670	8,829,954.750	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	75,772	41.260	3,126,352.720	
	AFLAC INC	73,710	43.870	3,233,657.700	
	AMERICAN INTL GROUP	82,528	25.070	2,068,976.960	
	ANALOG DEVICES	48,702	36.760	1,790,285.520	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	80,197	80.880	6,486,333.360	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	32,327	74.680	2,414,180.360	
	NABORS INDUSTRIES LTD	49,134	19.700	967,939.800	
	ARCH COAL INC	33,405	15.670	523,456.350	
	TIME WARNER	171,008	36.970	6,322,165.760	
	VALERO ENERGY CORP	88,182	20.080	1,770,694.560	
	APOLLO GROUP INC	22,785	56.920	1,296,922.200	
	APACHE CORP	61,668	98.090	6,049,014.120	
	APPLE INC	150,797	423.240	63,823,322.280	
	APPLIED MATERIALS INC	206,845	11.600	2,399,402.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,776	28.780	2,871,553.280	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	18,364	47.810	877,982.840	
	AMEREN CORP	51,264	32.290	1,655,314.560	
	ARROW ELECTRONICS INC	17,437	37.750	658,246.750	
	AUTOLIV INC	14,963	58.800	879,824.400	
	AUTODESK INC	38,885	32.530	1,264,929.050	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	77,786	54.660	4,251,782.760	
	AUTOZONE INC	4,387	340.140	1,492,194.180	
	AVERY DENNISON CORP	15,202	29.650	450,739.300	
	AVNET INC	22,835	32.160	734,373.600	
	AVON PRODUCTS INC	76,614	17.870	1,369,092.180	
	BMC SOFTWARE INC	28,920	31.650	915,318.000	
	BAKER HUGHES INC	69,228	51.950	3,596,394.600	
	BALL CORP	20,878	36.860	769,563.080	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	151,952	77.420	11,764,123.840	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	31,946	37.520	1,198,613.920	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	196,051	21.300	4,175,886.300	
	CR BARD INC	14,153	85.750	1,213,619.750	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	92,601	50.180	4,646,718.180	
	BED BATH & BEYOND INC	38,406	60.640	2,328,939.840	
	BECTON DICKINSON & CO	34,887	74.220	2,589,313.140	
	AMETEK INC	25,735	44.030	1,133,112.050	
	NII HOLDINGS INC	31,218	21.280	664,319.040	
	VERIZON COMM INC	464,509	38.570	17,916,112.130	
	WR BERKLEY CORP	18,150	34.990	635,068.500	
	BEST BUY CO INC	59,621	24.720	1,473,831.120	
	YUM! BRANDS INC	75,823	59.990	4,548,621.770	
	FIRSTENERGY CORP	76,736	42.380	3,252,071.680	
	SLM CORP	92,921	13.770	1,279,522.170	
	H&R BLOCK INC	55,467	16.250	901,338.750	
	BOEING CO	112,465	75.000	8,434,875.000	
	ROBERT HALF INTL INC	24,240	28.900	700,536.000	
	BORGWARNER INC	16,519	72.250	1,193,497.750	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	268,520	5.530	1,484,915.600	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26,111	67.370	1,759,098.070	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272,850	34.620	9,446,067.000	
	ONEOK INC	15,305	88.160	1,349,288.800	
	SEMPRA ENERGY	35,687	56.050	2,000,256.350	
	FEDEX CORP	48,665	88.510	4,307,339.150	
	VERISIGN INC	30,233	35.720	1,079,922.760	

AMPHENOL CORP	24,477	47.980	1,174,406.460
BROWN-FORMAN CORP	13,755	80.300	1,104,526.500
QUANTA SERVICES INC	33,320	22.030	734,039.600
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,732	17.890	460,345.480
SIRIUS XM RADIO INC	614,899	2.050	1,260,542.950
CSX CORP	173,731	23.530	4,087,890.430
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	14.400	538,689.600
CABOT OIL & GAS CORP	16,699	78.370	1,308,700.630
CAMPBELL SOUP CO	30,602	32.400	991,504.800
WHITING PETROLEUM CORP	17,265	51.500	889,147.500
CONSTELLATION BRANDS INC	30,765	20.700	636,835.500
CARDINAL HEALTH INC	55,062	41.400	2,279,566.800
CATERPILLAR INC	105,480	99.960	10,543,780.800
CELGENE CORP	72,999	70.260	5,128,909.740
CITRIX SYSTEMS INC	30,333	64.110	1,944,648.630
CHESAPEAKE ENERGY CORP	120,200	23.280	2,798,256.000
CENTURYLINK INC	92,807	36.980	3,432,002.860
CERNER CORP	20,155	62.690	1,263,516.950
JPMORGAN CHASE & CO	635,306	36.050	22,902,781.300
CHUBB CORP	49,163	69.310	3,407,487.530
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,516	44.800	1,053,516.800
CIGNA CORP	38,955	45.670	1,779,074.850
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	31.320	745,541.280
CINTAS CORP	13,173	38.040	501,100.920
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	164,569	5.050	831,073.450
CISCO SYSTEMS INC	891,472	18.830	16,786,417.760
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	25,703	68.820	1,768,880.460
CLOROX COMPANY	21,099	67.960	1,433,888.040
COCA-COLA CO/THE	338,528	69.340	23,473,531.520
COCA-COLA ENTERPRISES INC	49,318	25.720	1,268,458.960
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,864	89.450	7,054,384.800
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,730	32.700	1,397,271.000
AON CORP	46,043	46.740	2,152,049.820
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	110,849	24.890	2,759,031.610
COMERICA INC	31,637	28.490	901,338.130
NRG ENERGY, INC.	31,248	17.630	550,902.240
COMCAST CORP-CL A	337,071	25.400	8,561,603.400
CA INC	53,086	20.940	1,111,620.840
COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	24.410	562,992.240
CONAGRA FOODS INC	66,889	26.970	1,803,996.330
CONSOLIDATED EDISON INC	47,195	59.340	2,800,551.300
SARA LEE CORP	90,891	18.910	1,718,748.810
CAMERON INTERNATIONAL CORP	38,217	52.260	1,997,220.420
MOLSON COORS BREWING CO	24,801	44.660	1,107,612.660
CORNING INC	249,781	13.990	3,494,436.190
DIRECTV	123,996	43.030	5,335,547.880
COVANCE INC	10,195	49.240	502,001.800
CREE INC	21,128	23.060	487,211.680
COVENTRY HEALTH CARE INC	28,393	29.770	845,259.610
SEALED AIR CORP	30,348	17.480	530,483.040
BROADCOM CORP-CL A	76,142	31.230	2,377,914.660
CUMMINS INC	29,309	98.730	2,893,677.570
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,299	67.970	971,903.030
DR HORTON INC	39,483	13.480	532,230.840
DANAHER CORP	91,324	49.740	4,542,455.760
MOODY'S CORP	30,243	36.330	1,098,728.190
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	48,164	69.760	3,359,920.640
TARGET CORP	109,960	48.790	5,364,948.400

	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	15,093	56.810	857,433.330	
	DEERE & CO	66,793	83.750	5,593,913.750	
	DELL INC	271,070	15.820	4,288,327.400	
	MORGAN STANLEY	246,338	16.890	4,160,648.820	
	REPUBLIC SERVICES INC	53,213	27.780	1,478,257.140	
	DEVRY INC	12,485	41.870	522,746.950	
	THE WALT DISNEY CO	286,288	39.630	11,345,593.440	
	DOLLAR TREE INC	18,954	82.700	1,567,495.800	
	RR DONNELLEY & SONS CO	36,360	14.620	531,583.200	
	DOVER CORP	27,697	59.180	1,639,108.460	
	DOW CHEMICAL	190,281	30.980	5,894,905.380	
	OMNICOM GROUP	42,885	45.300	1,942,690.500	
	DTE ENERGY CO	28,132	53.760	1,512,376.320	
	DUKE ENERGY CORP	213,159	21.470	4,576,523.730	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	50,667	46.130	2,337,268.710	
	FLOWSERVE CORP	8,844	105.270	931,007.880	
	DARDEN RESTAURANTS INC	21,227	44.380	942,054.260	
	EBAY INC	186,649	31.200	5,823,448.800	
	EMC CORP/MASS	330,575	21.880	7,232,981.000	
	BANK OF AMERICA CORP	1,630,623	6.630	10,811,030.490	
	EL PASO CORP	120,489	26.220	3,159,221.580	
	CITIGROUP INC	472,863	30.000	14,185,890.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	23,682	43.260	1,024,483.320	
	EATON CORP	51,780	47.740	2,471,977.200	
	EATON VANCE CORP	11,913	24.870	296,276.310	
	DISH NETWORK CORP	30,117	28.880	869,778.960	
	ECOLAB INC	54,723	58.880	3,222,090.240	
	ELECTRONIC ARTS INC	52,870	19.455	1,028,585.850	
	SALESFORCE.COM INC	22,101	104.790	2,315,963.790	
	EMERSON ELECTRIC CO	119,595	48.700	5,824,276.500	
	ENTERGY CORP	27,589	72.000	1,986,408.000	
	EOG RESOURCES INC	42,985	105.520	4,535,777.200	
	EQUIFAX INC	15,777	39.580	624,453.660	
	EQT CORP	21,454	53.680	1,151,650.720	
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,944	112.100	2,123,622.400	
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	34,083	42.510	1,448,868.330	
	EXPRESS SCRIPTS INC	78,777	49.670	3,912,853.590	
	EXXON MOBIL CORP	792,090	85.720	67,897,954.800	
	FMC CORP	9,929	89.050	884,177.450	
	NEXTERA ENERGY INC	67,434	59.250	3,995,464.500	
	FAMILY DOLLAR STORES	18,264	53.800	982,603.200	
	ASSURANT INC	14,771	40.530	598,668.630	
	FASTENAL CO	45,490	45.010	2,047,504.900	
	FIFTH THIRD BANCORP	148,746	13.850	2,060,132.100	
	M&T BANK CORP	20,397	80.140	1,634,615.580	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	18,192	35.970	654,366.240	
	FISERV INC	23,158	59.190	1,370,722.020	
	FLIR SYSTEMS INC	30,904	25.610	791,451.440	
	MACY'S INC	75,831	34.870	2,644,226.970	
	FORD MOTOR CO	572,755	11.800	6,758,509.000	
	FOREST LABORATORIES INC	51,204	31.060	1,590,396.240	
	FOSSIL INC	8,025	80.670	647,376.750	
	FRANKLIN RESOURCES INC	24,134	101.800	2,456,841.200	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	154,165	40.600	6,259,099.000	
	GAP INC/THE	60,675	18.140	1,100,644.500	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	22,388	35.520	795,221.760	
	GENERAL DYNAMICS CORP	49,345	69.930	3,450,695.850	
	GENERAL MILLS INC	105,604	40.330	4,259,009.320	

	GENUINE PARTS CO	24,938	62.810	1,566,355.780	
	GILEAD SCIENCES INC	124,643	44.250	5,515,452.750	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	31,505	51.940	1,636,369.700	
	GOODRICH CORP	19,092	124.150	2,370,271.800	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	14.010	513,900.810	
	MCKESSON CORP	40,111	79.680	3,196,044.480	
	NVIDIA CORP	106,802	14.480	1,546,492.960	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,726,383	18.720	32,317,889.760	
	VW GRAINGER INC	8,547	191.260	1,634,699.220	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	22,545	47.990	1,081,934.550	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,927	46.170	1,104,709.590	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	41,880	28.250	1,183,110.000	
	HALLIBURTON CO	146,529	36.330	5,323,398.570	
	MONSTER BEVERAGE CORP	14,485	95.250	1,379,696.250	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,841	98.330	7,457,445.530	
	HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	40.330	1,478,901.100	
	HARRIS CORP	21,855	37.900	828,304.500	
	CONSOL ENERGY INC	36,761	37.210	1,367,876.810	
	HASBRO INC	17,406	32.910	572,831.460	
	HENRY SCHEIN INC	13,991	66.700	933,199.700	
	DENBURY RESOURCES INC	68,370	18.080	1,236,129.600	
	HJ HEINZ CO	52,070	53.110	2,765,437.700	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,984	65.130	1,041,037.920	
	HERSHEY FOODS CORP	25,491	61.000	1,554,951.000	
	HEWLETT-PACKARD CO	334,130	26.690	8,917,929.700	
	F5 NETWORKS INC	14,109	109.610	1,546,487.490	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	29,491	33.820	997,385.620	
	REYNOLDS AMERICAN INC	62,992	41.150	2,592,120.800	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	18,519	44.250	819,465.750	
	JUNIPER NETWORKS INC	85,477	21.340	1,824,079.180	
	HOLLYFRONTIER CORP	35,010	26.060	912,360.600	
	HOLOGIC INC	49,195	18.750	922,406.250	
	UNUM GROUP	49,083	21.840	1,071,972.720	
	HOME DEPOT INC	256,367	43.530	11,159,655.510	
	HORMEL FOODS CORP	24,530	29.290	718,483.700	
	HUDSON CITY BANCORP INC	86,651	7.240	627,353.240	
	CENTERPOINT ENERGY INC	69,448	19.550	1,357,708.400	
	HUMANA INC	25,341	94.310	2,389,909.710	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	13,732	46.030	632,083.960	
	RED HAT INC	34,463	42.960	1,480,530.480	
	BIOGEN IDEC INC	36,831	114.880	4,231,145.280	
	ILLINOIS TOOL WORKS	70,431	48.680	3,428,581.080	
	INTUIT INC	44,821	54.750	2,453,949.750	
	INTEL CORP	859,574	25.590	21,996,498.660	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,144	54.060	710,564.640	
	INTL GAME TECH	44,449	17.300	768,967.700	
	INTERNATIONAL PAPER CO	67,397	31.320	2,110,874.040	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88,192	10.590	933,953.280	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	41.680	816,094.400	
	JOHNSON & JOHNSON	447,344	65.200	29,166,828.800	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	63,376	17.650	1,118,586.400	
	JOHNSON CONTROLS INC	100,080	34.360	3,438,748.800	
	KLA-TENCOR CORP	24,993	48.570	1,213,910.010	
	DEVON ENERGY CORP	65,607	65.700	4,310,379.900	
	NSTAR	17,088	44.530	760,928.640	
	KELLOGG CO	38,305	51.400	1,968,877.000	
	KEYCORP	176,901	8.140	1,439,974.140	
	KIMBERLY-CLARK CORP	62,968	72.880	4,589,107.840	

BLACKROCK INC/NEW YORK	14,451	183.090	2,645,833.590
KOHL'S CORP	40,351	46.030	1,857,356.530
KROGER CO	94,372	24.320	2,295,127.040
LSI CORP	89,888	6.690	601,350.720
LAM RESEARCH CORP	20,796	39.000	811,044.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	33,115	33.140	1,097,431.100
LEGG MASON INC	22,970	25.500	585,735.000
LEGETT & PLATT INC	19,896	22.410	445,869.360
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,757	25.230	775,999.110
ELI LILLY & CO	177,048	40.330	7,140,345.840
LIMITED BRANDS	42,413	39.240	1,664,286.120
LINCOLN NATIONAL CORP	59,469	21.190	1,260,148.110
LINEAR TECH CORP	29,706	30.840	916,133.040
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	118,780	74.190	8,812,288.200
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,045	39.100	2,269,559.500
LOCKHEED MARTIN CORP	50,289	80.620	4,054,299.180
LOEWS CORP	61,921	38.480	2,382,720.080
RANGE RESOURCES CORP	23,850	58.020	1,383,777.000
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	19,286	49.470	954,078.420
LOWE'S COS INC	206,337	26.430	5,453,486.910
DOMINION RESOURCES INC/VA	88,598	51.290	4,544,191.420
IRON MOUNTAIN INC	33,638	32.080	1,079,107.040
SCANA CORP	15,400	44.300	682,220.000
MDU RESOURCES GROUP INC	32,188	21.500	692,042.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	66,033	11.440	755,417.520
MCCORMICK & CO INC	19,813	51.190	1,014,227.470
MCDONALD'S CORPORATION	170,451	99.700	16,993,964.700
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	45,478	47.750	2,171,574.500
MANPOWER INC	13,462	37.820	509,132.840
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	21,403	74.390	1,592,169.170
MARSH & MCLENNAN COS	85,095	31.030	2,640,497.850
ENERGIZER HOLDINGS INC	11,343	78.200	887,022.600
MASCO CORP	58,195	11.460	666,914.700
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	74.770	381,476.540
MATTEL INC	56,682	28.840	1,634,708.880
METLIFE INC	170,890	34.550	5,904,249.500
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	52,075	26.310	1,370,093.250
MEDTRONIC INC	169,366	39.100	6,622,210.600
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,641	12.450	1,066,230.450
CVS CAREMARK CORP	217,764	41.950	9,135,199.800
MERCK & CO. INC.	502,391	38.520	19,352,101.320
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	87.700	1,372,592.700
MICROSOFT CORP	1,227,806	27.840	34,182,119.040
MICRON TECH INC	164,842	7.250	1,195,104.500
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	35.990	965,179.820
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	94,204	15.620	1,471,466.480
3M CO	108,342	84.300	9,133,230.600
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	60.310	540,256.980
PROGRESS ENERGY INC	50,830	54.540	2,772,268.200
MOTOROLA SOLUTIONS INC	48,368	46.290	2,238,954.720
KANSAS CITY SOUTHERN	20,502	72.600	1,488,445.200
MURPHY OIL CORPORATION	30,207	59.200	1,788,254.400
MYLAN LABORATORIES	60,562	22.190	1,343,870.780
ILLUMINA INC	20,615	33.010	680,501.150
XCEL ENERGY INC	76,360	27.440	2,095,318.400
NATIONAL OILWELL VARCO INC	69,693	73.890	5,149,615.770
NETAPP INC	56,606	35.130	1,988,568.780

