

【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25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25年4月12日から平成26年4月14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、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。また、上記マザーファンドには運用管理費用(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%以下にしております*。

※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。

*2012年12月末時点

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。運用管理費用（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	日本			
	年4回	北米			日経225
債券 一般 公債 社債	年6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	あり ()	
その他債券 クレジット属性 ()	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、NOM URA - BP I総合、シティ グループ世界 国債インデッ クス、東証RE IT指数、S & P先進国RE IT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			

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(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、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での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、一般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。

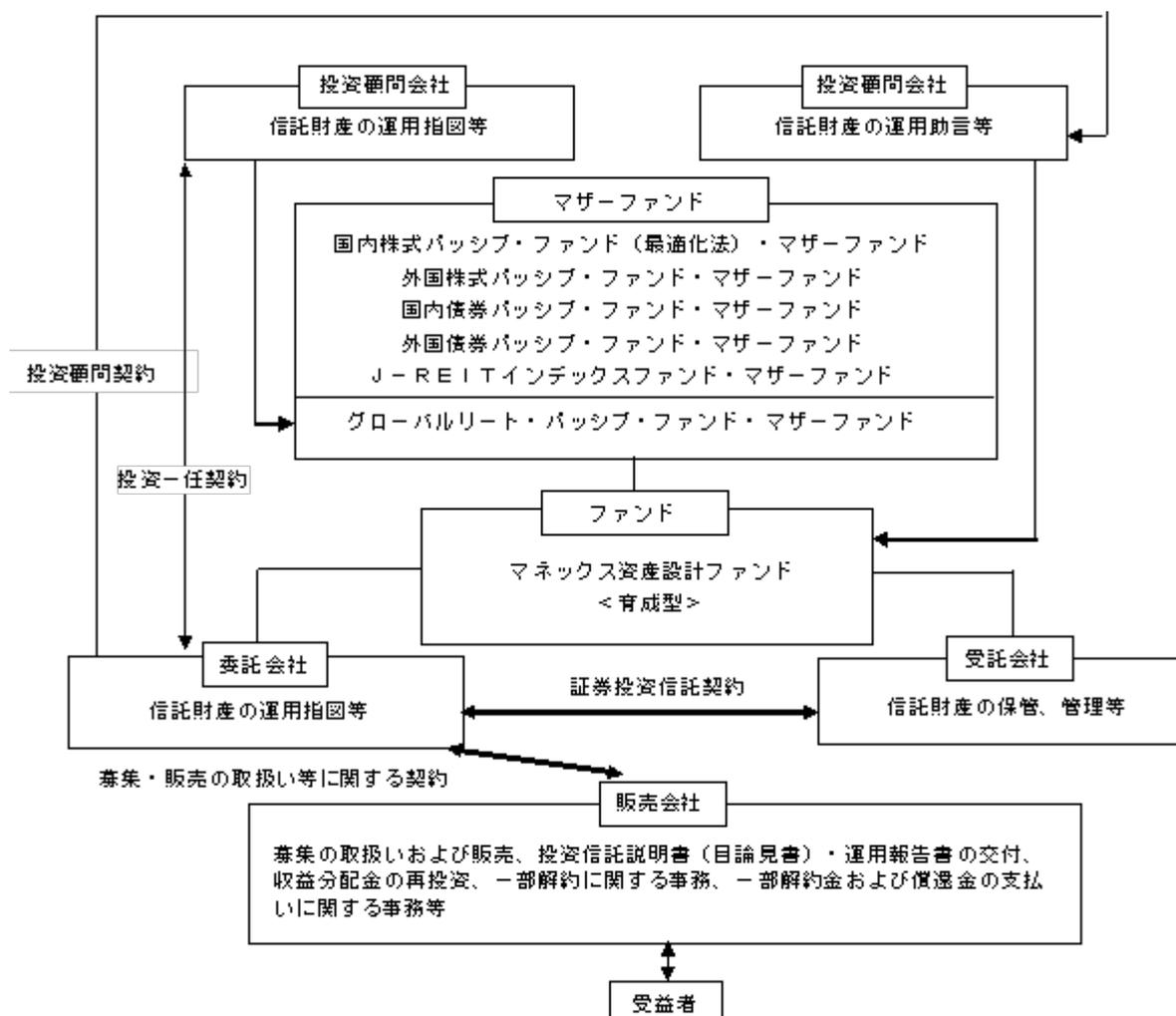
- ・投資信託協会への照会

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

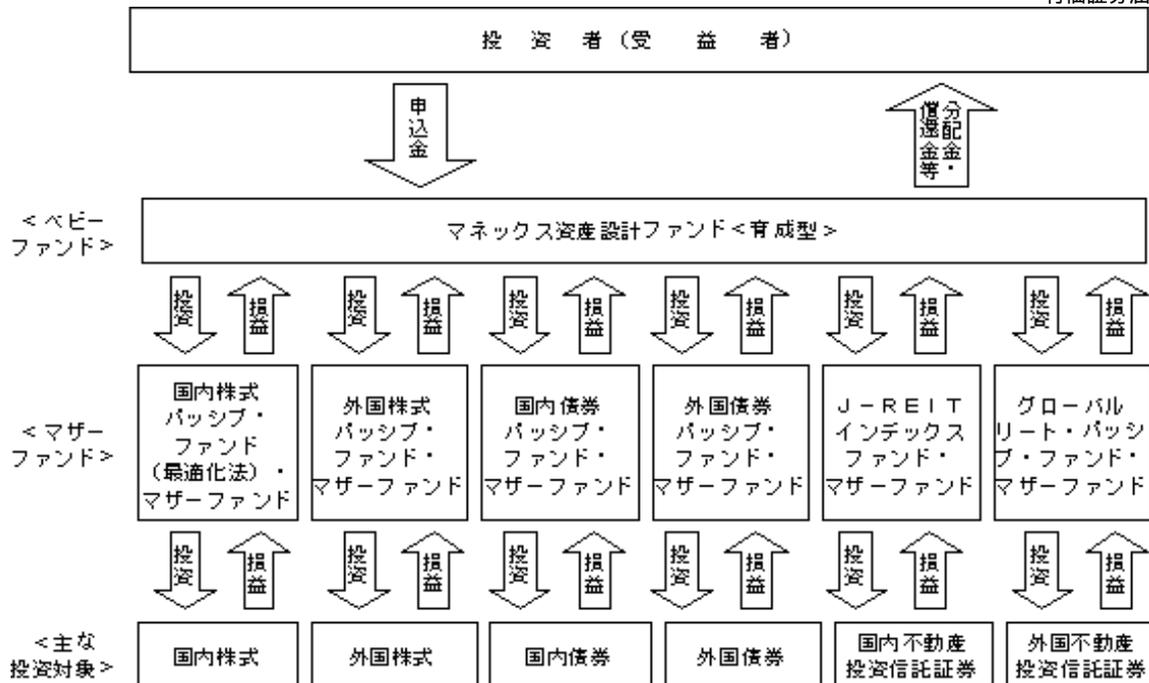
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

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25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25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。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券およびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<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、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・リート（REIT）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート（REIT）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（REIT）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（REIT）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産の種類（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券

(8) 国債証券

(9) 地方債証券

(10) 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

(16) コマーシャル・ペーパー

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

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

- (19)投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
 - (20)投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 - (21)外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - (22)オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - (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

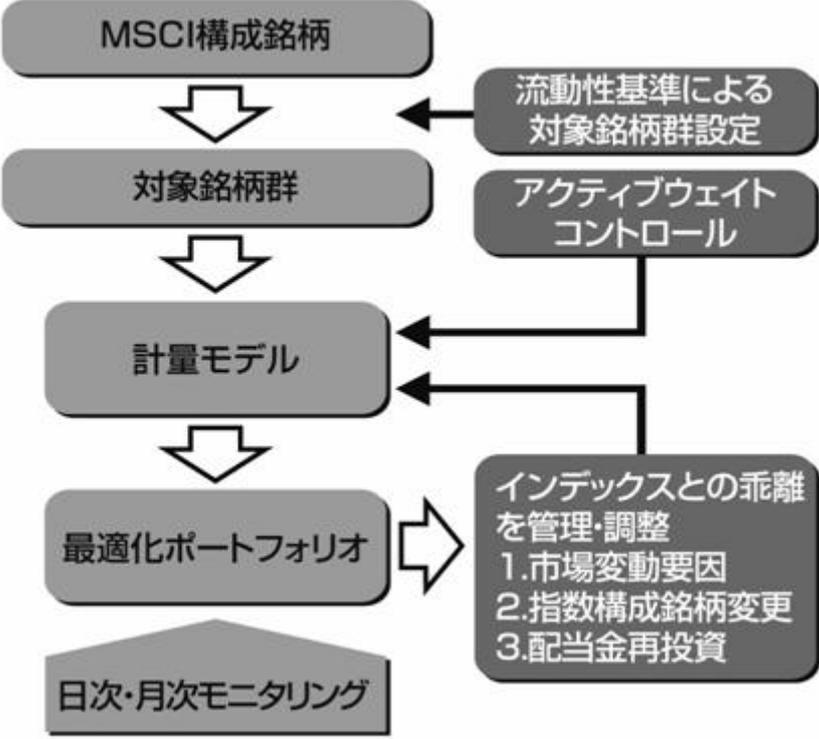
- ### 4.上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

（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"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。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。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
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。

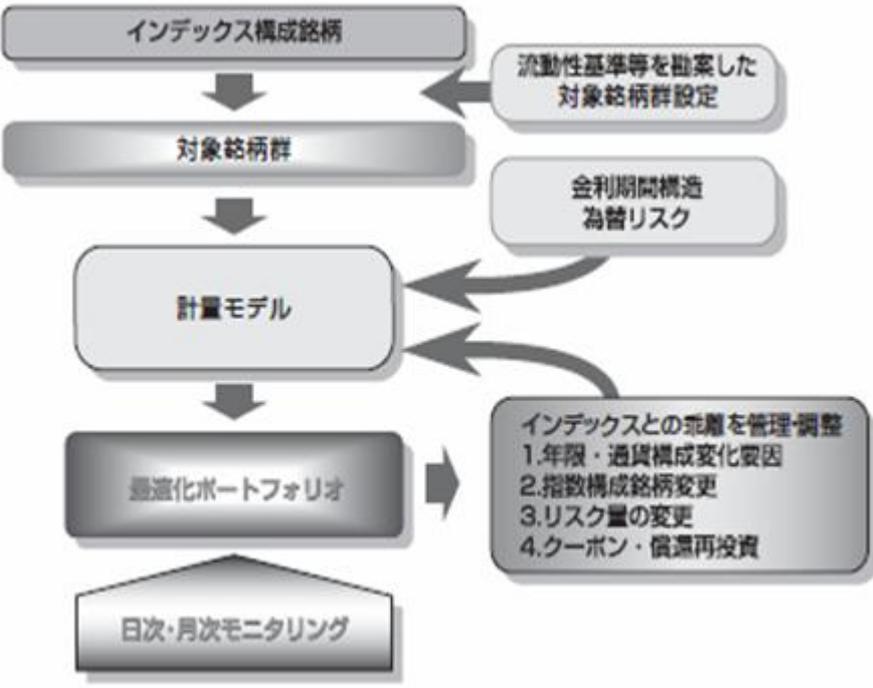
<p>投資態度</p>	<p>1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）（注）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 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。 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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>

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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <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> </div>
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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 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。 2. 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。 3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> 1)流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 <ol style="list-style-type: none"> 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。 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。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資

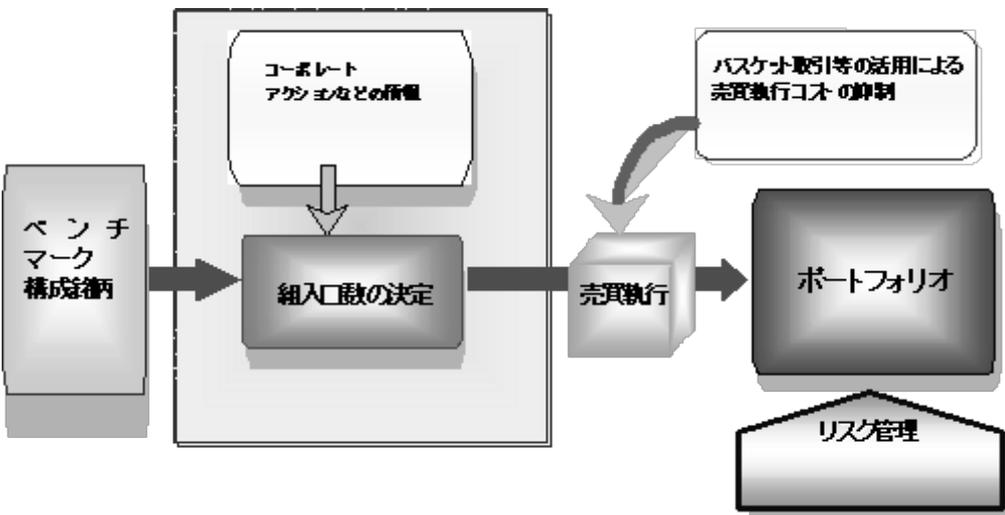
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）（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。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>2. 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>3. 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"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<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（一般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"> 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。 2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証 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。

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
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>

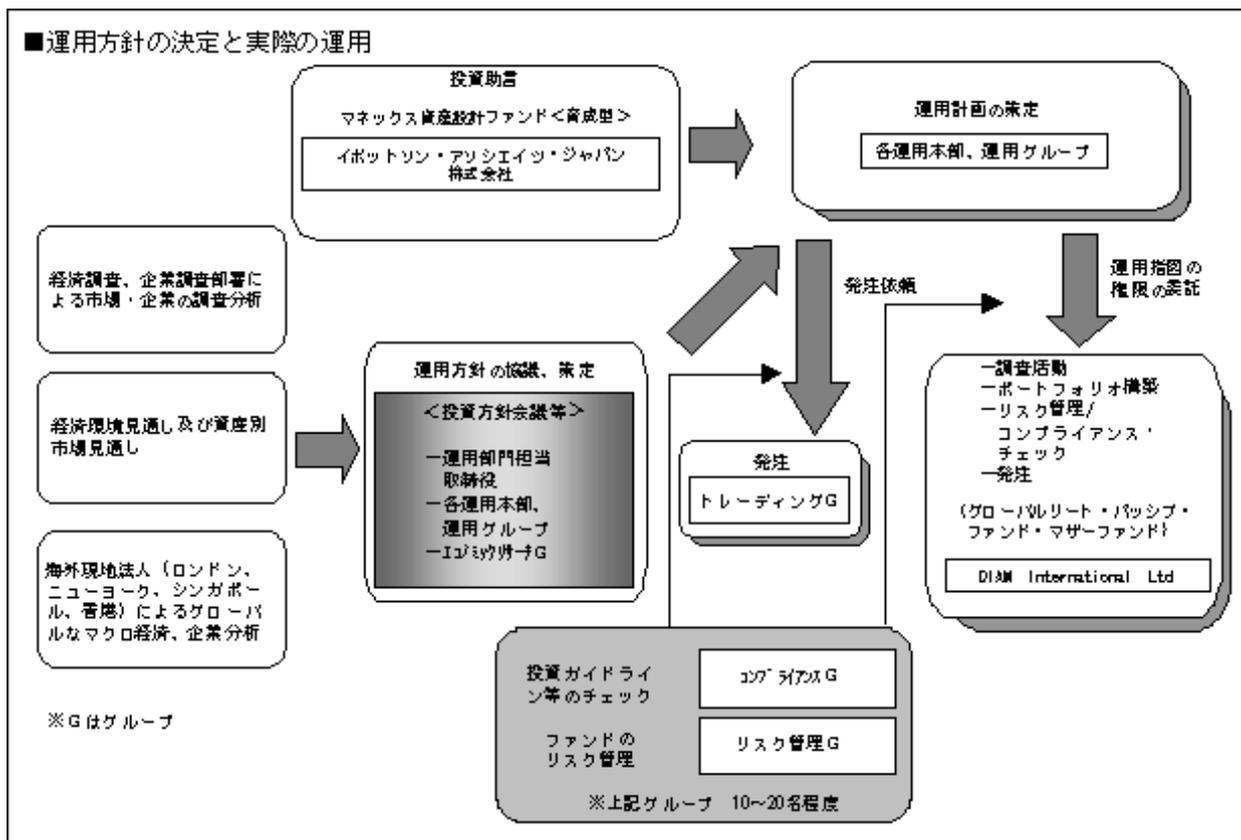
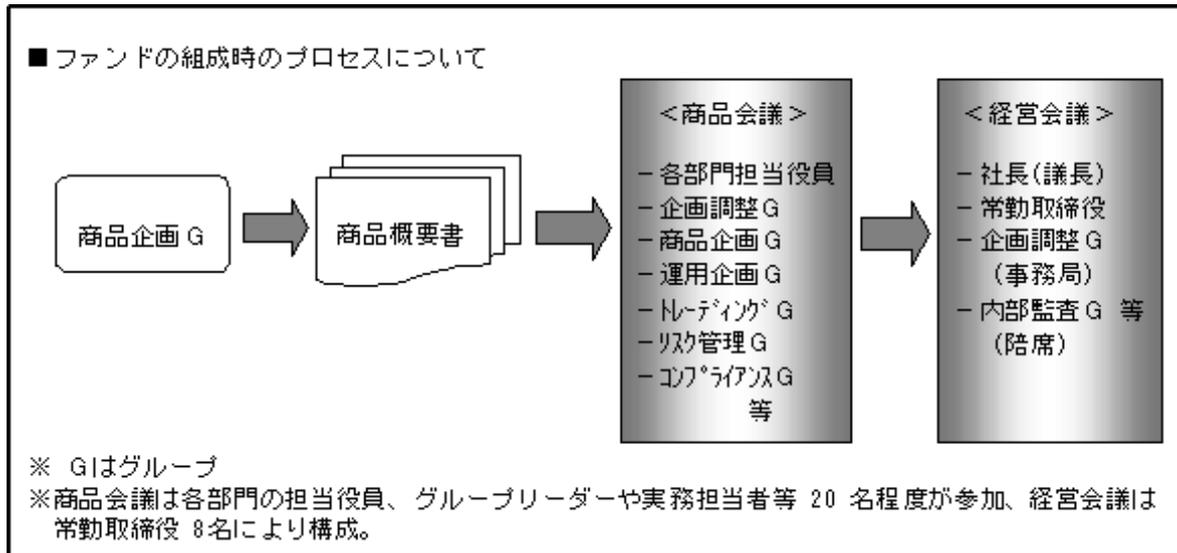
ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	----------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、S & 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 & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P先進国REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、DIAMアセットマネジメント株式会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P先進国REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスのDIAMアセットマネジメント株式会社に対するS&P先進国REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。</p> <p>S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P先進国REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P先進国REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P先進国REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</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>1. 日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</p> <p>3. 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>4. 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 & 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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの ・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	<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>株式への投資は行いません。</p> <p>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。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

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

事項を審議しています。

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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

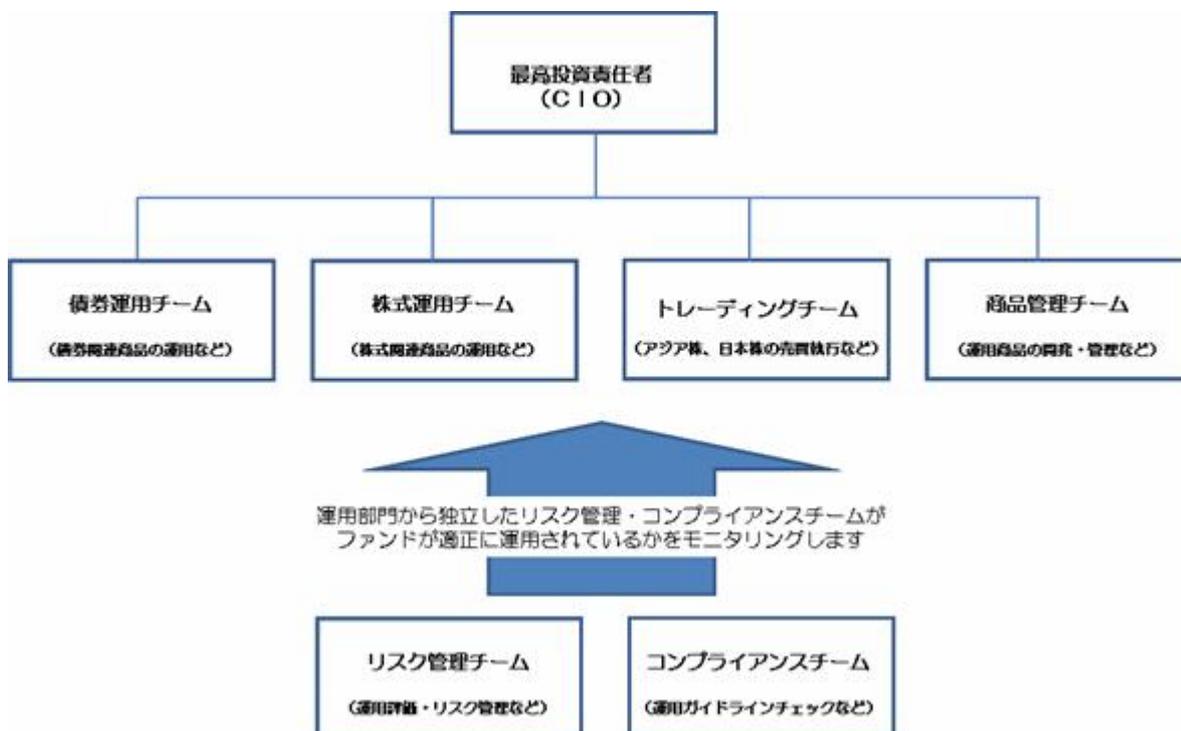
個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

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

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

2)グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは、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。

1.DIAM International Ltdにおける運用体制



2.DIAM International Ltdにおける運用プロセス

情報収集・分析

- ・投資対象国・地域のマクロ経済分析や対象資産に関する情報分析や市場分析を行います。その際、DIAM International Ltd内の他の運用チームの運用担当者とも随時議論を行います。

投資方針の決定

- ・CIOを含む全運用チームの運用担当者が出席する月次の投資方針会議で市場環境見通しやそれぞれの市場の分析結果を議論し、DIAM International Ltdとしての投資方針のすり合わせを行います。
- ・それぞれの運用チームごとに週次の運用戦略会議を開催し、新しい情報や投資アイデアについて議論をし、具体的な運用戦略を決定します。

ポートフォリオの構築

- ・月次の投資方針会議や週次の運用戦略会議での議論を踏まえ、運用担当者がポートフォリオを構築します。運用対象となる銘柄の執行については基本的にはそれぞれの運用担当者が自ら行います。
- ・運用担当者は使用するポートフォリオ・マネジメント・システムでポートフォリオのリスク量やその変化をリアルタイムで把握することができる体制となっています。

運用モニタリング

- ・運用ガイドラインチェックは運用部門からは独立したコンプライアンスチームによってシステムを用いて日次で行われています。
- ・同じく運用部門から独立したリスク管理チームが各ファンドのパフォーマンス評価や各種リスクのモニタリングを行っており、週次で開催されるモニタリング会議で報告されています。

上記運用体制は、平成25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。
- 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、）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ものとします。
 - 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、為替変動等により影響を受けますが、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、下記の変動要因により基準価額が下落し、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トの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

リートの価格変動リスク

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

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

リートが投資対象とする建物の用途規制等、不動産等に係る規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があります。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

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

<その他の留意点>

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

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

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

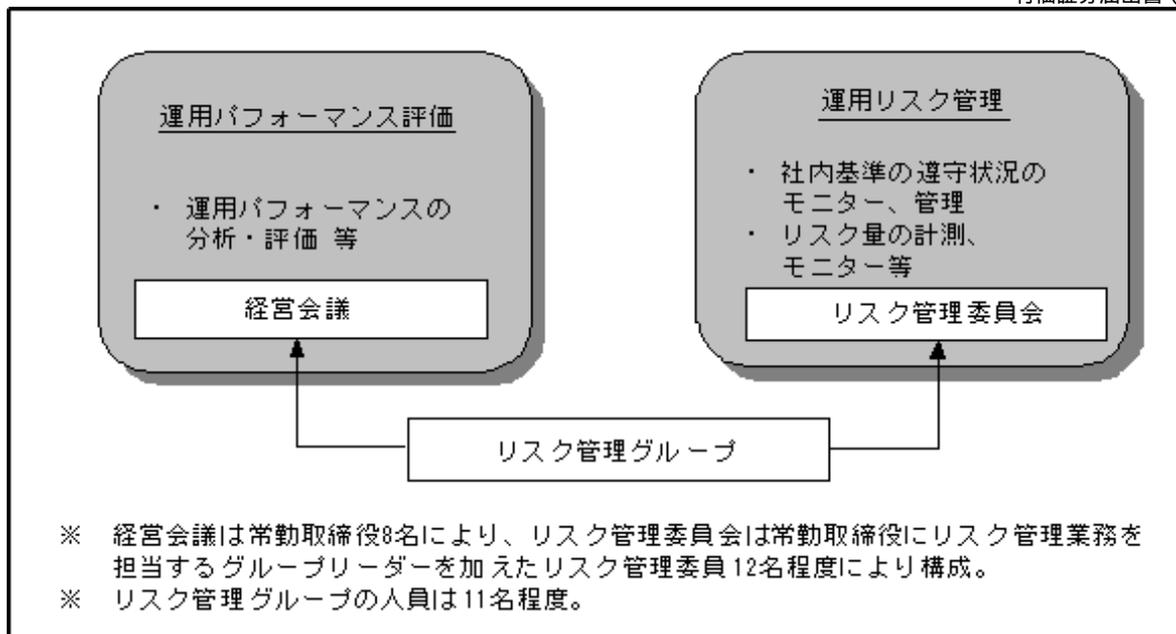
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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は、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、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および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、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。

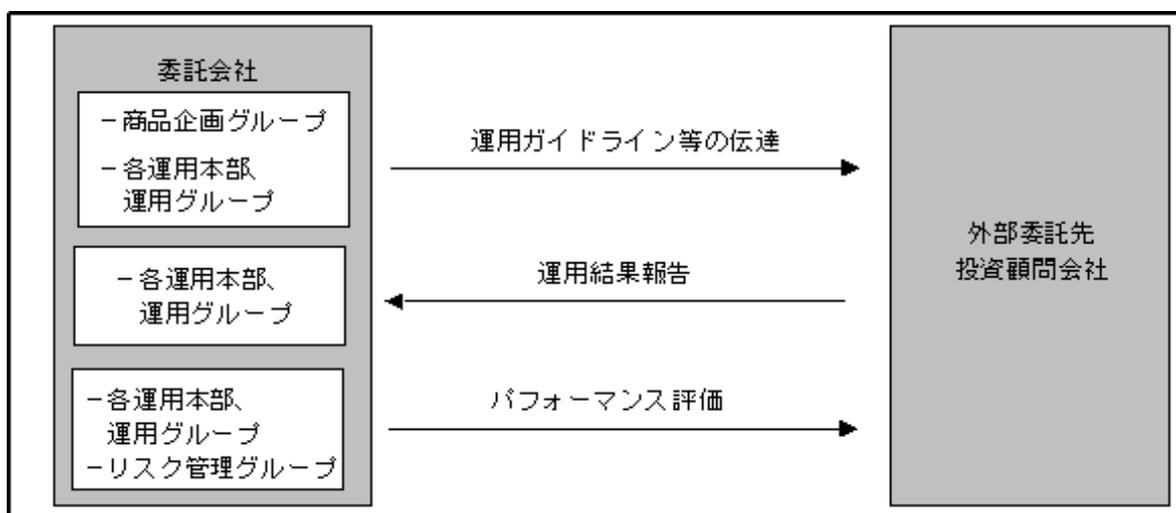
<運用評価・運用リスク管理体制>



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25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		
毎日	信託報酬	総額	信託財産の純資産総額に対して年率0.9975% (税抜0.95%)	
		配分	委託会社	年率0.441% (税抜0.42%) ~ 0.546% (税抜0.52%)
			販売会社	年率0.378% (税抜0.36%) ~ 0.483% (税抜0.46%)
			受託会社	年率0.0735% (税抜0.07%)

委託会社と販売会社の配分は、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、受益者の負担とし、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。

上場投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託（リート）の費用は表示しておりません。

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25年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）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10.147%の税率は平成26年1月1日以降、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25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、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）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、10.147%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10.147%の税率は平成26年1月1日以降、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25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、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））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7.147%の税率は平成26年1月1日以降、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25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25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	9,017,705,816	98.90
内 日本	9,017,705,816	98.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	99,974,846	1.10
純資産総額	9,117,680,662	100.00

（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25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	292,021,582,728	97.87
内 日本	292,021,582,728	97.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,363,613,427	2.13
純資産総額	298,385,196,155	100.00

その他資産の投資状況

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,690,625,000	1.91
内 日本	5,690,625,000	1.91

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	345,335,734,800	78.56
内 日本	345,335,734,800	78.56
地方債証券	29,622,332,853	6.74
内 日本	29,622,332,853	6.74
特殊債券	32,882,393,399	7.48
内 日本	32,882,393,399	7.48
社債券	29,338,506,240	6.67
内 日本	29,338,506,240	6.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,424,674,201	0.55
純資産総額	439,603,641,493	100.00

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	17,486,043,190	98.86
内 日本	17,486,043,190	98.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	201,046,469	1.14
純資産総額	17,687,089,659	100.00

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	300,825,347,107	95.72
内 アメリカ	171,668,278,442	54.63

内 ユーロ	41,579,441,262	13.23
内 イギリス	31,627,142,571	10.06
内 カナダ	15,845,862,129	5.04
内 スイス	12,819,071,418	4.08
内 オーストラリア	11,820,185,221	3.76
内 スウェーデン	4,659,042,569	1.48
内 香港	4,391,016,067	1.40
内 シンガポール	2,408,409,928	0.77
内 デンマーク	1,769,729,979	0.56
内 ノルウェー	1,340,829,136	0.43
内 イスラエル	741,916,088	0.24
内 ニュージーランド	154,422,297	0.05
投資信託受益証券	1,183,931,386	0.38
内 オーストラリア	1,057,183,655	0.34
内 シンガポール	126,747,731	0.04
投資証券	5,894,017,127	1.88
内 アメリカ	4,845,016,794	1.54
内 ユーロ	408,713,887	0.13
内 イギリス	368,240,089	0.12
内 香港	158,748,081	0.05
内 カナダ	113,298,276	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,359,977,025	2.02
純資産総額	314,263,272,645	100.00

その他資産の投資状況

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	651,584,000	0.21
内 日本	651,584,000	0.21
株価指数先物取引（買建）	5,847,942,667	1.86
内 アメリカ	3,372,970,639	1.07
内 ユーロ	1,195,364,898	0.38
内 イギリス	614,907,387	0.20
内 オーストラリア	357,892,830	0.11
内 カナダ	306,806,913	0.10

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	397,118,458,989	97.98
内 ユーロ	165,735,424,754	40.89
内 アメリカ	164,756,003,154	40.65
内 イギリス	30,092,026,319	7.42
内 カナダ	10,909,236,265	2.69
内 オーストラリア	6,016,745,927	1.48
内 メキシコ	3,886,948,913	0.96
内 デンマーク	3,186,559,276	0.79
内 ポーランド	3,028,405,344	0.75
内 スウェーデン	2,450,225,258	0.60
内 南アフリカ	2,238,231,710	0.55
内 マレーシア	2,092,321,669	0.52
内 シンガポール	1,733,611,447	0.43

	内 ノルウェー	992,718,953	0.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,186,467,426	2.02
純資産総額		405,304,926,415	100.00

その他資産の投資状況

平成25年1月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	45,761,600	0.01
内 日本	45,761,600	0.01

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25年1月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	460,024,049	15.24
内 オーストラリア	355,563,490	11.78
内 シンガポール	104,460,559	3.46
投資証券	2,502,655,461	82.90
内 アメリカ	1,933,716,504	64.05
内 ユーロ	217,302,679	7.20
内 イギリス	174,068,943	5.77
内 カナダ	92,616,917	3.07
内 香港	74,855,842	2.48
内 ニュージーランド	10,094,576	0.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	56,177,242	1.86
純資産総額	3,018,856,752	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で分けした地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価は、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で評価しています。

(注4) 先物取引の時価は、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で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,101,909,794	1.1599 2,438,012,291	1.1636 2,445,782,236	- -	26.82%
2	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,488,681,999	1.3927 2,073,290,133	1.4262 2,123,158,266	- -	23.29%
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,517,309,221	1.2279 1,863,115,466	1.2847 1,949,287,156	- -	21.38%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	802,050,366	1.6201 1,299,412,956	1.6918 1,356,908,809	- -	14.88%
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	593,384,643	0.9885 586,563,565	1.0732 636,820,398	- -	6.98%
6	グローバルリート・パッシ ブ・ファンド・マザーファ ンド 日本	親投資信託 受益証券	468,459,570	1.0408 487,577,628	1.0796 505,748,951	- -	5.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.90%
合計	98.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

(参考)マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,895,300	3,000.38 8,687,003,204	4,365.00 12,637,984,500	- -	4.24%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	16,842,800	377.48 6,357,822,690	521.00 8,775,098,800	- -	2.94%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,901,300	2,744.47 5,218,070,615	3,505.00 6,664,056,500	- -	2.23%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,682,100	2,528.10 4,252,533,074	3,670.00 6,173,307,000	- -	2.07%
5	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	28,661,900	121.11 3,471,432,465	183.00 5,245,127,700	- -	1.76%
6	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,399,900	3,362.57 4,707,264,930	3,365.00 4,710,663,500	- -	1.58%
7	武田薬品 日本	株式 医薬品	884,200	3,355.63 2,967,055,169	4,700.00 4,155,740,000	- -	1.39%
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	936,400	3,757.56 3,518,585,529	3,830.00 3,586,412,000	- -	1.20%
9	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,063,300	2,163.67 2,300,636,245	3,260.00 3,466,358,000	- -	1.16%
10	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,557,000	1,275.66 1,986,203,890	2,214.00 3,447,198,000	- -	1.16%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,735,600	1,741.22 3,022,064,630	1,928.00 3,346,236,800	- -	1.12%
12	ファナック 日本	株式 電気機器	234,600	13,001.45 3,050,141,286	14,250.00 3,343,050,000	- -	1.12%
13	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,119,600	2,055.80 2,301,673,856	2,847.00 3,187,501,200	- -	1.07%
14	日立 日本	株式 電気機器	5,314,000	434.17 2,307,225,607	542.00 2,880,188,000	- -	0.97%
15	小松製作所 日本	株式 機械	1,100,700	2,162.94 2,380,749,745	2,435.00 2,680,204,500	- -	0.90%
16	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,847,000	756.85 2,154,761,349	936.00 2,664,792,000	- -	0.89%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	1,920,000	1,301.10 2,498,128,002	1,381.00 2,651,520,000	- -	0.89%
18	セブン&アイ・HLDG S 日本	株式 小売業	930,400	2,193.96 2,041,263,296	2,782.00 2,588,372,800	- -	0.87%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	415,600	4,949.91 2,057,183,742	6,180.00 2,568,408,000	- -	0.86%
20	エヌ・ティ・ティ・ドコ モ 日本	株式 情報・通信業	18,328	136,264.94 2,497,463,936	138,900.00 2,545,759,200	- -	0.85%
21	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	9,974,000	190.00 1,895,132,953	253.00 2,523,422,000	- -	0.85%

22	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	524,000	3,234.96 1,695,120,558	4,655.00 2,439,220,000	- -	0.82%
23	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	4,547,100	308.06 1,400,812,880	526.00 2,391,774,600	- -	0.80%
24	信越化学 日本	株式 化学	423,300	4,160.63 1,761,195,112	5,590.00 2,366,247,000	- -	0.79%
25	東京海上HD 日本	株式 保険業	861,500	2,000.46 1,723,403,230	2,703.00 2,328,634,500	- -	0.78%
26	三井不動産 日本	株式 不動産業	1,049,000	1,322.61 1,387,427,890	2,089.00 2,191,361,000	- -	0.73%
27	KDDI 日本	株式 情報・通信業	313,800	4,834.72 1,517,135,650	6,800.00 2,133,840,000	- -	0.72%
28	ソニー 日本	株式 電気機器	1,416,200	1,461.58 2,069,900,688	1,362.00 1,928,864,400	- -	0.65%
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	556,700	2,433.80 1,354,897,520	3,420.00 1,903,914,000	- -	0.64%
30	三菱重工業 日本	株式 機械	3,777,000	360.06 1,359,956,940	489.00 1,846,953,000	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
株式	97.87%
合計	97.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成25年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.58%
輸送用機器		11.21%
銀行業		10.48%
情報・通信業		5.82%
化学		5.55%
卸売業		5.17%
機械		5.11%
医薬品		5.02%
小売業		4.03%
陸運業		3.93%
食料品		3.75%
不動産業		3.12%
建設業		2.50%
保険業		2.45%
電気・ガス業		2.18%
サービス業		2.03%
鉄鋼		1.77%
証券、商品先物取引業		1.51%
精密機器		1.37%
その他製品		1.28%
非鉄金属		1.06%
その他金融業		0.95%

ガラス・土石製品	0.92%
ゴム製品	0.81%
繊維製品	0.78%
石油・石炭製品	0.75%
金属製品	0.69%
鉱業	0.62%
空運業	0.51%
海運業	0.33%
パルプ・紙	0.27%
倉庫・運輸関連業	0.24%
水産・農林業	0.08%
合計	97.87%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

平成25年1月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX 先物 2503月	買建	607	5,436,825,527	5,690,625,000	1.91%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、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で評価しています。

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25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	3 2 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	6,300,000,000	101.77 6,412,020,000	102.96 6,487,047,000	1.000000 2022/3/20	1.48%
2	8 1 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,700,000,000	101.41 5,780,610,000	100.82 5,746,911,000	0.800000 2014/3/20	1.31%
3	3 2 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.48 5,526,505,000	100.67 5,537,070,000	0.800000 2022/9/20	1.26%
4	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.01 5,500,730,000	100.32 5,517,930,000	0.200000 2017/6/20	1.26%
5	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.11 5,506,075,000	100.29 5,516,390,000	0.200000 2017/9/20	1.25%
6	9 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,300,000,000	101.11 5,359,221,000	101.24 5,366,091,000	0.500000 2015/12/20	1.22%
7	3 1 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	103.75 4,980,045,000	106.03 5,089,728,000	1.300000 2021/3/20	1.16%
8	2 9 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	106.57 4,795,830,000	107.29 4,828,050,000	1.500000 2018/9/20	1.10%
9	3 1 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.06 4,592,869,000	103.93 4,677,255,000	1.000000 2020/9/20	1.06%
10	3 0 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	105.69 4,545,000,000	106.99 4,600,871,000	1.400000 2020/3/20	1.05%
11	2 9 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	108.36 4,551,194,000	108.70 4,565,694,000	1.800000 2018/6/20	1.04%
12	1 0 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,435,000	100.75 4,534,110,000	0.300000 2017/3/20	1.03%
13	2 8 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	107.55 4,409,618,000	107.30 4,399,587,000	1.800000 2017/6/20	1.00%
14	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	105.02 4,306,178,000	106.34 4,359,981,000	1.300000 2019/12/20	0.99%
15	2 9 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	105.20 4,313,543,000	106.32 4,359,489,000	1.300000 2019/3/20	0.99%
16	8 9 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.67 4,328,975,000	100.79 4,334,099,000	0.400000 2015/6/20	0.99%
17	2 8 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.82 4,272,910,000	106.52 4,260,880,000	1.700000 2017/3/20	0.97%
18	2 8 9 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	106.27 4,144,701,000	106.58 4,156,737,000	1.500000 2017/12/20	0.95%

19	97回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.67 4,027,115,000	101.05 4,042,360,000	0.400000 2016/6/20	0.92%
20	92回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.29 4,011,980,000	100.61 4,024,600,000	0.300000 2015/9/20	0.92%
21	312回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,700,000,000	103.13 3,815,822,000	105.34 3,897,654,000	1.200000 2020/12/20	0.89%
22	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	106.58 3,837,026,000	107.63 3,874,968,000	1.500000 2019/6/20	0.88%
23	288回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	107.19 3,858,984,000	107.21 3,859,812,000	1.700000 2017/9/20	0.88%
24	87回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.94 3,835,948,000	100.81 3,830,932,000	0.500000 2014/12/20	0.87%
25	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	106.10 3,713,665,000	106.84 3,739,470,000	1.400000 2018/12/20	0.85%
26	315回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.62 3,591,820,000	105.16 3,680,600,000	1.200000 2021/6/20	0.84%
27	282回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	106.33 3,615,458,000	105.83 3,598,390,000	1.700000 2016/9/20	0.82%
28	324回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.16 3,505,655,000	100.96 3,533,880,000	0.800000 2022/6/20	0.80%
29	88回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,265,000	100.92 3,532,235,000	0.500000 2015/3/20	0.80%
30	102回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.22 3,507,840,000	100.75 3,526,320,000	0.300000 2016/12/20	0.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	78.56%
地方債証券	6.74%
特殊債券	7.48%
社債券	6.67%
合計	99.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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 - R E I T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25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	2,343	815,220.50 1,910,061,639	943,000.00 2,209,449,000	- -	12.49%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,026	772,037.08 1,564,147,141	924,000.00 1,872,024,000	- -	10.58%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	7,092	139,504.35 989,364,870	173,200.00 1,228,334,400	- -	6.94%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,174	91,287.83 654,898,912	111,700.00 801,335,800	- -	4.53%
5	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,814	232,338.71 653,801,133	260,000.00 731,640,000	- -	4.14%
6	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,752	161,236.98 604,961,181	190,100.00 713,255,200	- -	4.03%
7	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	776	689,843.66 535,318,681	847,000.00 657,272,000	- -	3.72%
8	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	825	688,391.19 567,922,733	774,000.00 638,550,000	- -	3.61%
9	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	1,041	472,896.66 492,285,428	539,000.00 561,099,000	- -	3.17%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	6,268	78,500.00 492,038,000	81,500.00 510,842,000	- -	2.89%
11	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	970	385,808.54 374,234,290	518,000.00 502,460,000	- -	2.84%
12	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,350	245,566.73 331,515,093	351,500.00 474,525,000	- -	2.68%
13	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	664	550,239.18 365,358,821	699,000.00 464,136,000	- -	2.62%
14	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	700	504,146.36 352,902,454	655,000.00 458,500,000	- -	2.59%
15	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	548	597,192.22 327,261,337	765,000.00 419,220,000	- -	2.37%
16	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	756	444,130.73 335,762,834	543,000.00 410,508,000	- -	2.32%
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	505	712,392.88 359,758,407	811,000.00 409,555,000	- -	2.32%
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	480	578,207.10 277,539,410	825,000.00 396,000,000	- -	2.24%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	790	378,041.09 298,652,465	485,000.00 383,150,000	- -	2.17%
20	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券	977	273,750.50 267,454,239	357,500.00 349,277,500	- -	1.97%
21	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,539	45,800.10 207,886,667	67,400.00 305,928,600	- -	1.73%

22	福岡リート投資法人 日本	投資証券	420	585,232.19 245,797,520	720,000.00 302,400,000	- -	1.71%
23	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	578	414,968.25 239,851,651	518,000.00 299,404,000	- -	1.69%
24	野村不動産レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	515	441,396.89 227,319,399	516,000.00 265,740,000	- -	1.50%
25	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	418	575,489.21 240,554,490	630,000.00 263,340,000	- -	1.49%
26	プレミア投資法人 日本	投資証券	671	298,755.70 200,465,078	391,500.00 262,696,500	- -	1.49%
27	トップリート投資法人 日本	投資証券	529	391,576.05 207,143,733	430,000.00 227,470,000	- -	1.29%
28	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	7,201	22,118.62 159,276,241	29,790.00 214,517,790	- -	1.21%
29	積水ハウス・S I 投資法人 日本	投資証券	468	356,567.10 166,873,406	441,500.00 206,622,000	- -	1.17%
30	グローバル・ワン不動産投資法人 日本	投資証券	330	493,568.27 162,877,531	568,000.00 187,440,000	- -	1.06%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.86%
合計	98.86%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	128,065	46,667.50 5,976,473,994	41,635.48 5,332,048,540	- -	1.70%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	631,192	7,706.80 4,864,472,531	8,263.66 5,215,958,481	- -	1.66%
3	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,443,231	1,727.79 2,493,611,315	2,026.04 2,924,046,910	- -	0.93%
4	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	268,118	9,688.39 2,597,633,249	10,613.25 2,845,604,167	- -	0.91%
5	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	441,539	5,432.64 2,398,723,860	6,395.11 2,823,691,357	- -	0.90%
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	148,082	17,537.81 2,597,034,772	18,548.81 2,746,745,297	- -	0.87%
7	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	2,509,071	805.28 2,020,506,662	1,042.48 2,615,673,322	- -	0.83%
8	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,028,438	2,754.71 2,833,055,515	2,538.24 2,610,431,725	- -	0.83%
9	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	377,062	5,871.59 2,213,956,971	6,842.79 2,580,156,535	- -	0.82%
10	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	1,021,781	1,947.84 1,990,271,930	2,507.26 2,561,872,060	- -	0.82%
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	376,959	5,880.50 2,216,708,907	6,752.56 2,545,439,245	- -	0.81%
12	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	786,809	2,752.53 2,165,716,329	3,142.50 2,472,552,947	- -	0.79%
13	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	35,707	55,505.35 1,981,929,881	68,704.06 2,453,216,091	- -	0.78%
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	519,460	3,438.71 1,786,275,418	4,295.42 2,231,303,132	- -	0.71%
15	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	686,067	2,779.11 1,906,661,881	3,187.16 2,186,609,278	- -	0.70%
16	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	314,991	5,179.41 1,631,469,593	6,219.97 1,959,235,200	- -	0.62%
17	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	96,249	16,191.34 1,558,400,585	19,875.88 1,913,034,344	- -	0.61%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	553,956	3,151.12 1,745,584,412	3,417.75 1,893,283,119	- -	0.60%
19	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	230,221	7,453.37 1,715,922,737	7,988.42 1,839,102,271	- -	0.59%
20	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,600,576	707.40 1,839,667,473	685.15 1,781,793,045	- -	0.57%
21	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	531,610	2,566.97 1,364,630,708	3,224.53 1,714,194,094	- -	0.55%

22	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	512,238	3,346.27 1,714,091,455	3,319.22 1,700,234,891	- -	0.54%
23	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	6,700,644	250.35 1,677,558,875	249.78 1,673,740,128	- -	0.53%
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	416,185	3,480.41 1,448,496,021	3,964.58 1,650,002,889	- -	0.53%
25	WAL-MART STORES INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	254,832	5,678.45 1,447,051,477	6,357.01 1,619,970,846	- -	0.52%
26	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 金属・鉱業	438,171	3,417.49 1,497,448,404	3,574.65 1,566,309,016	- -	0.50%
27	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	388,315	3,478.43 1,350,728,494	3,974.61 1,543,402,779	- -	0.49%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	399,620	2,899.73 1,158,793,088	3,823.32 1,527,876,337	- -	0.49%
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,470,445	722.12 1,061,851,351	1,037.17 1,525,106,146	- -	0.49%
30	SANOFI ユーロ	株式 医薬品	162,683	6,979.96 1,135,520,859	8,992.26 1,462,888,321	- -	0.47%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
株式	95.72%
投資信託受益証券	0.38%
投資証券	1.88%
合計	97.98%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成25年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	9.51%
商業銀行		7.86%
医薬品		6.56%
保険		4.27%
金属・鉱業		3.10%
化学		2.95%
各種電気通信サービス		2.81%
食品		2.77%
メディア		2.73%
各種金融サービス		2.42%
飲料		2.36%
ソフトウェア		2.35%
コンピュータ・周辺機器		2.32%
食品・生活必需品小売り		2.27%
情報技術サービス		2.22%
コングロマリット		2.06%
資本市場		2.05%
機械		1.81%
航空宇宙・防衛		1.71%

電力	1.64%
ホテル・レストラン・レジャー	1.63%
家庭用品	1.60%
専門小売り	1.59%
タバコ	1.57%
エネルギー設備・サービス	1.54%
ヘルスケア機器・用品	1.50%
インターネットソフトウェア・サービス	1.44%
半導体・半導体製造装置	1.39%
総合公益事業	1.34%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.29%
通信機器	1.24%
バイオテクノロジー	1.16%
繊維・アパレル・贅沢品	1.08%
自動車	0.98%
電気設備	0.86%
陸運・鉄道	0.86%
無線通信サービス	0.85%
不動産管理・開発	0.69%
インターネット販売・カタログ販売	0.63%
複合小売り	0.60%
航空貨物・物流サービス	0.53%
商業サービス・用品	0.50%
消費者金融	0.48%
自動車部品	0.44%
専門サービス	0.43%
建設・土木	0.36%
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	0.30%
パーソナル用品	0.29%
商社・流通業	0.26%
家庭用耐久財	0.25%
ガス	0.20%
建設関連製品	0.19%
運送インフラ	0.18%
容器・包装	0.17%
紙製品・林産品	0.14%
販売	0.11%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
旅客航空輸送業	0.10%
海運業	0.09%
水道	0.08%
レジャー用品	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
ヘルスケア・テクノロジー	0.05%
事務用電子機器	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

平成25年1月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約 取引	日本	アメリカ・ドル売/円買2013年02月	売建	4,200,000	382,100,900	382,746,000	0.12%
		ユーロ売/円買2013年02月	売建	1,300,000	159,971,820	160,784,000	0.05%
		イギリス・ポンド売/円買2013年02月	売建	300,000	43,188,750	43,188,000	0.01%
		カナダ・ドル売/円買2013年02月	売建	400,000	36,326,900	36,366,000	0.01%
		オーストラリア・ドル売/円買2013年02月	売建	300,000	28,499,800	28,500,000	0.01%
株価指数 先物取引	アメリカ	S & P 5 0 0 F U T U R E M a r 1 3	買建	99	3,314,137,491	3,372,970,639	1.07%
	ユーロ	D J E U R O S T O X X 5 0 M a r 1 3	買建	354	1,176,218,922	1,195,364,898	0.38%
	イギリス	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E M a r 1 3	買建	68	591,346,697	614,907,387	0.20%
	オーストラリア	S P I 2 0 0 F U T U R E S M a r 1 3	買建	31	344,233,705	357,892,830	0.11%
	カナダ	S & P / T S E 6 0 I X F U T M a r 1 3	買建	23	300,938,290	306,806,913	0.10%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、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で評価しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、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で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 4.75 05/15/14 アメリカ	国債証券	3,645,600,000	109.63 3,996,718,194	105.84 3,858,758,232	4.750000 2014/5/15	0.95%
2	US T N/B 1.75 03/31/14 アメリカ	国債証券	3,645,600,000	102.82 3,748,485,243	101.81 3,711,804,096	1.750000 2014/3/31	0.92%
3	US T N/B 0.25 09/15/14 アメリカ	国債証券	3,645,600,000	99.82 3,639,238,428	100.05 3,647,714,448	0.250000 2014/9/15	0.90%
4	US T N/B 4.25 11/15/14 アメリカ	国債証券	3,326,610,000	109.97 3,658,546,868	107.10 3,563,098,704	4.250000 2014/11/15	0.88%
5	US T N/B 2.375 09/30/14 アメリカ	国債証券	3,189,900,000	104.92 3,346,843,080	103.54 3,302,886,258	2.375000 2014/9/30	0.81%
6	US T N/B 4.0 02/15/14 アメリカ	国債証券	2,870,910,000	107.33 3,081,491,248	103.96 2,984,827,708	4.000000 2014/2/15	0.74%
7	US T N/B 2.5 03/31/15 アメリカ	国債証券	2,734,200,000	106.02 2,898,917,322	104.77 2,864,812,734	2.500000 2015/3/31	0.71%
8	US T N/B 2.125 11/30/14 アメリカ	国債証券	2,734,200,000	104.51 2,857,713,315	103.41 2,827,436,220	2.125000 2014/11/30	0.70%
9	US T N/B 2.625 06/30/14 アメリカ	国債証券	2,734,200,000	105.33 2,880,178,938	103.39 2,826,889,380	2.625000 2014/6/30	0.70%
10	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	2,734,200,000	102.61 2,805,767,685	102.29 2,796,867,864	1.250000 2015/8/31	0.69%
11	US T N/B 4.25 08/15/14 アメリカ	国債証券	2,551,920,000	109.65 2,798,333,395	106.19 2,709,909,367	4.250000 2014/8/15	0.67%
12	FRANCE OAT 4.0 10/25/14 ユーロ	国債証券	2,473,800,000	107.75 2,665,532,611	106.18 2,626,680,840	4.000000 2014/10/25	0.65%
13	FRANCE OAT 3.5 04/25/15 ユーロ	国債証券	2,350,110,000	107.44 2,525,063,567	106.68 2,507,097,348	3.500000 2015/4/25	0.62%
14	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,278,500,000	110.75 2,523,598,245	109.25 2,489,420,745	3.250000 2016/6/30	0.61%
15	US T N/B 2.625 12/31/14 アメリカ	国債証券	2,278,500,000	106.08 2,417,122,117	104.50 2,381,191,995	2.625000 2014/12/31	0.59%
16	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 ユーロ	国債証券	2,226,420,000	105.72 2,353,919,652	106.55 2,372,406,359	3.000000 2015/10/25	0.59%
17	US T N/B 2.25 01/31/15 アメリカ	国債証券	2,278,500,000	105.22 2,397,597,195	103.93 2,368,113,405	2.250000 2015/1/31	0.58%

18	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 ユーロ	国債証券	2,102,730,000	110.04 2,314,044,717	111.47 2,344,018,267	3.750000 2017/4/25	0.58%
19	US T N/B 4.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	2,005,080,000	118.22 2,370,604,261	115.74 2,320,719,693	4.625000 2017/2/15	0.57%
20	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14 ユーロ	国債証券	2,102,730,000	109.26 2,297,547,934	105.67 2,221,996,845	4.250000 2014/7/4	0.55%
21	US T N/B 2.375 02/28/15 アメリカ	国債証券	2,096,220,000	105.79 2,217,716,911	104.31 2,186,692,855	2.375000 2015/2/28	0.54%
22	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	2,096,220,000	102.52 2,149,071,174	102.35 2,145,585,981	1.250000 2015/9/30	0.53%
23	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 ユーロ	国債証券	1,979,040,000	98.40 1,947,438,936	104.81 2,074,231,824	4.000000 2017/2/1	0.51%
24	ITALY BTPS 4.25 08/01/14 ユーロ	国債証券	1,979,040,000	102.24 2,023,370,496	103.99 2,058,181,809	4.250000 2014/8/1	0.51%
25	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	1,822,800,000	111.42 2,030,981,988	110.10 2,006,921,028	3.250000 2016/12/31	0.50%
26	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 ユーロ	国債証券	1,855,350,000	106.56 1,977,060,960	108.12 2,006,060,080	3.250000 2016/4/25	0.49%
27	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	1,822,800,000	110.38 2,012,043,096	109.35 1,993,395,852	3.000000 2017/2/28	0.49%
28	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	1,822,800,000	110.01 2,005,353,420	108.79 1,983,133,488	3.000000 2016/9/30	0.49%
29	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	1,822,800,000	110.58 2,015,743,380	107.55 1,960,421,400	4.000000 2015/2/15	0.48%
30	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17 ユーロ	国債証券	1,731,660,000	114.07 1,975,447,795	112.32 1,945,087,095	3.750000 2017/1/4	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.98%
合計	97.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