	SEARS HOLDINGS CORP	6,881	30.460	209,595.260	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,264	39.490	800,225.360	
	NEWELL RUBBERMAID INC	50,723	17.190	871,928.370	
	DUN & BRADSTREET CORP	8,370	77.570	649,260.900	
	NEWMONT MINING CORP	79,243	62.650	4,964,573.950	
	NIKE INC-CL B	58,194	98.470	5,730,363.180	
	NOBLE ENERGY INC	29,400	98.730	2,902,662.000	
	NORDSTROM INC	26,726	49.360	1,319,195.360	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	56,818	77.720	4,415,894.960	
	NORTHEAST UTILITIES	29,133	34.470	1,004,214.510	
	NISOURCE INC	44,250	22.800	1,008,900.000	
	COACH INC	45,740	62.320	2,850,516.800	
	NORTHERN TRUST CORP	31,465	42.000	1,321,530.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	48,456	58.620	2,840,490.720	
	WELLS FARGO & CO	820,034	29.410	24,117,199.940	
	NUCOR CORP	49,784	41.580	2,070,018.720	
	MONSANTO CO	85,459	79.200	6,768,352.800	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	79,591	47.680	3,794,898.880	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	132,129	97.880	12,932,786.520	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22,143	80.900	1,791,368.700	
	OMNICARE INC	18,060	33.780	610,066.800	
	ORACLE CORP	658,279	26.970	17,753,784.630	
	OWENS-ILLINOIS INC	23,621	21.650	511,394.650	
	PACCAR INC	52,618	42.050	2,212,586.900	
	PALL CORP	19,300	58.020	1,119,786.000	
	EXELON CORP	102,041	41.120	4,195,925.920	
	PARKER HANNIFIN CORP	26,410	81.220	2,145,020.200	
	PATTERSON COS INC	12,490	29.670	370,578.300	
	PAYCHEX INC	46,374	31.100	1,442,231.400	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	25,588	34.420	880,738.960	
	PPL CORPORATION	90,174	28.750	2,592,502.500	
	PEPSICO INC	258,974	65.660	17,004,232.840	
	PENTAIR INC	14,352	36.080	517,820.160	
	PERRIGO CO	13,145	99.580	1,308,979.100	
	PFIZER INC	1,272,209	21.940	27,912,265.460	
	CONOCOPHILLIPS	214,603	73.280	15,726,107.840	
	PETSMART INC	18,380	52.370	962,560.600	
	PG&E CORP	62,245	41.130	2,560,136.850	
	PITNEY BOWES INC	40,682	19.180	780,280.760	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,254	97.660	1,685,025.640	
	ALTRIA GROUP INC	336,357	28.910	9,724,080.870	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	84,364	61.570	5,194,291.480	
	AETNA INC	56,047	44.320	2,484,003.040	
	FLUOR CORP (NEW)	31,879	53.010	1,689,905.790	
	PPG INDUSTRIES INC	25,285	86.140	2,178,049.900	
	PRAXAIR INC	47,744	107.580	5,136,299.520	
	PRECISION CASTPARTS CORP	25,232	175.160	4,419,637.120	
	COSTCO WHOLESALE CORP	72,742	79.150	5,757,529.300	
	T ROWE PRICE GROUP INC	40,535	60.410	2,448,719.350	
	QUEST DIAGNOSTICS	24,069	57.450	1,382,764.050	
	PROCTER & GAMBLE CO	449,329	66.330	29,803,992.570	
	PROGRESSIVE CORP	97,111	19.620	1,905,317.820	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79,277	31.570	2,502,774.890	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	70,124	13.220	927,039.280	
	QUALCOMM INC	271,677	55.750	15,145,992.750	
	US BANCORP	311,086	28.260	8,791,290.360	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	86.790	784,234.440	
	ROSS STORES INC	38,750	50.310	1,949,512.500	

ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,158	63.940	649,502.520
ROPER INDUSTRIES INC	16,209	91.650	1,485,554.850
ROWAN COS INC	21,239	31.780	674,975.420
PEABODY ENERGY CORP	41,483	36.050	1,495,462.150
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,328	74.860	1,746,334.080
RAYTHEON COMPANY	61,426	48.700	2,991,446.200
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	16,767	77.200	1,294,412.400
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	104.960	892,684.800
FMC TECHNOLOGIES INC	36,804	52.630	1,936,994.520
KRAFT FOODS INC-A	268,447	38.020	10,206,354.940
SANDISK CORP	38,624	50.780	1,961,326.720
SAFWAY INC	56,305	21.400	1,204,927.000
ROCKWELL COLLINS INC	23,945	57.200	1,369,654.000
ST JUDE MEDICAL INC	49,860	35.490	1,769,531.400
THE TRAVELERS COMPANIES INC	68,088	60.100	4,092,088.800
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	44,008	27.170	1,195,697.360
PRICELINE.COM INC	7,926	484.280	3,838,403.280
SCHWAB (CHARLES) CORP	165,176	12.310	2,033,316.560
JOY GLOBAL INC	16,611	81.890	1,360,274.790
ZIMMER HOLDINGS INC	30,008	55.520	1,666,044.160
SPX CORP	7,436	66.730	496,204.280
SEI INVESTMENTS CO	31,573	18.120	572,102.760
WELLPOINT INC	55,584	72.210	4,013,720.640
AMERISOURCEBERGEN CORP	44,825	39.010	1,748,623.250
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,798	25.970	1,267,284.060
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,042	94.500	1,421,469.000
SIGMA-ALDRICH	20,592	63.420	1,305,944.640
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	74,340	53.420	3,971,242.800
ADVANCE AUTO PARTS	12,466	71.540	891,817.640
UNITED STATES STEEL CORP	20,827	27.290	568,368.830
SOUTHWESTERN ENERGY CO	55,432	32.510	1,802,094.320
EDISON INTERNATIONAL	46,526	40.490	1,883,837.740
SOUTHERN CO	145,483	44.790	6,516,183.570
BB&T CORP	102,369	26.730	2,736,323.370
SOUTHWEST AIRLINES	47,976	8.710	417,870.960
AT&T INC	968,742	29.760	28,829,761.920
CHEVRON CORP	327,303	109.060	35,695,665.180
MEADWESTVACO CORP	27,873	29.950	834,796.350
STANLEY BLACK & DECKER INC	29,304	71.850	2,105,492.400
STAPLES INC	126,463	15.020	1,899,474.260
STATE STREET CORP	82,469	43.170	3,560,186.730
STARBUCKS CORP	116,933	46.820	5,474,803.060
STRYKER CORP	44,084	52.260	2,303,829.840
NETFLIX INC	7,832	95.830	750,540.560
SUNOCO INC	17,700	41.160	728,532.000
STERICYCLE INC	12,270	79.810	979,268.700
SUNTRUST BANKS INC	96,662	20.470	1,978,671.140
SYMANTEC CORP	108,592	15.910	1,727,698.720
SYNOPSIS INC	22,281	27.470	612,059.070
SYSCO CORP	92,867	29.200	2,711,716.400
INTUITIVE SURGICAL INC	5,872	450.190	2,643,515.680
TEXAS INSTRUMENTS INC	185,622	30.670	5,693,026.740
TEXTRON INC	42,770	20.170	862,670.900
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	59,991	49.070	2,943,758.370
TIFFANY & CO	19,250	59.940	1,153,845.000
TOLL BROTHERS INC	20,812	22.500	468,270.000
TORCHMARK CORP	13,057	43.890	573,071.730
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	20.250	493,431.750



	DAVITA INC	18,022	78.620	1,416,889.640	
	TYSON FOODS INC	47,556	20.330	966,813.480	
	URS CORP	17,162	37.350	641,000.700	
	MARATHON OIL CORP	110,823	31.080	3,444,378.840	
	UNION PACIFIC CORP	80,006	111.360	8,909,468.160	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	141,651	76.030	10,769,725.530	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	176,372	52.620	9,280,694.640	
	SPRINT NEXTEL CORP	516,213	2.230	1,151,154.990	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,206	69.510	1,265,499.060	
	VF CORP	12,611	133.990	1,689,747.890	
	CBS CORP	100,965	28.610	2,888,608.650	

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,939	36.320	1,305,304.480	
	VULCAN MATERIALS CO	20,011	39.700	794,436.700	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,027	29.410	559,584.070	
	WALGREEN CO	146,465	34.400	5,038,396.000	
	WAL-MART STORES INC	311,734	59.040	18,404,775.360	
	WASTE MANAGEMENT INC	64,451	33.420	2,153,952.420	
	WATERS CORP	12,959	74.140	960,780.260	
	WASHINGTON POST	998	388.130	387,353.740	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	24,662	64.580	1,592,671.960	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	78.800	1,425,019.200	
	WALTER INDUSTRIES INC	10,524	57.440	604,498.560	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	66,265	61.390	4,068,008.350	
	WESTERN DIGITAL CORP	42,329	33.530	1,419,291.370	
	WEYERHAEUSER CO	88,971	19.210	1,709,132.910	
	WHIRLPOOL CORP	11,190	51.830	579,977.700	
	WYNN RESORTS LTD	12,936	107.530	1,391,008.080	
	WHOLE FOODS MARKET INC	21,819	72.680	1,585,804.920	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	18,704	25.170	470,779.680	
	CME GROUP INC	11,219	227.530	2,552,659.070	
	WILLIAMS COS INC	102,537	28.330	2,904,873.210	
	PEPCO HOLDINGS INC	36,572	20.110	735,462.920	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,827	43.420	774,048.340	
	WISCONSIN ENERGY CORP	35,977	34.510	1,241,566.270	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	37.740	872,095.920	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,983	52.930	687,190.190	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	40,324	16.810	677,846.440	
	CARMAX INC	38,348	30.930	1,186,103.640	
	XEROX CORP	243,920	8.110	1,978,191.200	
	XILINX INC	36,827	32.930	1,212,713.110	
	YAHOO! INC	204,636	15.510	3,173,904.360	
	CIMAREX ENERGY CO	12,720	61.190	778,336.800	
	TJX COMPANIES INC	62,811	65.560	4,117,889.160	
	HOSPIRA INC	25,220	30.350	765,427.000	
	GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	7.270	533,821.560	
	CBRE GROUP INC	50,310	16.570	833,636.700	
	LIBERTY GLOBAL INC	17,272	42.510	734,232.720	
	REGIONS FINANCIAL CORP	233,614	4.700	1,097,985.800	
	GOOGLE INC	41,260	623.140	25,710,756.400	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	48,345	8.300	401,263.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	62,799	43.790	2,749,968.210	
	MOSAIC CO/THE	49,222	54.850	2,699,826.700	
	NEWS CORP CLASS B	72,381	18.920	1,369,448.520	
	NEWS CORP INC CLASS A	294,557	18.650	5,493,488.050	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	11,212	32.600	365,511.200	
	CELANESE CORP	24,956	45.750	1,141,737.000	
	WINDSTREAM CORP	100,523	11.760	1,182,150.480	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	37,286	21.330	795,310.380	
	IHS INC-CLASS A	8,495	91.110	773,979.450	
	DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	17,131	42.350	725,497.850	
	EXPEDIA INC	14,880	29.500	438,960.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,523	166.210	1,915,237.830	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,711	51.900	2,112,900.900	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	27,877	41.010	1,143,235.770	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	50,710	16.210	822,009.100	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	24.230	565,334.360	

	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	13,552	113.910	1,543,708.320	
	VIACOM INC-CLASS B	84,583	46.930	3,969,480.190	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,315	341.120	1,471,932.800	
	UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	17,227	17.480	301,127.960	
	NYSE EURONEXT	43,767	27.790	1,216,284.930	
	VIRGIN MEDIA INC	47,938	22.850	1,095,383.300	
	MASTERCARD INC	18,319	348.830	6,390,216.770	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP	92,772	16.920	1,569,702.240	
	PHARMASSET INC	11,721	136.250	1,596,986.250	
	WESTERN UNION CO	102,998	18.600	1,915,762.800	
	SAIC INC	52,491	12.960	680,283.360	
	KBR INC	23,562	29.380	692,251.560	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	37,702	12.650	476,930.300	
	FIRST SOLAR INC	11,035	38.770	427,826.950	
	SPECTRA ENERGY CORP	100,338	30.600	3,070,342.800	
	TIME WARNER CABLE INC	53,147	64.300	3,417,352.100	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	59,253	13.440	796,360.320	
	DELTA AIR LINES INC	41,454	8.270	342,824.580	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	75.380	464,265.420	
	DISCOVER FINANCIAL	85,015	25.650	2,180,634.750	
	CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	102.410	1,524,987.310	
	LULULEMON ATHLETICA INC	16,598	59.870	993,722.260	
	VMWARE INC	15,614	85.300	1,331,874.200	
	TERADATA CORP	26,391	48.490	1,279,699.590	
	CALPINE CORP NPR	39,169	15.590	610,644.710	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	287,035	77.320	22,193,546.200	
	VISA INC	83,874	99.800	8,370,625.200	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	39,931	38.620	1,542,135.220	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	31.390	901,677.750	
	LORILLARD INC	23,305	113.860	2,653,507.300	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	17,233	44.880	773,417.040	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	22,552	38.140	860,133.280	
	MARATHON PETROLEUM CORP	60,615	31.830	1,929,375.450	
	CAREFUSION CORP	34,028	22.990	782,303.720	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	22,125	33.180	734,107.500	
	XYLEM INC	31,066	25.580	794,668.280	
	HCA HOLDINGS INC	33,601	22.460	754,678.460	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	48,273	38.270	1,847,407.710	
	VERISK ANALYTICS INC	25,396	39.770	1,009,998.920	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	33,053	71.830	2,374,196.990	
	CIT GROUP INC	30,698	37.110	1,139,202.780	
	DOLLAR GENERAL CORP	20,592	40.500	833,976.000	
	QEP RESOURCES INC	35,396	30.890	1,093,382.440	
	LIBERTY MEDIA CORP - LIBERTY CAPITAL	12,979	82.130	1,065,965.270	
	GENERAL MOTORS CO	116,861	23.240	2,715,849.640	
	ORCHARD SUPPLY PREFERRED	310	1.510	468.100	
米ドル小計	銘柄数 : 566	50,292,703		1,937,364,044.440	
	組入時価比率 : 56.37%			(148,963,921,377)	
	合計時価比率 : 57.03%				
英ポンド	XSTRATA PLC	332,865	10.430	3,471,781.950	
	AMEC PLC	62,610	9.920	621,091.200	
	ANTOFAGASTA PLC	58,006	12.960	751,757.760	
	SEVERN TRENT PLC	38,266	15.390	588,913.740	

BHP BILLITON PLC	342,236	20.140	6,892,633.040
BARCLAYS PLC	1,948,510	1.883	3,669,044.330
BALFOUR BEATTY PLC	141,722	2.797	396,396.430
BT GROUP PLC	1,312,092	1.995	2,617,623.540
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	192,735	7.165	1,380,946.270
AGGREKO PLC	36,191	21.230	768,334.930
TULLOW OIL PLC	157,693	14.370	2,266,048.410
BUNZL PLC	38,195	9.065	346,237.670
CAPITA PLC	102,099	6.490	662,622.510
AVIVA PLC	441,178	3.070	1,354,416.460
DIAGEO PLC	398,398	14.160	5,641,315.680
SCHRODERS PLC	22,293	12.710	283,344.030
NATIONAL GRID PLC	559,198	6.315	3,531,335.370
LONMIN	24,209	9.750	236,037.750
GKN PLC	312,603	1.962	613,327.080
KINGFISHER PLC	332,300	2.550	847,365.000
BAE SYSTEMS PLC	506,678	3.041	1,540,807.790
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	321,407	30.285	9,733,810.990
MAN GROUP PLC	309,687	1.083	335,391.020
COBHAM PLC	215,276	1.845	397,184.220
NEXT PLC	28,133	25.900	728,644.700
REXAM PLC	138,079	3.715	512,963.480
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	161,212	24.150	3,893,269.800
JOHNSON MATTHEY PLC	30,474	20.000	609,480.000
SABMILLER PLC	152,390	23.395	3,565,164.050
ANGLO AMERICAN PLC	213,378	25.185	5,373,924.930
COMPASS GROUP PLC	297,929	6.125	1,824,815.120
HSBC HOLDINGS PLC	2,905,537	5.047	14,664,245.230
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.070	975,647.400
ARM HOLDINGS PLC	215,348	6.040	1,300,701.920
CENTRICA PLC	793,221	2.875	2,280,510.370
UNILEVER PLC	207,565	21.510	4,464,723.150
MEGGITT PLC	151,642	3.577	542,423.430
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	359,061	3.097	1,112,011.910
INTL POWER PLC	244,870	3.470	849,698.900
UNITED UTILITIES GROUP PLC	105,557	6.140	648,119.980
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442,155	1.090	481,948.950
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,767	11.320	642,602.440
PEARSON PLC	125,455	12.370	1,551,878.350
PRUDENTIAL PLC	406,510	6.520	2,650,445.200
RIO TINTO PLC	226,674	34.285	7,771,518.090
VODAFONE GROUP PLC	8,292,120	1.787	14,818,018.440
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,980	33.550	3,287,229.000
REED ELSEVIER PLC	180,949	5.175	936,411.070
OLD MUTUAL PLC	836,251	1.396	1,167,406.390
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	322,993	7.690	2,483,816.170
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,068,711	0.211	647,498.020
SSE PLC	153,744	13.010	2,000,209.440
SERCO GROUP PLC	72,250	5.120	369,920.000
BP PLC	3,080,901	4.796	14,776,001.190
SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	3.004	661,354.630
INVENSYS PLC	163,653	2.148	351,526.640
SMITHS GROUP PLC	59,731	9.435	563,561.980
STANDARD CHARTERED PLC	384,438	14.325	5,507,074.350
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,572,100	0.273	1,794,183.300
TATE & LYLE PLC	87,522	7.130	624,031.860
BG GROUP PLC	548,796	14.780	8,111,204.880
TESCO PLC	1,284,831	3.900	5,010,840.900
3I GROUP PLC	187,027	1.745	326,362.110