平成25年1月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ売/円買 2013年02月	売建	370,000	45,329,070	45,761,600	0.01%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価は、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で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年1月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	13,724	14,102.09 193,537,113	14,708.17 201,854,968	- -	6.69%
2	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資信託受 益証券	92,058	1,007.21 92,721,922	1,053.77 97,008,124	- -	3.21%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	6,644	12,763.24 84,799,003	14,019.15 93,143,264	- -	3.09%
4	HCP INC アメリカ	投資証券	20,900	3,963.67 82,840,882	4,285.40 89,564,918	- -	2.97%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券	4,040	21,175.72 85,549,941	21,713.77 87,723,669	- -	2.91%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	13,568	5,762.78 78,189,428	6,076.30 82,443,289	- -	2.73%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	20,797	3,115.16 64,786,090	3,650.15 75,912,315	- -	2.51%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	13,600	5,337.15 72,585,354	5,201.35 70,738,493	- -	2.34%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	6,888	9,696.38 66,788,697	9,707.32 66,864,029	- -	2.21%
10	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	11,201	5,318.01 59,567,130	5,742.73 64,324,334	- -	2.13%
11	LINK REIT/THE 香港	投資証券	127,000	455.31 57,824,687	471.76 59,913,837	- -	1.98%
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	4,798	12,488.91 59,921,810	12,362.22 59,313,977	- -	1.96%
13	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	7,429	7,280.26 54,085,075	7,761.48 57,660,052	- -	1.91%
14	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	35,768	1,316.06 47,072,891	1,529.32 54,701,046	- -	1.81%
15	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	32,978	1,174.07 38,718,656	1,158.23 38,196,394	- -	1.27%
16	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	45,200	768.79 34,749,750	811.99 36,701,984	- -	1.22%
17	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受 益証券	110,440	330.66 36,519,150	330.66 36,519,150	- -	1.21%
18	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	19,997	1,731.65 34,628,005	1,804.57 36,086,026	- -	1.20%
19	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	5,510	5,402.77 29,769,313	6,388.91 35,202,916	- -	1.17%
20	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託受 益証券	113,200	298.36 33,774,668	303.11 34,312,482	- -	1.14%
21	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	17,422	1,770.85 30,851,752	1,893.88 32,995,337	- -	1.09%
22	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	3,390	9,634.40 32,660,647	9,693.65 32,861,474	- -	1.09%
23	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	6,020	5,229.61 31,482,271	5,452.90 32,826,495	- -	1.09%

24	GPT GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	86,000	332.57 28,601,020	355.37 30,562,232	- -	1.01%
25	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	7,290	3,579.97 26,098,048	3,970.05 28,941,725	- -	0.96%
26	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,060	13,367.50 27,537,057	13,980.87 28,800,604	- -	0.95%
27	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	67,152	419.03 28,139,253	427.58 28,713,523	- -	0.95%
28	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	191,854	140.62 26,980,351	148.23 28,438,748	- -	0.94%
29	SL GREEN アメリカ	投資証券	3,825	6,966.74 26,647,786	7,320.36 28,000,395	- -	0.93%
30	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	247,400	94.54 23,390,408	100.24 24,800,885	- -	0.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	15.24%
投資証券	82.90%
合計	98.14%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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25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 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年1月11日)	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2計算期間末 (平成21年1月13日)	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3計算期間末 (平成22年1月12日)	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4計算期間末 (平成23年1月11日)	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5計算期間末 (平成24年1月11日)	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末 (平成25年1月11日)	8,892	8,892	0.8003	0.8003
平成24年1月末日	7,655	-	0.6804	-
2月末日	8,139	-	0.7233	-
3月末日	8,208	-	0.7348	-
4月末日	8,091	-	0.7223	-
5月末日	7,709	-	0.6840	-
6月末日	7,905	-	0.6991	-
7月末日	7,917	-	0.6968	-
8月末日	7,964	-	0.7016	-
9月末日	8,059	-	0.7101	-
10月末日	8,163	-	0.7189	-
11月末日	8,378	-	0.7392	-
12月末日	8,667	-	0.7777	-
平成25年1月末日	9,117	-	0.8243	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.8
第2計算期間	30.0
第3計算期間	15.3
第4計算期間	1.9
第5計算期間	7.4
第6計算期間	19.7

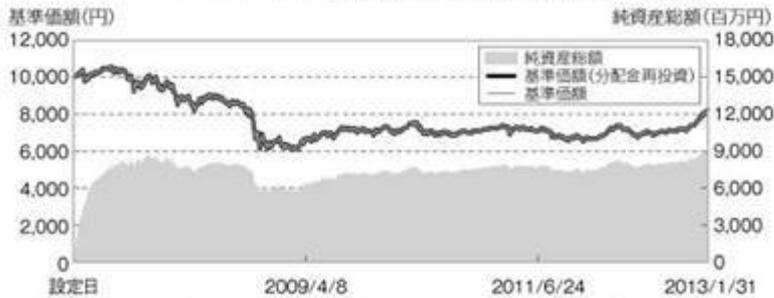
- (注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
- なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

<< 参考情報 >>

データの基準日：2013年1月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2007年1月26日)～2013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
第6期	(2013.01.11)	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	国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド	26.82%
2	外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド	23.29%
3	国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	21.38%
4	外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド	14.88%
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.98%
6	グローバルリートバッシブ・ファンド・マザーファンド	5.55%

■国内株式バッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.87
内 日本	97.87
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.13
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.24%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.94%
3	本田技研	株式	日本	輸送用機器	2.23%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.07%
5	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.76%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.58%
2	輸送用機器	11.21%
3	銀行業	10.48%
4	情報・通信業	5.82%
5	化学	5.55%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.91

■外国株式バッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.72
内 アメリカ	54.63
内 ユーロ	13.23
内 イギリス	10.06
内 カナダ	5.04
内 スイス	4.08
内 その他	8.68
投資信託受益証券	0.38
内 オーストラリア	0.34
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.88
内 アメリカ	1.54
内 ユーロ	0.13
内 イギリス	0.12
内 香港	0.05
内 カナダ	0.04
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.02
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.70%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.66%
3	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.93%
4	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.91%
5	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.90%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	9.51%
2	商業銀行	7.86%
3	医薬品	6.56%
4	保険	4.27%
5	金属・鉱業	3.10%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.21
株価指数先物取引(買建)	1.86

○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：2013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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	78.56
内 日本	78.56
地方債証券	6.74
内 日本	6.74
特殊債券	7.48
内 日本	7.48
社債券	6.67
内 日本	6.67
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.55
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	321回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.000000	2022/3/20	1.48%
2	81回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.800000	2014/3/20	1.31%
3	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/9/20	1.26%
4	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.26%
5	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.98
内 ユーロ	40.89
内 アメリカ	40.65
内 イギリス	7.42
内 カナダ	2.69
内 オーストラリア	1.48
内 その他	4.85
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.02
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 4.75 05/15/14	国債証券	アメリカ	4.750000	2014/5/15	0.95%
2	US T N/B 1.75 03/31/14	国債証券	アメリカ	1.750000	2014/3/31	0.92%
3	US T N/B 0.25 09/15/14	国債証券	アメリカ	0.250000	2014/9/15	0.90%
4	US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	アメリカ	4.250000	2014/11/15	0.88%
5	US T N/B 2.375 09/30/14	国債証券	アメリカ	2.375000	2014/9/30	0.81%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△0.01

■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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.86
内 日本	98.86
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.14
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	12.49%
2	ジャパシリアルエステイト投資法人	日本	10.58%
3	日本リテールファンド投資法人	日本	6.94%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.53%
5	日本プライムリアルティ投資法人	日本	4.14%

■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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

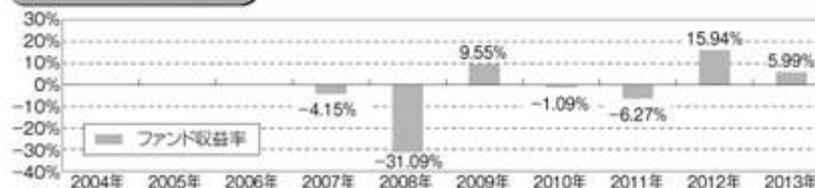
ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	15.24
内 オーストラリア	11.78
内 シンガポール	3.46
投資証券	82.90
内 アメリカ	64.05
内 ユーロ	7.20
内 イギリス	5.77
内 カナダ	3.07
内 香港	2.48
内 その他	0.33
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.86
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.69%
2	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.21%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.09%
4	HCP INC	アメリカ	2.97%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	2.91%

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2013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】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	12,252,099,717	3,511,628,988
第2計算期間	2,271,286,181	1,714,151,191
第3計算期間	1,780,961,356	925,938,640
第4計算期間	1,561,559,539	1,016,414,248
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499

(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ます。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に販売会社の定める単位をもって解約を請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、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、振替受益権をもって行うものとします。

・解約価額

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

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。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を

控除した金額を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。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】

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

(5)【その他】

イ.償還規定

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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、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ことができる旨を付記します。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、公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、原則として期間満了の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、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

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、）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、）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（平成24年1月12日から平成25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<育成型>

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 平成24年1月11日現在	第6期 平成25年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	164,302,185	169,208,833
親投資信託受益証券	7,370,644,902	8,789,189,976
未収入金	211,000	11,557,000
流動資産合計	7,535,158,087	8,969,955,809
資産合計	7,535,158,087	8,969,955,809
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,634,019	36,791,671
未払受託者報酬	2,772,613	3,017,915
未払委託者報酬	34,856,313	37,939,950
その他未払費用	188,057	204,700
流動負債合計	42,451,002	77,954,236
負債合計	42,451,002	77,954,236
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 11,202,486,919	¹ 11,110,695,874
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 3,709,779,834	² 2,218,694,301
（分配準備積立金）	582,398,171	706,226,905
元本等合計	7,492,707,085	8,892,001,573
純資産合計	7,492,707,085	8,892,001,573
負債純資産合計	7,535,158,087	8,969,955,809

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日		自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日	
営業収益				
受取利息		87,617		88,042
有価証券売買等損益		511,725,832		1,557,304,074
営業収益合計		511,638,215		1,557,392,116
営業費用				
受託者報酬		5,607,377		5,912,614
委託者報酬		² 70,493,889		² 74,331,012
その他費用		380,332		401,036
営業費用合計		76,481,598		80,644,662
営業利益又は営業損失()		588,119,813		1,476,747,454
経常利益又は経常損失()		588,119,813		1,476,747,454
当期純利益又は当期純損失()		588,119,813		1,476,747,454
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		22,699,705		72,481,939
期首剰余金又は期首欠損金()		2,969,962,899		3,709,779,834
剰余金増加額又は欠損金減少額		291,795,799		471,158,078
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		291,795,799		471,158,078
剰余金減少額又は欠損金増加額		466,192,626		384,338,060
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		466,192,626		384,338,060
分配金		¹ -		¹ -
期末剰余金又は期末欠損金()		3,709,779,834		2,218,694,301

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 平成24年1月11日現在	第6期 平成25年1月11日現在
1 . 1 期首元本額	10,697,773,726円	11,202,486,919円
期中追加設定元本額	1,553,939,256円	1,341,335,454円
期中一部解約元本額	1,049,226,063円	1,433,126,499円
2 . 受益権の総数	11,202,486,919口	11,110,695,874口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,709,779,834円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,218,694,301円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期 自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	第6期 自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日
1 . 1 分配金の計算過程	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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（193,436,543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（314,925,157円）及び分配準備積立金（512,790,362円）より分配対象収益は1,021,152,062円（1万口当たり919.07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。
2 . 2 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	758,846円	829,295円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	第6期 自 平成24年1月12日 至 平成25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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 平成24年1月11日現在	第6期 平成25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)有価証券 「(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)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	第5期 平成24年1月11日現在	第6期 平成25年1月11日現在
	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	492,553,991	1,473,804,199
合計	492,553,991	1,473,804,199

（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5期 平成24年1月11日現在	第6期 平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.6688円	0.8003円
（1万口当たり純資産額）	(6,688円)	(8,003円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	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	1,524,084,288	1,871,423,097	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,111,906,126	2,449,599,915	
	J-REITインデックスファンド・マ ザーファンド	596,048,209	589,193,654	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	805,866,848	1,305,584,880	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,496,007,439	2,083,489,560	
	グローバルリート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド	470,694,534	489,898,870	
親投資信託受益証券 合計		7,004,607,444	8,789,189,976	
合計		7,004,607,444	8,789,189,976	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

（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」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「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あります。

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

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		8,167,025,073	3,274,614,333
株式	3	240,208,368,152	288,061,413,066
派生商品評価勘定		73,235,934	205,108,443
未収入金		-	3,376,637
未収配当金		275,024,850	324,804,849
流動資産合計		248,723,654,009	291,869,317,328
資産合計		248,723,654,009	291,869,317,328
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		49,141,051	-
前受金		18,071,000	169,900,000
未払金		878,667	-
未払解約金		59,935,000	125,621,000
流動負債合計		128,025,718	295,521,000
負債合計		128,025,718	295,521,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	254,010,406,324	237,448,868,793
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	5,414,778,033	54,124,927,535
元本等合計		248,595,628,291	291,573,796,328
純資産合計		248,595,628,291	291,573,796,328
負債純資産合計		248,723,654,009	291,869,317,328

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1 . 1 本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	228,379,687,941円	254,010,406,324円
同期中追加設定元本額	66,418,443,179円	51,588,132,502円
同期中一部解約元本額	40,787,724,796円	68,149,670,033円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	2,701,746,053円	3,342,203,908円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,057,501,374円	1,124,411,816円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	34,316,155,026円	36,969,163,098円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	936,995,181円	957,396,034円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	3,425,810,539円	3,584,616,266円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,457,055,475円	3,627,226,257円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	525,549,744円	486,965,527円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,549,301,539円	1,564,883,551円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,165,543,224円	1,208,432,963円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	132,245,304円	123,323,679円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,452,916,419円	1,524,084,288円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	20,312,409円	18,412,264円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	- 円	47,575円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	- 円	72,736円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	- 円	98,899円
投資のコンシェルジュ	- 円	2,463,013円
クルーズコントロール	- 円	8,460,239円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	280,428,799円	219,087,971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)	11,221,617,726円	9,902,179,526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)	1,825,986,372円	1,740,050,483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)	221,224,066円	205,408,632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)	846,811,544円	779,188,349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)	231,792,696円	201,556,717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)	305,439,044円	286,014,701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)	21,135,260,399円	19,405,357,081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)	6,973,194,770円	6,430,632,308円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,515,819,691円	4,819,546,621円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,602,818,118円	3,172,154,862円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,266,263,783円	7,355,651,520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)	1,276,613,232円	1,100,908,007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)	2,798,733,260円	2,408,510,938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)	2,860,749,528円	2,416,554,459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)	15,940,632,519円	13,895,228,477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)	222,287,324円	200,292,399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)	5,180,128,773円	4,434,605,750円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	9,604,697,727円	9,117,855,893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)	488,514,372円	438,508,601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)	44,336,116,313円	39,496,785,494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)	2,888,855,576円	2,468,429,367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)	5,478,086,307円	4,750,729,993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)	27,076,022,500円	24,377,132,725円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	315,394,843円	255,241,831円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	106,653円	103,294円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	163,481円	161,931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)	23,768,412,878円	21,226,322,800円
D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	267,316,165円	274,023,461円
D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	98,488,565円	85,221,168円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	241,043,818円	202,479,650円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	101,120円	95,763円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	152,075円	146,629円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1212)(適格機関 投資家限定)	-円	1,236,284,379円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1303)(適格機関 投資家限定)	-円	4,154,900円
計	254,010,406,324円	237,448,868,793円
2. 受益権の総数	254,010,406,324口	237,448,868,793口

3 .	2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,414,778,033円であります。	
4 .	3	差入代用有価証券	株式 1,313,000,000円	株式 2,130,000,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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)有価証券 「(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)デリバティブ取引 「(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)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	60,210,126,168	41,537,448,229
合計	60,210,126,168	41,537,448,229

（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期末日までの期間（平成23年2月8日から平成24年1月11日まで及び平成24年2月8日から平成25年1月11日まで）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

種類	平成24年1月11日 現在				平成25年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,575,000	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000
合計	8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,575,000	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000

（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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.9787円	1.2279円
（1万口当たり純資産額）	(9,787円)	(12,279円)

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	113,000	194	21,922,000	
日本水産	281,300	185	52,040,500	
マルハニチロホールディングス	502,000	153	76,806,000	
ハウスイ	20,000	116	2,320,000	
サカタのタネ	38,900	1,111	43,217,900	
ホクト	26,700	1,749	46,698,300	
ショーボンドHD	23,300	3,420	79,686,000	
ミライト・ホールディングス	74,500	787	58,631,500	
住石ホールディングス	77,400	98	7,585,200	
日鉄鉱業	67,000	398	26,666,000	
三井松島	170,000	188	31,960,000	
国際石油開発帝石	3,170	466,500	1,478,805,000	
日本海洋掘削	6,500	2,910	18,915,000	
関東天然瓦斯	27,000	477	12,879,000	
石油資源開発	37,200	3,120	116,064,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	135,000	2,970,000	
間組	88,600	272	24,099,200	
東急建設	93,310	257	23,980,670	
コムシスホールディングス	127,000	1,101	139,827,000	
ミサワホーム	30,900	1,323	40,880,700	
高松コンストラクションGP	19,900	1,376	27,382,400	
東建コーポレーション	9,780	5,050	49,389,000	
ヤマウラ	8,500	304	2,584,000	
大成建設	1,320,000	298	393,360,000	
大林組	782,000	520	406,640,000	
清水建設	799,000	338	270,062,000	
飛島建設	162,000	124	20,088,000	
長谷工コーポレーション	1,632,000	87	141,984,000	
松井建設	2,000	371	742,000	
鹿島建設	1,147,000	296	339,512,000	
不動テトラ	185,000	203	37,555,000	
大末建設	101,000	80	8,080,000	
鉄建建設	160,000	132	21,120,000	
安藤建設	88,000	143	12,584,000	
太平工業	46,000	378	17,388,000	
西松建設	322,000	188	60,536,000	
三井住友建設	363,700	108	39,279,600	
大豊建設	74,000	138	10,212,000	
前田建設	161,000	445	71,645,000	
佐田建設	91,000	96	8,736,000	
ナカノフード建設	20,500	290	5,945,000	
奥村組	232,000	379	87,928,000	
大和小田急建設	14,000	243	3,402,000	
東鉄工業	34,200	1,209	41,347,800	

イチケン	27,000	171	4,617,000
浅沼組	80,000	89	7,120,000
戸田建設	304,000	267	81,168,000
熊谷組	190,000	134	25,460,000
青木あすなる建設	15,000	589	8,835,000
北野建設	61,000	233	14,213,000
植木組	34,000	206	7,004,000
三井ホーム	35,000	513	17,955,000
矢作建設	32,900	447	14,706,300
ピーエス三菱	16,700	592	9,886,400
大東建託	99,100	8,490	841,359,000
新日本建設	32,200	259	8,339,800
N I P P O	61,000	1,276	77,836,000
東亜道路	50,000	333	16,650,000
前田道路	75,000	1,394	104,550,000
日本道路	78,000	428	33,384,000
東亜建設	229,000	152	34,808,000
若築建設	142,000	117	16,614,000
東洋建設	81,300	325	26,422,500
五洋建設	311,000	249	77,439,000
大林道路	31,000	373	11,563,000
世紀東急	96,000	101	9,696,000
福田組	39,000	422	16,458,000
住友林業	179,900	883	158,851,700
日本基礎技術	31,800	346	11,002,800
日成ビルド工業	77,000	199	15,323,000
エス・パイ・エル	133,000	165	21,945,000
巴コーポレーション	36,900	300	11,070,000
パナホーム	98,000	605	59,290,000
大和ハウス	650,000	1,548	1,006,200,000
ライト工業	59,000	501	29,559,000
積水ハウス	783,000	993	777,519,000
日特建設	22,500	408	9,180,000
北陸電気工事	15,000	284	4,260,000
ユアテック	42,000	311	13,062,000
西部電気工業	1,000	384	384,000
四電工	6,000	332	1,992,000
中電工	38,400	836	32,102,400
関電工	121,000	391	47,311,000
きんでん	174,000	565	98,310,000
東京エネシス	27,000	474	12,798,000
トーエネック	36,000	471	16,956,000
住友電設	18,300	980	17,934,000
日本電設工業	48,000	859	41,232,000
協和エクシオ	94,200	919	86,569,800
新日本空調	19,400	500	9,700,000
日本工営	82,000	327	26,814,000
N D S	42,000	259	10,878,000
九電工	43,000	463	19,909,000
三機工業	61,000	456	27,816,000
日揮	262,000	2,761	723,382,000

中外炉工業	85,000	230	19,550,000
ヤマト	16,000	304	4,864,000
太平電業	33,000	543	17,919,000
高砂熱学	75,400	701	52,855,400
三晃金属	29,000	239	6,931,000
N E C ネットズエスアイ	21,900	1,634	35,784,600
朝日工業社	28,000	294	8,232,000
アタカ大機	16,000	350	5,600,000
大 氣 社	37,500	1,754	65,775,000
ダイダン	25,000	540	13,500,000
日比谷総合設	32,300	1,034	33,398,200
東芝プラントシステム	42,000	1,301	54,642,000
日本製粉	161,000	362	58,282,000
日清製粉G 本社	236,500	1,087	257,075,500
日東富士製粉	8,000	310	2,480,000
昭和産業	109,000	284	30,956,000
鳥越製粉	21,600	617	13,327,200
協同飼料	94,000	104	9,776,000
中部飼料	23,600	531	12,531,600
日本配合飼料	75,000	112	8,400,000
東洋精糖	43,000	97	4,171,000
日本甜菜糖	136,000	168	22,848,000
三井製糖	104,000	265	27,560,000
ネクスト	10,900	955	10,409,500
日本M & A センター	12,500	2,820	35,250,000
ノバレーゼ	63	55,400	3,490,200
アコーディア・ゴルフ	1,065	80,300	85,519,500
タケエイ	2,400	2,156	5,174,400
パソナグループ	244	50,200	12,248,800
リンクアンドモチベーション	101	36,600	3,696,600
G C A サヴィアングループ	11,100	952	10,567,200
エス・エム・エス	67	190,600	12,770,200
テンプホールディングス	33,200	1,116	37,051,200
クックパッド	4,700	2,496	11,731,200
エスクリ	5,000	825	4,125,000
森永製菓	258,000	188	48,504,000
中 村 屋	62,000	414	25,668,000
江崎グリコ	95,000	899	85,405,000
名糖産業	12,000	981	11,772,000
不 二 家	150,000	197	29,550,000
山崎製パン	191,000	993	189,663,000
第一屋製パン	39,000	85	3,315,000
モロゾフ	43,000	304	13,072,000
亀田製菓	14,800	1,980	29,304,000
カルビー	23,600	6,480	152,928,000
森永乳業	222,000	281	62,382,000
ヤクルト	152,600	3,850	587,510,000
明治ホールディングス	77,300	3,890	300,697,000
雪印メグミルク	51,300	1,423	72,999,900
プリマハム	148,000	155	22,940,000
日本ハム	198,000	1,202	237,996,000

伊藤ハム	144,000	384	55,296,000
林兼産業	86,000	82	7,052,000
丸大食品	126,000	290	36,540,000
米 久	23,300	735	17,125,500
S F o o d s	17,000	820	13,940,000
学情	8,500	304	2,584,000
スタジオアリス	11,200	1,276	14,291,200
シミックホールディングス	9,200	1,271	11,693,200
システナ	244	78,600	19,178,400
NECフィールドディング	19,800	1,053	20,849,400
新日鉄住金SOL	15,300	1,625	24,862,500
総合警備保障	88,500	1,145	101,332,500
日本駐車場開発	2,574	4,735	12,187,890
コア	8,800	751	6,608,800
カカクコム	33,600	3,220	108,192,000
アイロムホールディングス	475	6,510	3,092,250
ルネサンス	11,000	700	7,700,000
新日本科学	15,000	353	5,295,000
ツクイ	10,800	1,778	19,202,400
エムスリー	573	148,100	84,861,300
ベストブライダル	70	81,800	5,726,000
ディー・エヌ・エー	119,800	3,215	385,157,000
博報堂DYHLDGS	33,690	5,940	200,118,600
ぐるなび	17,000	947	16,099,000
一休	151	62,800	9,482,800
ジャパンベストレスキューS	31	80,000	2,480,000
ジェイコムホールディングス	4,400	700	3,080,000
PGMホールディングス	342	68,900	23,563,800
サッポロホールディングス	428,000	287	122,836,000
アサヒグループホールディング	524,300	1,840	964,712,000
麒麟HD	1,116,000	1,033	1,152,828,000
宝ホールディングス	205,000	720	147,600,000
オエノンホールディングス	69,000	206	14,214,000
養命酒	3,000	754	2,262,000
三国コカ・コ・ラ	27,900	830	23,157,000
コカ・コーラウエスト	88,600	1,359	120,407,400
コカコーラセントラルジャパン	33,200	1,089	36,154,800
ダイドードリンコ	13,300	3,625	48,212,500
伊藤園	71,100	1,679	119,376,900
キーコーヒー	23,200	1,569	36,400,800
ユニカフェ	6,100	478	2,915,800
ジャパンフーズ	3,800	955	3,629,000
日清オイリオグループ	114,000	329	37,506,000
不二製油	63,400	1,229	77,918,600
J・オイルミルズ	111,000	261	28,971,000
ローソン	86,900	6,180	537,042,000
サンエー	8,700	3,290	28,623,000
麒麟堂	8,400	596	5,006,400
ダイユーエイト	4,700	672	3,158,400
カワチ薬品	16,000	1,801	28,816,000
エービーシー・マート	27,200	3,555	96,696,000

ハードオフコーポレーション	11,200	625	7,000,000
高千穂交易	9,900	896	8,870,400
アスクル	15,800	1,205	19,039,000
ゲオホールディングス	392	92,600	36,299,200
ポイント	21,140	3,025	63,948,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	30,000	94	2,820,000
伊藤忠食品	5,800	2,999	17,394,200
くらコーポレーション	13,500	1,255	16,942,500
キャンドウ	123	106,400	13,087,200
エレマテック	10,700	1,182	12,647,400
パル	6,700	4,145	27,771,500
JALUX	7,200	869	6,256,800
エディオン	99,300	399	39,620,700
あらた	52,000	363	18,876,000
サーラコーポレーション	20,000	497	9,940,000
トーメンデバイス	3,400	1,827	6,211,800
J Pホールディングス	7,300	1,043	7,613,900
あみやき亭	40	201,900	8,076,000
東京エレクトロンデバイス	47	146,000	6,862,000
ひらまつ	79	111,200	8,784,800
双日	1,449,900	137	198,636,300
ゲンキー	2,300	1,890	4,347,000
アルフレッサホールディングス	59,500	3,560	211,820,000
大黒天物産	3,900	2,426	9,461,400
ハニーズ	20,160	1,079	21,752,640
キッコーマン	213,000	1,319	280,947,000
味の素	687,000	1,182	812,034,000
キューピー	132,800	1,188	157,766,400
ハウス食品	92,900	1,345	124,950,500
カゴメ	93,900	1,709	160,475,100
焼津水産化工	13,200	769	10,150,800
アリアケジャパン	24,000	1,566	37,584,000
ニチレイ	293,000	465	136,245,000
横浜冷凍	57,600	619	35,654,400
東洋水産	120,000	2,432	291,840,000
日清食品H D	102,000	3,360	342,720,000
永谷園	7,000	851	5,957,000
フジッコ	29,000	1,030	29,870,000
ロックフィールド	14,000	1,488	20,832,000
日本たばこ産業	1,156,200	2,649	3,062,773,800
ケンコーマヨネーズ	8,100	802	6,496,200
わらべや日洋	15,700	1,492	23,424,400
なとり	12,800	859	10,995,200
片倉工業	30,900	839	25,925,100
グンゼ	183,000	247	45,201,000
ヒューリック	297,600	573	170,524,800
神栄	30,000	124	3,720,000
山下医科器械	2,000	1,326	2,652,000
ラサ商事	10,700	430	4,601,000
アルペン	17,500	1,543	27,002,500
アルコニックス	6,600	1,546	10,203,600