	SMITH & NEPHEW PLC	149,006	5.990	892,545.940	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	824,294	14.200	11,704,974.800	
	WEIR GROUP	34,823	21.920	763,320.160	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,945	8.010	239,859.450	
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	7.355	446,183.720	
	ASTRAZENECA PLC	219,774	30.245	6,647,064.630	
	WHITBREAD PLC	33,917	16.450	557,934.650	
	CARNIVAL PLC	30,375	21.930	666,123.750	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	284,440	3.177	903,665.880	
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	21.010	588,406.060	
	BURBERRY GROUP PLC	78,941	12.790	1,009,655.390	
	INVESTEC PLC	74,705	3.411	254,818.750	
	CAIRN ENERGY	224,914	2.704	608,167.450	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	49,316	12.300	606,586.800	
	VEDANTA RESOURCES PLC	24,021	10.270	246,695.670	
	ICAP PLC	87,128	3.212	279,855.130	
	ITV PLC	657,334	0.718	471,965.810	
	SAINSBURY (J) PLC	190,870	3.059	583,871.330	
	G4S PLC	231,452	2.762	639,270.420	
	ADMIRAL GROUP PLC	44,675	8.435	376,833.620	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	589,874	24.020	14,168,773.480	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	437,493	24.890	10,889,200.770	
	INMARSAT PLC	80,402	4.240	340,904.480	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	10.370	353,969.580	
	STANDARD LIFE PLC	325,057	2.037	662,141.100	
	EXPERIAN PLC	162,080	8.765	1,420,631.200	
	TUI TRAVEL PLC	100,036	1.595	159,557.420	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	46,617	7.195	335,409.310	
	FRESNILLO PLC NPR	33,218	17.320	575,335.760	
	RESOLUTION LTD	265,877	2.545	676,656.960	
	SHIRE PLC	89,740	21.800	1,956,332.000	
	WPP PLC	189,654	7.245	1,374,043.230	
	WOLSELEY PLC	51,052	21.100	1,077,197.200	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	14,969	72.200	1,080,761.800	
	PETROFAC LTD	43,902	15.700	689,261.400	
	GLENORE INTERNATIONAL PLC	141,303	4.017	567,614.150	
英ポンド小計	銘柄数 : 99	47,958,387		233,644,744.190	
	組入時価比率 : 10.51%			(27,778,023,637)	
	合計時価比率 : 10.63%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	27,787	38.890	1,080,636.430	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	24,971	30.500	761,615.500	
	BARRICK GOLD CORP	159,936	49.220	7,872,049.920	
	TMX GROUP INC	14,916	41.850	624,234.600	
	TALISMAN ENERGY INC	167,312	12.490	2,089,726.880	
	BANK OF MONTREAL	102,997	58.240	5,998,545.280	
	BANK OF NOVA SCOTIA	173,004	51.870	8,973,717.480	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	71.960	1,835,699.600	
	BCE INC	45,085	41.830	1,885,905.550	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	96,756	28.790	2,785,605.240	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	50,390	50.490	2,544,191.100	
	BOMBARDIER INC 'B'	240,632	4.160	1,001,029.120	
	SAPUTO INC	23,636	38.300	905,258.800	
	RESEARCH IN MOTION LTD	79,152	15.770	1,248,227.040	
	CGI GROUP INC	29,163	18.420	537,182.460	
	CAE INC	53,145	10.150	539,421.750	
	CAMECO CORP	69,632	19.070	1,327,882.240	
	ROGERS COMM-CL B	65,502	38.730	2,536,892.460	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,175	74.930	4,658,772.750
CANADIAN NATURAL RESOURCES	179,282	39.510	7,083,431.820
NEXEN INC	86,198	18.400	1,586,043.200
CANADIAN TIRE CORP-CL A	12,753	65.380	833,791.140
CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	60.300	827,617.500
CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,527	79.150	5,740,512.050
AGRIUM INC	22,588	75.160	1,697,714.080
YAMANA GOLD INC	115,290	15.550	1,792,759.500
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,729	20.960	497,359.840
OPEN TEXT CORP	9,281	50.600	469,618.600
ELDORADO GOLD CORP	89,925	14.600	1,312,905.000
OSISKO MINING CORP	52,038	11.080	576,581.040
EMPIRE CO LTD	6,539	57.700	377,300.300
KINROSS GOLD CORP	173,556	13.020	2,259,699.120
FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	23.020	692,441.600
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	17,487	22.110	386,637.570
FORTIS INC	29,702	33.040	981,354.080
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,329	23.100	1,624,599.900
TELUS CORP-NON VOTE	31,757	53.610	1,702,492.770
GREAT WEST LIFECO INC	50,480	20.770	1,048,469.600
IAMGOLD CORP	65,070	17.680	1,150,437.600
IMPERIAL OIL LTD	50,996	47.080	2,400,891.680
ENBRIDGE INC	118,128	37.420	4,420,349.760
IGM FINANCIAL INC	19,774	44.050	871,044.700
IVANHOE MINES LTD/CA	49,079	18.950	930,047.050
MANULIFE FINANCIAL CORP	268,208	11.570	3,103,166.560
LOBLAW CO LTD	17,526	37.000	648,462.000
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,573	21.980	935,754.540
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	18,285	25.740	470,655.900
MAGNA INTERNATIONAL INC	36,714	38.320	1,406,880.480
SUN LIFE FINANCIAL INC	83,291	19.940	1,660,822.540
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,579	430.490	1,540,723.710
INMET MINING CORPORATION	10,004	65.630	656,562.520
METRO INC	13,859	52.930	733,556.870
HUSKY ENERGY INC	57,774	24.420	1,410,841.080
CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,557	45.610	1,621,754.770
NIKO RESOURCES LTD	9,961	48.600	484,104.600
ONEX CORP	17,569	33.410	586,980.290
PAN AMERICAN SILVER CORP	21,311	23.300	496,546.300
GOLDCORP INC	132,052	45.830	6,051,943.160
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	137,099	44.360	6,081,711.640
POWER CORP OF CANADA	48,941	23.490	1,149,624.090
POWER FINANCIAL CORP	43,517	25.320	1,101,850.440
ROYAL BANK OF CANADA	235,240	52.430	12,333,633.200
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	53.480	1,122,331.280
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,563	68.670	1,686,741.210
SHAW COMM INC-B	56,820	20.580	1,169,355.600
SINO-FOREST CORP	38,862	4.810	186,926.220
SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	41.480	1,417,620.480
NEW GOLD INC	62,801	11.210	703,999.210
SUNCOR ENERGY INC	250,475	32.820	8,220,589.500
ENCANA CORP	112,909	18.860	2,129,463.740
TECK RESOURCES LTD-CL B	91,181	38.650	3,524,145.650
THOMSON REUTERS CORP	62,106	28.370	1,761,947.220
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	146,225	76.830	11,234,466.750
TRANSCANADA CORP	113,590	42.790	4,860,516.100

	TRANSALTA CORP	34,014	21.020	714,974.280	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,627	65.960	503,076.920	
	CENTERRA GOLD INC	34,094	19.150	652,900.100	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	34,783	12.560	436,874.480	
	INTACT FINANCIAL CORP	25,325	55.840	1,414,148.000	
	SILVER WHEATON CORP	66,626	31.590	2,104,715.340	
	VITERRA INC NPR	46,498	10.720	498,458.560	
	PRECISION DRILLING CORP	49,510	11.400	564,414.000	
	BELL ALIANT INC	14,926	27.960	417,330.960	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,093	40.500	773,266.500	
	CI FINANCIAL CORP	26,281	20.740	545,067.940	
	TOURMALINE OIL CORP	15,696	26.360	413,746.560	
	PEMBINA PIPELINE CORP	31,058	29.310	910,309.980	
	TIM HORTONS INC	28,835	47.840	1,379,466.400	
	BAYTEX ENERGY CORP	18,200	57.350	1,043,770.000	
	MEG ENERGY CORP	24,271	40.830	990,984.930	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	60,247	11.920	718,144.240	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	118,611	34.950	4,145,454.450	
	ENERPLUS CORP	28,113	25.910	728,407.830	
	VERMILION ENERGY INC	10,515	46.630	490,314.450	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	74,986	21.170	1,587,453.620	
	ARC RESOURCES LTD	42,391	24.300	1,030,101.300	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	76,612	23.730	1,818,002.760	
	BONAVISTA ENERGY CORP	22,644	25.630	580,365.720	
	PENGROWTH ENERGY CORP	55,901	11.180	624,973.180	
カナダドル小計	銘柄数 : 99	6,116,625		196,051,093.850	
	組入時価比率 : 5.60%			(14,809,699,629)	
	合計時価比率 : 5.67%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	38,728	10.000	387,280.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	181,466	21.520	3,905,148.320	
	SYNGENTA AG	14,963	285.000	4,264,455.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	540,194	54.800	29,602,631.200	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	83,325	51.000	4,249,575.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	113,908	163.200	18,589,785.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,515	109.300	930,689.500	
	SIKA INHABER	363	1,877.000	681,351.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,620.000	1,394,820.000	
	SULZER AG-REG	4,948	107.000	529,436.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	378,588	54.150	20,500,540.200	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	64.300	577,671.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	928.000	361,920.000	
	SWISSCOM AG-REG	4,052	356.600	1,444,943.200	
	ABB LTD	350,365	18.750	6,569,343.750	
	ADECCO SA-REG	19,348	42.160	815,711.680	
	GEBERIT AG	4,882	185.600	906,099.200	
	LONZA GROUP AG-REG	9,112	59.150	538,974.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	183	2,747.000	502,701.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	31,400.000	628,000.000	
	UBS AG-REGISTERED	578,179	11.080	6,406,223.320	
	GIVAUDAN-REG	1,382	870.000	1,202,340.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	23,106	217.400	5,023,244.400	
	HOLCIM LTD-REG	37,527	50.850	1,908,247.950	
	ACTELION	19,725	32.600	643,035.000	
	SONOVA HOLDING AG	8,743	93.800	820,093.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,380	105.800	675,004.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	2,017	160.500	323,728.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,734	374.400	2,146,809.600	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	904	65.100	58,850.400
	SCHINDLER NAMEN	3,701	108.900	403,038.900
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,331	83.900	531,170.900
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,737	158.000	432,446.000
	ARYZTA AG	13,689	45.900	628,325.100
	JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	35.940	1,109,575.620
	SWISS RE LTD	56,205	49.330	2,772,592.650
	TRANSOCEAN LTD	54,450	37.740	2,054,943.000
	SYNTHES INC	12,220	158.300	1,934,426.000
スイスフラン 小計	銘柄数 : 38	2,627,098		126,455,171.390
	組入時価比率 : 3.87%			(10,223,900,607)
	合計時価比率 : 3.91%			
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	13,005	697.000	9,064,485.000
	ATLAS COPCO AB-A SHS	119,574	157.700	18,856,819.800
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,097	139.300	8,928,712.100
	ERICSSON LM-B SHS	501,760	67.900	34,069,504.000
	GETINGE AB-B SHS	31,964	173.000	5,529,772.000
	SKF AB-B SHS	55,959	150.100	8,399,445.900
	SANDVIK AB	161,874	92.000	14,892,408.000
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	40.490	8,667,856.260
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	118.500	6,933,079.500
	SWEDBANK AB	125,939	95.400	12,014,580.600
	SSAB AB-A	32,561	69.200	2,253,221.200
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	75,229	105.200	7,914,090.800
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,081	188.300	14,137,752.300
	VOLVO AB-B SHS	241,404	81.400	19,650,285.600
	HOLMEN AB-B SHS	13,305	202.500	2,694,262.500
	SCANIA AB	49,676	110.300	5,479,262.800
	SWEDISH MATCH AB	38,399	243.000	9,330,957.000
	TELE2 AB-B SHS	49,717	133.400	6,632,247.800
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	9,101	323.200	2,941,443.200
	NORDEA AB	446,262	54.000	24,098,148.000
	INDUSTRIVARDEN C	26,391	88.000	2,322,408.000
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	113.500	4,379,284.000
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	62.950	3,339,812.250
	INVESTOR AB-B SHS	81,125	132.700	10,765,287.500
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	162,271	221.100	35,878,118.100
	ASSA ABLOY AB-B	43,425	177.500	7,707,937.500
	TELIASONERA AB	311,185	45.560	14,177,588.600
	LUNDIN PETROLEUM AB	40,808	184.000	7,508,672.000
	BOLIDEN AB	44,557	113.000	5,034,941.000
	ALFA LAVAL AB	45,040	135.300	6,093,912.000
	KINNEVIK INVESTMENT B	33,473	135.300	4,528,896.900
	HUSQVARNA AB-B SHS	91,308	34.960	3,192,127.680
	RATOS AB	34,246	84.700	2,900,636.200
	HEXAGON AB	45,953	113.100	5,197,284.300
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 34	3,428,909		335,515,240.390
	組入時価比率 : 1.41%			(3,730,929,473)
	合計時価比率 : 1.43%			
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	59,022	9.066	535,093.450
	OMV AG	24,898	24.285	604,647.930
	VERBUND AG	15,466	20.090	310,711.940
	VOEST-ALPINE AG	17,613	23.505	413,993.560
	ERSTE GROUP BANK AG	33,508	12.365	414,326.420
	IMMOFINANZ AG	152,609	2.231	340,470.670



RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	19.145	174,200.350
UMICORE	18,212	33.955	618,388.460
DELHAIZE GROUP	18,413	45.600	839,632.800
KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	27,003	9.300	251,127.900
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	128,599	47.930	6,163,750.070
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400
SOLVAY SA	8,874	65.010	576,898.740
MOBISTAR SA	5,958	40.005	238,349.790
AGEAS	411,212	1.246	512,370.150
UCB SA	18,529	32.515	602,470.430
COLRUYT NV	14,070	29.575	416,120.250
BEKAERT NV	7,702	27.470	211,573.940
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	52.950	679,348.500
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.002	1.030
BELGACOM SA	23,896	24.350	581,867.600
ADIDAS AG	36,120	53.520	1,933,142.400
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	52,537	58.720	3,084,972.640
COMMERZBANK AG	605,908	1.235	748,296.380
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,745	74.980	1,480,480.100
UNITED INTERNET	18,350	14.020	257,267.000
MAN SE	10,044	74.720	750,487.680
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	12,421	38.405	477,028.500
GEA GROUP AG	28,135	23.060	648,793.100
CONTINENTAL AG	13,432	56.370	757,161.840
DEUTSCHE POST AG-REG	142,801	12.545	1,791,438.540
AXEL SPRINGER AG	6,021	35.000	210,735.000
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	25,205	41.965	1,057,727.820
MERCK KGAA	9,951	77.650	772,695.150
RWE AG	77,047	28.550	2,199,691.850
SAP AG	152,859	42.065	6,430,013.830
E.ON AG	289,445	16.865	4,881,489.920
HENKEL AG & CO KGAA	20,540	37.905	778,568.700
METRO AG	22,519	29.310	660,031.890
SIEMENS AG-REG	132,214	75.750	10,015,210.500
BAYER AG	131,788	53.890	7,102,055.320
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31,566	45.485	1,435,779.510
DAIMLER AG	143,802	38.260	5,501,864.520
BASF SE	147,554	57.490	8,482,879.460
CELESIO AG	16,256	13.445	218,561.920
BEIERSDORF AG	17,671	44.435	785,210.880
HOCHTIEF AG	7,587	45.360	344,146.320
HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	34.955	752,895.740
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	31,792	54.940	1,746,652.480
ALLIANZ SE	72,704	76.020	5,526,958.080

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	13,630	14.895	203,018.850	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,971	8.938	357,260.790	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	29,962	95.790	2,870,059.980	
	SALZGITTER	7,018	41.385	290,439.930	
	VOLKSWAGEN AG	5,402	112.150	605,834.300	
	VOLKSWAGEN AG PFD	23,174	125.700	2,912,971.800	
	THYSSENKRUPP AG	55,869	19.460	1,087,210.740	
	LINDE AG	29,120	119.750	3,487,120.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	148,629	27.480	4,084,324.920	
	BMW VORZUG	11,145	40.425	450,536.620	
	K & S	30,163	36.830	1,110,903.290	
	SUEDZUCKER AG	11,866	24.715	293,268.190	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	447,100	8.963	4,007,357.300	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	191,316	6.294	1,204,142.900	
	FRAPORT AG	6,165	39.790	245,305.350	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	14,055	45.410	638,237.550	
	WACKER-CHEMIE GMBH	3,025	70.000	211,750.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG NEW	32,038	41.655	1,334,542.890	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	15,026	41.385	621,851.010	
	BRENNTAG AG	6,654	76.730	510,561.420	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	63,071	12.655	798,163.500	
	IBERDROLA SA	658,233	4.688	3,085,796.300	
	INDRA SISTEMAS SA	16,340	10.140	165,687.600	
	REPSOL YPF SA	118,170	23.540	2,781,721.800	
	TELEFONICA S.A	658,705	13.360	8,800,298.800	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,133	22.505	520,608.160	
	BANKINTER S.A.	34,675	4.764	165,191.700	
	ACERINOX SA	16,481	10.375	170,990.370	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	728,423	6.285	4,578,138.550	
	ACCIONA S.A.	5,285	63.120	333,589.200	
	GAS NATURAL SDG SA	57,849	12.950	749,144.550	
	BANCO SANTANDER SA	1,354,682	5.740	7,775,874.680	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	20,735	33.525	695,140.870	
	ZARDOYA OTIS	20,589	10.910	224,625.990	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	8,715	18.880	164,539.200	
	BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	3.392	497,324.860	
	BANCO SABADELL	179,119	2.687	481,292.750	
	INDITEX	36,724	65.450	2,403,585.800	
	MAPFRE SA	135,413	2.541	344,084.430	
	ENAGAS	25,191	14.295	360,105.340	
	GRIFOLS SA	24,523	13.020	319,289.460	
	FERROVIAL SA	63,117	9.424	594,814.600	
	CAIXABANK	149,185	3.769	562,278.260	
	AMADEUS IT HOLDING SA	52,881	12.895	681,900.490	
	IBERDROLA SA	658,233	0.147	96,760.250	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	151,868	1.775	269,565.700	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	111,285	3.654	406,635.390	
	BANKIA SAU	140,798	3.550	499,832.900	

	KESKO OYJ-B	13,297	26.280	349,445.160
	WARTSILA OYJ	26,436	24.560	649,268.160
	NOKIAN RENKAAT OYJ	21,730	26.650	579,104.500
	UPM-KYMMENE OYJ	93,053	9.000	837,477.000
	STORA ENSO OYJ-R SHS	108,663	5.165	561,244.390
	SAMPO OYJ-A SHS	59,871	18.970	1,135,752.870
	FORTUM OYJ	79,645	16.240	1,293,434.800
	NOKIA OYJ	597,512	4.248	2,538,230.970
	ELISA CORP	25,398	16.420	417,035.160
	METSO OYJ	21,261	30.400	646,334.400
	NESTE OIL OYJ	23,509	8.510	200,061.590
	KONE OYJ	28,457	41.650	1,185,234.050
	ORION OYJ	17,482	15.350	268,348.700
	AIR LIQUIDE	45,890	97.960	4,495,384.400
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,253	25.030	1,658,312.590
	AXA	266,452	10.265	2,735,129.780
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	68,396	8.198	560,710.400
	DANONE	92,643	48.890	4,529,316.270
	SAFRAN SA	25,102	23.520	590,399.040
	ACCOR SA	26,806	19.755	529,552.530
	BOUYGUES	30,754	23.240	714,722.960
	BNP PARIBAS	154,692	29.585	4,576,562.820
	THALES SA	19,494	23.890	465,711.660
	CAP GEMINI SA	24,414	25.295	617,552.130
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	64.480	423,440.160
	CHRISTIAN DIOR	9,796	98.120	961,183.520
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	20.075	472,605.650
	ALCATEL-LUCENT	384,592	1.269	488,047.240
	NATIXIS	164,630	1.890	311,150.700
	EIFFAGE	8,253	19.850	163,822.050
	PUBLICIS GROUPE	25,533	37.460	956,466.180
	IMERYS SA	7,765	37.220	289,013.300
	LAFARGE SA	28,285	27.700	783,494.500
	L'OREAL	38,417	82.950	3,186,690.150
	LVHM MOET HENNESSY LOUI V SA	40,582	115.200	4,675,046.400
	LAGARDERE S.C.A.	21,125	21.030	444,258.750
	MICHELIN(CGDE)-B	27,685	47.995	1,328,741.570
	PERNOD-RICARD	34,206	74.330	2,542,531.980
	PEUGEOT SA	30,300	12.920	391,476.000
	RENAULT SA	35,257	29.495	1,039,905.210
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,891	30.900	1,912,431.900
	SOCIETE GENERALE-A	111,856	15.745	1,761,172.720
	VINCI S.A.	67,944	35.000	2,378,040.000
	SOLEXO	11,780	56.210	662,153.800
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	77,535	44.560	3,454,959.600
	VIVENDI SA	197,714	16.280	3,218,783.920
	TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,942	73.870	1,177,635.540
	TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	24,183	7.693	186,039.810
	TOTAL SA	344,864	40.440	13,946,300.160
	VALLOUREC	20,400	52.690	1,074,876.000
	FRANCE TELECOM SA	295,145	11.875	3,504,846.870
	BIC	6,136	67.790	415,959.440
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	62.310	614,501.220
	PPR	11,855	118.000	1,398,890.000
	NEOPOST SA	6,482	53.720	348,213.040
	CARREFOUR SA	85,148	16.850	1,434,743.800
	ATOS	9,475	35.335	334,799.120