ビックカメラ	870	43,700	38,019,000
DCMホールディングス	118,700	614	72,881,800
Monotaro	15,300	2,816	43,084,800
あいホールディングス	36,800	631	23,220,800
J.フロントリテイリング	542,000	499	270,458,000
ドトール・日レスHD	40,400	1,161	46,904,400
マツモトキヨシHLDGS	38,600	2,050	79,130,000
ブロンコビリー	1,500	2,160	3,240,000
スタートトゥデイ	47,600	753	35,842,800
物語コーポレーション	2,900	2,182	6,327,800
ココカラファイン	23,900	2,822	67,445,800
三越伊勢丹HD	456,300	874	398,806,200
東洋紡	1,030,000	140	144,200,000
ユニチカ	668,000	55	36,740,000
富士紡ホールディングス	113,000	311	35,143,000
日清紡ホールディングス	155,000	745	115,475,000
倉敷紡績	251,000	153	38,403,000
ダイワボウHD	209,000	192	40,128,000
シキボウ	149,000	115	17,135,000
日東紡績	179,000	367	65,693,000
トヨタ紡織	81,300	1,039	84,470,700
ウエルシアHD	8,000	3,250	26,000,000
クリエイトSDH	9,700	2,800	27,160,000
バイタルKSKHD	43,300	841	36,415,300
八洲電機	17,300	362	6,262,600
UKCホールディングス	13,600	1,670	22,712,000
丸善CHIHD	13,700	214	2,931,800
TOKAIホールディングス	89,700	288	25,833,600
日本毛織	77,000	598	46,046,000
大東紡織	38,000	77	2,926,000
トーア紡コーポレーション	111,000	66	7,326,000
ガイドーリミテッド	28,000	620	17,360,000
東京建物不動産販	13,000	384	4,992,000
三栄建築設計	5,900	832	4,908,800
野村不動産HLDGS	110,200	1,674	184,474,800
常和ホールディングス	4,600	1,782	8,197,200
帝国繊維	25,000	682	17,050,000
ブックオフコーポレーション	12,700	687	8,724,900
日本コークス工業	197,000	121	23,837,000
ミタチ産業	3,800	417	1,584,600
あさひ	13,300	1,303	17,329,900
日本調剤	2,900	2,333	6,765,700
コスモス薬品	10,100	9,180	92,718,000
シップヘルスケアHD	32,800	2,623	86,034,400
ソフトクリエイトHD	2,500	1,385	3,462,500
セブン&アイ・HLDGS	960,700	2,614	2,511,269,800
ツルハホールディングス	19,000	7,130	135,470,000
サンマルクホールディングス	7,400	3,190	23,606,000
フェリシモ	6,600	1,052	6,943,200
トリドール	19,800	989	19,582,200
クスリのアオキ	3,400	4,570	15,538,000

帝人	925,000	219	202,575,000	
東レ	1,886,000	528	995,808,000	
クラレ	415,100	1,145	475,289,500	
旭化成	1,520,000	515	782,800,000	
サカイオーベックス	64,000	131	8,384,000	
稲葉製作所	10,600	1,123	11,903,800	
宮地エンジニアリングG	81,000	184	14,904,000	
トーカロ	13,700	1,367	18,727,900	
アルファCO	8,300	970	8,051,000	
SUMCO	148,900	854	127,160,600	
川田テクノロジーズ	5,700	1,750	9,975,000	
住江織物	62,000	191	11,842,000	
日本フエルト	14,700	418	6,144,600	
イチカワ	14,000	167	2,338,000	
日本バイリン	31,000	368	11,408,000	
エコナックホールディングス	78,000	49	3,822,000	

[次へ](#)

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日東製網	28,000	135	3,780,000	
芦森工業	58,000	140	8,120,000	
アツギ	203,000	109	22,127,000	
ダイニック	47,000	172	8,084,000	
共和レザー	13,400	284	3,805,600	
セーレン	65,600	572	37,523,200	
東海染工	35,000	104	3,640,000	
小松精練	39,000	389	15,171,000	
ワコールホールディングス	145,000	924	133,980,000	
ホギメディカル	15,400	4,165	64,141,000	
レナウン	53,100	121	6,425,100	
クラウドディア	2,600	1,159	3,013,400	
T S Iホールディングス	125,500	535	67,142,500	
デジタルハーツ	4,200	695	2,919,000	
I Tホールディングス	76,000	1,188	90,288,000	
ネオス	45	63,100	2,839,500	
電算システム	2,500	1,206	3,015,000	
グリー	118,400	1,403	166,115,200	
コーエーテクモHD	45,500	746	33,943,000	
三菱総合研究所	8,900	1,854	16,500,600	
ボルテージ	3,600	920	3,312,000	
K L a b	6,800	543	3,692,400	
ポルトウウィン・ピットクル	3,600	1,418	5,104,800	
ネクソン	188,300	903	170,034,900	
エイチーム	1,500	2,659	3,988,500	
特種東海製紙	142,000	232	32,944,000	
ドワンゴ	118	180,700	21,322,600	
ベリサーブ	13	137,900	1,792,700	
マクロミル	22,400	952	21,324,800	
ティーガイア	28,400	838	23,799,200	
G M Oペイメントゲートウェイ	7,500	1,366	10,245,000	
ザッパラス	128	91,000	11,648,000	
インターネットイニシアティブ	26,900	2,079	55,925,100	
S R Aホールディングス	11,100	944	10,478,400	
朝日ネット	19,000	424	8,056,000	
王子ホールディングス	1,077,000	295	317,715,000	
三菱製紙	348,000	90	31,320,000	
北越紀州製紙	151,500	496	75,144,000	
中越パルプ	94,000	155	14,570,000	
巴川製紙	38,000	162	6,156,000	
大王製紙	103,000	623	64,169,000	
日本製紙G本社	117,600	1,235	145,236,000	
レンゴー	196,000	443	86,828,000	
トーモク	77,000	249	19,173,000	
ザ・バック	17,300	1,475	25,517,500	
コ・プケミカル	39,000	114	4,446,000	

昭和電工	1,515,000	144	218,160,000
住友化学	1,675,000	268	448,900,000
日本化成	48,000	119	5,712,000
住友精化	46,000	320	14,720,000
日産化学	173,100	1,093	189,198,300
ラサ工業	87,000	99	8,613,000
クレハ	172,000	327	56,244,000
テイカ	42,000	259	10,878,000
石原産業	439,000	76	33,364,000
片倉チツカリン	13,000	220	2,860,000
日本曹達	146,000	418	61,028,000
東ソー	652,000	212	138,224,000
トクヤマ	354,000	199	70,446,000
セントラル硝子	218,000	300	65,400,000
東亜合成	287,000	362	103,894,000
ダイソー	99,000	247	24,453,000
関東電化	59,000	190	11,210,000
電気化学	488,000	308	150,304,000
イビデン	141,700	1,330	188,461,000
信越化学	437,100	5,450	2,382,195,000
日本カ-バイド	71,000	356	25,276,000
堺化学	92,000	270	24,840,000
エア・ウォーター	201,000	1,135	228,135,000
大陽日酸	321,000	535	171,735,000
日本化学工業	92,000	125	11,500,000
日本パ-カライジング	58,000	1,329	77,082,000
高压ガス	37,000	496	18,352,000
チタン工業	29,000	245	7,105,000
四国化成	36,000	527	18,972,000
戸田工業	35,000	378	13,230,000
ステラケミファ	10,700	1,924	20,586,800
保土谷化学	56,000	181	10,136,000
日本触媒	177,000	897	158,769,000
大日精化	88,000	395	34,760,000
カネカ	304,000	451	137,104,000
協和発酵キリン	292,000	886	258,712,000
三菱瓦斯化学	384,000	541	207,744,000
三井化学	1,034,000	217	224,378,000
J S R	240,400	1,796	431,758,400
東京応化工業	47,100	1,780	83,838,000
大阪有機化学	16,900	392	6,624,800
三菱ケミカルH L D G S	1,524,000	437	665,988,000
日本合成化学	50,000	673	33,650,000
ダイセル	290,000	599	173,710,000
住友ベ-クライト	190,000	378	71,820,000
積水化学	500,000	837	418,500,000
日本ゼオン	210,000	767	161,070,000
アイカ工業	68,600	1,440	98,784,000
宇部興産	1,167,000	203	236,901,000
積水樹脂	35,000	962	33,670,000
タキロン	57,000	320	18,240,000

旭有機材	88,000	221	19,448,000
日立化成	105,400	1,343	141,552,200
ニチバン	22,000	266	5,852,000
リケンテクノス	40,000	255	10,200,000
大倉工業	59,000	277	16,343,000
積水化成製品	63,000	225	14,175,000
群栄化学	68,000	223	15,164,000
タイガース ポリマー	12,300	315	3,874,500
ミライアル	6,000	1,760	10,560,000
日本カ-リット	19,900	459	9,134,100
日本化薬	172,000	976	167,872,000
イーピーエス	144	236,800	34,099,200
パナソニック インフォシス	5,400	1,957	10,567,800
フェイス	795	9,220	7,329,900
アミューズ	7,400	1,771	13,105,400
野村総合研究所	130,000	1,858	241,540,000
ドリームインキュベータ	77	94,000	7,238,000
サイバネットシステム	198	24,690	4,888,620
T A C	15,400	214	3,295,600
ケネディクス	2,322	20,720	48,111,840
電通	221,100	2,435	538,378,500
インテージ	6,800	1,974	13,423,200
テイクアンドギヴニーズ	947	9,150	8,665,050
ぴあ	7,300	1,215	8,869,500
シンプレクスホールディング	427	28,000	11,956,000
イオンファンタジー	8,000	1,254	10,032,000
ソースネクスト	5,700	353	2,012,100
ネクシィーズ	952	2,453	2,335,256
メディカルシステムネットワーク	12,600	412	5,191,200
日本精化	20,800	583	12,126,400
A D E K A	105,200	751	79,005,200
日油	190,000	394	74,860,000
ミヨシ油脂	86,000	111	9,546,000
ハリマ化成グループ	21,100	437	9,220,700
花王	646,400	2,370	1,531,968,000
第一工業製薬	45,000	232	10,440,000
三洋化成	77,000	526	40,502,000
武田薬品	913,000	4,270	3,898,510,000
アステラス製薬	541,000	4,420	2,391,220,000
大日本住友製薬	172,700	1,104	190,660,800
塩野義製薬	355,300	1,537	546,096,100
田辺三菱製薬	202,900	1,187	240,842,300
わかもと製薬	7,000	232	1,624,000
あすか製薬	28,000	545	15,260,000
日本新薬	51,000	1,085	55,335,000
中外製薬	283,200	1,744	493,900,800
科研製薬	96,000	1,335	128,160,000
エーザイ	300,100	3,755	1,126,875,500
ロート製薬	102,000	1,110	113,220,000
小野薬品	119,300	4,660	555,938,000

久光製薬	75,700	4,445	336,486,500
有機合成薬品	18,000	238	4,284,000
持田製薬	92,000	1,134	104,328,000
参天製薬	83,300	3,550	295,715,000
扶桑薬品	82,000	344	28,208,000
日本ケミファ	34,000	522	17,748,000
ツムラ	66,500	2,827	187,995,500
日医工	35,400	1,814	64,215,600
テルモ	178,300	3,565	635,639,500
みらかホールディングス	63,500	3,695	234,632,500
キッセイ薬品工業	45,400	1,709	77,588,600
生化学工業	46,900	945	44,320,500
栄研化学	17,500	1,118	19,565,000
日水製薬	10,300	945	9,733,500
鳥居薬品	14,700	2,166	31,840,200
東和薬品	12,400	4,785	59,334,000
富士製薬工業	6,200	1,446	8,965,200
沢井製薬	16,000	9,020	144,320,000
ゼリア新薬工業	35,000	1,389	48,615,000
第一三共	768,700	1,423	1,093,860,100
キョーリン製薬HD	65,000	1,781	115,765,000
大幸薬品	11,400	901	10,271,400
ダイト	6,900	1,395	9,625,500
大塚ホールディングス	483,600	2,604	1,259,294,400
大正製薬HD	58,600	6,190	362,734,000
大日本塗料	141,000	157	22,137,000
日本ペイント	211,000	793	167,323,000
関西ペイント	276,000	974	268,824,000
トウペ	21,000	107	2,247,000
中国塗料	75,000	509	38,175,000
日本特殊塗料	19,400	365	7,081,000
藤倉化成	28,900	387	11,184,300
太陽ホールディングス	20,000	2,490	49,800,000
D I C	864,000	162	139,968,000
サカタインクス	50,000	467	23,350,000
東洋インキSCホールディン	219,000	376	82,344,000
アルプス技研	10,200	631	6,436,200
サニックス	35,300	269	9,495,700
ダイオーズ	5,100	538	2,743,800
日本空調サービス	6,600	784	5,174,400
オリエンタルランド	72,300	10,930	790,239,000
ダスキン	67,100	1,617	108,500,700
パーク24	119,500	1,492	178,294,000
明光ネットワークジャパン	22,300	996	22,210,800
ファルコSDホールディングス	13,200	1,010	13,332,000
クレスコ	5,300	627	3,323,100
フジ・メディア・HD	2,220	139,500	309,690,000
秀英予備校	5,000	364	1,820,000
田谷	4,400	714	3,141,600
ラウンドワン	75,900	539	40,910,100
リゾートトラスト	41,200	1,818	74,901,600

オービック	7,910	17,980	142,221,800
TDCソフトウェアエンジニア	4,700	782	3,675,400
ヤフー	16,822	29,030	488,342,660
ビー・エム・エル	14,300	2,163	30,930,900
ワタベウェディング	7,400	655	4,847,000
トレンドマイクロ	91,200	2,646	241,315,200
もしもしホットライン	40,100	1,173	47,037,300
東急コミュニティー	6,300	3,155	19,876,500
リソー教育	2,485	7,150	17,767,750
日本オラクル	45,900	3,720	170,748,000
アルファシステムズ	7,600	1,135	8,626,000
フューチャーアーキテクト	278	34,600	9,618,800
ウェアハウス	5,100	222	1,132,200
シーエーシー	14,200	697	9,897,400
ソフトバンク・テクノ	5,400	827	4,465,800
トーセ	6,000	558	3,348,000
ユー・エス・エス	27,150	9,490	257,653,500
オービックビジネスC	7,300	4,930	35,989,000
伊藤忠テクノソリューションズ	27,000	3,755	101,385,000
アイティフォー	25,800	352	9,081,600
東京個別指導学院	13,400	238	3,189,200
東計電算	4,100	1,225	5,022,500
エクスネット	18	119,400	2,149,200
テー・オー・ダブリュー	8,400	507	4,258,800
大塚商会	20,600	7,030	144,818,000
総合メディカル	5,500	3,065	16,857,500
サイボウズ	384	25,300	9,715,200
ソフトブレーン	335	12,070	4,043,450
アグレックス	6,400	794	5,081,600
セントラルスポーツ	7,600	1,400	10,640,000
電通国際情報S	14,200	836	11,871,200
イーエムシステムズ	3,500	1,730	6,055,000
ウェザーニューズ	6,000	2,410	14,460,000
C I J	23,300	341	7,945,300
WOWOW	71	193,000	13,703,000
フルキャストホールディングス	229	16,090	3,684,610
富士フイルムHLDGS	520,500	1,803	938,461,500
コニカミノルタHLDGS	614,500	665	408,642,500
資生堂	433,600	1,273	551,972,800
ライオン	282,000	442	124,644,000
高砂香料	81,000	465	37,665,000
マンダム	26,200	2,476	64,871,200
ミルボン	12,000	2,752	33,024,000
ファンケル	61,600	962	59,259,200
コーセー	43,800	1,836	80,416,800
ドクターシーラボ	165	272,200	44,913,000
ポーラ・オルビスHD	29,000	2,506	72,674,000
ノエビアホールディングス	14,300	1,312	18,761,600
エステー	15,500	943	14,616,500
コニシ	17,700	1,514	26,797,800
長谷川香料	31,100	1,169	36,355,900

小林製薬	36,900	4,265	157,378,500
荒川化学工業	19,500	674	13,143,000
メック	18,000	313	5,634,000
日本高純度化学	66	204,000	13,464,000
J C U	3,600	3,370	12,132,000
アース製薬	17,600	2,908	51,180,800
イハラケミカル	42,000	509	21,378,000
北興化学	11,000	237	2,607,000
大成ラミック	6,900	2,443	16,856,700
クミアイ化学	51,000	521	26,571,000
日本農薬	56,000	508	28,448,000
昭和シエル石油	218,100	495	107,959,500
コスモ石油	674,000	195	131,430,000
富士興産	8,300	533	4,423,900
ニチレキ	31,000	511	15,841,000
東燃ゼネラル石油	368,000	755	277,840,000
ユシロ化学	13,400	922	12,354,800
ビーピー・カストロール	9,800	371	3,635,800
A O Cホールディングス	56,800	424	24,083,200
M O R E S C O	4,900	826	4,047,400
出光興産	28,900	7,760	224,264,000
J Xホールディングス	2,704,400	517	1,398,174,800
横浜ゴム	272,000	634	172,448,000
東洋ゴム	202,000	279	56,358,000
ブリヂストン	763,700	2,398	1,831,352,600
住友ゴム	189,900	1,152	218,764,800
藤倉ゴム	14,300	269	3,846,700
オカモト	87,000	308	26,796,000
アキレス	199,000	129	25,671,000
フ コ ク	10,300	849	8,744,700
ニッタ	24,100	1,494	36,005,400
クリエートメディック	7,000	816	5,712,000
東海ゴム工業	45,100	891	40,184,100
三ツ星ベルト	62,000	493	30,566,000
パンドー化学	84,000	292	24,528,000
鬼怒川ゴム	44,000	512	22,528,000
旭硝子	1,200,000	637	764,400,000
日本板硝子	1,110,000	106	117,660,000
石塚硝子	31,000	148	4,588,000
有沢製作所	37,900	346	13,113,400
日本山村硝子	97,000	188	18,236,000
日本電気硝子	431,000	475	204,725,000
オハラ	9,300	677	6,296,100
住友大阪セメント	432,000	309	133,488,000
太平洋セメント	1,341,000	242	324,522,000
デイ・シイ	25,400	347	8,813,800
リゾートソリューション	22,000	190	4,180,000
日本ヒユ - ム	24,000	490	11,760,000
日本コンクリ - ト	42,000	335	14,070,000
東海カーボン	211,000	362	76,382,000
日本カーボン	128,000	184	23,552,000

東洋炭素	12,000	1,783	21,396,000	
ノリタケ	127,000	225	28,575,000	
TOTO	377,000	680	256,360,000	
日本碍子	317,000	1,068	338,556,000	
日本特殊陶業	210,000	1,155	242,550,000	
ダントーホールディングス	38,000	101	3,838,000	
MARUWA	5,400	2,851	15,395,400	
品川リフクトリーズ	62,000	203	12,586,000	
黒崎播磨	53,000	241	12,773,000	
東京窯業	30,000	168	5,040,000	
ニッカトー	8,300	433	3,593,900	
フジミインコーポレーテッド	22,200	1,509	33,499,800	
エーアンドエーマテリアル	51,000	92	4,692,000	
ニチアス	109,000	495	53,955,000	
新日鐵住金	10,300,000	223	2,296,900,000	
神戸製鋼所	3,377,000	110	371,470,000	
中山製鋼所	123,000	75	9,225,000	
合同製鐵	136,000	175	23,800,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
J F Eホールディングス	621,500	1,678	1,042,877,000	
日新製鋼HD	103,200	726	74,923,200	
東京製鐵	134,600	456	61,377,600	
共英製鋼	22,700	1,623	36,842,100	
大和工業	50,400	2,565	129,276,000	
東京鐵鋼	47,000	352	16,544,000	
大阪製鐵	12,200	1,566	19,105,200	
淀川製鋼所	173,000	314	54,322,000	
東洋鋼鈹	51,000	310	15,810,000	
住友鋼管	16,600	718	11,918,800	
丸一鋼管	81,500	2,017	164,385,500	
モリ工業	37,000	268	9,916,000	
大同特殊鋼	377,000	434	163,618,000	
日本高周波	98,000	93	9,114,000	
日本冶金工	179,500	115	20,642,500	
山陽特殊製鋼	121,000	307	37,147,000	
愛知製鋼	129,000	406	52,374,000	
日立金属	173,000	795	137,535,000	
日本金属	63,000	133	8,379,000	
大平洋金属	156,000	403	62,868,000	
日本電工	96,000	261	25,056,000	
栗本鉄工所	106,000	350	37,100,000	
日本鑄鉄管	26,000	273	7,098,000	
日本製鋼所	376,000	564	212,064,000	
三菱製鋼	147,000	177	26,019,000	
日亜鋼業	34,000	222	7,548,000	
日本精線	17,000	327	5,559,000	
大紀アルミニウム	41,000	231	9,471,000	
日本軽金属HD	511,200	103	52,653,600	
三井金属	621,000	216	134,136,000	
東邦亜鉛	137,000	391	53,567,000	
三菱マテリアル	1,425,000	292	416,100,000	
住友鋳山	630,000	1,262	795,060,000	
D O W Aホールディングス	269,000	567	152,523,000	
古河機金	411,000	98	40,278,000	
大阪チタニウム	23,900	2,099	50,166,100	
東邦チタニウム	41,200	901	37,121,200	
住友軽金属	587,000	91	53,417,000	
古河スカイ	82,000	263	21,566,000	
古河電工	766,000	195	149,370,000	
住友電工	860,500	1,029	885,454,500	
フジクラ	392,000	275	107,800,000	
昭和電線H L D G S	317,000	81	25,677,000	
東京特殊電線	35,000	99	3,465,000	
タツタ電線	46,000	746	34,316,000	
日立電線	191,000	156	29,796,000	

沖 電 線	28,000	140	3,920,000
カナレ電気	3,600	1,296	4,665,600
平河ヒューテック	5,800	708	4,106,400
リョービ	136,000	222	30,192,000
アサヒHD	36,700	1,517	55,673,900
東洋製罐	173,100	1,206	208,758,600
ホッカンホールディングス	59,000	266	15,694,000
コロナ	11,200	1,078	12,073,600
横河ブリッジHLDGS	47,000	796	37,412,000
日本橋梁	18,050	433	7,815,650
駒井ハルテック	52,000	271	14,092,000
高田機工	21,000	221	4,641,000
三和ホールディングス	224,000	382	85,568,000
文化シャツタ -	63,000	432	27,216,000
三協立山	32,800	1,745	57,236,000
東洋シャツタ -	7,100	501	3,557,100
L I X I Lグループ	339,400	1,951	662,169,400
日本フィルコン	18,300	373	6,825,900
ノーリツ	47,900	1,479	70,844,100
長府製作所	23,500	1,903	44,720,500
リンナイ	39,200	6,220	243,824,000
ユニプレス	40,700	1,889	76,882,300
ダイニチ工業	12,500	994	12,425,000
日東精工	31,000	281	8,711,000
三洋工業	32,000	176	5,632,000
岡 部	48,300	631	30,477,300
中国工業	39,000	95	3,705,000
東 プ レ	46,900	859	40,287,100
高周波熱錬	32,600	611	19,918,600
東京製綱	166,000	138	22,908,000
パイオラックス	10,400	2,075	21,580,000
日本発条	176,200	762	134,264,400
中央発条	28,000	303	8,484,000
アドバネクス	49,000	86	4,214,000
三浦工業	36,200	2,295	83,079,000
タ ク マ	82,000	529	43,378,000
リブセンス	1,900	3,665	6,963,500
ツ ガ ミ	65,000	558	36,270,000
オークマ	158,000	612	96,696,000
東芝機械	121,000	422	51,062,000
ア マ ダ	372,000	568	211,296,000
アイダエンジニア	57,200	691	39,525,200
牧野フライス	113,000	553	62,489,000
オーエスジー	100,100	1,134	113,513,400
ダイジェット	29,000	162	4,698,000
旭ダイヤモンド	59,900	909	54,449,100
森精機製作所	128,400	744	95,529,600
ディスコ	27,000	4,640	125,280,000
日東工器	14,300	1,864	26,655,200
豊田自動織機	211,900	3,005	636,759,500
豊和工業	136,000	101	13,736,000

大阪機工	94,000	125	11,750,000
石川製作所	56,000	90	5,040,000
東洋機械金属	18,300	216	3,952,800
津田駒工業	59,000	145	8,555,000
エンシュウ	60,000	111	6,660,000
島精機製作所	31,800	1,398	44,456,400
日阪製作所	31,000	784	24,304,000
やまびこ	9,600	1,430	13,728,000
ペガサスミシン製造	22,700	193	4,381,100
ナプテスコ	120,400	1,903	229,121,200
三井海洋開発	20,100	2,021	40,622,100
レオン自動機	21,000	197	4,137,000
S M C	72,700	15,300	1,112,310,000
新川	20,700	455	9,418,500
ホソカワミクロン	41,000	634	25,994,000
ユニオンツール	13,500	1,424	19,224,000
オイレス工業	25,400	1,765	44,831,000
サト - ホールディングス	25,400	1,332	33,832,800
日本エアータック	6,800	375	2,550,000
日精樹脂工業	17,800	438	7,796,400
ワイエイシイ	9,200	493	4,535,600
小松製作所	1,136,600	2,330	2,648,278,000
住友重機械	666,000	415	276,390,000
日立建機	124,300	1,902	236,418,600
日工	33,000	381	12,573,000
巴工業	9,100	1,671	15,206,100
井関農機	233,000	253	58,949,000
T O W A	21,700	593	12,868,100
丸山製作所	55,000	185	10,175,000
北川鉄工所	105,000	149	15,645,000
シンニッタン	19,100	399	7,620,900
クボタ	1,301,000	1,013	1,317,913,000
荏原実業	6,000	1,222	7,332,000
東洋エンジニア	139,000	404	56,156,000
三菱化工機	76,000	164	12,464,000
月島機械	40,000	792	31,680,000
帝国電機製作所	7,500	1,451	10,882,500
東京機械	89,000	59	5,251,000
新東工業	49,100	685	33,633,500
渋谷工業	15,400	899	13,844,600
アイチ コーポレーション	40,700	462	18,803,400
小森コーポレーション	59,300	768	45,542,400
鶴見製作所	14,000	697	9,758,000
住友精密	39,000	408	15,912,000
酒井重工業	46,000	327	15,042,000
荏原製作所	458,000	366	167,628,000
石井鉄工所	36,000	173	6,228,000
西島製作所	28,100	684	19,220,400
千代田化工建	188,000	1,213	228,044,000
ダイキン工業	317,700	3,110	988,047,000
オルガノ	42,000	500	21,000,000