	SANOFI	185,780	56.750	10,543,015.000	
	STMICROELECTRONICS NV	97,120	5.060	491,427.200	
	JC DECAUX INTERNATIONAL	11,841	17.795	210,710.590	
	ESSILOR INTL	31,399	56.360	1,769,647.640	
	CREDIT AGRICOLE SA	172,905	4.117	711,849.880	
	WENDEL	6,630	52.980	351,257.400	
	ILIAD SA	3,765	97.670	367,727.550	
	GDF SUEZ	198,651	21.360	4,243,185.360	
	ALSTOM	33,600	23.195	779,352.000	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	29.850	520,882.500	
	ELECTRICITE DE FRANCE	44,581	18.025	803,572.520	
	ARKEMA SA	9,569	56.470	540,361.430	
	LEGRAND SA	41,030	25.500	1,046,265.000	
	ADP	6,435	53.570	344,722.950	
	SCOR SE	35,430	17.850	632,425.500	
	BUREAU VERITAS SA	7,690	57.200	439,868.000	
	GROUPE EUROTUNNEL SA	89,249	5.299	472,930.450	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	58,532	8.667	507,296.840	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	EDENRED	27,224	19.210	522,973.040	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	32,274	12.970	418,593.780	
	NATIONAL BANK OF GREECE	170,555	1.310	223,427.050	
	OPAP SA	41,034	6.250	256,462.500	
	CRH PLC	121,874	15.285	1,862,844.090	
	KERRY GROUP PLC-A	24,173	29.170	705,126.410	
	ELAN CORPORATION PLC	89,094	10.800	962,215.200	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.132	12,053.710	
	ASSICURAZIONI GENERALI	177,127	11.930	2,113,125.110	
	INTESA SANPAOLO	1,783,476	1.174	2,093,800.820	
	UNICREDIT SPA	226,755	2.424	549,654.120	
	ENI SPA	384,840	16.600	6,388,344.000	
	MEDIOBANCA SPA	81,452	3.978	324,016.050	
	PIRELLI & C	48,668	6.940	337,755.920	
	SAIPEM	41,590	35.330	1,469,374.700	
	LUXOTTICA GROUP SPA	22,387	22.620	506,393.940	
	MEDIASET SPA	117,464	2.080	244,325.120	
	AUTOGRILL SPA	20,544	7.645	157,058.880	
	A2A SPA	273,914	0.729	199,683.300	
	FIAT SPA	119,079	3.936	468,694.940	
	ENEL SPA	1,035,843	3.124	3,235,973.530	
	FINMECCANICA SPA	70,788	2.790	197,498.520	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	804,540	0.197	158,494.380	
	SNAM SPA	270,029	3.372	910,537.780	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	137,041	2.846	390,018.680	
	TELECOM ITALIA SPA	1,374,164	0.845	1,161,168.580	
	TELECOM ITALIA-RNC	1,110,927	0.708	786,536.310	
	ATLANTIA SPA	54,105	12.350	668,196.750	
	TERNA SPA	234,235	2.756	645,551.660	
	EXOR SPA	9,585	15.860	152,018.100	
	PRYSMIAN SPA	37,609	10.230	384,740.070	
	BANCO POPOLARE SPA	305,979	0.847	259,164.210	
	ENEL GREEN POWER SPA	319,809	1.620	518,090.580	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	7.080	843,079.320	
	UNICREDIT SPA RTS	226,755	0.850	192,741.750	
	ARCELOR MITTAL (NL)	147,189	15.040	2,213,722.560	
	TENARIS SA	82,125	15.280	1,254,870.000	
	SES FDR	46,853	18.205	852,958.860	

	BOSKALIS WESTMINSTER CT	13,745	28.690	394,344.050	
	REED ELSEVIER NV	112,391	8.972	1,008,372.050	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,732	37.140	732,846.480	
	SBM OFFSHORE NV	23,374	15.750	368,140.500	
	ING GROEP NV-CVA	639,027	5.787	3,698,049.240	
	RANDSTAD HOLDINGS	21,850	24.495	535,215.750	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	179,713	10.355	1,860,928.110	
	HEINEKEN NV	43,858	36.930	1,619,675.940	
	AKZO NOBEL	35,469	39.020	1,384,000.380	
	ASML HOLDING NV	68,040	32.480	2,209,939.200	
	AEGON NV	277,959	3.274	910,037.760	
	UNILEVER NV-CVA	264,948	26.585	7,043,642.580	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	158,542	14.910	2,363,861.220	
	WOLTERS KLUWER-CVA	49,896	13.395	668,356.920	
	QIAGEN N.V.	39,540	11.550	456,687.000	
	VOPAK (KON.)	11,504	42.790	492,256.160	
	KONINKLIJKE KPN NV	251,126	8.635	2,168,473.010	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	32.335	606,927.950	
	FUGRO CERT	10,228	48.245	493,449.860	
	TNT EXPRESS NV W/I	61,074	5.974	364,856.070	
	DELTA LLOYD NV	19,898	12.570	250,117.860	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	112,619	1.180	132,890.420	
	JERONIMO MARTINS	40,183	13.020	523,182.660	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	120,094	4.270	512,801.380	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,886	2.352	740,611.870	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	43,777	12.790	559,907.830	
ユーロ小計	銘柄数 : 238	28,597,028		330,305,204.100	
	組入時価比率 : 12.25%			(32,369,910,002)	
	合計時価比率 : 12.39%				
デンマーク ローネ	CARLSBERG AS-B	17,266	441.300	7,619,485.800	
	A P MOLLER A/S	215	38,520.000	8,281,800.000	
	AP MOLLER MAERSK A	100	36,900.000	3,690,000.000	
	DANSKE BANK A/S	108,499	75.950	8,240,499.050	
	NOVOZYMES-B SHS	40,415	177.200	7,161,538.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	67,866	692.000	46,963,272.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35,696	61.150	2,182,810.400	
	TDC A/S	58,423	46.070	2,691,547.610	
	COLOPLAST-B	4,175	844.000	3,523,700.000	
	DSV A/S	29,112	112.400	3,272,188.800	
	WILLIAM DEMANT	4,646	471.900	2,192,447.400	
	TRYG A/S	4,793	317.900	1,523,694.700	
デンマーク ローネ小計	銘柄数 : 12	371,206		97,342,983.760	
	組入時価比率 : 0.49%			(1,282,980,526)	
	合計時価比率 : 0.49%				
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	46,984	208.400	9,791,465.600	
	ACERGY SA	53,986	120.100	6,483,718.600	
	DNB ASA	136,403	60.600	8,266,021.800	
	NORSK HYDRO ASA	138,196	29.500	4,076,782.000	
	TELENOR ASA	123,877	96.300	11,929,355.100	
	ORKLA ASA	129,845	44.590	5,789,788.550	
	STATOIL ASA	181,422	155.000	28,120,410.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,891	255.500	7,381,650.500	
	AKER SOLUTIONS ASA	36,670	68.550	2,513,728.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	43,012	68.450	2,944,171.400	

ノルウェーク ローネ小計	銘柄数 : 10	919,286		87,297,092.050	
	組入時価比率 : 0.42%			(1,117,402,778)	
	合計時価比率 : 0.43%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	136,000	25.000	3,400,000.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	43,000	43.500	1,870,500.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	408,000	4.710	1,921,680.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	358,000	23.400	8,377,200.000	
	BANK OF EAST ASIA	262,660	29.000	7,617,140.000	
	CLP HOLDINGS LTD	311,500	66.700	20,777,050.000	
	PCCW LTD	734,000	2.360	1,732,240.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	13.800	2,911,800.000	
	LI & FUNG LTD	964,400	15.660	15,102,504.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	223,000	94.100	20,984,300.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	95,000	45.800	4,351,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	156,400	123.200	19,268,480.000	
	MTR CORP	245,000	25.250	6,186,250.000	
	FIRST PACIFIC CO	380,000	8.800	3,344,000.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	44.200	5,967,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	132,400	93.350	12,359,540.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	173,000	39.950	6,911,350.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	246,500	58.150	14,333,975.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	267,750	37.750	10,107,562.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	834,050	18.360	15,313,158.000	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	343,000	67.000	22,981,000.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	127,000	26.250	3,333,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	237,000	14.440	3,422,280.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	137,000	26.050	3,568,850.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	644,500	18.820	12,129,490.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	668,700	6.840	4,573,908.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.400	3,312,000.000	
	SINO LAND CO	389,400	11.340	4,415,796.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	224,000	98.400	22,041,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	128,000	77.150	9,875,200.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	162,000	20.550	3,329,100.000	
	SJM HOLDINGS LTD	290,000	12.960	3,758,400.000	
	AIA GROUP LTD	1,348,600	24.000	32,366,400.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	15,956	4.730	75,471.880	
	ASM PACIFIC TECH	37,600	93.650	3,521,240.000	
	WYNN MACAU LTD	273,200	18.380	5,021,416.000	
	SANDS CHINA LTD	361,200	23.100	8,343,720.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 37	11,933,816		328,906,351.380	
	組入時価比率 : 1.23%			(3,256,172,879)	
	合計時価比率 : 1.25%				
シンガポール ・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	887,400	1.540	1,366,596.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.740	608,013.600	
	SINGAPORE TECH ENG	261,000	2.730	712,530.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	182,000	4.220	768,040.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.700	965,700.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	272,000	11.880	3,231,360.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	9.220	811,360.000	
	SEMBCORP MARINE	166,000	4.190	695,540.000	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	49.870	897,660.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	6.160	868,560.000	
	CAPITALAND LTD	471,000	2.350	1,106,850.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	105,500	6.430	678,365.000	
	KEPPEL CORP LTD	250,500	9.940	2,489,970.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.440	478,080.000	
	NEPTUNE ORIENT	215,750	1.170	252,427.500	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	646,763	1.095	708,205.480	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	431,200	8.040	3,466,848.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,264,867	3.110	3,933,736.370	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	91,400	10.480	957,872.000	
	KEPPEL LAND LTD	164,000	2.390	391,960.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	202,000	15.400	3,110,800.000	
	STARHUB LTD	110,000	2.870	315,700.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	302,800	2.200	666,160.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	322,000	5.100	1,642,200.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	390,000	0.945	368,550.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	288,000	1.190	342,720.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	1.790	452,870.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 27	8,938,820		32,288,673.950	
	組入時価比率 : 0.73%			(1,921,176,100)	
	合計時価比率 : 0.74%				
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	207,413	13.200	2,737,851.600	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	236,029	11.920	2,813,465.680	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	282,651	6.910	1,953,118.410	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	193,818	5.392	1,045,066.650	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	81,827	41.120	3,364,726.240	
	NICE SYSTEMS LTD	11,709	133.000	1,557,297.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	155,807	171.200	26,674,158.400	
	ISRAEL CORP LTD/THE	489	2,375.000	1,161,375.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	32,363	31.320	1,013,609.160	
イスラエル・シュケル小計	銘柄数 : 9	1,202,106		42,320,668.140	
	組入時価比率 : 0.32%			(848,952,603)	
	合計時価比率 : 0.33%				
オーストラリアドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	24,976	19.560	488,530.560	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	423,264	20.750	8,782,728.000	
	AMCOR LTD	210,271	7.270	1,528,670.170	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	489,112	20.200	9,880,062.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	212,072	4.570	969,169.040	
	TELSTRA CORP LTD	677,536	3.390	2,296,847.040	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	8.230	462,369.630	
	AMP LTD	449,927	4.220	1,898,691.940	
	LYNAS CORP LTD	315,096	1.030	324,548.880	
	ASX LTD	30,082	30.810	926,826.420	
	BHP BILLITON LTD	520,479	35.660	18,560,281.140	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,948	12.150	303,118.200	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	12,052	48.990	590,427.480	

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	1.925	195,866.820	
	COMPUTERSHARE LT	75,518	8.140	614,716.520	
	CSL LIMITED	87,717	32.050	2,811,329.850	
	TRANSURBAN GROUP	220,888	5.560	1,228,137.280	
	COCA-COLA AMATIL LTD	93,286	11.770	1,097,976.220	
	COCHLEAR LTD	10,605	59.310	628,982.550	
	ORIGIN ENERGY LTD	180,178	13.430	2,419,790.540	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	252,854	49.780	12,587,072.120	
	BORAL LIMITED	107,619	3.720	400,342.680	
	RIO TINTO LIMITED	73,221	63.200	4,627,567.200	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	378,109	2.970	1,122,983.730	
	ONESTEEL LIMITED	213,885	0.710	151,858.350	
	OZ MINERALS LTD	55,513	10.330	573,449.290	
	ORICA LTD	63,650	23.940	1,523,781.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	373,327	0.740	276,261.980	
	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	19.710	428,830.470	
	SYDNEY AIRPORT	66,175	2.730	180,657.750	
	MACQUARIE GROUP LTD	58,487	23.750	1,389,066.250	
	WORLEYPARSONS LTD	28,202	26.910	758,915.820	
	SUNCORP GROUP LTD	211,551	8.350	1,766,450.850	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	354,370	23.500	8,327,695.000	
	NEWCREST MINING LTD	121,376	32.180	3,905,879.680	
	INCITEC PIVOT LTD	270,689	3.090	836,429.010	
	TOLL HOLDINGS LTD	118,338	4.390	519,503.820	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	186,960	1.550	289,788.000	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	169,191	13.150	2,224,861.650	
	SANTOS LTD	140,142	12.630	1,769,993.460	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	28,753	13.200	379,539.600	
	SONIC HEALTHCARE	64,654	11.740	759,037.960	
	TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	2.850	368,168.700	
	WESFARMERS LTD	156,607	30.640	4,798,438.480	
	ALUMINA LIMITED	397,286	1.170	464,824.620	
	ILUKA RESOURCES LIM I	71,975	16.090	1,158,077.750	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	111,229	31.420	3,494,815.180	
	WOOLWORTHS LTD	192,530	25.500	4,909,515.000	
	METCASH LTD	147,295	4.150	611,274.250	
	TATTS GROUP LTD	225,953	2.390	540,027.670	
	AGL ENERGY LTD	65,010	14.780	960,847.800	
	BRAMBLES LTD	217,633	7.230	1,573,486.590	
	ASCIANO LTD	161,903	4.580	741,515.740	
	CROWN LTD	81,029	8.150	660,386.350	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	116,369	3.660	425,910.540	
	QR NATIONAL LTD	278,184	3.520	979,207.680	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	83,754	6.910	578,740.140	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 57	10,010,699		123,074,272.840	
	組入時価比率 : 3.68%			(9,735,174,982)	
	合計時価比率 : 3.73%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	177,042	5.800	1,026,843.600	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	407,280	2.030	826,778.400	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	584,322		1,853,622.000	
	組入時価比率 : 0.04%			(113,070,942)	
	合計時価比率 : 0.04%				
合計				256,151,315,535	



				(256,151,315,535)	
--	--	--	--	-------------------	--

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

### 株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	294,800.00	517,374.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.00	577,016.700	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	590,706.00	1,094,390.700	
	組入時価比率 : 0.02%		(65,116,247)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	MIRVAC GROUP	612,711.00	762,825.190	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	604,795.480	
	GPT GROUP	292,236.00	905,931.600	
	LEND LEASE GROUP	97,048.00	711,361.840	
	STOCKLAND	357,887.00	1,206,079.190	
	WESTFIELD GROUP	354,089.00	3,002,674.720	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	763,982.620	
	GOODMAN GROUP	1,183,581.00	727,902.310	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	418,064.00	1,078,605.120	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 9	4,527,560.00	9,764,158.070	
	組入時価比率 : 0.29%		(772,344,903)	
	合計時価比率 : 0.30%			
投資信託受益証券計			837,461,150	
			(837,461,150)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	24,635.00	2,453,153.300	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	144,552.00	2,353,306.560	
	PROLOGIS INC	75,195.00	2,203,965.450	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,805.00	1,768,558.550	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	465,027.400	
	EQUITY RESIDENTIAL	44,402.00	2,450,546.380	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	926,532.720	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	72,923.00	1,086,552.700	
	HCP INC	66,067.00	2,715,353.700	
	HEALTH CARE REIT INC	24,501.00	1,355,395.320	
	RAYONIER INC	14,915.00	672,368.200	
	KIMCO REALTY	65,111.00	1,082,795.930	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.00	522,762.500	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	1,033,258.380	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	130,521.00	2,023,075.500	
	PLUM CREEK TIMBER CO	29,979.00	1,135,904.310	
	REGENCY	15,096.00	571,534.560	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	49,355.00	6,291,775.400	
	PUBLIC STORAGE	21,726.00	2,903,245.380	
	VENTAS INC	40,444.00	2,199,749.160	
	VORNADO REALTY TRUST	24,478.00	1,921,767.780	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,583.00	1,109,402.700	
	AMERICAN TOWER REIT INC	63,741.00	3,907,960.710	
米ドル小計	銘柄数 : 23	1,022,359.00	43,153,992.590	
	組入時価比率 : 1.26%		(3,318,110,490)	
	合計時価比率 : 1.27%			
	BRITISH LAND CO PLC	155,704.00	733,054.430	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	372,305.470	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.00	683,295.630	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	115,270.00	357,221.730	
	SEGRO PLC	153,729.00	311,762.410	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	634,323.00	2,457,639.670	
	組入時価比率 : 0.11%		(292,188,780)	
	合計時価比率 : 0.11%			
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	49,605.00	795,664.200	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	17,922.00	414,894.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	27,441.00	722,795.940	
カナダドル小計	銘柄数 : 3	94,968.00	1,933,354.440	
	組入時価比率 : 0.06%		(146,045,594)	
	合計時価比率 : 0.06%			
	GECINA SA	4,806.00	297,299.160	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,804.00	2,031,108.800	
	KLEPIERRE	21,188.00	450,033.120	
	FONCIERE DES REGIONS	5,785.00	261,771.250	
	CORIO NV	12,621.00	404,629.260	
ユーロ小計	銘柄数 : 5	59,204.00	3,444,841.590	
	組入時価比率 : 0.13%		(337,594,476)	
	合計時価比率 : 0.13%			
	LINK REIT/THE	407,000.00	11,477,400.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	407,000.00	11,477,400.000	
	組入時価比率 : 0.04%		(113,626,260)	
	合計時価比率 : 0.04%			
投資証券計			4,207,565,600	
			(4,207,565,600)	
合計			5,045,026,750	
			(5,045,026,750)	