ト - ヨ - カネツ	131,000	204	26,724,000
栗田工業	134,400	1,854	249,177,600
樫本チエイン	124,000	484	60,016,000
大同工業	49,000	147	7,203,000
日本コンベヤ	78,000	83	6,474,000
日 機 装	81,000	923	74,763,000
木村化工機	22,400	354	7,929,600
新興プランテック	53,600	694	37,198,400
アネスト岩田	38,000	368	13,984,000
ダイフク	107,000	584	62,488,000
加藤製作所	55,000	275	15,125,000
油研工業	46,000	155	7,130,000
タダノ	112,000	736	82,432,000
フジテック	68,000	649	44,132,000
C K D	65,300	567	37,025,100
キトー	148	79,500	11,766,000
平和	50,300	1,546	77,763,800
理想科学工業	16,700	1,667	27,838,900
S A N K Y O	70,500	3,620	255,210,000
日本金銭機械	21,500	800	17,200,000
マースエンジニアリング	13,100	1,791	23,462,100
福島工業	6,400	1,916	12,262,400
オーイズミ	8,500	331	2,813,500
ダイコク電機	9,600	1,937	18,595,200
ア マ ノ	70,500	793	55,906,500
J U K I	150,000	121	18,150,000
サンデン	132,000	361	47,652,000
蛇の目ミシン	226,000	94	21,244,000
ブラザー工業	300,700	935	281,154,500
マックス	37,000	1,085	40,145,000
モリタホールディングス	41,000	783	32,103,000
グローリー	69,400	2,012	139,632,800
大和冷機工業	38,000	509	19,342,000
セガサミーホールディングス	250,100	1,585	396,408,500
日本ピストンリング	85,000	180	15,300,000
リ ケ ン	85,000	329	27,965,000
T P R	25,800	1,153	29,747,400
ホシザキ電機	50,800	2,486	126,288,800
大豊工業	16,500	961	15,856,500
日本精工	518,000	613	317,534,000
N T N	500,000	234	117,000,000
ジェイテクト	247,200	878	217,041,600
不 二 越	216,000	339	73,224,000
ミネベア	317,000	301	95,417,000
日本トムソン	80,000	371	29,680,000
T H K	154,700	1,560	241,332,000
ユーシン精機	11,600	1,745	20,242,000
前澤給装工業	9,200	1,191	10,957,200
イーグル工業	29,000	739	21,431,000
前澤工業	17,500	263	4,602,500
日本ピラ - 工業	24,000	661	15,864,000

キッツ	95,800	425	40,715,000
日立	5,445,000	539	2,934,855,000
東芝	4,593,000	350	1,607,550,000
三菱電機	2,327,000	770	1,791,790,000
富士電機	701,000	210	147,210,000
東洋電機製造	46,000	250	11,500,000
安川電機	255,000	847	215,985,000
シンフォニアテクノロジー	141,000	180	25,380,000
明電舎	231,000	299	69,069,000
オリジン電気	34,000	429	14,586,000
デンヨー	22,900	1,099	25,167,100
日立工機	62,300	725	45,167,500
三桜工業	29,700	585	17,374,500
マキタ	141,600	4,115	582,684,000
東芝テック	146,000	478	69,788,000
芝浦メカトロニクス	42,000	231	9,702,000
マブチモーター	34,600	3,865	133,729,000
日本電産	125,800	5,320	669,256,000
東光高岳HD	11,800	1,447	17,074,600
宮越ホールディングス	8,100	313	2,535,300
ダイヘン	128,000	264	33,792,000
ヤーマン	1,900	1,190	2,261,000
JVCケンウッド	140,300	322	45,176,600
第一精工	7,300	1,350	9,855,000
日新電機	47,000	487	22,889,000
大崎電気	31,000	507	15,717,000
オムロン	259,100	2,224	576,238,400
日東工業	34,200	1,155	39,501,000
I D E C	30,500	806	24,583,000
ジーエス・ユアサコーポ	448,000	337	150,976,000
サクサホールディングス	59,000	171	10,089,000
メルコホールディングス	14,500	1,543	22,373,500
テクノメディカ	17	476,000	8,092,000
日本電気	3,011,000	196	590,156,000
富士通	2,243,000	347	778,321,000
沖電気	845,000	108	91,260,000
岩崎通信機	103,000	82	8,446,000
電気興業	61,000	364	22,204,000
サンケン電気	118,000	369	43,542,000
ナカヨ通信機	23,000	276	6,348,000
アイホン	13,500	1,472	19,872,000
ルネサスエレクトロニクス	60,300	297	17,909,100
セイコーエプソン	158,800	758	120,370,400
ワコム	427	240,800	102,821,600
アルバック	46,400	804	37,305,600
アクセル	11,700	1,928	22,557,600
ピクセラ	10,000	184	1,840,000
ナナオ	19,800	1,416	28,036,800
日本信号	58,700	651	38,213,700
京三製作所	50,000	306	15,300,000
能美防災	31,000	598	18,538,000

ホーチキ	19,000	444	8,436,000
日本無線	50,000	259	12,950,000
パナソニック	2,658,800	551	1,464,998,800
シャープ	1,204,000	330	397,320,000
アンリツ	125,000	1,082	135,250,000
富士通ゼネラル	55,000	869	47,795,000
日立国際電気	53,000	680	36,040,000
ソニー	1,462,400	983	1,437,539,200
T D K	131,000	3,450	451,950,000
帝国通信工業	56,000	163	9,128,000
ミツミ電機	88,600	533	47,223,800
タムラ製作所	90,000	213	19,170,000
アルプス電気	170,500	502	85,591,000
池上通信機	74,000	67	4,958,000
パイオニア	282,700	228	64,455,600
日本電波工業	19,500	1,131	22,054,500
日本トリム	3,050	2,554	7,789,700
ローランド ディー . ジー .	10,400	1,105	11,492,000
日本コロムビア	230,000	33	7,590,000
フオスタ - 電機	23,700	1,364	32,326,800
クラリオン	122,000	151	18,422,000
S M K	69,000	236	16,284,000
ヨコオ	18,300	425	7,777,500
東光	117,000	224	26,208,000
ティアック	126,000	40	5,040,000
ホシデン	63,300	550	34,815,000
ヒロセ電機	40,500	10,660	431,730,000
日本航空電子	53,000	678	35,934,000
T O A	26,000	675	17,550,000
ユニデン	69,000	246	16,974,000
アルパイン	45,400	810	36,774,000
スミダコーポレーション	14,500	517	7,496,500
アイコム	12,900	1,921	24,780,900
リオン	5,300	658	3,487,400
船井電機	23,600	1,082	25,535,200
横河電機	232,900	1,037	241,517,300
新電元工業	75,000	262	19,650,000
アズビル	65,200	1,798	117,229,600
日本光電工業	46,300	2,854	132,140,200
チノー	42,000	217	9,114,000
共和電業	27,000	254	6,858,000
日本電子材料	10,500	401	4,210,500
堀場製作所	46,100	2,582	119,030,200
アドバンテスト	158,600	1,391	220,612,600
小野測器	28,000	412	11,536,000
エスベック	24,100	691	16,653,100
パナソニックデバイス	20,600	382	7,869,200
キーエンス	57,100	24,420	1,394,382,000
日置電機	12,300	1,371	16,863,300
シスメックス	82,000	4,475	366,950,000
メガチップス	19,100	1,569	29,967,900

OBARA GROUP	16,600	1,005	16,683,000	
日本電産コバル電子	24,200	440	10,648,000	
ミヤチテクノス	10,500	629	6,604,500	
東京電波	6,900	429	2,960,100	
澤藤電機	13,000	250	3,250,000	
デンソー	574,900	3,180	1,828,182,000	
コーセル	33,900	1,080	36,612,000	
日立メディコ	17,000	1,279	21,743,000	
新日本無線	17,000	197	3,349,000	
オブテックス	14,900	982	14,631,800	
千代田インテグレ	11,400	880	10,032,000	
スタンレー電気	181,000	1,281	231,861,000	
岩崎電気	85,000	227	19,295,000	
ウシオ電機	141,200	995	140,494,000	
岡谷電機	13,100	328	4,296,800	
ヘリオステクノH	20,100	190	3,819,000	
日本セラミック	15,200	1,387	21,082,400	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本デジタル研究所	19,600	1,015	19,894,000	
古河電池	17,000	510	8,670,000	
双信電機	11,700	341	3,989,700	
山一電機	25,800	162	4,179,600	
図研	13,700	578	7,918,600	
日本電子	86,000	254	21,844,000	
カシオ	221,700	789	174,921,300	
ファナック	242,300	15,630	3,787,149,000	
日本シイエムケイ	50,200	336	16,867,200	
エンプラス	10,200	3,740	38,148,000	
ローム	122,900	2,919	358,745,100	
浜松ホトニクス	90,700	3,275	297,042,500	
三井ハイテック	33,800	663	22,409,400	
新光電気工業	78,100	749	58,496,900	
京セラ	193,500	7,960	1,540,260,000	
協栄産業	28,000	160	4,480,000	
太陽誘電	113,000	770	87,010,000	
村田製作所	244,100	5,280	1,288,848,000	
ユーシン	32,300	466	15,051,800	
双葉電子工業	43,200	987	42,638,400	
日東電工	200,900	4,510	906,059,000	
北陸電気工業	94,000	116	10,904,000	
東海理化電機	54,500	1,248	68,016,000	
ニチコン	73,300	730	53,509,000	
日本ケミコン	134,000	183	24,522,000	
K O A	29,400	743	21,844,200	
三井造船	901,000	147	132,447,000	
日立造船	920,500	129	118,744,500	
佐世保重工業	153,000	108	16,524,000	
三菱重工業	3,900,000	467	1,821,300,000	
川崎重工業	1,812,000	242	438,504,000	
I H I	1,590,000	245	389,550,000	
日本車輛	85,000	352	29,920,000	
日本輸送機	30,000	451	13,530,000	
近畿車輛	40,000	308	12,320,000	
島根銀行	5,200	1,219	6,338,800	
じもとホールディングス	164,700	244	40,186,800	
日産自動車	2,939,900	873	2,566,532,700	
いすゞ自動車	1,349,000	541	729,809,000	
トヨタ自動車	2,989,800	4,260	12,736,548,000	*
日野自動車	291,000	838	243,858,000	
三菱自動車工業	5,508,000	94	517,752,000	
エフテック	8,100	1,249	10,116,900	
武蔵精密工業	24,800	1,832	45,433,600	
日産車体	80,000	1,138	91,040,000	
新明和工業	94,000	617	57,998,000	

極東開発工業	43,300	981	42,477,300
日信工業	47,300	1,335	63,145,500
トピー工業	174,000	211	36,714,000
ティラド	79,000	231	18,249,000
曙ブレーキ	108,200	431	46,634,200
タチエス	30,900	1,528	47,215,200
N O K	112,500	1,379	155,137,500
フタバ産業	71,100	388	27,586,800
カヤバ工業	177,000	359	63,543,000
シロキ工業	52,000	233	12,116,000
市光工業	56,000	148	8,288,000
大同メタル工業	32,000	782	25,024,000
プレス工業	99,000	392	38,808,000
カルソニックカンセイ	158,000	371	58,618,000
太平洋工業	47,500	482	22,895,000
ケーヒン	48,100	1,179	56,709,900
河西工業	29,000	432	12,528,000
アイシン精機	212,900	2,818	599,952,200
富士機工	27,000	282	7,614,000
マ ッ ダ	3,684,000	204	751,536,000
ダイハツ	247,000	1,747	431,509,000
今仙電機製作所	17,100	1,086	18,570,600
本田技研	1,963,400	3,380	6,636,292,000
スズキ	486,500	2,346	1,141,329,000
富士重工業	735,000	1,175	863,625,000
ヤマハ発動機	353,800	1,050	371,490,000
ショーワ	54,900	893	49,025,700
小糸製作所	116,000	1,311	152,076,000
T B K	23,000	490	11,270,000
エクセディ	31,600	1,981	62,599,600
ミツバ	43,000	621	26,703,000
豊田合成	65,700	1,775	116,617,500
愛三工業	24,200	757	18,319,400
ヨロズ	17,100	1,287	22,007,700
エフ・シー・シー	38,000	1,859	70,642,000
新家工業	55,000	127	6,985,000
シマノ	93,800	5,760	540,288,000
タカタ	42,100	1,803	75,906,300
テイ・エス テック	49,100	1,636	80,327,600
小野建	20,100	827	16,622,700
はるやま商事	9,700	494	4,791,800
佐島電機	17,100	431	7,370,100
カップ・クリエイトHD	16,900	1,941	32,802,900
エコトレーディング	6,100	792	4,831,200
伯東	14,000	840	11,760,000
コンドーテック	18,500	498	9,213,000
中山福	13,600	653	8,880,800
ライトオン	17,200	679	11,678,800
ナガイレーベン	30,500	1,140	34,770,000
ジーンズメイト	7,400	383	2,834,200
三菱食品	25,300	2,309	58,417,700

良品計画	24,300	5,010	121,743,000
三城ホールディングス	28,800	478	13,766,400
松田産業	17,000	1,117	18,989,000
メディバルHD	229,700	1,028	236,131,600
アドヴァン	11,900	900	10,710,000
S P K	5,600	1,455	8,148,000
アズワン	15,000	1,845	27,675,000
スズデン	8,000	474	3,792,000
尾家産業	6,800	837	5,691,600
シモジマ	14,300	964	13,785,200
ドウシシャ	12,400	2,300	28,520,000
コナカ	26,900	651	17,511,900
高速	13,900	779	10,828,100
ハウス ローゼ	2,800	1,315	3,682,000
G - 7ホールディングス	6,000	464	2,784,000
イオン北海道	14,400	447	6,436,800
コジマ	33,800	320	10,816,000
ヒマラヤ	6,600	703	4,639,800
コーナン商事	29,800	1,075	32,035,000
黒田電気	30,600	1,049	32,099,400
ネットワンシステムズ	83,500	891	74,398,500
エコス	8,000	559	4,472,000
ワタミ	27,100	1,719	46,584,900
マルシェ	6,000	771	4,626,000
ドン・キホーテ	61,200	3,340	204,408,000
丸文	20,300	415	8,424,500
メガネトップ	39,400	1,042	41,054,800
西松屋チェーン	45,300	717	32,480,100
ゼンショーホールディングス	87,400	1,023	89,410,200
ハビネット	14,000	726	10,164,000
幸楽苑	14,300	1,265	18,089,500
トーマンエレクトロニクス	11,600	1,183	13,722,800
ハークスレイ	6,400	675	4,320,000
サイゼリヤ	34,000	1,197	40,698,000
エクセル	9,900	772	7,642,800
マルカキカイ	7,500	1,119	8,392,500
アルゴグラフィックス	8,500	1,173	9,970,500
ガリバーインターナショナル	7,750	3,565	27,628,750
日本エム・ディ・エム	21,400	259	5,542,600
ポブラ	6,300	556	3,502,800
ユナイテッドアローズ	24,600	2,048	50,380,800
進和	13,700	1,011	13,850,700
エスケイジャパン	5,500	271	1,490,500
ダイトエレクトロン	10,900	368	4,011,200
ハイデイ日高	12,100	1,766	21,368,600
シークス	14,500	1,021	14,804,500
京都きもの友禅	15,300	999	15,284,700
コロワイド	76,000	856	65,056,000
田中商事	8,100	475	3,847,500
オーハシテクニカ	12,700	615	7,810,500
壱番屋	9,200	2,895	26,634,000

マクニカ	11,700	1,746	20,428,200
白銅	7,600	838	6,368,800
トップカルチャー	8,500	381	3,238,500
スギホールディングス	36,600	3,105	113,643,000
島津製作所	278,000	602	167,356,000
J M S	35,000	346	12,110,000
クボテック	52	34,200	1,778,400
モリテックス	5,200	283	1,471,600
長野計器	16,500	700	11,550,000
ブイ・テクノロジー	48	276,900	13,291,200
スター精密	40,900	869	35,542,100
東京計器	74,000	176	13,024,000
愛知時計	26,000	290	7,540,000
日本電産トーソク	11,300	668	7,548,400
東京精密	41,700	1,453	60,590,100
マニー	7,100	3,175	22,542,500
ニコン	434,400	2,721	1,182,002,400
トプコン	46,900	757	35,503,300
オリンパス	274,400	1,799	493,645,600
理研計器	18,900	552	10,432,800
大日本スクリーン	239,000	473	113,047,000
キヤノン電子	21,300	1,907	40,619,100
タムロン	17,900	2,498	44,714,200
H O Y A	565,600	1,792	1,013,555,200
ノーリツ鋼機	21,300	405	8,626,500
エー・アンド・デイ	21,300	346	7,369,800
キヤノン	1,445,600	3,370	4,871,672,000
リコー	700,000	955	668,500,000
日本電産コパル	18,200	711	12,940,200
シチズンホールディングス	262,600	467	122,634,200
リズム時計	105,000	169	17,745,000
大研医器	2,900	1,908	5,533,200
パラマウントベッドHD	20,000	2,668	53,360,000
S H O B I	5,200	395	2,054,000
永大産業	31,000	357	11,067,000
ダンロップスポーツ	12,700	1,002	12,725,400
パンダイナムコHLDGS	240,500	1,235	297,017,500
共立印刷	30,100	249	7,494,900
フランスベッドHLDGS	147,000	177	26,019,000
マーベラスAQL	261	33,800	8,821,800
パイロットコーポレーション	203	168,700	34,246,100
エイベックス・グループHD	43,300	1,858	80,451,400
トッパン・フォームズ	41,600	816	33,945,600
フジシールインターナショナル	28,300	1,902	53,826,600
タカラトミー	76,600	494	37,840,400
廣濟堂	19,700	330	6,501,000
アーク	78,400	181	14,190,400
レック	7,800	1,016	7,924,800
タカノ	10,600	436	4,621,600
プロネクサス	27,600	512	14,131,200
ホクシン	17,100	197	3,368,700

ウッドワン	40,000	305	12,200,000
大建工業	95,000	252	23,940,000
きもと	21,800	735	16,023,000
凸版印刷	657,000	561	368,577,000
大日本印刷	709,000	705	499,845,000
図書印刷	39,000	145	5,655,000
共同印刷	72,000	250	18,000,000
日本写真印刷	35,800	1,236	44,248,800
光村印刷	3,000	264	792,000
藤森工業	18,800	2,421	45,514,800
宝印刷	13,700	607	8,315,900
前澤化成工業	17,400	896	15,590,400
アシックス	216,700	1,396	302,513,200
ツツミ	11,600	2,314	26,842,400
ジェイエスピー	15,900	1,244	19,779,600
ニチハ	27,100	1,079	29,240,900
ローランド	22,300	763	17,014,900
エフピコ	12,000	5,760	69,120,000
小松ウオール工業	8,800	1,216	10,700,800
ヤマハ	171,200	939	160,756,800
河合楽器	81,000	172	13,932,000
クリナップ	24,000	670	16,080,000
ピジョン	17,600	4,545	79,992,000
天馬	19,500	931	18,154,500
兼松日産農林	37,000	159	5,883,000
キングジム	19,600	660	12,936,000
リンテック	49,800	1,659	82,618,200
T A S A K I	5,100	412	2,101,200
信越ポリマー	48,100	339	16,305,900
東リ	64,000	195	12,480,000
イトーキ	48,800	460	22,448,000
任天堂	133,100	9,070	1,207,217,000
三菱鉛筆	19,300	1,523	29,393,900
松風	11,600	804	9,326,400
タカラスタンダード	108,000	640	69,120,000
コクヨ	121,100	631	76,414,100
ナカバヤシ	50,000	185	9,250,000
ニフコ	54,400	1,897	103,196,800
グローブライド	112,000	106	11,872,000
岡村製作所	89,000	646	57,494,000
日本バルカー	102,000	229	23,358,000
M U T O Hホールディングス	32,000	224	7,168,000
伊藤忠	1,832,500	962	1,762,865,000
丸紅	1,884,000	642	1,209,528,000
スクロール	30,100	264	7,946,400
高島	43,000	302	12,986,000
F & A アクアホールディングス	17,600	1,002	17,635,200
三陽商会	128,000	246	31,488,000
長瀬産業	130,100	956	124,375,600
ナイガイ	92,000	61	5,612,000
蝶理	14,700	987	14,508,900

豊田通商	256,000	2,219	568,064,000
オンワードホールディングス	162,000	713	115,506,000
三共生興	39,700	313	12,426,100
兼松	490,000	139	68,110,000
美津濃	115,000	415	47,725,000
ツカモトコーポレーション	38,000	152	5,776,000
ファミリーマート	70,500	3,610	254,505,000
ルック	41,000	378	15,498,000
三井物産	1,982,800	1,366	2,708,504,800
日本紙バルブ	120,000	297	35,640,000
東京エレクトロン	195,700	3,965	775,950,500
日立ハイテクノロジーズ	69,600	1,819	126,602,400
カメイ	27,000	807	21,789,000
東都水産	43,000	141	6,063,000
スターゼン	79,000	257	20,303,000
セイコーHD	148,000	233	34,484,000
山善	88,500	678	60,003,000
橋本興業	23,000	250	5,750,000
住友商事	1,355,700	1,139	1,544,142,300
日本ユニシス	63,300	606	38,359,800
内田洋行	49,000	258	12,642,000
三菱商事	1,792,300	1,761	3,156,240,300
第一実業	53,000	421	22,313,000
キャノンマーケティングJPN	76,300	1,273	97,129,900
西華産業	83,000	259	21,497,000
佐藤商事	20,500	598	12,259,000
菱洋エレクトロ	27,200	833	22,657,600
東京産業	23,500	285	6,697,500
ユアサ商事	236,000	173	40,828,000
神鋼商事	60,000	180	10,800,000
阪和興業	230,000	345	79,350,000
カナデン	2,000	525	1,050,000
菱電商事	35,000	533	18,655,000
ニプロ	123,800	623	77,127,400
フルサト工業	12,600	771	9,714,600
岩谷産業	256,000	345	88,320,000
すてきナイスグループ	94,000	250	23,500,000
昭光通商	86,000	137	11,782,000
ニチモウ	34,000	213	7,242,000
極東貿易	28,000	175	4,900,000
イワキ	36,000	182	6,552,000
兼松エレクトロニクス	14,700	1,059	15,567,300
三愛石油	55,000	373	20,515,000
稲畑産業	57,100	613	35,002,300
G S Iクレオス	61,000	124	7,564,000
明和産業	18,300	469	8,582,700
ゴールドウイン	55,000	515	28,325,000
ユニ・チャーム	134,500	4,680	629,460,000
デサント	61,000	542	33,062,000
ヤマトインタ-ナショナル	15,600	387	6,037,200
東邦ホールディングス	73,500	1,658	121,863,000

サンゲツ	40,800	2,171	88,576,800	
ミツウロコグループ	37,200	497	18,488,400	
シナネン	50,000	370	18,500,000	
伊藤忠エネクス	50,900	471	23,973,900	
サンリオ	57,900	3,130	181,227,000	
サンワ テクノス	11,200	687	7,694,400	
リョーサン	37,400	1,578	59,017,200	
新光商事	25,200	765	19,278,000	
トーホー	50,000	332	16,600,000	
三信電気	32,900	595	19,575,500	
東陽テクニカ	33,400	1,043	34,836,200	
モスフード サービス	30,100	1,607	48,370,700	
加賀電子	22,900	778	17,816,200	
三益半導体	20,600	732	15,079,200	
ソーダニツカ	2,000	377	754,000	
立花エレテック	14,000	736	10,304,000	
木曾路	28,200	1,725	48,645,000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
千趣会	41,500	547	22,700,500	
タカキユー	17,500	308	5,390,000	
ケーヨー	38,900	483	18,788,700	
アデランス	29,100	1,166	33,930,600	
上新電機	50,000	854	42,700,000	
日本瓦斯	31,600	1,194	37,730,400	
ベスト電器	72,000	139	10,008,000	
マルエツ	47,000	287	13,489,000	
ロイヤルホールディングス	38,400	1,016	39,014,400	
東天紅	17,000	203	3,451,000	
いなげや	25,800	993	25,619,400	
島忠	51,900	1,844	95,703,600	
チヨダ	27,000	2,214	59,778,000	
ライフコーポレーション	14,500	1,272	18,444,000	
カスミ	47,200	555	26,196,000	
リンガーハット	20,900	1,095	22,885,500	
さが美	18,000	129	2,322,000	
MR MAX	23,200	338	7,841,600	
テナライド	18,300	293	5,361,900	
AOKIホールディングス	20,200	2,023	40,864,600	
オークワ	36,000	1,099	39,564,000	
コメリ	35,300	2,252	79,495,600	
青山商事	63,200	1,658	104,785,600	
しまむら	26,600	8,650	230,090,000	
CFSコーポレーション	15,400	399	6,144,600	
高島屋	311,000	626	194,686,000	
松屋	46,300	887	41,068,100	
エイチ・ツー・オーリテイリング	149,000	770	114,730,000	
丸栄	40,000	105	4,200,000	
ニッセンHD	41,400	324	13,413,600	
パルコ	44,000	987	43,428,000	
丸井グループ	299,600	676	202,529,600	
クレディセゾン	201,100	2,062	414,668,200	
原信ナルスHLDGS	12,800	1,622	20,761,600	
井筒屋	123,000	85	10,455,000	
ダイエー	133,650	216	28,868,400	
イズミヤ	87,000	483	42,021,000	
イオン	809,500	1,003	811,928,500	
ユニー	219,700	623	136,873,100	
イズミ	56,900	1,888	107,427,200	
東武ストア	32,000	279	8,928,000	
平和堂	46,500	1,241	57,706,500	
フジ	25,700	1,852	47,596,400	
ヤオコー	11,600	3,300	38,280,000	
ゼビオ	31,100	1,902	59,152,200	
ケーブホールディングス	57,300	2,328	133,394,400	

P a l t a c	24,900	1,047	26,070,300
O L Y M P I C	13,700	820	11,234,000
日産東京販売HD	34,000	346	11,764,000
新生銀行	1,988,000	170	337,960,000
あおぞら銀行	835,000	254	212,090,000
三菱UFJフィナンシャルG	17,392,200	479	8,330,863,800
りそなホールディングス	2,362,300	406	959,093,800
三井住友トラストHD	4,802,000	307	1,474,214,000
三井住友フィナンシャルG	1,737,000	3,330	5,784,210,000
第四銀行	296,000	283	83,768,000
北越銀行	235,000	184	43,240,000
西日本シティ銀行	806,000	221	178,126,000
千葉銀行	886,000	533	472,238,000
横浜銀行	1,461,000	427	623,847,000
常陽銀行	866,000	430	372,380,000
群馬銀行	519,000	434	225,246,000
武蔵野銀行	37,000	2,945	108,965,000
千葉興業銀行	43,800	630	27,594,000
筑波銀行	95,500	319	30,464,500
東京都民銀行	43,600	868	37,844,800
七十七銀行	360,000	363	130,680,000
青森銀行	172,000	260	44,720,000
秋田銀行	158,000	258	40,764,000
山形銀行	140,000	398	55,720,000
岩手銀行	16,600	3,820	63,412,000
東邦銀行	194,000	285	55,290,000
東北銀行	119,000	147	17,493,000
みちのく銀行	115,000	178	20,470,000
ふくおかフィナンシャルG	932,000	360	335,520,000
静岡銀行	673,000	870	585,510,000
十六銀行	288,000	303	87,264,000
スルガ銀行	224,000	1,133	253,792,000
八十二銀行	423,000	449	189,927,000
山梨中央銀行	140,000	371	51,940,000
大垣共立銀行	306,000	297	90,882,000
福井銀行	199,000	178	35,422,000
北國銀行	266,000	330	87,780,000
清水銀行	7,800	2,593	20,225,400
滋賀銀行	216,000	545	117,720,000
南都銀行	229,000	402	92,058,000
百五銀行	207,000	405	83,835,000
京都銀行	411,000	748	307,428,000
三重銀行	96,000	198	19,008,000
ほくほくフィナンシャルG	1,609,000	135	217,215,000
広島銀行	678,000	386	261,708,000
山陰合同銀行	135,000	634	85,590,000
中国銀行	177,000	1,254	221,958,000
鳥取銀行	73,000	181	13,213,000
伊予銀行	246,000	708	174,168,000
百十四銀行	252,000	326	82,152,000
四国銀行	166,000	238	39,508,000

阿波銀行	189,000	514	97,146,000
鹿児島銀行	160,000	570	91,200,000
大分銀行	135,000	314	42,390,000
宮崎銀行	153,000	219	33,507,000
肥後銀行	189,000	494	93,366,000
佐賀銀行	140,000	203	28,420,000
十八銀行	147,000	232	34,104,000
沖縄銀行	17,100	3,505	59,935,500
琉球銀行	47,800	1,012	48,373,600
八千代銀行	11,800	2,059	24,296,200
セブン銀行	775,300	223	172,891,900
みずほフィナンシャルG	29,595,800	169	5,001,690,200
紀陽ホールディングス	916,000	132	120,912,000
山口フィナンシャルG	229,000	810	185,490,000
アクリーティブ	131	14,110	1,848,410
芙蓉総合リース	21,900	3,065	67,123,500
興銀リース	34,700	2,444	84,806,800
東京センチュリーリース	53,900	1,896	102,194,400
S B Iホールディングス	292,100	744	217,322,400
日本証券金融	88,500	569	50,356,500
大阪証券金融	31,300	244	7,637,200
アイフル	191,500	627	120,070,500
日本アジア投資	158,000	77	12,166,000
ポケットカード	23,500	458	10,763,000
長野銀行	82,000	161	13,202,000
名古屋銀行	208,000	324	67,392,000
北洋銀行	345,700	266	91,956,200
愛知銀行	8,300	4,755	39,466,500
第三銀行	131,000	164	21,484,000
中京銀行	95,000	198	18,810,000
東日本銀行	101,000	208	21,008,000
大光銀行	82,000	215	17,630,000
愛媛銀行	135,000	232	31,320,000
トマト銀行	90,000	178	16,020,000
みなと銀行	208,000	159	33,072,000
京葉銀行	189,000	417	78,813,000
関西アーバン銀行	320,000	118	37,760,000
栃木銀行	115,000	316	36,340,000
北日本銀行	6,700	2,448	16,401,600
東和銀行	246,000	103	25,338,000
福島銀行	281,000	91	25,571,000
大東銀行	146,000	91	13,286,000
リコーリース	15,900	2,186	34,757,400
イオン クレジットサービス	83,700	1,677	140,364,900
アコム	46,170	2,435	112,423,950
ジャックス	127,000	444	56,388,000
オリコ	443,500	344	152,564,000
日立キャピタル	45,200	1,759	79,506,800
オリックス	119,510	9,330	1,115,028,300
三菱UFJリース	58,290	3,930	229,079,700
ジャフコ	31,500	2,571	80,986,500

トモニホールディングス	176,200	392	69,070,400
大和証券G本社	2,275,000	464	1,055,600,000
野村ホールディングス	4,695,200	490	2,300,648,000
岡三証券グループ	196,000	449	88,004,000
丸三証券	70,400	473	33,299,200
東洋証券	86,000	232	19,952,000
東海東京HD	264,000	398	105,072,000
光世証券	56,000	168	9,408,000
水戸証券	67,000	239	16,013,000
いちよし証券	51,700	605	31,278,500
松井証券	136,300	804	109,585,200
N K S Jホールディングス	510,300	1,912	975,693,600
だいこう証券ビジ	13,700	427	5,849,900
マネックスG	2,596	23,640	61,369,440
カブドットコム証券	93,800	400	37,520,000
極東証券	30,800	909	27,997,200
岩井コスモホールディング	22,000	460	10,120,000
フィデアホール	131,800	197	25,964,600
池田泉州HD	189,500	518	98,161,000
MS & AD	686,400	1,881	1,291,118,400
SONY FH	220,000	1,540	338,800,000
小林洋行	5,200	188	977,600
第一生命	12,282	131,700	1,617,539,400
東京海上HD	889,600	2,687	2,390,355,200
アサックス	42	121,400	5,098,800
NECキャピタルソリューション	9,500	1,332	12,654,000
T & Dホールディングス	787,800	1,147	903,606,600
三井不動産	1,083,000	2,067	2,238,561,000
三菱地所	1,608,000	2,104	3,383,232,000
平和不動産	43,800	1,233	54,005,400
東京建物	438,000	431	188,778,000
ダイビル	59,400	835	49,599,000
東急不動産	501,000	655	328,155,000
京阪神ビルディング	30,700	449	13,784,300
住友不動産	550,000	2,793	1,536,150,000
東宝不動産	21,100	737	15,550,700
太平洋興発	84,000	95	7,980,000
大京	354,000	245	86,730,000
テーオーシー	79,800	589	47,002,200
東京楽天地	27,000	375	10,125,000
レオパレス21	184,400	344	63,433,600
フジ住宅	29,900	496	14,830,400
空港施設	28,700	429	12,312,300
明和地所	12,200	490	5,978,000
住友不動産販売	8,360	4,235	35,404,600
ゴールドクレスト	18,400	1,473	27,103,200
東栄住宅	15,900	1,261	20,049,900
リロ・ホールディング	8,300	3,355	27,846,500
日本エスリード	10,400	867	9,016,800
東急リパブル	24,400	1,414	34,501,600

飯田産業	21,900	1,070	23,433,000
日神不動産	14,000	567	7,938,000
アーネストワン	38,100	1,554	59,207,400
タカラレーベン	24,200	966	23,377,200
サンヨーハウジ 名古屋	124	105,500	13,082,000
イオンモール	104,800	2,175	227,940,000
フージャースコーポレーション	307	66,600	20,446,200
タクトホーム	123	122,900	15,116,700
ランド	52,400	8	419,200
トーセイ	299	55,400	16,564,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,430	87,700	125,411,000
サンフロンティア不動産	189	43,450	8,212,050
ランドビジネス	156	37,150	5,795,400
グランディハウス	5,300	813	4,308,900
東武鉄道	1,321,000	483	638,043,000
相鉄ホールディングス	373,000	306	114,138,000
東京急行	1,370,000	492	674,040,000
京浜急行	598,000	777	464,646,000
小田急電鉄	746,000	910	678,860,000
京王電鉄	651,000	654	425,754,000
京成電鉄	349,000	771	269,079,000
富士急行	64,000	510	32,640,000
新京成電鉄	31,000	358	11,098,000
東日本旅客鉄道	429,200	5,790	2,485,068,000
西日本旅客鉄道	200,600	3,460	694,076,000
東海旅客鉄道	193,500	7,260	1,404,810,000
西日本鉄道	302,000	349	105,398,000
ハマキョウレックス	6,600	2,810	18,546,000
サカイ引越センター	4,300	1,889	8,122,700
近畿日本鉄道	2,102,000	368	773,536,000
阪急阪神HLDGS	1,470,000	465	683,550,000
南海電鉄	485,000	405	196,425,000
京阪電鉄	522,000	395	206,190,000
名糖運輸	10,100	612	6,181,200
名古屋鉄道	812,000	237	192,444,000
日本通運	921,000	365	336,165,000
ヤマトホールディングス	439,600	1,394	612,802,400
山九	283,000	354	100,182,000
日新	89,000	223	19,847,000
丸運	14,000	213	2,982,000
丸全昭和運輸	79,000	257	20,303,000
センコー	93,000	419	38,967,000
トナミホールディングス	48,000	183	8,784,000
日本梱包運輸	75,100	1,084	81,408,400
日石輸送	28,000	204	5,712,000
福山通運	141,000	456	64,296,000
セイノーホールディングス	180,000	571	102,780,000
神奈川中央交通	28,000	477	13,356,000
日立物流	40,300	1,291	52,027,300
日本郵船	1,843,000	216	398,088,000
商船三井	1,133,000	280	317,240,000

川崎汽船	1,018,000	155	157,790,000
N S ユナイテッド海運	101,000	133	13,433,000
乾 汽 船	27,800	309	8,590,200
明治海運	21,000	321	6,741,000
飯野海運	96,700	354	34,231,800
共栄タンカー	19,000	211	4,009,000
第一中央汽船	171,000	90	15,390,000
日本航空	196,400	3,635	713,914,000
全日本空輸	4,574,000	184	841,616,000
パスコ	21,000	283	5,943,000
三菱倉庫	165,000	1,298	214,170,000
三井倉庫	108,000	359	38,772,000
住友倉庫	156,000	448	69,888,000
渋沢倉庫	61,000	270	16,470,000
ヤマタネ	107,000	134	14,338,000
東陽倉庫	38,000	212	8,056,000
日本トランスシティ	54,000	338	18,252,000
ケイヒン	43,000	129	5,547,000
安田倉庫	18,600	608	11,308,800
東洋埠頭	69,000	154	10,626,000
宇徳	19,100	263	5,023,300
上 組	258,000	689	177,762,000
サンリツ	1,700	580	986,000
キムラユニティー	5,500	819	4,504,500
キューソー流通システム	6,600	915	6,039,000
郵船ロジスティクス	18,300	899	16,451,700
近鉄エクスプレス	20,800	3,020	62,816,000
東海運	13,300	267	3,551,100
エーアイティー	2,000	1,406	2,812,000
東京放送HD	124,000	936	116,064,000
日本テレビH L D S	209,700	1,232	258,350,400
テレビ朝日	58,200	1,286	74,845,200
スカパーJ S A T H D	1,997	40,250	80,379,250
テレビ東京HD	16,900	947	16,004,300
アイ・ティー・シーネットワーク	20,600	671	13,822,600
N E C モバイリング	8,400	3,780	31,752,000
日本電信電話	966,900	3,725	3,601,702,500
K D D I	324,000	6,100	1,976,400,000
光通信	23,100	3,840	88,704,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,925	128,500	2,431,862,500
G M O インターネット	76,600	609	46,649,400
学研ホールディングス	69,000	302	20,838,000
ゼンリン	30,400	1,246	37,878,400
昭文社	14,200	582	8,264,400
角川グループH L D G S	19,700	2,428	47,831,600
インプレスホールディングス	19,400	136	2,638,400
東京電力	1,974,300	221	436,320,300
中部電力	712,100	1,160	826,036,000
関西電力	949,700	922	875,623,400
中国電力	321,800	1,360	437,648,000

北陸電力	228,000	1,045	238,260,000
東北電力	581,400	826	480,236,400
四国電力	209,600	1,342	281,283,200
九州電力	514,000	984	505,776,000
北海道電力	217,800	1,058	230,432,400
沖縄電力	13,900	2,876	39,976,400
電源開発	144,400	2,137	308,582,800
東京瓦斯	2,794,000	413	1,153,922,000
大阪瓦斯	2,258,000	322	727,076,000
東邦瓦斯	592,000	482	285,344,000
北海道瓦斯	42,000	241	10,122,000
西部瓦斯	262,000	223	58,426,000
静岡瓦斯	60,500	614	37,147,000
アイネット	10,100	672	6,787,200
松竹	151,000	948	143,148,000
東宝	164,200	1,679	275,691,800
エイチ・アイ・エス	19,800	2,963	58,667,400
東映	96,000	479	45,984,000
AOI Pro.	7,500	576	4,320,000

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
NTTデータ	1,418	271,800	385,412,400	
共立メンテナンス	12,100	2,032	24,587,200	
イチネンホールディングス	25,700	609	15,651,300	
建設技術研究所	13,600	617	8,391,200	
スペース	13,400	692	9,272,800	
アインファーマシーズ	12,700	4,575	58,102,500	
燦ホールディングス	5,500	1,256	6,908,000	
スバル興業	3,000	335	1,005,000	
東京テアトル	97,000	141	13,677,000	
よみうりランド	49,000	365	17,885,000	
東京都競馬	189,000	216	40,824,000	
常磐興産	75,000	153	11,475,000	
カナモト	28,000	1,368	38,304,000	
東京ドーム	180,000	353	63,540,000	
D T S	21,900	1,083	23,717,700	
スクウェア・エニックス・HD	83,400	1,114	92,907,600	
シーイーシー	15,300	570	8,721,000	
カブコン	43,900	1,400	61,460,000	
アゴーラ・ホスピタリティーG	105,000	24	2,520,000	
日本空港ビルデング	79,600	921	73,311,600	
トランス・コスモス	31,700	957	30,336,900	
乃村工藝社	52,000	374	19,448,000	
ジャステック	13,700	536	7,343,200	
S C S K	54,400	1,524	82,905,600	
藤田観光	62,000	303	18,786,000	
K N T - C Tホールディングス	77,000	124	9,548,000	
日本管財	9,100	1,591	14,478,100	
トーカイ	10,800	2,273	24,548,400	
白 洋 舎	5,000	212	1,060,000	
セコム	252,800	4,490	1,135,072,000	
日本システムウエア	7,800	348	2,714,400	
セントラル警備保障	11,200	828	9,273,600	
アイネス	31,300	610	19,093,000	
丹青社	22,000	324	7,128,000	
メイテック	37,600	2,017	75,839,200	
T K C	21,300	1,536	32,716,800	
アサツー ディ・ケイ	40,100	2,184	87,578,400	
富士ソフト	32,600	1,650	53,790,000	
応用地質	25,600	1,055	27,008,000	
船井総合研究所	25,600	563	14,412,800	
N S D	45,300	798	36,149,400	
進学会	12,300	340	4,182,000	
丸紅建材リース	20,000	178	3,560,000	
コナミ	103,700	1,815	188,215,500	
ベネッセホールディングス	74,000	3,845	284,530,000	
イオンディライト	23,500	1,694	39,809,000	

ナック	5,500	2,310	12,705,000
福井コンピュータHLDS	1,500	554	831,000
ニチイ学館	47,500	745	35,387,500
ダイセキ	35,900	1,201	43,115,900
ステップ	7,400	736	5,446,400
日鐵商事	51,000	242	12,342,000
元気寿司	7,200	1,096	7,891,200
トラスコ中山	26,500	1,651	43,751,500
ヤマダ電機	104,710	3,330	348,684,300
オートバックスセブン	28,300	3,750	106,125,000
アークランドサカモト	15,000	1,398	20,970,000
ニトリホールディングス	45,450	6,360	289,062,000
グルメ杵屋	17,000	576	9,792,000
愛眼	19,000	303	5,757,000
吉野家ホールディングス	623	107,300	66,847,900
加藤産業	33,300	1,581	52,647,300
イノテック	19,900	457	9,094,300
イエローハット	21,600	1,364	29,462,400
富士エレクトロニクス	11,800	1,203	14,195,400
松屋フーズ	11,000	1,596	17,556,000
JBC Cホールディングス	19,500	645	12,577,500
J Kホールディングス	19,400	464	9,001,600
サガミチェーン	27,000	677	18,279,000
日伝	10,400	2,144	22,297,600
ミロク情報サービス	15,000	342	5,130,000
北沢産業	11,000	168	1,848,000
杉本商事	12,600	788	9,928,800
因幡電機産業	27,100	2,595	70,324,500
住金物産	121,000	252	30,492,000
プレナス	25,700	1,445	37,136,500
ミニストップ	17,100	1,430	24,453,000
アークス	39,100	1,731	67,682,100
パロー	49,400	1,391	68,715,400
ミスミグループ本社	85,300	2,361	201,393,300
江守商事	5,300	986	5,225,800
アルテック	11,600	211	2,447,600
ベルク	11,300	1,235	13,955,500
大庄	10,900	1,126	12,273,400
タキヒヨー	35,000	450	15,750,000
ファーストリテイリング	46,000	23,640	1,087,440,000
ソフトバンク	1,097,629	3,020	3,314,839,580
スズケン	88,300	2,588	228,520,400
サンドラッグ	43,700	3,150	137,655,000
東京デリカ	7,500	1,031	7,732,500
ジェコス	16,100	610	9,821,000
ヤマザワ	6,100	1,490	9,089,000
やまや	4,700	1,236	5,809,200
ベルーナ	28,650	624	17,877,600
合計	360,487,789		288,061,413,066

*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	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 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
「（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](#)

「国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		873,647,571	876,030,630
国債証券		310,960,050,900	334,182,536,300
地方債証券		27,599,541,199	28,812,766,678
特殊債券		36,028,802,468	33,064,745,956
社債券		28,803,244,940	29,476,121,980
未収利息		1,197,897,440	1,194,438,844
前払費用		40,940,020	64,014,583
流動資産合計		405,504,124,538	427,670,654,971
資産合計		405,504,124,538	427,670,654,971
負債の部			
流動負債			
未払解約金		49,249,000	191,180,000
流動負債合計		49,249,000	191,180,000
負債合計		49,249,000	191,180,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	355,473,910,842	368,547,050,465
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		49,980,964,696	58,932,424,506
元本等合計		405,454,875,538	427,479,474,971
純資産合計		405,454,875,538	427,479,474,971
負債純資産合計		405,504,124,538	427,670,654,971

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>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。</p>
--------------------	---

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1. 1 本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	382,815,805,870円	355,473,910,842円
同期中追加設定元本額	45,298,515,774円	65,764,231,532円
同期中一部解約元本額	72,640,410,802円	52,691,091,909円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	5,155,256,189円	3,991,216,113円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	8,922,325,995円	9,774,671,371円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,726,495,700円	3,017,915,316円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	4,167,936,865円	4,653,416,935円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,613,401,322円	1,837,401,615円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,162,260,661円	1,205,781,061円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,144,513,455円	1,246,466,334円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	143,628,591円	164,434,297円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	187,546,557円	171,444,580円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,054,399,443円	2,111,906,126円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,400,626円	4,544,968円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	- 円	252,886円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	- 円	140,671円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	- 円	23,301円
投資のコンシェルジュ	- 円	15,516,654円

クルーズコントロール	- 円	9,210,180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	6,676,001円
D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	19,646,256,891円	14,957,916,660円
D I A M国内債券パッシ ブ私募ファンド(適格機 関投資家限定)	110,129,562円	- 円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	786,265,876円	728,798,402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)	11,483,027,617円	12,032,808,688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)	621,814,679円	705,141,298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)	440,076,924円	485,451,984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)	1,083,119,886円	1,184,383,018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)	494,258,303円	510,141,484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)	347,099,993円	385,983,341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)	27,029,746,082円	29,480,241,613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)	8,918,132,672円	9,769,462,046円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	12,545,486,322円	13,019,722,192円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	4,608,440,444円	4,819,111,382円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	7,044,247,918円	7,448,476,648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)	1,633,954,855円	1,670,954,094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)	5,968,970,466円	6,098,817,308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)	7,324,395,966円	7,346,245,786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)	13,597,303,957円	14,072,147,308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）	708,137,610円	608,623,338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）	13,259,924,844円	13,481,093,387円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA（適格機関投資家限 定）	6,699,998,806円	7,151,217,773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）	1,421,114,722円	1,494,650,417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）	100,827,988,739円	106,724,960,968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）	2,463,053,761円	2,499,662,584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）	9,343,943,979円	9,625,232,600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）	30,791,603,401円	32,937,435,569円
D I A Mバランス30V A（適格機関投資家限 定）	2,155,530,686円	2,071,352,106円
D I A Mバランス50V A（適格機関投資家限 定）	228,742円	261,734円
D I A Mバランス70V A（適格機関投資家限 定）	139,716円	163,175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）	33,787,052,960円	35,827,613,691円
D I A M世界バランス2 5VA（適格機関投資家 限定）	749,365,188円	912,114,674円
D I A M国内バランス3 0VA（適格機関投資家 限定）	196,036,686円	201,397,299円
D I A Mバランス20V A（適格機関投資家限 定）	2,059,389,385円	2,054,001,727円
D I A Mバランス40V A（適格機関投資家限 定）	304,419円	339,154円
D I A Mバランス60V A（適格機関投資家限 定）	216,500円	247,769円
計	355,473,910,842円	368,547,050,465円
2 . 受益権の総数	355,473,910,842口	368,547,050,465口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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)有価証券 「(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)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	6,918,869,400	1,367,061,600
地方債証券	269,324,504	12,073,749
特殊債証券	328,958,769	10,446,711
社債証券	563,869,500	46,541,540
合計	6,953,283,173	1,391,082,680

（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期末日までの期間（平成23年2月15日から平成24年1月11日まで及び平成24年2月15日から平成25年1月11日まで）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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1406円	1.1599円
（1万口当たり純資産額）	（11,406円）	（11,599円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25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 1 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,420,000	
	3 1 4 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,500,345,000	
	3 1 5 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,480,000	
	3 1 6 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,500,650,000	
	3 1 7 回 利付国庫債券(2年)	2,500,000,000	2,500,700,000	
	3 1 8 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,580,000	
	3 1 9 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,620,000	
	3 2 1 回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,200,748,000	
	3 2 2 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,720,000	
	3 2 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,760,000	
	8 1 回 利付国庫債券(5年)	5,700,000,000	5,748,051,000	
	8 3 回 利付国庫債券(5年)	3,100,000,000	3,136,146,000	
	8 5 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,525,950,000	
	8 7 回 利付国庫債券(5年)	3,800,000,000	3,830,666,000	
	8 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,850,000	
	8 9 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,333,282,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,420,496,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,023,480,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,352,718,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,032,580,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,519,695,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,041,640,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,031,830,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,021,480,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,517,075,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,531,725,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,514,465,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,511,440,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,001,460,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	616,128,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,023,010,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,323,335,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	959,930,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,014,290,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,145,423,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,768,715,000	
	2 6 6 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,358,374,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,539,675,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,441,328,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,449,350,000	
	2 7 4 回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,499,480,000	
	2 7 7 回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,620,250,000	

280回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,973,012,000	
282回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,598,594,000	
284回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,442,002,000	
285回 利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,261,480,000	
286回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,400,243,000	
288回 利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,859,128,000	
289回 利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,155,411,000	
290回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,656,975,000	
293回 利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,561,830,000	
296回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,750,110,000	
297回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,732,855,000	
299回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,348,460,000	
301回 利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,864,960,000	
303回 利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,988,860,000	
305回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,345,713,000	
306回 利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,585,391,000	
308回 利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,905,804,000	
309回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,566,105,000	
310回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,659,435,000	
312回 利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,882,632,000	
313回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	5,069,616,000	
315回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,662,505,000	
317回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,591,325,000	
318回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,261,380,000	
319回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,586,175,000	
320回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,564,075,000	
321回 利付国庫債券(10年)	6,300,000,000	6,446,223,000	
323回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,024,620,000	
324回 利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,512,285,000	
325回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,502,420,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,483,470,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	118,208,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	112,017,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	220,498,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,072,000	
5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	215,790,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	221,560,000	
7回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	327,150,000	
8回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	502,570,000	
11回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	393,436,000	
12回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	314,985,000	
13回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	309,588,000	
14回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	550,205,000	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	223,372,000	
16回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	446,444,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	219,554,000	
18回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	884,968,600	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	215,802,000	
20回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	334,353,000	
21回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	538,820,000	
22回 利付国庫債券(30年)	470,000,000	523,796,200	

2 3 回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	445,768,000	
2 4 回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	668,616,000	
2 5 回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	645,846,000	
2 6 回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,095,520,000	
2 7 回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,003,356,000	
2 8 回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	892,368,000	
2 9 回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,424,462,000	
3 0 回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,610,505,000	
3 1 回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,262,604,000	
3 2 回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,716,224,000	
3 3 回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,510,755,000	
3 4 回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,572,465,000	
3 5 回 利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,208,030,000	
3 6 回 利付国庫債券(30年)	2,600,000,000	2,607,202,000	
3 7 回 利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	1,859,416,000	
3 7 回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,356,000	
3 9 回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	449,952,000	
4 0 回 利付国庫債券(20年)	720,000,000	803,959,200	
4 2 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	912,056,000	
4 3 回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	1,002,416,000	
4 5 回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,022,292,000	
4 6 回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,695,000	
4 7 回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,069,035,000	
4 8 回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	574,730,000	
5 0 回 利付国庫債券(20年)	780,000,000	860,722,200	
5 1 回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	667,110,000	
5 2 回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	616,027,500	
5 4 回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	790,531,000	
5 5 回 利付国庫債券(20年)	810,000,000	900,784,800	
5 7 回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,246,582,100	
5 8 回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	661,650,000	
6 0 回 利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,045,103,400	
6 1 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	812,752,000	
6 2 回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,292,525,000	
6 4 回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	661,662,000	
6 5 回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,212,431,000	
6 7 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,761,520,000	
7 0 回 利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,441,987,500	
7 2 回 利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,400,350,000	
7 3 回 利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,318,900,800	
7 5 回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,566,264,000	
7 8 回 利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,477,737,000	
8 1 回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,546,188,000	
8 3 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,783,088,000	
8 5 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,224,980,000	
8 8 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,701,585,000	
9 0 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,792,176,000	
9 2 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,880,302,000	
9 3 回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	764,127,000	
9 4 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	882,928,000	
9 5 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,916,971,000	

97回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,003,364,000	
99回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,756,704,000	
100回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,775,728,000	
102回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,156,063,000	
105回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,964,502,000	
107回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,851,351,000	
109回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,115,120,000	
111回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,194,600,000	
113回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,376,066,000	
114回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,370,170,000	
116回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,724,075,000	
118回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,268,856,000	
119回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,334,515,000	
121回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,286,218,000	
123回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,348,324,000	
125回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,161,340,000	
128回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,238,004,000	
129回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,016,160,000	
130回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,229,590,000	
132回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,388,024,000	
134回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,211,220,000	
135回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,191,384,000	
137回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,180,882,000	
140回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,472,650,000	
141回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	493,390,000	
国債証券 合計	319,820,000,000	334,182,536,300	
地方債証券			
611回 東京都公募公債	200,000,000	204,894,000	
612回 東京都公募公債	161,500,000	165,174,125	
614回 東京都公募公債	200,000,000	204,548,000	
616回 東京都公募公債	100,000,000	102,474,000	
617回 東京都公募公債	200,000,000	204,908,000	
619回 東京都公募公債	200,000,000	206,126,000	
620回 東京都公募公債	200,000,000	205,340,000	
622回 東京都公募公債	106,800,000	109,795,740	
623回 東京都公募公債	200,000,000	205,756,000	
627回 東京都公募公債	100,000,000	103,732,000	
628回 東京都公募公債	100,000,000	104,266,000	
629回 東京都公募公債	494,000,000	513,053,580	
632回 東京都公募公債	115,300,000	122,149,973	
633回 東京都公募公債	100,000,000	105,846,000	
634回 東京都公募公債	200,000,000	211,804,000	
638回 東京都公募公債	200,000,000	212,850,000	
640回 東京都公募公債	150,000,000	159,538,500	
641回 東京都公募公債	100,000,000	106,476,000	
659回 東京都公募公債	203,500,000	218,579,350	
664回 東京都公募公債	300,000,000	319,209,000	
667回 東京都公募公債	300,000,000	322,356,000	
680回 東京都公募公債	200,000,000	212,456,000	
685回 東京都公募公債	500,000,000	521,275,000	
688回 東京都公募公債	200,000,000	205,450,000	
697回 東京都公募公債	200,000,000	207,028,000	