(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 566銘柄	56.37%	57.03%
米ドル	投資証券 23銘柄	1.26%	1.27%
英ポンド	株式 99銘柄	10.51%	10.63%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.11%	0.11%
カナダドル	株式 99銘柄	5.60%	5.67%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.06%	0.06%

スイスフラン	株式	38銘柄	3.87%	3.91%
スウェーデンクローネ	株式	34銘柄	1.41%	1.43%
ユーロ	株式	238銘柄	12.25%	12.39%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.13%	0.13%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	0.49%	0.49%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.42%	0.43%
香港ドル	株式	37銘柄	1.23%	1.25%
香港ドル	投資証券	1銘柄	0.04%	0.04%
シンガポール・ドル	株式	27銘柄	0.73%	0.74%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	0.02%	0.02%
イスラエル・シュケル	株式	9銘柄	0.32%	0.33%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	3.68%	3.73%
オーストラリアドル	投資信託受益証券	9銘柄	0.29%	0.30%
ニュージーランドドル	株式	2銘柄	0.04%	0.04%

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,397,911,926	873,647,571
国債証券		322,573,919,600	310,960,050,900
地方債証券		28,262,974,448	27,599,541,199
特殊債券		40,170,595,634	36,028,802,468
社債券		33,525,809,740	28,803,244,940
未収利息		1,248,628,767	1,197,897,440
前払費用		61,692,067	40,940,020
流動資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538
資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538
負債の部			
流動負債			
未払解約金		175,433,000	49,249,000
流動負債合計		175,433,000	49,249,000
負債合計		175,433,000	49,249,000
純資産の部			
元本等			
元本		382,815,805,870	355,473,910,842
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		44,250,293,312	49,980,964,696
元本等合計		427,066,099,182	405,454,875,538
純資産合計		427,066,099,182	405,454,875,538
負債純資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11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22年2月16日から平成23年2月14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23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

## (追加情報)

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	395,927,275,552円	382,815,805,870円
同期中追加設定元本額	64,938,202,760円	45,298,515,774円
同期中解約元本額	78,049,672,442円	72,640,410,802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	3,206,343,130円	5,155,256,189円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	7,362,564,589円	8,922,325,995円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,527,472,340円	2,726,495,700円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	4,021,199,991円	4,167,936,865円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,630,226,006円	1,613,401,322円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,160,677,732円	1,162,260,661円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,144,755,923円	1,144,513,455円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	141,655,342円	143,628,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	223,569,498円	187,546,557円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,022,475,991円	2,054,399,443円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,113,051円	9,400,626円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	17,824,993,618円	19,646,256,891円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	111,008,492円	110,129,562円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	880,631,582円	786,265,876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）	12,866,521,066円	11,483,027,617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）	731,575,501円	621,814,679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）	495,928,416円	440,076,924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）	1,206,613,436円	1,083,119,886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）	573,513,324円	494,258,303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）	402,399,684円	347,099,993円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定）	30,348,959,090円	27,029,746,082円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	10,094,541,385円	8,918,132,672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）	13,990,484,377円	12,545,486,322円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	5,327,235,731円	4,608,440,444円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	8,316,169,080円	7,044,247,918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）	1,890,509,761円	1,633,954,855円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2（適格機関投 資家限定）	6,625,226,349円	5,968,970,466円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	8,112,251,131円	7,324,395,966円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A（適格機関投資家 向け）	14,562,601,859円	13,597,303,957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）	711,652,567円	708,137,610円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	595,564,015円	円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限 定）	14,947,846,567円	13,259,924,844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）	7,370,232,806円	6,699,998,806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）	1,543,769,952円	1,421,114,722円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	111,216,690,515円	100,827,988,739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）	2,820,350,588円	2,463,053,761円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A（適格機関投 資家限定）	10,098,797,743円	9,343,943,979円

D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	33,627,817,936円	30,791,603,401円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	2,329,762,532円	2,155,530,686円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	241,057円	228,742円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	150,296円	139,716円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	36,630,963,943円	33,787,052,960円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	689,313,902円	749,365,188円
D I A M国内バランス3 0 V A （適格機関投資家限定）	189,363,623円	196,036,686円
D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定）	2,199,536,122円	2,059,389,385円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	316,732円	304,419円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	230,618円	216,500円
（合 計）	382,815,805,870円	355,473,910,842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	382,815,805,870口	355,473,910,842口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,663,133,300	6,918,869,400
地方債証券	102,062,963	269,324,504
特殊債券	49,332,711	328,958,769
社債券	862,770	563,869,500
合計	2,815,391,744	6,953,283,173

(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23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1156円 (11,156円)	1.1406円 (11,406円)



[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	3 0 1 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,720,000	
	3 0 2 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,840,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,501,485,000	
	3 0 4 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,100,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,003,360,000	
	3 0 6 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,380,000	
	3 0 7 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,202,772,000	
	3 0 8 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,490,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,475,000	
	3 1 0 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	500,730,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	4,939,004,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	4,200,000,000	4,282,404,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	4,600,000,000	4,675,394,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,552,115,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,564,800,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	3,400,000,000	3,461,574,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,549,875,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,834,808,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,532,515,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,526,730,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,709,588,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	3,000,000,000	3,006,000,000	
	9 3 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,045,650,000	
	9 5 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,025,960,000	
	9 6 回 利付国庫債券（5年）	1,500,000,000	1,513,290,000	
	9 7 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,518,630,000	
	9 9 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,018,400,000	
	2 回 利付国庫債券（40年）	600,000,000	620,292,000	
	3 回 利付国庫債券（40年）	1,000,000,000	1,029,910,000	
	4 回 利付国庫債券（40年）	700,000,000	718,130,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	705,572,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,071,124,000	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,757,807,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,561,225,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,025,230,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,100,000,000	2,173,563,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,803,248,000	
	2 6 6 回 利付国庫債券（10年）	3,700,000,000	3,831,387,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,552,005,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,969,407,000	

272回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,188,767,000
274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,515,656,000
277回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,163,320,000
280回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,996,924,000
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,617,838,000
284回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,305,840,000
285回	利付国庫債券(10年)	4,900,000,000	5,236,042,000
286回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,766,140,000
288回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,860,820,000
289回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,611,242,000
290回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,382,560,000
293回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,414,700,000
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,257,040,000
297回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,384,832,000
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,258,162,000
301回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,045,936,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,957,864,000
305回	利付国庫債券(10年)	5,100,000,000	5,341,791,000
306回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,739,805,000
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,878,444,000
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,053,840,000
310回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,572,990,000
312回	利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,872,824,000
313回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,737,380,000
315回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,128,050,000
317回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,563,855,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,205,844,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	117,506,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	111,226,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	219,074,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,680,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	215,652,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,422,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	328,194,000
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	503,815,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	394,728,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	316,998,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	311,388,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	555,465,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	225,976,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	452,372,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,360,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	896,571,600
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	218,638,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	338,799,000
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	545,455,000
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	530,775,700
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	452,104,000
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	678,138,000
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	654,432,000
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,110,670,000

27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,018,674,000
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	906,072,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,668,210,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,636,845,000
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,282,740,000
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,741,392,000
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,836,810,000
34回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,126,580,000
35回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,728,968,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	690,684,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	452,056,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	803,728,800
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	914,112,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	1,005,150,800
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,019,844,000
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	558,145,000
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,060,523,000
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	571,070,000
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	849,724,200
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	659,070,000
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	609,031,500
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	781,844,000
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	888,910,200
57回	利付国庫債券(20年)	830,000,000	902,218,300
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	652,092,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,023,452,100
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	792,432,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	965,630,000
64回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	865,776,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,405,937,000
67回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,402,609,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,419,087,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,375,287,500
73回	利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,510,207,200
75回	利付国庫債券(20年)	1,340,000,000	1,469,645,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,658,190,000
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,513,792,000
83回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,745,776,000
85回	利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,907,272,500
88回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,892,695,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,760,112,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,844,636,000
93回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,069,730,000
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	866,824,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,886,898,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,641,600,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,725,616,000
100回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,963,980,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,789,760,000
105回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,932,462,000
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,144,600,000

	1 0 9 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,082,220,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,386,362,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,136,320,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,133,360,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,811,692,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,258,452,000	
	1 1 9 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,526,385,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,270,400,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,339,392,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,588,472,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,235,040,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,013,120,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,529,400,000	
国債証券計			310,960,050,900	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	151,214,560	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	207,910,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	167,417,360	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	206,732,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,413,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	206,768,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	208,026,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	206,888,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,433,336	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	207,008,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,446,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,954,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	515,785,400	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,214,192	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,741,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,244,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	214,156,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	160,215,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,956,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	217,311,545	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	316,197,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	319,824,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	209,626,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	512,435,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	201,286,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	205,608,550	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	257,417,500	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	203,604,495	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	107,516,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	323,439,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	212,116,000	
	1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,636,000	
	1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	184,168,129	
	1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,003,000	
	1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,430,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,582,652	

1 3 5 回	神奈川県公募公債	200,000,000	209,636,000
1 3 6 回	神奈川県公募公債	100,000,000	104,575,000
1 6 6 回	神奈川県公募公債	300,000,000	314,574,000
2 6 1 回	大阪府公募公債	129,000,000	132,121,800
2 7 8 回	大阪府公募公債	200,000,000	206,342,000
2 8 5 回	大阪府公募公債	100,000,000	104,321,000
2 8 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	208,766,000
2 8 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	211,676,000
2 9 3 回	大阪府公募公債	200,000,000	215,122,000
3 0 1 回	大阪府公募公債	100,000,000	106,934,000
3 1 0 回	大阪府公募公債	240,000,000	254,767,200
3 3 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	209,446,000
1 回	大阪府公募公債 7年	500,000,000	512,560,000
1 5 年度 3 回	京都府公募公債	219,300,000	224,881,185
1 6 年度 2 回	京都府公募公債	100,000,000	103,409,000
1 8 年度 1 回	京都府公募公債	100,000,000	106,329,000
1 4 年度 5 回	兵庫県公募公債	100,000,000	100,642,000
1 5 年度 1 回	兵庫県公募公債	100,000,000	100,589,000
1 6 年度 4 回	兵庫県公募公債	251,970,000	259,899,495
1 6 年度 8 回	兵庫県公募公債	111,500,000	116,196,380
1 7 年度 2 回	兵庫県公募公債	200,000,000	206,932,000
1 7 年度 9 回	兵庫県公募公債	306,000,000	320,351,400
1 7 年度 1 3 回	兵庫県公募公債	105,000,000	110,630,100
1 8 年度 1 回	兵庫県公募公債	120,000,000	127,058,400
1 5 年度 3 回	静岡県公募公債	116,130,000	118,643,053
1 8 年度 5 回	静岡県公募公債	129,800,000	138,740,624
2 1 年度 5 回	静岡県公募公債	197,000,000	206,286,580
1 5 年度 1 回	愛知県公募公債	303,600,000	310,169,904
1 6 年度 2 回	愛知県公募公債	200,000,000	207,572,000
1 8 年度 2 回	愛知県公募公債	160,300,000	171,870,454
2 0 年度 4 回	愛知県公募公債	100,000,000	106,650,000
2 2 年度 6 回	愛知県公募公債	200,000,000	205,388,000
1 6 年度 2 回	広島県公募公債	200,000,000	207,738,000
2 2 年度 1 回	広島県公募公債	200,000,000	208,618,000
1 5 年度 3 回	埼玉県公募公債	100,000,000	102,407,000
1 7 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	206,780,000
1 8 年度 1 回	埼玉県公募公債	200,000,000	212,258,000
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	464,802,800
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	203,932,000
1 6 年度 3 回	福岡県公募公債	131,040,000	135,237,211
1 7 年度 1 回	福岡県公募公債	100,000,000	103,922,000
1 7 年度 5 回	福岡県公募公債	100,000,000	104,648,000
1 8 年度 1 回	福岡県公募公債	104,000,000	112,194,160
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	212,540,000
1 5 年度 4 回	千葉県公募公債	100,000,000	102,432,000
1 6 年度 3 回	千葉県公募公債	100,000,000	104,361,000
1 6 年度 8 回	千葉県公募公債	200,000,000	206,412,000
1 7 年度 2 回	千葉県公募公債	200,000,000	206,868,000
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	323,229,000
2 1 年度 6 回	千葉県公募公債	200,000,000	210,386,000
1 8 年度 2 回	新潟県公募公債	169,000,000	180,851,970

2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,565,000
3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,456,000
8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,516,000
9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,331,900
11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,975,000
12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,416,400
13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	227,508,450
18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,681,000
19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,907,500
20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,578,000
21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,116,000
23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,206,000
25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,071,680
28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,988,000
29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,838,000
31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,854,000
32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,748,000
33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,868,000
35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,246,000
36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,195,000
37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,181,500
38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	182,064,900
39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,879,820
40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,643,000
47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	172,865,136
55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,486,000
57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,360,000
61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	318,693,000
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,763,000
75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	534,990,000
80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	742,763,000
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,671,000
17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	103,233,000
17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	207,434,000
17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	209,042,000
17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,797,000
18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,846,000
18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	161,118,000
19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	145,682,550
12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,569,000
12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	206,972,000
12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	373,811,695
17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,826,000
18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	109,173,933
16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	206,586,000
17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	108,160,300
15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,650,000
16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	206,094,000
17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,759,000
14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,646,000
16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	103,869,000

	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,396,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	101,743,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	106,582,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,293,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,412,000	
地方債証券計			27,599,541,199	
特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	106,246,260	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,075,000	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,238,000	
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,228,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,221,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,857,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,056,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,176,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	207,084,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	133,569,480	
	322回 政保道路債	106,000,000	108,651,060	
	323回 政保道路債	200,000,000	205,142,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	204,968,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	206,244,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	103,448,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	311,541,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	245,164,650	
	338回 政保道路債	264,000,000	274,536,240	
	339回 政保道路債	301,000,000	312,254,390	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	429,396,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	321,198,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	425,396,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	748,622,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,274,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	219,936,970	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,725,080	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,547,000	
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	323,349,250	
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,212,220	
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,701,000	
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	400,826,250	
	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,362,000	
	29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,626,000	
	30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,977,000	
	33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	316,982,160	



3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	371,265,440	
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	357,671,980	
4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,882,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,934,000	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,961,380	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	428,324,140	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	632,880,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,966,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,161,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,647,000	
1 6 回 日本道路・機構承継債	430,000,000	433,663,600	
2 6 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	205,460,000	
4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	311,109,000	
8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	304,544,080	
8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	212,371,650	
8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	443,581,920	
8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	618,018,000	
8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	268,065,200	
8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,482,000	
8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,074,000	
8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,566,000	
8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,353,870	
8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	310,599,000	
8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,599,400	
8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	316,132,640	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,030,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,824,220	

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,849,070	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,396,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	213,340,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,827,600	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,989,040	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	514,737,440	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	691,342,470	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,176,150	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,760,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,080,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,165,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,804,000	
	2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,899,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,179,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,625,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,242,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,477,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,484,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	321,909,000	
	1 9 1 回 政保首都高速道路債券	113,000,000	117,592,320	
	1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,422,000	
	1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	110,953,650	
	5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,292,000	
	1 7 6 回 政保中小企業債券	100,000,000	102,398,000	
	1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	147,709,820	
	1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	107,820,960	
	2 6 回 中小企業債券	400,000,000	410,004,000	
	1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	207,096,000	
	8 回 国際協力銀行債券	300,000,000	301,416,000	
	1 2 回 国際協力銀行債券	200,000,000	205,802,000	
	2 回 都市再生債券	100,000,000	104,389,000	
	1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	216,772,000	
	2 3 回 都市再生機構債券	200,000,000	203,628,000	
	2 回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	103,039,000	
	6 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	102,676,000	
	1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,524,000	
	3 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,798,000	
	3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,734,000	
	6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	124,638,000	132,450,309	
	8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	86,258,000	91,084,135	
	9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	129,114,000	136,889,245	
	2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	150,030,000	158,923,778	

	1 3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	65,906,000	69,516,330	
	1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	338,025,000	352,499,230	
	4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,409,000	83,631,792	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,019,000	64,892,486	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	237,304,000	252,709,775	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	190,224,000	200,834,694	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	323,285,000	339,698,179	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	413,395,000	431,658,791	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	726,512,000	751,620,254	
	1 4 回 政保国民生活債券	132,000,000	136,540,800	
	7 0 4 号 利附商工債	200,000,000	204,472,000	
	7 0 6 号 利付商工債	300,000,000	307,203,000	
	7 1 4 号 利付商工債	300,000,000	305,133,000	
	7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	301,446,000	
	7 3 2 号 利付商工債	200,000,000	201,588,000	
	6 9 4 号 利附農林債	400,000,000	404,232,000	
	6 9 5 号 利附農林債	200,000,000	202,258,000	
	6 9 8 号 利附農林債	300,000,000	305,670,000	
	7 0 1 号 利附農林債	200,000,000	204,176,000	
	7 0 9 号 利附農林債	400,000,000	408,292,000	
	7 1 3 号 利附農林債	300,000,000	303,942,000	
	7 1 7 号 利附農林債	300,000,000	303,666,000	
	7 2 1 号 利附農林債	120,000,000	120,900,000	
	2 2 2 回 利附信金中金債	200,000,000	203,146,000	
	2 2 3 回 利附信金中金債	300,000,000	305,445,000	
	2 2 6 回 利附信金中金債	300,000,000	305,616,000	
	2 2 9 回 利附信金中金債	400,000,000	408,924,000	
	2 3 3 回 利附信金中金債	300,000,000	307,356,000	
	2 3 6 回 利附信金中金債	300,000,000	304,641,000	
	2 4 1 回 利附信金中金債	300,000,000	303,384,000	
	1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	106,003,540	
	2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,680,340	
	4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,974,300	
	8 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,693,900	
	2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	321,972,000	
	5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	215,376,000	
	1 回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	210,957,540	
	5 回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	277,111,870	
	6 回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	125,294,130	
	2 回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	311,952,000	
特殊債券計			36,028,802,468	
社債券	3 4 5 回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,501,000	
	9 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,505,000	
	1 2 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,133,000	
	1 4 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	102,561,000	
	2 回 J P モルガン・チェース劣後債	100,000,000	98,641,000	

4回	ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	99,235,000	
16回	シティグループ円貨社債	100,000,000	97,937,000	
22回	シティグループ円貨社債	200,000,000	200,680,000	
7回	ウエストパック銀行円貨社債	100,000,000	99,584,000	
1回	オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	102,433,000	
1回	キリンホールディングス社債	100,000,000	100,983,000	
7回	キリンホールディングス社債	100,000,000	105,935,000	
5回	日本たばこ産業社債	100,000,000	101,978,000	
25回	住友化学工業社債	100,000,000	102,332,000	
41回	住友化学社債	100,000,000	105,254,000	
25回	三菱化学社債	100,000,000	101,600,000	
34回	三井化学社債	100,000,000	105,374,000	
2回	花王社債	100,000,000	102,340,000	
24回	新日本石油社債	100,000,000	103,614,000	
8回	旭硝子社債	100,000,000	100,569,000	
29回	新日本製鐵社債	100,000,000	114,197,000	
48回	新日本製鐵社債	100,000,000	101,003,000	
52回	新日本製鐵社債	100,000,000	103,018,000	
13回	ジェイエフイーホールディングス社債	100,000,000	101,547,000	
15回	ジェイエフイーホールディングス社債	100,000,000	100,637,000	
12回	日立製作所社債	100,000,000	100,602,000	
25回	富士通社債	100,000,000	103,655,000	
7回	パナソニック社債	200,000,000	204,702,000	
10回	パナソニック社債	200,000,000	202,066,000	
11回	パナソニック社債	100,000,000	102,247,000	
24回	シャープ社債	200,000,000	202,466,000	
17回	ソニー社債	100,000,000	103,806,000	
19回	ソニー社債	100,000,000	101,469,000	
3回	パナソニック電工社債	100,000,000	104,180,000	
19回	三菱重工業社債	100,000,000	107,029,000	
49回	日産自動車社債	100,000,000	103,985,000	
51回	日産自動車社債	100,000,000	101,044,000	
7回	トヨタ自動車社債	300,000,000	306,222,000	
9回	トヨタ自動車社債	200,000,000	203,790,000	
49回	伊藤忠商事社債	100,000,000	109,553,000	
77回	丸紅社債	100,000,000	101,105,000	
45回	三井物産社債	100,000,000	100,630,000	
29回	住友商事社債	100,000,000	101,235,000	
16回	三菱商事社債	100,000,000	105,439,000	
14回	クレディセゾン社債	100,000,000	100,758,000	
1回	みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	205,756,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,772,000	
13回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,304,000	
14回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,317,000	
15回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,288,000	
18回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,648,000	
20回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,062,000	

24回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,146,000	
100回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,368,000	
106回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,638,000	
112回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,018,000	
114回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,096,000	
3回2号	三菱東京UFJ銀行社債 (劣後)	200,000,000	202,340,000	
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,331,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,824,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,640,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	202,810,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,738,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,052,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,861,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,871,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,866,000	
5回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,709,000	
45回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,882,000	
47回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,116,000	
50回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,898,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	199,700,000	
6回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	101,855,000	
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,994,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,714,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,792,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,750,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,984,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,795,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,013,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,544,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,846,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,978,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,909,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,590,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	320,649,000	
40回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,863,000	
118回	オリックス社債	100,000,000	103,262,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	100,924,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	200,256,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,410,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,050,000	
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,954,000	
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,466,000	
20回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,229,000	
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,010,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	104,699,000	
31回	三井不動産社債	100,000,000	103,500,000	
66回	三菱地所社債	100,000,000	100,723,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	213,144,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	106,280,000	
73回	住友不動産社債	100,000,000	100,852,000	

4 1 回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,877,000
2 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	228,220,000
7 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,146,000
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,541,000
2 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	301,824,000
3 1 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,598,000
4 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,231,000
3 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,414,000
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,949,000
1 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,188,000
2 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	229,716,000
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,842,000
1 0 回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	199,064,900
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,321,000
3 回	東京地下鉄社債	100,000,000	106,660,000
4 8 回	日本電信電話社債	400,000,000	413,912,000
5 0 回	日本電信電話社債	100,000,000	104,341,000
5 1 回	日本電信電話社債	200,000,000	214,198,000
5 8 回	日本電信電話社債	100,000,000	101,719,000
5 回	K D D I 社債	100,000,000	113,726,000
1 6 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	203,934,000
1 8 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	201,834,000
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	135,328,000
5 1 1 回	東京電力社債	100,000,000	85,570,000
5 1 6 回	東京電力社債	100,000,000	79,751,000
5 1 9 回	東京電力社債	372,000,000	285,275,640
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	337,095,000
4 0 7 回	中部電力社債	100,000,000	109,154,000
4 0 9 回	中部電力社債	300,000,000	339,957,000
4 6 3 回	中部電力社債	200,000,000	200,894,000
4 6 7 回	中部電力社債	100,000,000	102,490,000
4 6 8 回	中部電力社債	100,000,000	102,231,000
4 7 1 回	中部電力社債	300,000,000	305,910,000
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	106,725,000
4 7 8 回	中部電力社債	100,000,000	104,722,000
4 8 0 回	中部電力社債	200,000,000	208,830,000
4 8 4 回	中部電力社債	200,000,000	203,958,000
4 8 7 回	中部電力社債	140,000,000	141,590,400
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	497,390,000
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	317,532,000
4 2 7 回	関西電力社債	100,000,000	101,427,000
4 3 3 回	関西電力社債	200,000,000	203,578,000
4 4 1 回	関西電力社債	200,000,000	204,876,000
4 4 6 回	関西電力社債	200,000,000	207,970,000
2 9 8 回	中国電力社債	200,000,000	222,478,000
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	224,750,000
3 4 1 回	中国電力社債	100,000,000	102,209,000
3 5 0 回	中国電力社債	200,000,000	204,974,000
2 4 5 回	北陸電力社債	200,000,000	220,934,000
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	108,222,000
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	211,462,000

	2 8 9 回 北陸電力社債	300,000,000	306,432,000	
	3 6 8 回 東北電力社債	300,000,000	327,735,000	
	3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	109,852,000	
	3 8 0 回 東北電力社債	300,000,000	336,786,000	
	4 2 0 回 東北電力社債	100,000,000	101,370,000	
	4 2 7 回 東北電力社債	200,000,000	204,202,000	
	4 3 2 回 東北電力社債	500,000,000	524,780,000	
	2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	106,299,000	
	2 5 7 回 四国電力社債	200,000,000	204,280,000	
	3 7 4 回 九州電力社債	300,000,000	304,914,000	
	3 8 2 回 九州電力社債	100,000,000	102,293,000	
	3 8 3 回 九州電力社債	100,000,000	102,438,000	
	3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	207,274,000	
	2 5 7 回 北海道電力社債	200,000,000	225,412,000	
	2 8 2 回 北海道電力社債	200,000,000	203,302,000	
	2 8 4 回 北海道電力社債	500,000,000	513,670,000	
	2 8 6 回 北海道電力社債	100,000,000	102,378,000	
	2 回 電源開発社債	100,000,000	101,590,000	
	4 回 電源開発社債	200,000,000	202,678,000	
	6 回 電源開発社債	100,000,000	102,266,000	
	1 4 回 電源開発社債	100,000,000	102,646,000	
	1 7 回 電源開発社債	100,000,000	104,884,000	
	1 4 回 東京ガス社債	100,000,000	112,086,000	
	2 4 回 東京瓦斯社債	200,000,000	204,306,000	
	9 回 大阪ガス社債	100,000,000	113,708,000	
	2 4 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	103,532,000	
	2 7 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	101,744,000	
	2 0 回 N T T データ社債	100,000,000	101,189,000	
	社債券計		28,803,244,940	
	合計		403,391,639,507	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		8,022,524,784	3,821,539,025
コール・ローン		880,906,590	1,479,680,769
国債証券		384,733,019,200	346,635,059,718
派生商品評価勘定		103,677	756,767
未収利息		4,842,963,020	4,092,985,592
前払費用		220,292,547	173,177,455
流動資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326
資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,736,569	376,064
未払金		4,283,669,735	1,730,575,372
未払解約金		31,598,000	26,875,000
流動負債合計		4,320,004,304	1,757,826,436
負債合計		4,320,004,304	1,757,826,436
純資産の部			
元本等			
元本		350,943,197,818	320,315,770,753
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		43,436,607,696	34,129,602,137
元本等合計		394,379,805,514	354,445,372,890
純資産合計		394,379,805,514	354,445,372,890
負債純資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11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	<p>(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。</p> <p>(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。</p>	<p>(1)外貨建取引等の処理基準 同左</p> <p>(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日までとなっております。</p>
----------------------------	--	---

## (追加情報)

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	335,169,742,026円 53,327,268,319円 37,553,812,527円	350,943,197,818円 34,916,229,537円 65,543,656,602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 D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金> D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 D I A M DC バランス30インデックスファンド D I A M DC バランス50インデックスファンド D I A M DC バランス70インデックスファンド マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> マネックス資産設計ファンド<育成型> マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,574,134,629円 3,580,764,901円 297,183,514円 1,081,861,380円 1,177,346,407円 323,613,584円 632,799,046円 414,382,579円 178,030,226円 1,606,931,925円 4,175,814円	1,999,508,906円 3,985,025,882円 336,613,649円 1,167,060,872円 1,182,837,108円 337,866,678円 657,766,156円 401,779,916円 161,278,829円 1,764,418,944円 13,413,592円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	9,015,830,509円	6,140,558,650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)	4,150,240,749円	8,280,258,279円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,629,093,022円	6,776,955,433円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	948,036,288円	946,676,260円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	269,744,724円	240,836,858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)	51,933,106,616円	46,312,994,177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)	2,944,918,247円	2,510,570,901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)	498,993,629円	443,974,690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)	809,273,188円	727,637,617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)	230,874,683円	199,244,006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)	101,038,275円	87,637,321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)	30,549,846,148円	27,250,002,344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)	6,769,830,622円	5,992,515,436円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	12,341,497,659円	11,070,345,668円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,814,032,741円	5,030,172,400円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,376,189,817円	7,104,841,199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)	3,179,473,611円	2,746,963,331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)	9,356,072,523円	8,428,452,355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)	10,858,768,967円	9,873,989,080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)	53,494,918,132円	50,572,642,858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)	229,613,168円	267,315,107円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	562,278,813円	円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,410,654,771円	6,625,486,509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）	16,259,741,187円	14,994,966,188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）	285,986,643円	290,931,174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）	27,943,466,960円	25,427,832,054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）	33,836,231,153円	31,042,712,077円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	880,604,875円	813,502,633円
D I A Mバランス50VA（適格機関投資家限定）	243,618円	230,982円
D I A Mバランス70VA（適格機関投資家限定）	151,623円	140,632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）	29,514,006,257円	27,256,172,658円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	211,562,092円	229,549,307円
D I A Mバランス20VA（適格機関投資家限定）	665,284,710円	621,742,683円
D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	227,931円	218,810円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	139,862円	130,544円
（合計）	350,943,197,818円	320,315,770,753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	350,943,197,818口	320,315,770,753口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	554,332,068	14,933,279,836
合 計	554,332,068	14,933,279,836

(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)

## (通貨関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	メキシコ ペソ	65,510,955	-	65,427,000	83,955
	買建				
	ユーロ	268,039,814	-	265,179,790	2,860,024
	英ポンド	66,920,898	-	66,940,620	19,722
	米ドル	334,597,005	-	332,720,460	1,876,545
	合 計	735,068,672	-	730,267,870	4,632,892

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	93,786,574	-	93,776,430	10,144
	買建				
	オーストラリアドル	12,843,112	-	12,891,670	48,558
	カナダドル	25,775,421	-	25,906,790	131,369
	ポーランドズロチ	38,758,424	-	38,984,000	225,576
	ユーロ	477,097,414	-	476,721,350	376,064
	英ポンド	90,259,500	-	90,348,800	89,300
米ドル	645,078,900	-	645,330,720	251,820	
合 計	1,383,599,345	-	1,383,959,760	380,703	

（注）時価の算定方法

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1238円 (11,238円)	1.1065円 (11,065円)

[前へ](#) [次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 0.625 01/31/13	20,000,000.00	20,100,000.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	33,299,840.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,393,680.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,496,000.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,341,250.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	32,000,000.00	33,467,200.000	
	US T N/B 1.0 07/15/13	40,000,000.00	40,476,400.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,244,900.000	
	US T N/B 0.125 08/31/13	35,000,000.00	34,950,650.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	30,139,200.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	42,940,400.000	
	US T N/B 0.75 12/15/13	25,000,000.00	25,242,000.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,115,600.000	
	US T N/B 1.75 03/31/14	25,000,000.00	25,813,250.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,644,900.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,702,500.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,832,760.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	29,535,520.000	
	US T N/B 0.25 09/15/14	20,000,000.00	19,955,400.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	33,292,800.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	26,257,750.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	12,000,000.00	12,796,800.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	22,203,000.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	24,405,990.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	21,347,600.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	20,190,780.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,719,400.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	8,350,880.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,990,950.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	15,400,650.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	13,000,000.00	13,342,160.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,678,760.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	15,000,000.00	15,454,650.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.00	18,494,880.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	21,418,600.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.00	12,812,500.000	
	US T N/B 1.75 05/31/16	20,000,000.00	20,910,000.000	
	US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.00	27,771,250.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.00	20,162,170.000	

	US T N/B 1.0 08/31/16	10,000,000.00	10,106,200.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	22,039,000.000	
	US T N/B 1.0 10/31/16	15,000,000.00	15,135,300.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	18,443,880.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	21,825,000.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	22,318,600.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	14,227,440.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	22,095,200.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	11,124,200.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,855,230.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	14,044,030.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	18,050,250.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	8,359,360.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	8,349,360.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	16,503,480.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	14,000,000.00	14,906,640.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	15,922,760.000	
	US T N/B 2.875 03/31/18	5,000,000.00	5,506,600.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.00	9,310,000.000	
	US T N/B 2.375 06/30/18	18,000,000.00	19,234,620.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.00	14,095,200.000	
	US T N/B 1.375 09/30/18	12,000,000.00	12,033,720.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	11,000,000.00	12,751,310.000	
	US T N/B 1.375 11/30/18	15,000,000.00	15,005,850.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.00	6,046,840.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	15,000,000.00	16,376,850.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	16,000,000.00	17,883,680.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.00	5,925,600.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	15,000,000.00	17,302,650.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	14,000,000.00	15,897,560.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	22,000,000.00	25,397,900.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	19,000,000.00	21,746,070.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,975,230.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	23,000,000.00	24,667,500.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	22,000,000.00	23,534,720.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	24,000,000.00	27,665,520.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	25,000,000.00	27,699,000.000	
	US T N/B 2.125 08/15/21	20,000,000.00	20,345,200.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.00	9,307,020.000	
	US T N/B 2.0 11/15/21	2,000,000.00	2,005,000.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,502,790.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	3,000,000.00	4,495,770.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	7,000,000.00	9,921,940.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	2,000,000.00	3,158,420.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	2,000,000.00	3,197,960.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	5,323,815.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.00	5,689,040.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	4,487,790.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,517,650.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,988,580.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	8,792,760.000	



	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	4,172,790.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.00	4,073,430.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	3,000,000.00	4,080,000.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	2,000,000.00	2,985,000.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	4,000,000.00	6,086,560.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,000,000.00	7,007,800.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	8,000,000.00	10,256,240.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	4,000,000.00	5,317,480.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	5,505,600.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	5,000,000.00	6,319,500.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	6,000,000.00	7,728,240.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	8,000,000.00	8,779,360.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	9,500,000.00	11,797,005.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	10,000,000.00	12,912,500.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	13,000,000.00	16,476,460.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	12,000,000.00	15,806,160.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	13,000,000.00	16,480,490.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	13,000,000.00	15,194,660.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	17,415,720.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	15,000,000.00	20,176,050.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	14,000,000.00	17,786,440.000	
	US T N/B 3.75 08/15/41	13,000,000.00	14,894,100.000	
	US T N/B 3.125 11/15/41	6,000,000.00	6,114,360.000	
米ドル小計	銘柄数 : 113	1,709,000,000.00	1,905,155,050.000	
	組入時価比率 : 41.33%		(146,487,371,795)	
	合計時価比率 : 42.26%			
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	6,000,000.00	6,281,400.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,386,400.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,391,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	10,076,400.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,000,000.00	9,593,100.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	9,183,200.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,841,500.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	10,500,000.00	10,995,600.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	8,000,000.00	9,116,800.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	5,000,000.00	5,164,000.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,245,300.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.00	6,705,050.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,000,000.00	8,405,600.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	9,000,000.00	10,345,500.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.00	7,973,550.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	9,000,000.00	10,345,500.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	4,000,000.00	6,080,800.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	8,000,000.00	9,175,360.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	4,500,000.00	5,265,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,000,000.00	7,748,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	6,000,000.00	7,276,200.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,000,000.00	5,847,200.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	7,713,000.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,000,000.00	7,266,000.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,500,000.00	6,888,200.000	