1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	255,922,500	
1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	202,265,280	
1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	106,801,000	
1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	322,905,000	
2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	214,564,000	
2 2 年度 1 2 回 北海道公募公債	200,000,000	209,388,000	
1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,542,000	
1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	182,046,731	
1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,580,000	
1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,348,000	
1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	160,248,704	
1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	208,184,000	
1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,041,000	
1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	318,393,000	
2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	205,304,000	
2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	103,877,000	
2 8 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	207,974,000	
2 8 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	210,564,000	
2 9 3 回 大阪府公募公債	200,000,000	213,708,000	
3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	106,794,000	
3 0 7 回 大阪府公募公債	100,000,000	107,529,000	
3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	256,281,600	
3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	212,662,000	
3 4 5 回 大阪府公募公債	300,000,000	313,722,000	
3 5 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	204,392,000	
8 3 回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	300,900,000	
1 6 年度 2 回 京都府公募公債	100,000,000	102,326,000	
1 8 年度 1 回 京都府公募公債	100,000,000	105,995,000	
1 6 年度 4 回 兵庫県公募公債	251,970,000	256,938,848	
1 6 年度 8 回 兵庫県公募公債	111,500,000	114,633,150	
1 7 年度 2 回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,612,000	
1 7 年度 9 回 兵庫県公募公債	306,000,000	318,558,240	
1 7 年度 1 3 回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,105,100	
1 8 年度 1 回 兵庫県公募公債	120,000,000	126,379,200	
1 8 年度 5 回 静岡県公募公債	129,800,000	138,061,770	
2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	208,867,280	
2 2 年度 8 回 静岡県公募公債	200,000,000	207,218,000	
2 3 年度 9 回 静岡県公募公債	200,000,000	205,134,000	
1 6 年度 2 回 愛知県公募公債	200,000,000	205,256,000	
1 8 年度 2 回 愛知県公募公債	160,300,000	170,557,597	
2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	107,408,000	
2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	209,026,000	
2 3 年度 2 0 回 愛知県公募公債	300,000,000	307,923,000	
1 6 年度 2 回 広島県公募公債	200,000,000	205,964,000	
2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	211,852,000	
1 7 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,536,000	
1 8 年度 1 回 埼玉県公募公債	200,000,000	210,908,000	
2 1 年度 4 回 埼玉県公募公債	440,000,000	469,867,200	
2 3 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	208,348,000	
1 6 年度 3 回 福岡県公募公債	131,040,000	134,281,929	
1 7 年度 5 回 福岡県公募公債	100,000,000	104,153,000	

17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	103,318,000	
18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	111,328,880	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	214,744,000	
16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	102,860,000	
16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	204,954,000	
17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	205,720,000	
19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	323,424,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	212,868,000	
18年度2回 新潟県公募公債	169,000,000	180,044,150	
12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	131,977,300	
13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	224,882,970	
18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,491,000	
19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,389,100	
20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,548,000	
21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,395,000	
23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,477,000	
25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	312,782,560	
28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,904,000	
29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,630,000	
31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,590,000	
32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,378,000	
33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,927,000	
35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,146,000	
36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,685,000	
37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,167,500	
38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	180,594,400	
39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	154,818,400	
40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	160,311,000	
47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	172,335,088	
55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,616,000	
57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,174,000	
61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,682,000	
65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,496,000	
75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	539,680,000	
80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	750,862,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,787,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	727,713,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,505,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	705,173,000	
17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	102,848,000	
17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	206,618,000	
17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	207,916,000	
17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,419,000	
18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,209,000	
18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	160,072,500	
19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	145,590,750	
12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	205,886,000	
12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	371,838,040	
17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,261,000	
18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	108,797,643	
16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	204,864,000	

17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	107,635,000	
15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	202,620,000	
16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	203,482,000	
17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	307,650,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	208,728,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	210,048,000	
16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	102,993,000	
19年度7回 札幌市公募公債	300,000,000	319,308,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	107,797,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	211,764,000	
18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	106,122,000	
16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	102,432,000	
16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	102,558,000	
地方債証券 合計	27,584,080,000	28,812,766,678	
特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	104,786,640

[前](#) [次](#)

平成25年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
	1 3 回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	129,128,780	
	1 3 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,644,000	
	1 6 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,212,000	
	2 7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	212,850,000	
	4 6 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,310,000	
	3 2 8 回 政保道路債	200,000,000	203,816,000	
	3 2 9 回 政保道路債	100,000,000	102,160,000	
	3 3 3 回 政保道路債	300,000,000	307,980,000	
	3 3 5 回 政保道路債	237,000,000	242,951,070	
	3 3 8 回 政保道路債	264,000,000	272,073,120	
	3 3 9 回 政保道路債	301,000,000	309,879,500	
	1 5 回 高速道路機構債	400,000,000	426,572,000	
	2 5 回 高速道路機構債	300,000,000	321,396,000	
	3 5 回 高速道路機構債	400,000,000	427,584,000	
	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	754,446,000	
	3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,672,000	
	5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	218,701,780	
	8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,127,840	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,113,000	
	1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	320,905,130	
	1 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	130,256,960	
	1 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	337,707,000	
	1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,137,000	
	2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	398,895,000	
	2 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	318,252,000	
	2 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,138,000	
	3 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,317,000	
	3 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	316,468,350	
	3 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	370,212,800	
	4 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	357,175,480	
	4 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	212,874,000	
	5 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	212,412,000	
	6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	207,000,000	224,534,970	
	6 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	173,302,740	

6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	431,488,030	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	638,874,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	213,038,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,164,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,598,000	
3 4 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	204,782,000	
4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	308,550,000	
8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	610,656,000	
8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	264,924,400	
8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	102,371,000	
8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,262,000	
8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,034,000	
8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	268,910,910	
8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	308,733,000	
8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,587,560	
8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	314,126,240	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,682,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	215,712,630	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	252,123,490	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	212,628,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	212,202,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,297,350	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,480,060	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	513,908,400	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	532,660,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	697,553,010	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	108,230,590	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,315,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,271,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	528,680,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,632,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,902,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,967,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,420,000	
1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	306,921,000	
1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,801,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	308,442,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,764,000	
2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	212,776,000	
2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	320,274,000	
1 9 1 回 政保首都高速道路債券	113,000,000	115,936,870	
1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	102,477,000	
1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	110,419,720	
5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	101,857,000	
1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	145,633,780	
1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	107,287,440	
1 2 回 国際協力銀行債券	200,000,000	203,312,000	

1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	204,416,000	
2 回 都市再生債券	100,000,000	102,767,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	217,496,000	
6 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,543,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,400,000	
3 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,850,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,523,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	100,989,000	108,397,553	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	70,624,000	75,458,212	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	105,435,000	112,779,602	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	115,686,000	123,971,431	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	55,549,000	58,978,595	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	285,195,000	299,640,126	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,836,000	71,116,548	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,086,000	53,663,642	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	191,028,000	204,974,954	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	153,045,000	163,179,639	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,800,000	280,477,436	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	368,060,000	386,959,881	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	673,664,000	703,682,467	
1 4 回 政保国民生活債券	132,000,000	135,058,440	
7 0 6 号 利付商工債	300,000,000	304,257,000	
7 1 4 号 利付商工債	300,000,000	304,041,000	
7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	302,469,000	
7 3 2 号 利付商工債	400,000,000	405,632,000	
7 3 6 号 利付商工債	300,000,000	302,769,000	
7 0 9 号 利附農林債	400,000,000	405,492,000	
7 1 3 号 利附農林債	300,000,000	303,189,000	
7 1 7 号 利附農林債	300,000,000	303,432,000	
7 2 1 号 利附農林債	120,000,000	121,143,600	
7 3 7 号 利附農林債	300,000,000	302,937,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	302,427,000	
2 3 3 回 利附信金中金債	300,000,000	304,518,000	
2 3 6 回 利附信金中金債	300,000,000	303,327,000	
2 4 1 回 利附信金中金債	300,000,000	303,012,000	
2 5 3 回 利附信金中金債	300,000,000	303,699,000	
2 6 1 回 利附信金中金債	300,000,000	302,703,000	
1 3 9 号 利附商工債（3年）	300,000,000	300,609,000	
1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,276,340	
2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,085,450	
8 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	181,306,700	
4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,042,700	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	323,508,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	215,998,000	
1 回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	209,510,340	

	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	276,062,920	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	124,864,740	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	307,443,000	
特殊債券 合計		31,631,997,000	33,064,745,956	
社債券	9回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,655,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,219,000	
	14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	103,496,000	
	2回 JPモルガン・チェース劣後債	100,000,000	103,280,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	101,856,000	
	16回 シティグループ円貨社債	100,000,000	101,902,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	204,318,000	
	7回 ウエストバック銀行円貨社債	100,000,000	101,601,000	
	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	101,524,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	306,798,000	
	32回 アサヒビール社債	100,000,000	100,922,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	106,966,000	
	5回 日本たばこ産業社債	100,000,000	101,245,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	104,180,000	
	37回 三菱化学社債	100,000,000	108,386,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	104,440,000	
	11回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,441,000	
	12回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,659,000	
	24回 新日本石油社債	100,000,000	102,845,000	
	29回 新日本製鐵社債	100,000,000	111,551,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	101,656,000	
	64回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,711,000	
	13回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,960,000	
	15回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,598,000	
	25回 富士通社債	100,000,000	102,373,000	
	7回 パナソニック社債	200,000,000	200,760,000	
	10回 パナソニック社債	200,000,000	195,518,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	95,846,000	
	17回 ソニー社債	100,000,000	100,567,000	
	3回 パナソニック電工社債	100,000,000	100,677,000	
	19回 三菱重工業社債	100,000,000	106,330,000	
	49回 日産自動車社債	100,000,000	102,650,000	
	51回 日産自動車社債	100,000,000	101,046,000	
	9回 トヨタ自動車社債	200,000,000	202,532,000	
	49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	109,913,000	
	58回 伊藤忠商事社債	100,000,000	101,155,000	
	77回 丸紅社債	100,000,000	101,249,000	
	91回 丸紅社債	100,000,000	100,273,000	
	30回 住友商事社債	100,000,000	104,506,000	
	69回 三菱商事社債	300,000,000	325,353,000	
	1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	203,506,000	
	7回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	324,132,000	
	15回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,488,000	
	18回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,156,000	

20回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,222,000	
24回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,278,000	
27回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	303,033,000	
29回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	504,030,000	
106回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	303,324,000	
112回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,952,000	
114回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,230,000	
134回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,358,000	
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	102,746,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,512,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	214,126,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	215,370,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,180,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,108,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,819,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	209,754,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	105,157,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,714,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,713,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,917,000	
47回	三井住友銀行社債	200,000,000	202,214,000	
50回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,612,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,928,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	202,098,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,573,000	
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	101,821,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,871,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,597,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,708,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	216,462,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	218,566,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	209,738,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,484,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,450,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	107,038,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	108,074,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	201,438,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,881,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,592,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,705,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	105,683,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	318,699,000	
40回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,803,000	
118回	オリックス社債	100,000,000	102,719,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	103,477,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	204,740,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,923,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,144,000	
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,030,000	
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,504,000	

20回 野村ホールディングス社債	100,000,000	100,679,000	
22回 野村ホールディングス社債	200,000,000	201,128,000	
8回 野村ホールディングス社債	100,000,000	105,239,000	
24回 三井不動産社債	100,000,000	104,073,000	
31回 三井不動産社債	100,000,000	102,342,000	
79回 三菱地所社債	200,000,000	212,606,000	
90回 三菱地所社債	100,000,000	106,794,000	
73回 住友不動産社債	100,000,000	101,141,000	
8回 エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	108,475,000	
41回 小田急電鉄社債	100,000,000	107,026,000	
2回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,896,000	
3回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	223,312,000	
7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,875,000	
19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,267,000	
31回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	203,246,000	
41回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,631,000	
56回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	323,046,000	
3回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,094,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,098,000	
1回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,942,000	
2回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	224,474,000	
6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,438,000	
10回 東海旅客鉄道社債	190,000,000	200,125,100	
23回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,602,000	
3回 東京地下鉄社債	100,000,000	106,133,000	
5回 K D D I 社債	100,000,000	112,219,000	
48回 日本電信電話社債	400,000,000	409,452,000	
50回 日本電信電話社債	100,000,000	103,671,000	
51回 日本電信電話社債	200,000,000	212,628,000	
54回 日本電信電話社債	200,000,000	215,638,000	
58回 日本電信電話社債	100,000,000	101,147,000	
60回 日本電信電話社債	300,000,000	314,466,000	
15回 N T T ドコモ社債	200,000,000	217,406,000	
455回 東京電力社債	200,000,000	181,790,000	
511回 東京電力社債	100,000,000	98,300,000	
516回 東京電力社債	100,000,000	96,563,000	
519回 東京電力社債	372,000,000	355,367,880	
542回 東京電力社債	500,000,000	448,065,000	
407回 中部電力社債	100,000,000	107,182,000	
409回 中部電力社債	300,000,000	333,900,000	
467回 中部電力社債	100,000,000	102,032,000	
468回 中部電力社債	100,000,000	101,932,000	
471回 中部電力社債	300,000,000	305,739,000	
476回 中部電力社債	100,000,000	107,320,000	
478回 中部電力社債	100,000,000	104,708,000	
480回 中部電力社債	200,000,000	209,320,000	
484回 中部電力社債	200,000,000	203,110,000	
496回 中部電力社債	500,000,000	506,200,000	
410回 関西電力社債	300,000,000	301,476,000	
433回 関西電力社債	200,000,000	201,734,000	
441回 関西電力社債	200,000,000	202,596,000	

4 4 6 回 関西電力社債	200,000,000	203,714,000	
2 9 8 回 中国電力社債	200,000,000	216,844,000	
3 1 0 回 中国電力社債	200,000,000	223,076,000	
3 4 1 回 中国電力社債	100,000,000	101,557,000	
3 5 0 回 中国電力社債	200,000,000	203,820,000	
2 4 5 回 北陸電力社債	200,000,000	216,040,000	
2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	109,131,000	
2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	212,736,000	
2 8 9 回 北陸電力社債	300,000,000	305,343,000	
3 6 8 回 東北電力社債	300,000,000	315,681,000	
3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	107,000,000	
3 8 0 回 東北電力社債	300,000,000	329,307,000	
4 2 0 回 東北電力社債	100,000,000	100,790,000	
4 2 7 回 東北電力社債	200,000,000	203,280,000	
4 3 2 回 東北電力社債	500,000,000	518,935,000	
2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	106,981,000	
2 5 7 回 四国電力社債	200,000,000	203,740,000	
3 8 2 回 九州電力社債	100,000,000	101,718,000	
3 8 3 回 九州電力社債	100,000,000	101,799,000	
3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	205,782,000	
2 5 7 回 北海道電力社債	200,000,000	220,832,000	
2 8 4 回 北海道電力社債	500,000,000	513,495,000	
2 8 6 回 北海道電力社債	100,000,000	101,767,000	
6 回 電源開発社債	100,000,000	101,789,000	
1 4 回 電源開発社債	100,000,000	102,829,000	
1 7 回 電源開発社債	100,000,000	105,110,000	
1 4 回 東京ガス社債	100,000,000	107,478,000	
9 回 大阪ガス社債	100,000,000	113,079,000	
2 4 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	102,471,000	
社債券 合計	28,462,000,000	29,476,121,980	
合計	407,498,077,000	425,536,170,914	

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](#)

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,257,853	7,994,465
投資証券		3,460,690,650	13,890,668,820
未収入金		-	12,783,910
未収配当金		52,047,544	162,043,930
流動資産合計		3,514,996,047	14,073,491,125
資産合計		3,514,996,047	14,073,491,125
負債の部			
流動負債			
未払金		-	8,445,000
未払解約金		241,000	964,000
流動負債合計		241,000	9,409,000
負債合計		241,000	9,409,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,093,136,025	14,227,610,808
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	1,578,380,978	163,528,683
元本等合計		3,514,755,047	14,064,082,125
純資産合計		3,514,755,047	14,064,082,125
負債純資産合計		3,514,996,047	14,073,491,125

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1 . 1 本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	4,718,941,254円	5,093,136,025円
同期中追加設定元本額	4,892,978,114円	11,080,757,712円
同期中一部解約元本額	4,518,783,343円	1,946,282,929円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	43,781,811円	48,566,424円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	480,093,400円	596,048,209円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,526,412円	2,524,222円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	- 円	16,922円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	- 円	34,942円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	- 円	52,962円
投資のコンシェルジュ	- 円	518,423円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	- 円	4,521,953,369円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	- 円	1,530,009,840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）	3,750,397,262円	6,867,544,748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）	363,475,224円	295,961,762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）	452,861,916円	364,378,985円
計	5,093,136,025円	14,227,610,808円

2 .	受益権の総数	5,093,136,025口	14,227,610,808口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,578,380,978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163,528,683円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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)有価証券 「(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)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	653,145,923	1,845,180,295
合計	653,145,923	1,845,180,295

（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期末日までの期間（平成23年6月7日から平成24年1月11日まで及び平成24年6月7日から平成25年1月11日まで）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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.6901円	0.9885円
（1万口当たり純資産額）	（6,901円）	（9,885円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	M I Dリート投資法人	566	118,180,800	
	いちご不動産投資法人	2,596	126,555,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	632	371,616,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,388	611,195,200	
	インヴィンシブル投資法人	4,153	28,240,400	
	オリックス不動産投資法人	876	399,456,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	298	158,238,000	
	ケネディクスレジデンシャル投資法人	232	44,474,400	
	ケネディクス不動産投資法人	883	277,703,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,502	155,137,720	
	ジャパンエクセレント投資法人	581	280,913,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,830	1,604,910,000	
	スターツプロシード投資法人	333	44,955,000	
	トップリート投資法人	477	180,783,000	
	フロンティア不動産投資法人	701	539,069,000	
	プレミアム投資法人	606	208,464,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,478	660,756,000	
	阪急リート投資法人	263	112,038,000	
	産業ファンド投資法人	433	291,842,000	
	森トラスト総合リート投資法人	745	543,850,000	
	森ヒルズリート投資法人	713	333,684,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	422	170,910,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	494	348,270,000	
	大和ハウスリート投資法人	377	210,743,000	
	大和証券オフィス投資法人	1,219	371,185,500	
	東急リアル・エステート投資法人	522	250,560,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	600	368,400,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,888	1,733,184,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,541	628,897,500	
	日本リテールファンド投資法人	6,404	1,018,876,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	456	358,416,000	
	日本賃貸住宅投資法人	4,099	246,759,800	
	福岡リート投資法人	379	251,277,000	
平和不動産リート投資法人	2,422	138,780,600		
野村不動産オフィスファンド投資法人	940	477,520,000		
野村不動産レジデンシャル投資法人	465	224,827,500		
投資証券 合計		56,514	13,890,668,820	
合計		56,514	13,890,668,820	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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](#) [次へ](#)

「外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,772,064,269	2,995,117,588
コール・ローン		147,974,661	105,600,490
株式		256,151,315,535	299,969,453,942
投資信託受益証券		837,461,150	1,193,561,263
投資証券		4,207,565,600	5,865,091,266
派生商品評価勘定		65,636,265	96,096,811
未収入金		44,393,879	3,025,308
未収配当金		410,545,051	343,037,809
差入委託証拠金		665,362,488	1,563,569,155
流動資産合計		264,302,318,898	312,134,553,632
資産合計		264,302,318,898	312,134,553,632
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		530,178	2,400
未払解約金		24,364,000	84,532,000
流動負債合計		24,894,178	84,534,400
負債合計		24,894,178	84,534,400
純資産の部			
元本等			
元本	1	223,825,007,857	192,607,329,918
剰余金			
剰余金又は欠損金()		40,452,416,863	119,442,689,314
元本等合計		264,277,424,720	312,050,019,232
純資産合計		264,277,424,720	312,050,019,232
負債純資産合計		264,302,318,898	312,134,553,632

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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>

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1. 1 本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	218,946,599,573円	223,825,007,857円
同期中追加設定元本額	58,808,343,556円	24,312,045,994円
同期中一部解約元本額	53,929,935,272円	55,529,723,933円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,160,905,075円	1,264,941,534円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	32,471,102,298円	34,663,194,038円

D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金> 1 安定 型	206,051,376円	192,635,419円
D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金> 2 安定 ・成長型	1,129,874,746円	1,074,560,241円
D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金> 3 成長 型	1,349,118,541円	1,293,270,382円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファン ド	218,830,130円	192,757,103円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファン ド	556,210,749円	517,224,432円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファン ド	395,187,328円	369,633,085円
マネックス資産設計ファ ンド< 隔月分配型>	73,937,118円	65,245,313円
マネックス資産設計ファ ンド< 育成型>	810,799,004円	805,866,848円
マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	152,569,044円	153,265,189円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国 1 0)	- 円	35,866円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国 2 0)	- 円	55,158円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国 3 0)	- 円	75,205円
投資のコンシェルジュ	- 円	219,014円
クルーズコントロール	- 円	3,128,081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)	575,714,000円	542,138,384円
D I A M外国株式パッシ ブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	5,746,716,635円	5,707,368,590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)	16,543,915,689円	12,254,128,984円
D I A Mワールドバラン ス2 5 V A (適格機関投 資家限定)	100,143,177円	72,514,634円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	9,371,248,475円	7,675,157,100円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1,524,049,561円	1,345,528,917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)	184,616,196円	158,826,564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)	1,059,991,991円	906,017,627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)	96,638,946円	77,853,986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)	169,861,698円	147,335,281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)	17,638,143,945円	15,008,817,486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)	8,728,538,484円	7,461,861,312円
D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	3,068,245,521円	2,484,248,662円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	2,630,100,383円	2,146,629,341円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	6,896,514,050円	5,689,028,414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)	5,376,282,397円	4,219,738,741円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	7,067,524,414円	5,538,044,320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)	4,782,528,160円	3,739,745,900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)	4,430,149,513円	3,576,182,757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)	57,674,003円	51,515,013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)	19,356,115,653円	15,300,439,503円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	3,198,492,340円	2,846,622,975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)	145,100,301円	115,996,456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)	24,662,404,063円	20,371,140,933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)	2,411,197,220円	1,909,202,112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)	4,574,947,245円	3,674,405,812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)	15,063,905,369円	12,575,501,262円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	179,384円	159,888円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	274,212円	250,516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)	19,838,954,865円	16,414,596,880円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	84,710円	73,576円

	D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	169,848円	151,084円
計		223,825,007,857円	192,607,329,918円
2.	受益権の総数	223,825,007,857口	192,607,329,918口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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、株価指数先物取引及び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、株価及び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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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)有価証券 「(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)デリバティブ取引 「(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)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	15,824,531,452	23,967,239,175
投資信託受益証券	70,079,991	226,723,888
投資証券	28,825,338	570,431,456
合計	15,865,786,105	24,764,394,519

(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期末日までの期間（平成23年2月16日から平成24年1月11日まで及び平成24年2月16日から平成25年1月11日まで）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

種類	平成24年1月11日 現在				平成25年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	62,244,900	-	62,238,000	6,900	-	-	-	-
アメリカ・ドル	30,756,000	-	30,752,000	4,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	11,888,780	-	11,888,000	780	-	-	-	-
ユーロ	19,600,120	-	19,598,000	2,120	-	-	-	-
買 建	104,898,170	-	104,900,000	1,830	29,594,900	-	29,592,500	2,400
アメリカ・ドル	53,795,000	-	53,816,000	21,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	11,876,250	-	11,888,000	11,750	-	-	-	-
ユーロ	39,226,920	-	39,196,000	30,920	29,594,900	-	29,592,500	2,400
合計	167,143,070	-	167,138,000	8,730	29,594,900	-	29,592,500	2,400

(注)時価の算定方法

- 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。
- 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。
- 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はありません。

株式関連

種類	平成24年1月11日 現在				平成25年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	2,875,188,280	-	2,940,285,637	65,097,357	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811

合計	2,875,188,280	-	2,940,285,637	65,097,357	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811

(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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1807円	1.6201円
(1万口当たり純資産額)	(11,807円)	(16,201円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	51,153	265.340	13,572,937.020	
	ABBOTT LABORATORIES	222,799	33.850	7,541,746.150	
	AES CORP	99,276	11.090	1,100,970.840	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	154,086	192.880	29,720,107.680	
	ADOBE SYSTEMS INC	66,346	38.620	2,562,282.520	
	ACE LTD	47,929	82.040	3,932,095.160	
	AGCO CORP	14,077	50.990	717,786.230	
	AIRGAS INC	8,926	93.490	834,491.740	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28,677	87.880	2,520,134.760	
	ENERGEN CORP	8,985	48.960	439,905.600	
	ALLEGHANY CORP	1,956	351.360	687,260.160	
	ALLERGAN INC	42,566	103.380	4,400,473.080	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	129,565	46.200	5,985,903.000	
	RALPH LAUREN CORP	8,066	167.480	1,350,893.680	
	ALLSTATE CORP	69,930	42.580	2,977,619.400	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	107,197	66.420	7,120,024.740	
	ALTERA CORPORATION	42,462	34.930	1,483,197.660	
	ALCOA INC	133,644	8.970	1,198,786.680	
	AMGEN INC	108,834	87.810	9,556,713.540	
	HESS CORP	45,289	56.610	2,563,810.290	
	BEAM INC	19,343	60.250	1,165,415.750	
	AMERICAN EXPRESS CO	144,687	60.790	8,795,522.730	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	66,917	43.550	2,914,235.350	
	AFLAC INC	66,968	53.370	3,574,082.160	
	AMERICAN INTL GROUP	198,839	35.800	7,118,436.200	
	ANALOG DEVICES	41,618	42.610	1,773,342.980	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	69,442	77.660	5,392,865.720	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,690	102.570	2,840,163.300	
	NABORS INDUSTRIES LTD	43,474	14.590	634,285.660	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	60,909	30.390	1,851,024.510	
	TIME WARNER	133,226	49.810	6,635,987.060	
	VALERO ENERGY CORP	76,019	34.900	2,653,063.100	
	APACHE CORP	53,401	80.710	4,309,994.710	
	ANSYS INC	12,522	72.260	904,839.720	
APPLE INC	133,134	523.680	69,719,613.120		
APPLIED MATERIALS INC	164,730	11.640	1,917,457.200		
ALBEMARLE CORP	10,917	64.170	700,543.890		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	95,404	28.340	2,703,749.360		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	52.180	708,813.120		
AMEREN CORP	35,614	31.480	1,121,128.720		

ARROW ELECTRONICS INC	17,437	38.570	672,545.090	
AUTOLIV INC	14,963	65.780	984,266.140	
AUTODESK INC	32,299	36.520	1,179,559.480	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	69,806	59.320	4,140,891.920	
AUTOZONE INC	4,733	346.500	1,639,984.500	
AVERY DENNISON CORP	15,202	36.050	548,032.100	
AVNET INC	22,835	31.360	716,105.600	
AVON PRODUCTS INC	61,411	15.510	952,484.610	
BMC SOFTWARE INC	23,251	42.230	981,889.730	
BAKER HUGHES INC	64,277	43.030	2,765,839.310	
BALL CORP	20,878	45.610	952,245.580	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	131,684	94.650	12,463,890.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	172,702	26.830	4,633,594.660	
CR BARD INC	11,903	102.780	1,223,390.340	
BAXTER INTERNATIONAL INC	76,611	68.430	5,242,490.730	
BED BATH & BEYOND INC	32,751	56.700	1,856,981.700	
BECTON DICKINSON & CO	28,159	81.680	2,300,027.120	
AMETEK INC	32,620	38.790	1,265,329.800	
VERIZON COMM INC	405,164	43.590	17,661,098.760	
WR BERKLEY CORP	18,150	39.300	713,295.000	
BEST BUY CO INC	44,102	12.210	538,485.420	
YUM! BRANDS INC	66,698	66.250	4,418,742.500	
FIRSTENERGY CORP	57,222	40.120	2,295,746.640	
SLM CORP	73,611	17.650	1,299,234.150	
H&R BLOCK INC	42,326	19.800	838,054.800	
ENSCO PLC-CL A	27,725	61.500	1,705,087.500	
BOEING CO	103,640	77.090	7,989,607.600	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	32.740	484,781.180	
BORGWARNER INC	16,519	72.470	1,197,131.930	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	208,603	6.300	1,314,198.900	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	22,294	64.380	1,435,287.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	237,462	34.090	8,095,079.580	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	6,595	138.750	915,056.250	
ONEOK INC	30,610	44.850	1,372,858.500	
SEMPRA ENERGY	32,273	71.860	2,319,137.780	
FEDEX CORP	42,560	97.700	4,158,112.000	
VERISIGN INC	21,938	38.870	852,730.060	
AMPHENOL CORP	24,477	67.850	1,660,764.450	
BROWN-FORMAN CORP	18,526	62.860	1,164,544.360	
QUANTA SERVICES INC	33,320	29.190	972,610.800	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,732	23.550	605,988.600	
SIRIUS XM RADIO INC	554,178	3.130	1,734,577.140	
CSX CORP	141,789	20.540	2,912,346.060	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	28,666	15.410	441,743.060	
CABOT OIL & GAS CORP	28,561	47.760	1,364,073.360	
CAMPBELL SOUP CO	27,968	35.310	987,550.080	
SEAGATE TECHNOLOGY	54,327	33.680	1,829,733.360	