	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,000,000.00	8,502,200.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,000,000.00	7,887,000.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	6,000,000.00	7,305,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	7,000,000.00	8,529,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	6,000,000.00	7,657,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,000,000.00	7,429,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	5,000,000.00	6,227,500.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,000,000.00	1,134,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	7,593,000.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,500,000.00	5,478,750.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 35	216,000,000.00	257,054,610.000	
	組入時価比率 : 8.62%		(30,561,222,583)	
	合計時価比率 : 8.82%			
	CANADA 5.25 06/01/13	7,500,000.00	7,940,625.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	13,000,000.00	13,321,880.000	
	CANADA 1.5 11/01/13	7,000,000.00	7,067,760.000	
	CANADA 2.0 03/01/14	3,000,000.00	3,065,190.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,946,000.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	7,190,610.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,896,560.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	4,000,000.00	4,273,880.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	7,500,000.00	8,373,900.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.00	4,261,080.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,000,000.00	2,013,240.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.00	3,973,200.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.00	4,080,860.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	6,500,000.00	7,422,025.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	5,000,000.00	5,629,650.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,000,000.00	4,429,400.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,000,000.00	1,060,820.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	1,200,000.00	1,912,044.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,200,000.00	2,137,788.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	1,700,000.00	2,943,499.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	4,500,000.00	6,604,740.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	4,500,000.00	6,873,255.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,200,000.00	7,535,476.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	5,500,000.00	7,155,500.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,000,000.00	1,213,620.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 25	121,300,000.00	140,322,602.000	
	組入時価比率 : 2.99%		(10,599,969,355)	
	合計時価比率 : 3.06%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	26,000,000.00	29,470,220.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	25,832,910.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	19,480,500.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	21,282,850.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	25,000,000.00	29,697,500.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	27,000,000.00	34,604,010.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,000,000.00	12,841,730.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	20,360,800.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 8	165,000,000.00	193,570,520.000	

	組入時価比率 : 0.61%		(2,152,504,182)
	合計時価比率 : 0.62%		
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,625,000.000
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	6,000,000.00	6,435,600.000
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,154,500.000
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	5,000,000.00	5,260,000.000
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,500,000.00	4,815,000.000
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,000,000.00	1,028,200.000
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,310,000.000
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,370,000.000
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	4,000,000.00	4,323,600.000
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,232,500.000
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,500,000.00	4,592,250.000
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,500,000.00	2,555,000.000
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,800,000.00	3,200,260.000
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	2,500,000.00	3,276,000.000
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	4,300,000.00	4,626,800.000
	BELGIUM 4.0 03/28/13	4,000,000.00	4,110,800.000
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,100,000.000
	BELGIUM 4.0 03/28/14	5,000,000.00	5,163,000.000
	BELGIUM 4.25 09/28/14	5,000,000.00	5,157,500.000
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,063,500.000
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,092,000.000
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	2,922,300.000
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	4,964,000.000
	BELGIUM 4.0 03/28/17	5,500,000.00	5,643,000.000
	BELGIUM 5.5 09/28/17	3,500,000.00	3,741,150.000
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,106,800.000
	BELGIUM 4.0 03/28/19	3,500,000.00	3,526,250.000
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,293,300.000
	BELGIUM 4.25 09/28/21	4,500,000.00	4,465,350.000
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	4,819,500.000
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.00	1,553,550.000
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,500,000.00	6,296,950.000
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,500,000.00	5,773,790.000
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,500,000.00	3,340,750.000
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	10,000,000.00	10,443,500.000
	BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	5,000,000.00	5,087,250.000
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	14,500,000.00	15,286,625.000
	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	6,000,000.00	6,063,000.000
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	20,000,000.00	21,617,000.000
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,884,800.000
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	17,000,000.00	18,705,100.000
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	19,725,300.000
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	14,000,000.00	15,609,300.000
	BUNDESOBL 2.75 04/08/16	13,000,000.00	14,138,800.000
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	11,447,000.000
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	8,000,000.00	9,126,800.000
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.00	8,215,200.000
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.00	8,171,100.000
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	8,000,000.00	9,509,200.000

	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	8,000,000.00	9,279,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	9,000,000.00	10,298,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	8,000,000.00	9,019,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	7,000,000.00	7,756,000.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	6,280,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	7,000,000.00	7,462,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	6,500,000.00	7,326,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	6,000,000.00	6,226,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.00	2,528,750.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	3,500,000.00	5,022,500.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,000,000.00	6,128,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,000,000.00	7,107,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,000,000.00	5,228,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	5,381,250.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	6,100,000.00	8,826,700.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	7,000,000.00	9,662,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	8,000,000.00	10,204,480.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,000,000.00	6,740,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,800,000.00	8,447,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,300,000.00	5,019,390.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	6,000,000.00	6,223,200.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	10,134,300.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	12,000,000.00	12,159,000.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	7,500,000.00	7,673,250.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,500,000.00	5,440,600.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,070,000.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	5,834,100.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	6,000,000.00	5,763,000.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	5,000,000.00	4,784,000.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	3,000,000.00	2,977,920.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.00	5,772,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,000,000.00	5,197,400.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,768,700.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	5,000,000.00	4,881,500.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.00	5,249,750.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	7,000,000.00	6,485,500.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	6,000,000.00	5,829,600.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	7,500,000.00	7,427,250.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,000,000.00	1,005,870.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	5,500,000.00	4,972,550.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,000,000.00	4,375,500.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.00	2,444,750.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	6,500,000.00	6,367,400.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,000,000.00	4,725,850.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,500,000.00	4,162,015.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,500,000.00	3,642,750.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,800,000.00	3,032,400.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	2,500,000.00	2,685,875.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,599,825.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,500,000.00	2,773,250.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	3,075,450.000	

	FINLAND 3.875 09/15/17	2,000,000.00	2,219,000.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,309,600.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	2,000,000.00	2,172,100.000	
	FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.00	1,645,575.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	3,199,420.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	16,000,000.00	16,692,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	19,000,000.00	19,991,800.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,199,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	14,000,000.00	14,907,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	14,000,000.00	14,926,800.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	16,908,800.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,846,600.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	17,000,000.00	18,008,100.000	
	FR TREASURY 2.5 07/25/16	6,500,000.00	6,589,310.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,185,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,744,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,689,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.00	9,801,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,694,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	10,500,000.00	11,299,050.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.00	4,132,500.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	9,000,000.00	9,580,500.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	11,000,000.00	11,438,900.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	10,000,000.00	9,506,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,000,000.00	11,394,900.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	8,000,000.00	8,080,000.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,814,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,000,000.00	11,830,500.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,541,400.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	8,000,000.00	7,804,800.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	9,000,000.00	10,800,000.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,053,600.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,000,000.00	7,043,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	8,300,000.00	8,490,070.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	6,000,000.00	6,618,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	5,500,000.00	5,437,300.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,800,000.00	2,778,440.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	2,945,580.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,822,850.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,699,760.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,474,430.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,404,260.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	2,644,500.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,416,170.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,619,800.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,465,700.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	11,000,000.00	11,079,200.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	15,948,960.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	18,000,000.00	17,640,000.000	
	ITALY BTPS 3.5 06/01/14	4,000,000.00	3,847,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	18,593,400.000	

	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	8,000,000.00	7,712,000.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	9,000,000.00	8,289,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	14,022,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.00	9,200,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	12,740,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	9,000,000.00	8,164,800.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	7,605,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	8,148,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	9,000,000.00	8,096,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.00	7,005,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	7,510,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	8,000,000.00	6,890,400.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	7,500,000.00	6,522,750.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	7,713,900.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	8,000,000.00	6,655,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	8,000,000.00	6,500,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	10,000,000.00	7,962,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/21	9,000,000.00	7,738,200.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,000,000.00	3,433,200.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	8,000,000.00	6,566,400.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.00	4,395,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	6,112,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,000,000.00	4,611,000.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.00	3,524,150.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	9,000,000.00	8,378,100.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000,000.00	8,103,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	10,500,000.00	9,141,300.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	5,000,000.00	4,184,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,000,000.00	6,156,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,000,000.00	6,124,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	6,500,000.00	4,968,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	7,000,000.00	5,334,000.000	
	NETHERLANDS 1.75 01/15/13	2,500,000.00	2,544,500.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,421,400.000	
	NETHERLANDS 1.0 01/15/14	4,000,000.00	4,046,000.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,561,400.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,293,000.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,478,200.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,608,000.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/17	3,000,000.00	3,158,400.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,762,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,798,600.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	4,500,000.00	5,132,250.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,633,600.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.00	5,428,000.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,699,150.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	6,187,950.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	5,629,500.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,500,000.00	4,372,550.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	2,756,400.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,478,760.000	

	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	3,387,500.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	1,145,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	1,789,470.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	1,446,420.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	3,000,000.00	1,533,000.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	1,394,100.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 208	1,386,500,000.00	1,419,620,225.000	
	組入時価比率 : 39.25%		(139,122,782,050)	
	合計時価比率 : 40.14%			
	DENMARK 5.0 11/15/13	30,000,000.00	32,686,500.000	
	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.00	6,280,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	35,000,000.00	39,592,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	21,000,000.00	24,714,900.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	39,435,000.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	15,000,000.00	16,770,000.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	9,000,000.00	14,174,100.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	36,500,000.00	53,498,415.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 8	185,500,000.00	227,151,715.000	
	組入時価比率 : 0.84%		(2,993,859,604)	
	合計時価比率 : 0.86%			
	NORWAY 6.5 05/15/13	20,000,000.00	21,383,000.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	22,517,400.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	13,000,000.00	14,903,200.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	10,000,000.00	11,890,000.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	10,500,000.00	12,076,050.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 5	73,500,000.00	82,769,650.000	
	組入時価比率 : 0.30%		(1,059,451,520)	
	合計時価比率 : 0.31%			
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,104,020.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	15,000,000.00	15,060,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	13,000,000.00	13,244,400.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,500,000.00	4,565,475.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	17,000,000.00	17,680,000.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	4,000,000.00	3,971,800.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,809,200.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.00	8,913,060.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	7,500,000.00	7,243,500.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.00	2,488,500.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.00	8,892,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	2,920,500.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 12	110,500,000.00	110,892,455.000	
	組入時価比率 : 0.69%		(2,440,742,935)	
	合計時価比率 : 0.70%			
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	1,500,000.00	1,543,920.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,317,600.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	3,000,000.00	3,244,170.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,422,430.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,962,475.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	3,192,952.000	

	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,200,000.00	2,491,676.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,340,200.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.00	878,872.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	21,800,000.00	24,394,295.000	
	組入時価比率 : 0.41%		(1,451,460,553)	
	合計時価比率 : 0.42%			
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	9,000,000.00	9,081,360.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,611,780.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	6,000,000.00	6,143,220.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,292,180.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,151,270.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,318,500.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,000,000.00	8,468,240.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.00	4,165,240.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,753,000.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,307,940.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 10	68,000,000.00	70,292,730.000	
	組入時価比率 : 0.48%		(1,718,657,249)	
	合計時価比率 : 0.50%			
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	6,500,000.00	6,768,905.000	
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	8,500,000.00	9,100,440.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	8,000,000.00	8,749,600.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,500,000.00	4,766,265.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,500,000.00	7,298,330.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,000,000.00	3,323,580.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	6,000,000.00	6,620,040.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,500,000.00	5,809,430.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,000,000.00	5,766,000.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.00	3,474,210.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,000,000.00	2,269,080.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,000,000.00	1,063,820.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 12	59,500,000.00	65,009,700.000	
	組入時価比率 : 1.45%		(5,142,267,270)	
	合計時価比率 : 1.48%			
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	145,000,000.00	162,049,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	77,483,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	70,000,000.00	78,537,200.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	25,000,000.00	25,293,750.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.00	71,480,750.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	50,000,000.00	56,338,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	42,000,000.00	45,681,300.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 : 7	457,000,000.00	516,863,100.000	
	組入時価比率 : 0.82%		(2,904,770,622)	
	合計時価比率 : 0.84%			
合計			346,635,059,718	
			(346,635,059,718)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。



3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 113銘柄	41.33%	42.26%
英ポンド	国債証券 35銘柄	8.62%	8.82%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.99%	3.06%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.61%	0.62%
ユーロ	国債証券 208銘柄	39.25%	40.14%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	0.84%	0.86%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.30%	0.31%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.69%	0.70%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.41%	0.42%
マレーシアリングgit	国債証券 10銘柄	0.48%	0.50%
オーストラリアドル	国債証券 12銘柄	1.45%	1.48%
メキシコ ペソ	国債証券 7銘柄	0.82%	0.84%

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

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

## 「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		259,280,233	2,257,853
投資証券		4,135,148,100	3,460,690,650
未収入金		628,000	-
未収配当金		42,511,113	52,047,544
流動資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047
資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047
負債の部			
流動負債			
未払金		256,059,290	-
未払解約金		185,000	241,000
流動負債合計		256,244,290	241,000
負債合計		256,244,290	241,000
純資産の部			
元本等			
元本		4,718,941,254	5,093,136,025
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	537,618,098	1,578,380,978
元本等合計		4,181,323,156	3,514,755,047
純資産合計		4,181,323,156	3,514,755,047
負債純資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11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）、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 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22年6月8日から平成23年6月6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23年6月7日から平成24年6月6日までとなっております。

## (追加情報)

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
----------------------------	----------------------------

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	
---	--

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,226,243,410円	4,718,941,254円
同期中追加設定元本額	4,334,906,397円	4,892,978,114円
同期中解約元本額	4,842,208,553円	4,518,783,343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>	73,447,417円	43,781,811円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	660,693,969円	480,093,400円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,625,990円	2,526,412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）	2,376,575,088円	3,750,397,262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）	399,241,647円	363,475,224円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	789,057,681円	円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	418,299,462円	452,861,916円
（合計）	4,718,941,254円	5,093,136,025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	4,718,941,254口	5,093,136,025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537,618,098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1,578,380,978円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	651,763,217	653,145,923
合計	651,763,217	653,145,923

(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23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8861円 (8,861円)	0.6901円 (6,901円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	228	119,700,000	
	M I Dリート投資法人	215	39,345,000	
	森ヒルズリート投資法人	271	69,213,400	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	176	59,664,000	
	産業ファンド投資法人	109	41,093,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,145	165,567,000	
	日本ビルファンド投資法人	676	436,020,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	572	354,068,000	
	日本リテールファンド投資法人	2,197	247,382,200	
	オリックス不動産投資法人	332	108,066,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	836	149,142,400	
	プレミアム投資法人	230	58,006,000	
	東急リアル・エステート投資法人	198	79,992,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	113	57,404,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	357	143,692,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,458	208,438,400	
	森トラスト総合リート投資法人	283	177,158,000	
	インヴィンシブル投資法人	1,576	9,771,200	
	フロンティア不動産投資法人	227	141,875,000	
	平和不動産リート投資法人	813	30,731,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	173	115,218,000	
	福岡リート投資法人	144	73,440,000	
	ケネディクス不動産投資法人	335	75,341,500	
	積水ハウス・S I投資法人	134	39,972,200	
	いちご不動産投資法人	985	30,288,750	
	大和証券オフィス投資法人	463	75,330,100	
	阪急リート投資法人	100	33,150,000	

	スタートプロシード投資法人	126	12,726,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	124	21,576,000	
	トップリート投資法人	181	63,531,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	188	91,368,000	
	日本ホテルファンド投資法人	68	13,511,600	
	日本賃貸住宅投資法人	1,555	52,248,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	220	66,660,000	
合計		17,808	3,460,690,650	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		47,581,715	24,403,112
コール・ローン		4,902,723	13,859,446
投資信託受益証券		611,982,793	362,196,875
投資証券		3,103,364,098	2,104,604,573
未収配当金		18,345,081	10,714,409
流動資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415
資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415
負債の部			
流動負債			
未払解約金		89,000	175,000
流動負債合計		89,000	175,000
負債合計		89,000	175,000
純資産の部			
元本等			
元本		5,089,591,953	3,472,218,155
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	*3	1,303,504,543	956,614,740
元本等合計		3,786,087,410	2,515,603,415
純資産合計		3,786,087,410	2,515,603,415
負債純資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415

## 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22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資信託受益証券及び投資証券 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22年11月9日から平成23年11月7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23年11月8日から平成24年11月6日までとなっております。

## (追加情報)

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,398,034,421円	5,089,591,953円
同期中追加設定元本額	420,369,795円	66,409,391円
同期中解約元本額	5,728,812,263円	1,683,783,189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>	58,724,937円	46,062,427円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	529,055,653円	503,071,359円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,660,568円	39,015,043円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	4,273,962,787円	2,708,943,679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）	200,188,008円	175,125,647円
（合計）	5,089,591,953円	3,472,218,155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	5,089,591,953口	3,472,218,155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1,303,504,543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956,614,740円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左



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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	15,587,123	7,098,111
投資証券	107,573,644	7,160,175
合計	123,160,767	14,258,286

(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23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7439円 (7,439円)	0.7245円 (7,245円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考	
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	206,000.00	361,530.000		
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	132,000.00	257,400.000		
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	150,000.00	160,500.000		
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	170,000.00	189,550.000		
	STARHILL GLOBAL REIT	120,000.00	69,600.000		
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	95,000.00	158,175.000		
シンガポール・ドル 小計	銘柄数 : 6	873,000.00	1,196,755.000		
	組入時価比率 : 2.83%		(71,206,923)		
	合計時価比率 : 2.89%				
	BWP TRUST	20,500.00	35,567.500		
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	152,300.00	150,777.000		
	MIRVAC GROUP	191,854.00	238,858.230		
	INVESTA OFFICE FUND	161,080.00	99,869.600		
	CHARTER HALL RETAIL REIT	8,480.00	27,814.400		
	CFS RETAIL PROPERTY	153,300.00	273,640.500		
	GPT GROUP	121,000.00	375,100.000		
	ABACUS PROPERTY GR	16,920.00	32,401.800		
	CHARTER HALL OFFICE REIT	25,840.00	91,473.600		
	STOCKLAND	130,140.00	438,571.800		
	WESTFIELD GROUP	116,200.00	985,376.000		
	DEXUS PROPERTY GROUP	247,400.00	216,475.000		
	GOODMAN GROUP	445,762.00	274,143.630		
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,590.00	48,595.400		
	WESTFIELD RETAIL TRUST	151,200.00	390,096.000		
	オーストラリアドル 小計	銘柄数 : 15	1,965,566.00	3,678,760.460	
		組入時価比率 : 11.57%		(290,989,952)	
合計時価比率 : 11.80%					
投資信託受益証券計			362,196,875		
			(362,196,875)		
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,900.00	271,674.000		
	BOSTON PROPERTIES INC	8,750.00	871,325.000		
	CEDAR REALTY TRUST INC	5,300.00	25,228.000		
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,400.00	33,384.000		
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	3,400.00	67,898.000		
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7,715.00	176,596.350		
	AGREE REALTY CORP	1,100.00	27,082.000		
	BRE PROPERTIES -CL A	5,300.00	266,855.000		
	SL GREEN	4,225.00	300,989.000		
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	2,200.00	97,878.000		
	PROLOGIS INC	25,729.00	754,116.990		
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,138.00	658,229.180		
	LEXINGTON REALTY TRUST	3,521.00	26,618.760		
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,800.00	233,472.000		
	CBL & ASSOCIATES	5,882.00	93,582.620		

	MACK CALI	5,300.00	138,860.000
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	3,500.00	72,310.000
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,100.00	83,142.000
	COUSINS PROPERTIES INC	909.00	6,081.210
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,000.00	129,050.000
	EQUITY ONE INC	6,000.00	104,220.000
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.00	47,502.000
	DDR CORP	12,882.00	165,791.340
	DUKE REALTY TRUST	17,200.00	209,840.000
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,700.00	61,446.000
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,060.00	288,297.000
	EQUITY RESIDENTIAL	17,800.00	982,382.000
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,030.00	368,019.600
	FIRST INDUSTRIAL RT	4,600.00	48,898.000
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	34,963.00	520,948.700
	GLIMCHER REALTY TRUST	800.00	7,344.000
	FELCOR LODGING TR INC	4,700.00	15,322.000
	HOME PROPERTIES INC	2,400.00	134,592.000
	HCP INC	22,200.00	912,420.000
	COMMONWEALTH REIT	4,325.00	80,272.000
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.00	110,606.000
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,300.00	100,551.000
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.00	45,040.000
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,400.00	202,188.000
	HEALTH CARE REIT INC	11,201.00	619,639.320
	EAST GROUP	2,300.00	102,511.000
	KIMCO REALTY	21,199.00	352,539.370
	KILROY REALTY CORP	2,500.00	97,500.000
	LTC PROPERTIES INC	3,500.00	111,195.000
	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	11,300.00	253,798.000
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,400.00	238,058.000
	BRANDYWINE REALTY TRUST	5,700.00	54,834.000
	THE MACERICH COMPANY	8,820.00	459,874.800
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,800.00	188,160.000
	ACADIA REALTY TRUST	4,585.00	90,691.300
	HOST HOTELS & RESORTS INC	41,168.00	638,104.000
	MID AMERICA	2,200.00	134,596.000
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,000.00	94,240.000
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	11,500.00	85,100.000
	PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	47,775.000
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600.00	63,224.000
	GETTY REALTY CORP	3,500.00	51,520.000
	POST PROPERTIES, INC	2,200.00	94,512.000
	PS BUSINESS PARKS	400.00	23,044.000
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	56,504.000
	REALTY INCOME CORP	8,100.00	286,011.000
	REGENCY	3,900.00	147,654.000
	UDR INC	13,779.00	338,963.400
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,800.00	81,054.000
	SAUL CENTERS INC	800.00	26,752.000
	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,484.00	2,228,860.320

	SOVRAN SELF STORAGE INC	2,700.00	120,177.000
	PUBLIC STORAGE	8,678.00	1,159,641.140
	SUN COMMUNITIES INC	1,200.00	43,392.000
	TAUBMAN CENTERS INC	3,100.00	195,176.000
	TANGER FACTORY OUTLET	4,700.00	136,300.000
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.00	35,109.000
	VENTAS INC	17,102.00	930,177.780
	VORNADO REALTY TRUST	10,429.00	818,780.790
	WASHINGTON REIT	4,000.00	111,320.000
	WEINGARTEN REALTY INVST	7,100.00	154,851.000
	CAPLEASE INC	7,000.00	30,030.000
	BIOMED REALTY TRUST INC	8,300.00	151,309.000
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,209.00	134,778.000
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,900.00	145,671.000
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.00	55,233.000
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,340.00	94,802.400
	CUBESMART	8,900.00	93,984.000
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,510.00	368,619.000
	INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.00	37,877.000
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	80,886.000
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,372.00	83,720.000
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,900.00	39,273.000
	DOUGLAS EMMETT INC	4,700.00	92,543.000
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,000.00	84,960.000
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	3,500.00	81,795.000
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,400.00	129,056.000
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,200.00	101,764.000
米ドル小計	銘柄数 : 93	678,705.00	21,217,991.370
	組入時価比率 : 64.85%		(1,631,451,356)
	合計時価比率 : 66.14%		
	BRITISH LAND CO PLC	45,200.00	212,801.600
	DERWENT LONDON PLC	5,800.00	90,480.000
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.00	26,290.000
	HAMMERSON PLC	46,200.00	169,600.200
	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,200.00	272,808.000
	WORKSPACE GROUP PLC	7,067.00	16,006.750
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	37,804.00	117,154.590
	SHAFTESBURY PLC	16,000.00	75,856.000
	SEGRO PLC	50,090.00	101,582.520
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	21,400.00	71,583.000
	LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	60,000.00	64,260.000
英ポンド小計	銘柄数 : 11	342,761.00	1,218,422.660
	組入時価比率 : 5.76%		(144,858,270)
	合計時価比率 : 5.87%		
	CALLOWAY REAL ESTATE INVNT TR	3,400.00	90,610.000
	CANADIAN APT PPTYS REIT	5,400.00	122,310.000
	MORGUARD REAL ESTATE INVNT TR	5,900.00	95,875.000
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	5,400.00	125,010.000
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	1,300.00	11,258.000
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.00	99,279.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	10,000.00	263,400.000

	COMINAR REAL ESTATE INVNT TR	1,200.00	26,820.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	4,900.00	102,018.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVNT TR	12,000.00	55,920.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800.00	149,772.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 11	55,000.00	1,142,272.000	
	組入時価比率 : 3.43%		(86,287,227)	
	合計時価比率 : 3.50%			
	BEFIMMO	1,104.00	54,338.880	
	COFINIMMO SA	1,090.00	96,574.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	1,934.00	72,254.240	
	GECINA SA	1,790.00	110,729.400	
	ICADE EMGP	1,520.00	85,393.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,230.00	717,556.000	
	KLEPIERRE	3,700.00	78,588.000	
	FONCIERE DES REGIONS	2,000.00	90,500.000	
	MERCIALYS	3,065.00	74,678.720	
	EUROCOMMERCIAL	3,000.00	70,920.000	
	VASTNED RETAIL	700.00	21,819.000	
	CORIO NV	5,800.00	185,948.000	
	WERELDHAVE NV	1,500.00	75,960.000	
	NIEUWE STEEN INVS	2,691.00	23,277.150	
ユーロ小計	銘柄数 : 14	35,124.00	1,758,536.990	
	組入時価比率 : 6.85%		(172,336,625)	
	合計時価比率 : 6.99%			
	LINK REIT/THE	135,000.00	3,807,000.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	133,000.00	458,850.000	
	CHAMPION REIT	250,000.00	732,500.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	218,000.00	848,020.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 4	736,000.00	5,846,370.000	
	組入時価比率 : 2.30%		(57,879,063)	
	合計時価比率 : 2.35%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	73,600.00	73,232.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.00	51,000.000	
	ARGOSY PROPERTY TRUST	88,000.00	69,080.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 3	211,600.00	193,312.000	
	組入時価比率 : 0.47%		(11,792,032)	
	合計時価比率 : 0.48%			
投資証券計			2,104,604,573	
			(2,104,604,573)	
合計			2,466,801,448	
			(2,466,801,448)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

#### 有価証券明細表注記

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 93銘柄	64.85%	66.14%
英ポンド	投資証券 11銘柄	5.76%	5.87%
カナダドル	投資証券 11銘柄	3.43%	3.50%
ユーロ	投資証券 14銘柄	6.85%	6.99%
香港ドル	投資証券 4銘柄	2.30%	2.35%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 6銘柄	2.83%	2.89%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 15銘柄	11.57%	11.80%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.47%	0.48%

(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24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	7,663,621,910円
負債総額	7,865,512円
純資産総額（ - ）	7,655,756,398円
発行済数量	11,252,545,835口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6804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24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	251,255,980,420円
負債総額	509,374,391円
純資産総額（ - ）	250,746,606,029円
発行済数量	248,775,954,917口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0079円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	264,112,842,942円
負債総額	274,758,124円
純資産総額（ - ）	263,838,084,818円
発行済数量	218,955,340,443口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2050円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	421,236,769,920円
負債総額	9,832,220,000円
純資産総額（ - ）	411,404,549,920円
発行済数量	360,346,413,515口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1417円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	368,067,609,272円
負債総額	2,937,215,371円
純資産総額（ - ）	365,130,393,901円
発行済数量	322,272,938,488口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1330円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
----	--------

資産総額	3,596,443,379円
負債総額	216,688,000円
純資産総額（ - ）	3,379,755,379円
発行済数量	4,819,417,173口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7013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24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,643,332,134円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	2,643,332,134円
発行済数量	3,490,106,128口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7574円

### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

#### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

#### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

#### (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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。

#### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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



(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額 20億円

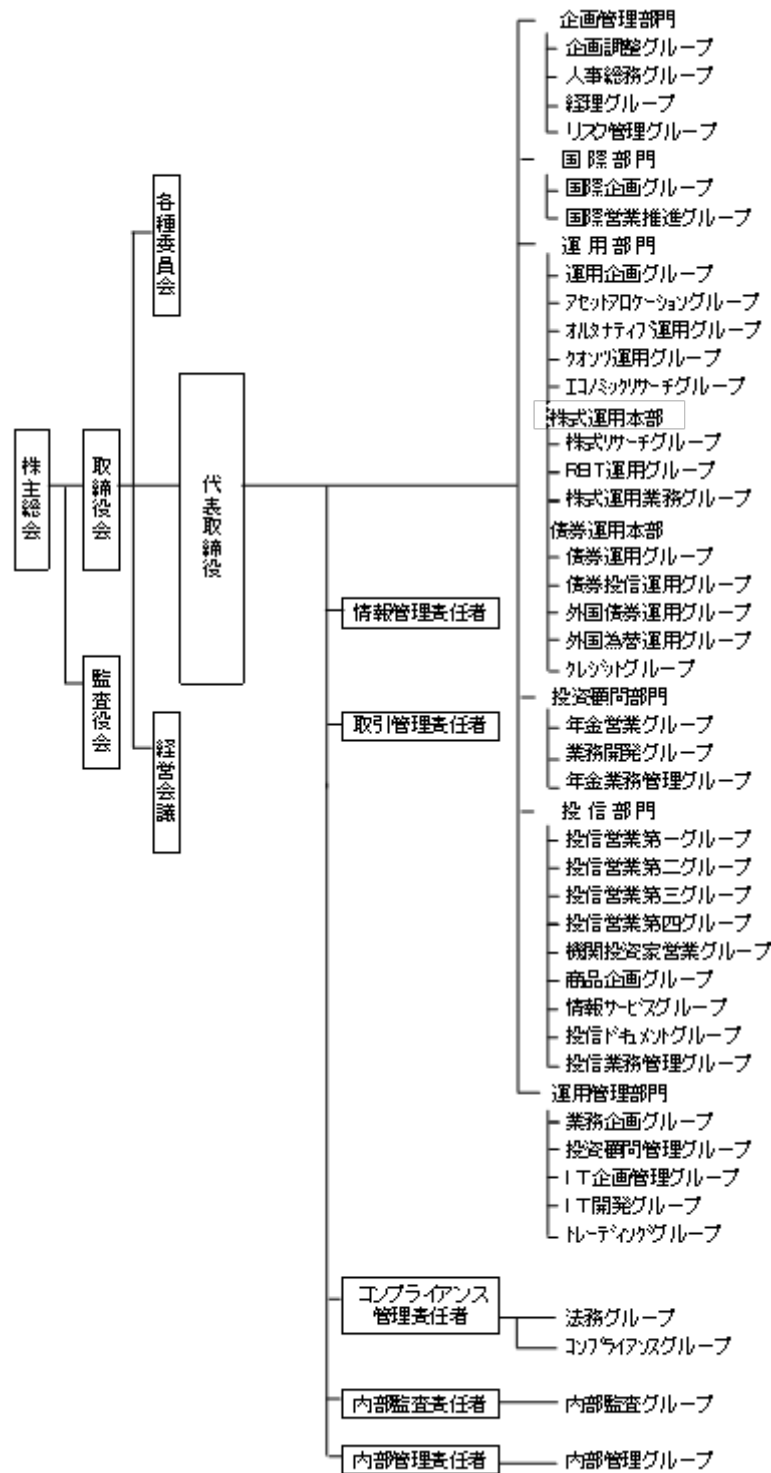
発行する株式総数 80,000株

発行済株式総数 24,000株

直近5カ年の資本金の変動

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24年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

#### 会社の意思決定機構

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

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

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

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席

し、出席取締役の過半数をもって行います。

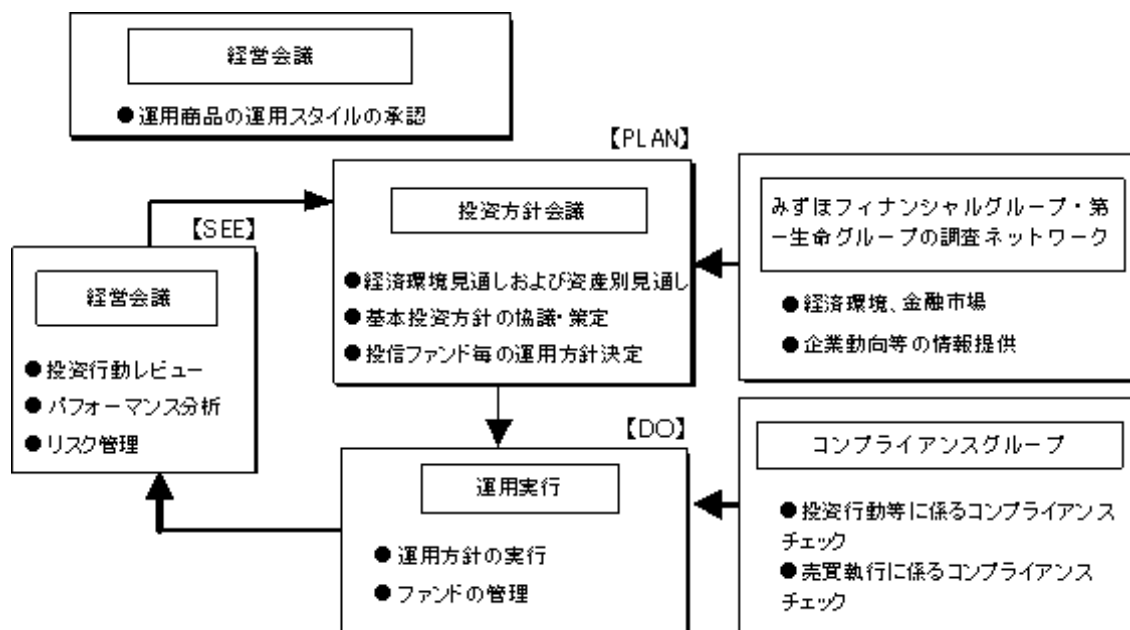
### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成24年1月31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24年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は277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	14	25,110,217,115
追加型株式投資信託	253	3,948,421,455,464
単位型公社債投資信託	9	71,107,233,679
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	390,669,044
合計	277	4,045,029,575,302

### 3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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



## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

[次へ](#)



## 重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p>
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>（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. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（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>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6. 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>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>（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. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 同左</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） 同左</p> <p>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6. 引当金の計上基準</p> <p>（1）同左</p> <p>（2）同左</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) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</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>7. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</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> <hr/> <p>(4) 同左</p> <p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>
--	--

## 追加情報

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

## （株主資本等変動計算書関係）

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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



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

(リース取引関係)

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)				第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	46,681千円	-	46,681千円
減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円	減価償却累計額 相当額	46,138千円	-	46,138千円
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円	未経過リース料 期末残高相当額	586千円	-	586千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		15,998千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		14,995千円	
支払利息相当額		845千円		支払利息相当額		234千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする 定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法につい ては、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,475千円	-	1,475千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## (4) 長期差入保証金

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

## (注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。  
デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。  
取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。  
金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。  
長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。  
金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額  
該当事項はありません。

(有価証券関係)

第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 4. その他有価証券

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

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

## 2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 3. 子会社株式及び関連会社株式

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



## 4. その他有価証券

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券  
該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

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

2. 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。3. その他の金銭の信託  
該当事項はありません。

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 運用目的の金銭の信託

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (2) 株式関連

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

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 第25期（平成22年3月31日現在）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## 第26期（平成23年3月31日現在）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日現在) (千円)	
(1) 退職給付債務		636,624
(2) 未認識数理計算上の差異		57,560
		579,063
退職給付引当金		579,063

## 3. 退職給付費用に関する事項

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) (千円)	
(1) 勤務費用		85,216
(2) 利息費用		7,954
(3) 数理計算上の差異の費用処理額		9,383
(4) 確定拠出年金 拠出額		37,218
		139,773
退職給付費用		139,773

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

## (セグメント情報等)

## 1. セグメント情報

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

## 2. 関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (追加情報)

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

( 関連当事者との取引 )

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その 他の 関係 会社	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 (基金償却 積立金)	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	711,279	未収投 資助言 報酬	190,025
								販売手数料 の支払	13,054		
								保険料の支 払	6,572		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

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

新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	785,924	未払 費用	296,169
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	244,629	未払 費用	98,673

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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



## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
信託報酬の 支払								130			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## 第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

## (1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ 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	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
信託報酬の 支払								3,163			

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## （1株当たり情報）

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

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

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

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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



## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

[前](#) [次](#)

## 重要な会計方針

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

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

## 追加情報

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

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

## (リース取引関係)

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1. ファイナンス・リース取引

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

リース資産の内容

該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料中間期末残高相当額

該当事項はありません。

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料 588千円

減価償却費相当額 543千円

支払利息相当額 1千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

## 2. オペレーティング・リース取引

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

1年以内	1年超	合計
670千円	-	670千円

## （金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## （1）現金・預金

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

## （2）金銭の信託

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

## （3）投資有価証券

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

## 負 債

## （1）未払法人税等

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## （有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

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

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

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

（金銭の信託関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

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



## （セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （持分法損益等）

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

## （1株当たり情報）

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

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

（重要な後発事象）

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

[前へ](#)

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更等  
平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。  
・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 受託会社
  - a. 名称  
みずほ信託銀行株式会社
  - b. 資本金の額  
平成23年3月末日現在 247,303百万円
  - c. 事業の内容  
日本において信託銀行業務を営んでいます。

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

(平成23年3月末日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	7,425	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

- (3) 投資顧問会社
  - a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

平成23年5月末日現在 5,425万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

(4) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM International Ltd

b. 資本金の額

平成23年12月末日現在 400万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する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】

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

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。  
（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：マ資産育成）

## 独立監査人の監査報告書

平成24年2月22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23年1月12日から平成24年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成24年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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23年6月10日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)



独立監査人の監査報告書

平成23年2月22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22年1月13日から平成23年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成23年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

---

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