WHITING PETROLEUM CORP	17,265	47.490	819,914.850	
CONSTELLATION BRANDS INC	21,923	35.680	782,212.640	
CARDINAL HEALTH INC	45,398	42.990	1,951,660.020	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	64,277	37.140	2,387,247.780	
CATERPILLAR INC	91,504	95.080	8,700,200.320	
CELGENE CORP	60,219	95.480	5,749,710.120	
CORE LABORATORIES N.V.	7,859	110.580	869,048.220	
CITRIX SYSTEMS INC	27,277	70.480	1,922,482.960	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	101,910	16.730	1,704,954.300	
CENTURYLINK INC	86,458	40.180	3,473,882.440	
CERNER CORP	21,440	82.210	1,762,582.400	
JPMORGAN CHASE & CO	539,688	46.150	24,906,601.200	
CHUBB CORP	40,064	77.580	3,108,165.120	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,209	55.750	1,182,401.750	
CIGNA CORP	42,832	55.620	2,382,315.840	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	41.200	980,724.800	
CINTAS CORP	15,201	42.690	648,930.690	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	164,569	4.340	714,229.460	
CISCO SYSTEMS INC	758,406	20.440	15,501,818.640	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	21,907	37.740	826,770.180	
CLOROX COMPANY	19,278	75.480	1,455,103.440	
EQUINIX INC	7,423	217.780	1,616,580.940	
COCA-COLA CO/THE	574,317	36.960	21,226,756.320	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	44,836	33.160	1,486,761.760	
COLGATE-PALMOLIVE CO	66,662	107.390	7,158,832.180	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,850	39.020	1,437,887.000	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	85,351	36.960	3,154,572.960	
COMERICA INC	22,997	32.100	738,203.700	
NRG ENERGY, INC.	44,248	23.140	1,023,898.720	
COMCAST CORP-CL A	296,431	38.500	11,412,593.500	
CA INC	44,575	23.110	1,030,128.250	
COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	41.680	961,307.520	
CONAGRA FOODS INC	56,067	30.620	1,716,771.540	
CONSOLIDATED EDISON INC	42,306	56.090	2,372,943.540	
CMS ENERGY CORP	35,850	24.950	894,457.500	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	34,776	58.240	2,025,354.240	
MOLSON COORS BREWING CO	21,679	42.340	917,888.860	
CORNING INC	215,508	12.640	2,724,021.120	
DIRECTV	87,516	52.440	4,589,339.040	
CREE INC	15,569	31.860	496,028.340	
COVENTRY HEALTH CARE INC	18,825	44.790	843,171.750	
SEALED AIR CORP	30,348	18.290	555,064.920	
BROADCOM CORP-CL A	74,221	34.830	2,585,117.430	
CUMMINS INC	24,674	112.440	2,774,344.560	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,299	78.490	1,122,328.510	
DR HORTON INC	39,483	20.860	823,615.380	

DANAHER CORP	84,986	59.990	5,098,310.140	
MOODY'S CORP	30,243	53.080	1,605,298.440	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	40,711	75.050	3,055,360.550	
TARGET CORP	87,109	60.310	5,253,543.790	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	9,386	72.300	678,607.800	
DEERE & CO	52,023	89.910	4,677,387.930	
DELL INC	215,547	11.040	2,379,638.880	
MORGAN STANLEY	214,689	20.340	4,366,774.260	
REPUBLIC SERVICES INC	44,916	30.190	1,356,014.040	
THE WALT DISNEY CO	240,989	50.790	12,239,831.310	
DOLLAR TREE INC	35,323	38.140	1,347,219.220	
DOVER CORP	24,097	67.410	1,624,378.770	
DOW CHEMICAL	173,354	33.840	5,866,299.360	
OMNICOM GROUP	37,658	52.050	1,960,098.900	
DTE ENERGY CO	25,524	61.410	1,567,428.840	
XL GROUP PLC	46,751	26.560	1,241,706.560	
DUKE ENERGY CORP	99,368	65.370	6,495,686.160	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	42,768	73.180	3,129,762.240	
FLOWSERVE CORP	7,245	155.250	1,124,786.250	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,429	45.240	788,487.960	
EBAY INC	163,741	53.000	8,678,273.000	
EMC CORP/MASS	302,921	23.850	7,224,665.850	
BANK OF AMERICA CORP	1,527,801	11.780	17,997,495.780	
CITIGROUP INC	415,246	42.830	17,784,986.180	
EASTMAN CHEMICAL CO	23,072	71.170	1,642,034.240	
EATON CORP PLC	63,653	55.930	3,560,112.290	
EATON VANCE CORP	18,014	32.970	593,921.580	
DISH NETWORK CORP	30,117	36.950	1,112,823.150	
ECOLAB INC	40,987	73.150	2,998,199.050	
ELECTRONIC ARTS INC	48,988	14.000	685,832.000	
SALESFORCE.COM INC	19,372	173.120	3,353,680.640	
EMERSON ELECTRIC CO	101,896	55.140	5,618,545.440	
WEATHERFORD INTL LTD	113,841	11.620	1,322,832.420	
ENTERGY CORP	24,617	63.370	1,559,979.290	
EOG RESOURCES INC	38,942	126.100	4,910,586.200	
EQUIFAX INC	15,777	56.110	885,247.470	
EQT CORP	21,454	57.700	1,237,895.800	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,570	63.800	2,141,766.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	28,000	42.540	1,191,120.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	117,005	55.840	6,533,559.200	
EXXON MOBIL CORP	656,348	89.100	58,480,606.800	
FMC CORP	19,858	61.860	1,228,415.880	
NEXTERA ENERGY INC	57,649	71.490	4,121,327.010	
FAMILY DOLLAR STORES	14,298	57.060	815,843.880	
ASSURANT INC	12,594	36.090	454,517.460	
FASTENAL CO	39,611	46.500	1,841,911.500	
FIFTH THIRD BANCORP	129,443	15.700	2,032,255.100	
M&T BANK CORP	15,930	103.540	1,649,392.200	

TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,945	54.670	762,373.150	
FISERV INC	19,124	83.200	1,591,116.800	
FLIR SYSTEMS INC	20,650	23.300	481,145.000	
MACY'S INC	54,708	37.250	2,037,873.000	
FORD MOTOR CO	518,119	13.830	7,165,585.770	
FOREST LABORATORIES INC	34,444	37.300	1,284,761.200	
FOSSIL INC	8,025	100.990	810,444.750	
FRANKLIN RESOURCES INC	20,586	134.010	2,758,729.860	
FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	137,283	35.600	4,887,274.800	
FLEXTRONICS INTL LTD	110,408	6.370	703,298.960	
GAP INC/THE	42,827	31.350	1,342,626.450	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	22,388	40.330	902,908.040	
GENERAL DYNAMICS CORP	41,405	71.650	2,966,668.250	
GENERAL MILLS INC	92,956	41.600	3,866,969.600	
GENUINE PARTS CO	20,859	65.640	1,369,184.760	
GILEAD SCIENCES INC	106,770	77.970	8,324,856.900	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	27,519	59.540	1,638,481.260	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	14.130	518,302.530	
MCKESSON CORP	34,605	101.660	3,517,944.300	
NVIDIA CORP	88,899	12.230	1,087,234.770	
GENERAL ELECTRIC CO	1,502,046	21.170	31,798,313.820	
VW GRAINGER INC	8,547	203.750	1,741,451.250	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	19,877	39.630	787,725.510	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,927	54.100	1,294,450.700	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	35,897	23.180	832,092.460	
HALLIBURTON CO	133,627	36.900	4,930,836.300	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,576	48.760	1,100,805.760	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	64,202	137.370	8,819,428.740	
HARLEY-DAVIDSON INC	31,226	50.360	1,572,541.360	
HARRIS CORP	14,775	50.040	739,341.000	
CONSOL ENERGY INC	30,142	30.900	931,387.800	
HASBRO INC	17,406	37.070	645,240.420	
HENRY SCHEIN INC	10,751	83.360	896,203.360	
DENBURY RESOURCES INC	55,448	16.800	931,526.400	
HJ HEINZ CO	47,379	58.580	2,775,461.820	
HELMERICH & PAYNE INC	15,984	58.870	940,978.080	
HERSHEY FOODS CORP	23,648	75.930	1,795,592.640	
HEWLETT-PACKARD CO	284,847	16.280	4,637,309.160	
F5 NETWORKS INC	11,354	95.710	1,086,691.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	20,737	37.610	779,918.570	
REYNOLDS AMERICAN INC	48,972	42.260	2,069,556.720	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	18,809	70.620	1,328,291.580	
JUNIPER NETWORKS INC	74,887	20.300	1,520,206.100	
HOLLYFRONTIER CORP	30,592	44.440	1,359,508.480	
HOLOGIC INC	34,080	22.680	772,934.400	
UNUM GROUP	42,091	22.120	931,052.920	
HOME DEPOT INC	213,488	63.620	13,582,106.560	

HORMEL FOODS CORP	22,056	34.500	760,932.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	8.610	527,612.190	
CENTERPOINT ENERGY INC	56,244	19.790	1,113,068.760	
HUMANA INC	24,469	69.240	1,694,233.560	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	13,732	61.400	843,144.800	
RED HAT INC	28,834	54.270	1,564,821.180	
BIOGEN IDEC INC	32,847	143.910	4,727,011.770	
ILLINOIS TOOL WORKS	61,471	62.760	3,857,919.960	
INTUIT INC	37,467	62.410	2,338,315.470	
INGERSOLL-RAND PLC	42,735	49.620	2,120,510.700	
INTEL CORP	707,807	21.800	15,430,192.600	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,144	69.050	907,593.200	
INTL GAME TECH	44,449	14.970	665,401.530	
INTERNATIONAL PAPER CO	58,471	40.010	2,339,424.710	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	57,675	11.740	677,104.500	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	45.190	884,820.200	
JOHNSON & JOHNSON	392,088	72.190	28,304,832.720	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	63,376	24.070	1,525,460.320	
JOHNSON CONTROLS INC	94,501	31.490	2,975,836.490	
KLA-TENCOR CORP	24,993	48.590	1,214,409.870	
DEVON ENERGY CORP	55,252	53.880	2,976,977.760	
KELLOGG CO	36,394	57.310	2,085,740.140	
KEYCORP	141,232	8.940	1,262,614.080	
KIMBERLY-CLARK CORP	55,117	84.930	4,681,086.810	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,762	218.750	4,104,187.500	
KOHL'S CORP	29,815	42.500	1,267,137.500	
KROGER CO	75,644	25.550	1,932,704.200	
LSI CORP	89,888	7.110	639,103.680	
LAM RESEARCH CORP	23,217	37.850	878,763.450	
AKAMA I TECHNOLOGIES	25,490	39.500	1,006,855.000	
LEGG MASON INC	13,165	26.840	353,348.600	
LEGGETT & PLATT INC	19,896	27.880	554,700.480	
LENNAR CORP	16,369	41.020	671,456.380	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,757	24.160	743,089.120	
ELI LILLY & CO	152,081	53.250	8,098,313.250	
LIMITED BRANDS	35,739	44.300	1,583,237.700	
LINCOLN NATIONAL CORP	35,107	27.840	977,378.880	
LINEAR TECH CORP	29,629	36.170	1,071,680.930	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	102,280	78.200	7,998,296.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	46,667	43.670	2,037,947.890	
LOCKHEED MARTIN CORP	39,210	94.110	3,690,053.100	
LOEWS CORP	47,689	42.760	2,039,181.640	
RANGE RESOURCES CORP	23,850	63.830	1,522,345.500	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,442	31.020	385,950.840	
LOWE'S COS INC	165,212	35.550	5,873,286.600	
DOMINION RESOURCES INC/VA	80,101	52.220	4,182,874.220	
IRON MOUNTAIN INC	20,204	33.100	668,752.400	

SCANA CORP	17,601	46.520	818,798.520	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	21.940	467,607.220	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,383	12.670	511,652.610	
MCCORMICK & CO INC	17,646	64.680	1,141,343.280	
MCDONALD'S CORPORATION	143,053	91.400	13,075,044.200	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	37,297	54.300	2,025,227.100	
EVEREST RE GROUP LTD	8,102	113.010	915,607.020	
MANPOWER INC	13,462	45.210	608,617.020	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,151	92.030	1,578,406.530	
MARSH & MCLENNAN COS	78,840	35.130	2,769,649.200	
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,643	83.450	804,708.350	
MASCO CORP	58,195	17.470	1,016,666.650	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	98.420	502,138.840	
MATTEL INC	51,106	37.000	1,890,922.000	
METLIFE INC	122,761	36.590	4,491,824.990	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,676	29.640	1,264,916.640	
MEDTRONIC INC	143,715	43.850	6,301,902.750	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,448	10.930	671,626.640	
CVS CAREMARK CORP	180,382	51.230	9,240,969.860	
MERCK & CO. INC.	433,026	42.780	18,524,852.280	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13,584	87.410	1,187,377.440	
MICROSOFT CORP	1,070,180	26.460	28,316,962.800	
MICRON TECH INC	123,712	7.420	917,943.040	
RACKSPACE HOSTING INC	17,320	77.780	1,347,149.600	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	33.550	899,743.900	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	72,353	8.480	613,553.440	
3M CO	92,855	96.890	8,996,720.950	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	94.430	845,903.940	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	36,931	56.780	2,096,942.180	
KANSAS CITY SOUTHERN	16,023	85.400	1,368,364.200	
MURPHY OIL CORPORATION	25,983	60.690	1,576,908.270	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MYLAN LABORATORIES	60,562	28.250	1,710,876.500	
	ILLUMINA INC	17,476	53.640	937,412.640	
	XCEL ENERGY INC	70,697	27.200	1,922,958.400	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	61,489	70.410	4,329,440.490	
	NETAPP INC	48,611	32.420	1,575,968.620	
	SEARS HOLDINGS CORP	6,881	41.300	284,185.300	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,264	28.190	571,242.160	
	NEWELL RUBBERMAID INC	38,632	21.950	847,972.400	
	DUN & BRADSTREET CORP	6,778	79.450	538,512.100	
	NEWMONT MINING CORP	72,187	45.950	3,316,992.650	
	NIKE INC-CL B	106,804	52.550	5,612,550.200	
	NOBLE CORP	34,855	36.400	1,268,722.000	
	NOBLE ENERGY INC	26,091	104.590	2,728,857.690	
	NORDSTROM INC	24,649	54.880	1,352,737.120	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	43,672	64.670	2,824,268.240	
	NORTHEAST UTILITIES	41,026	39.310	1,612,732.060	
	NISOURCE INC	44,250	25.500	1,128,375.000	
	COACH INC	39,046	57.490	2,244,754.540	
	NORTHERN TRUST CORP	31,465	52.410	1,649,080.650	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	33,510	67.400	2,258,574.000	
	WELLS FARGO & CO	713,116	35.400	25,244,306.400	
	NUCOR CORP	44,211	45.470	2,010,274.170	
	MONSANTO CO	75,474	99.470	7,507,398.780	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	84,420	62.870	5,307,485.400	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	113,666	83.010	9,435,414.660	
	OCEANEERING INTERNATIONAL INC	8,094	56.310	455,773.140	
	OGE ENERGY CORP	7,371	57.140	421,178.940	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	15,961	87.740	1,400,418.140	
	OMNICARE INC	18,060	38.270	691,156.200	
	ORACLE CORP	552,798	34.920	19,303,706.160	
	OWENS-ILLINOIS INC	23,621	22.230	525,094.830	
	PACCAR INC	45,266	46.010	2,082,688.660	
	PALL CORP	16,811	64.260	1,080,274.860	
	EXELON CORP	123,783	29.260	3,621,890.580	
	PARKER HANNIFIN CORP	19,641	89.600	1,759,833.600	
	PARTNERRE LTD	8,117	83.170	675,090.890	
	PATTERSON COS INC	12,490	35.600	444,644.000	
	PAYCHEX INC	46,374	31.850	1,477,011.900	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	36.650	511,010.950	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	25,588	19.150	490,010.200	
	PPL CORPORATION	79,342	29.000	2,300,918.000	
	PEPSICO INC	220,467	70.810	15,611,268.270	
	PENTAIR LTD	30,947	50.600	1,565,918.200	
	PERRIGO CO	13,145	110.230	1,448,973.350	

PFIZER INC	1,062,709	26.760	28,438,092.840	
CONOCOPHILLIPS	162,918	58.500	9,530,703.000	
PVH CORP	10,064	117.810	1,185,639.840	
PETSMART INC	16,410	69.430	1,139,346.300	
PG&E CORP	62,245	40.870	2,543,953.150	
PITNEY BOWES INC	24,423	11.900	290,633.700	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,254	112.560	1,942,110.240	
ALTRIA GROUP INC	286,004	32.700	9,352,330.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	73,522	61.140	4,495,135.080	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,883	87.810	428,776.230	
GARMIN LTD	20,043	39.390	789,493.770	
AETNA INC	50,167	45.760	2,295,641.920	
FLUOR CORP (NEW)	21,563	62.630	1,350,490.690	
PPG INDUSTRIES INC	21,536	141.770	3,053,158.720	
PRAXAIR INC	43,509	114.180	4,967,857.620	
PRECISION CASTPARTS CORP	20,340	190.010	3,864,803.400	
COSTCO WHOLESALE CORP	60,870	100.740	6,132,043.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	36,637	68.210	2,499,009.770	
QUEST DIAGNOSTICS	24,069	59.580	1,434,031.020	
PROCTER & GAMBLE CO	391,643	69.270	27,129,110.610	
PROGRESSIVE CORP	88,041	22.380	1,970,357.580	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	72,526	30.140	2,185,933.640	
PULTE GROUP INC	42,914	19.410	832,960.740	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	70,124	13.410	940,362.840	
ULTRA PETROLEUM CORP	22,514	18.140	408,403.960	
QUALCOMM INC	240,541	64.760	15,577,435.160	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	81.520	692,349.360	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,531	183.770	2,119,051.870	
RESMED INC	11,154	44.060	491,445.240	
US BANCORP	268,449	33.640	9,030,624.360	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,239	44.510	945,347.890	
RALCORP HOLDINGS INC	9,036	89.620	809,806.320	
ROSS STORES INC	33,430	57.300	1,915,539.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,158	72.340	734,829.720	
ROPER INDUSTRIES INC	14,467	114.470	1,656,037.490	
ROWAN COMPANIES PLC-A	21,239	34.620	735,294.180	
PEABODY ENERGY CORP	41,483	26.600	1,103,447.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	20,641	86.400	1,783,382.400	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	35.710	799,082.670	
RAYTHEON COMPANY	47,609	58.580	2,788,935.220	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	14,096	80.710	1,137,688.160	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,496	154.830	1,160,605.680	
FMC TECHNOLOGIES INC	31,233	44.430	1,387,682.190	
ACCENTURE PLC-CL A	88,902	69.170	6,149,351.340	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	234,463	27.310	6,403,184.530	

WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	25,010	34.700	867,847.000	
SANDISK CORP	32,067	45.600	1,462,255.200	
SAFEWAY INC	33,577	17.560	589,612.120	
ROCKWELL COLLINS INC	18,475	59.530	1,099,816.750	
ST JUDE MEDICAL INC	46,786	38.160	1,785,353.760	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	56,477	74.450	4,204,712.650	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	34,060	36.540	1,244,552.400	
PRICELINE.COM INC	7,181	653.620	4,693,645.220	
SCHLUMBERGER LTD	187,259	73.250	13,716,721.750	
SCHWAB (CHARLES) CORP	146,770	15.330	2,249,984.100	
JOY GLOBAL INC	16,611	68.700	1,141,175.700	
ZIMMER HOLDINGS INC	25,985	70.710	1,837,399.350	
SPX CORP	7,436	69.830	519,255.880	
BUNGE LTD	21,577	74.620	1,610,075.740	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	24.820	394,191.240	
WELLPOINT INC	47,779	62.240	2,973,764.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	37,481	43.890	1,645,041.090	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	40,716	29.670	1,208,043.720	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,388	162.360	2,173,675.680	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	24,554	22.640	555,902.560	
SIGMA-ALDRICH	17,354	76.730	1,331,572.420	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,807	57.900	3,694,425.300	
ADVANCE AUTO PARTS	10,577	71.760	759,005.520	
UNITED STATES STEEL CORP	20,827	25.730	535,878.710	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	49,291	32.090	1,581,748.190	
EDISON INTERNATIONAL	46,526	45.780	2,129,960.280	
SOUTHERN CO	123,203	43.220	5,324,833.660	
BB&T CORP	102,369	30.540	3,126,349.260	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	11.070	194,034.960	
AT&T INC	820,308	34.370	28,193,985.960	
CHEVRON CORP	278,664	110.470	30,784,012.080	
MEADWESTVACO CORP	27,873	32.610	908,938.530	
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,400	75.830	1,622,762.000	
STAPLES INC	103,831	11.740	1,218,975.940	
STATE STREET CORP	66,808	50.250	3,357,102.000	
STARBUCKS CORP	110,163	54.540	6,008,290.020	
STRYKER CORP	42,687	58.840	2,511,703.080	
NETFLIX INC	7,832	98.000	767,536.000	
STERICYCLE INC	12,270	95.240	1,168,594.800	
SUNTRUST BANKS INC	80,614	28.600	2,305,560.400	
SYMANTEC CORP	104,718	19.940	2,088,076.920	
SYNOPSIS INC	22,281	31.470	701,183.070	
SYSCO CORP	85,065	30.950	2,632,761.750	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,872	508.870	2,988,084.640	
TEXAS INSTRUMENTS INC	164,522	32.430	5,335,448.460	
TEXTRON INC	42,770	26.610	1,138,109.700	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,083	67.540	3,517,685.820	

TIFFANY & CO	19,250	60.400	1,162,700.000	
TOLL BROTHERS INC	20,812	34.090	709,481.080	
TORCHMARK CORP	13,057	53.240	695,154.680	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	23.330	568,482.110	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,301	109.680	1,458,853.680	
TRACTOR SUPPLY CO	11,578	93.040	1,077,217.120	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	15,962	62.040	990,282.480	
TYSON FOODS INC	42,955	20.160	865,972.800	
MARATHON OIL CORP	100,890	32.280	3,256,729.200	
UNION PACIFIC CORP	66,863	131.090	8,765,070.670	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	122,190	84.970	10,382,484.300	
UNITEDHEALTH GROUP INC	145,507	53.110	7,727,876.770	
SPRINT NEXTEL CORP	414,446	5.940	2,461,809.240	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,483	74.880	1,084,487.040	
VF CORP	12,611	150.920	1,903,252.120	
CBS CORP	81,986	38.540	3,159,740.440	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30,143	46.800	1,410,692.400	
VULCAN MATERIALS CO	20,011	54.200	1,084,596.200	
URBAN OUTFITTERS INC	19,027	42.640	811,311.280	
WALGREEN CO	128,614	38.570	4,960,641.980	
WAL-MART STORES INC	265,760	68.360	18,167,353.600	
WASTE MANAGEMENT INC	64,451	34.860	2,246,761.860	
WATERS CORP	12,959	91.260	1,182,638.340	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,235	87.990	1,604,497.650	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,359	89.840	1,379,852.560	
WESTERN DIGITAL CORP	33,429	44.160	1,476,224.640	
WHIRLPOOL CORP	11,190	105.780	1,183,678.200	
WYNN RESORTS LTD	11,234	122.900	1,380,658.600	
WHOLE FOODS MARKET INC	25,017	88.440	2,212,503.480	
NASDAQ OMX GROUP	18,704	26.630	498,087.520	
CME GROUP INC	43,877	53.320	2,339,521.640	
WILLIAMS COS INC	97,327	33.810	3,290,625.870	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,866	47.360	656,693.760	
LKQ CORP	24,935	22.900	571,011.500	
PEPCO HOLDINGS INC	36,572	19.420	710,228.240	
ALLIANT ENERGY CORP	17,827	45.690	814,515.630	
WISCONSIN ENERGY CORP	35,977	37.730	1,357,412.210	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	19,872	47.720	948,291.840	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,983	53.750	697,836.250	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	18.200	452,270.000	
CARMAX INC	29,210	37.730	1,102,093.300	
XEROX CORP	192,809	7.290	1,405,577.610	
XILINX INC	36,827	36.000	1,325,772.000	
YAHOO! INC	156,707	18.990	2,975,865.930	
CIMAREX ENERGY CO	12,720	61.000	775,920.000	
TJX COMPANIES INC	106,033	43.730	4,636,823.090	
HOSPIRA INC	25,220	34.050	858,741.000	

CBRE GROUP INC	50,310	20.550	1,033,870.500	
LIBERTY GLOBAL INC	17,100	66.580	1,138,518.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	198,265	7.350	1,457,247.750	
GOOGLE INC	37,167	741.480	27,558,587.160	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	48,345	9.730	470,396.850	
LAS VEGAS SANDS CORP	57,056	52.440	2,992,016.640	
MOSAIC CO/THE	45,346	59.730	2,708,516.580	
NEWS CORP CLASS B	72,381	27.500	1,990,477.500	
NEWS CORP INC CLASS A	210,910	26.970	5,688,242.700	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,402	30.140	223,096.280	
HERBALIFE LTD	16,408	39.240	643,849.920	
CELANESE CORP	24,956	47.330	1,181,167.480	
WINDSTREAM CORP	73,694	9.920	731,044.480	
VERIFONE HOLDINGS INC	17,494	31.090	543,888.460	
IHS INC-CLASS A	8,495	101.950	866,065.250	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	17,131	67.390	1,154,458.090	
EXPEDIA INC	14,880	62.770	934,017.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,581	217.470	2,083,580.070	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30,485	65.000	1,981,525.000	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	19,052	62.650	1,193,607.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,655	25.470	831,722.850	
GAMESTOP CORP. - CL. A	20,732	22.790	472,482.280	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,969	128.000	1,404,032.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	47.680	367,994.240	
VIACOM INC-CLASS B	64,024	58.500	3,745,404.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,577	298.410	1,365,822.570	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	25.390	259,968.210	
NYSE EURONEXT	34,329	32.450	1,113,976.050	
VIRGIN MEDIA INC	36,074	37.720	1,360,711.280	
TRANSDIGM GROUP INC	7,897	136.090	1,074,702.730	
MASTERCARD INC	15,212	527.650	8,026,611.800	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	78,760	20.930	1,648,446.800	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	19,554	56.180	1,098,543.720	
WESTERN UNION CO	89,216	13.850	1,235,641.600	
WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	27,146	13.190	358,055.740	
SAIC INC	31,598	12.030	380,123.940	
KBR INC	23,562	32.000	753,984.000	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	37,702	17.590	663,178.180	
SPECTRA ENERGY CORP	88,797	27.880	2,475,660.360	
TIME WARNER CABLE INC	45,225	97.950	4,429,788.750	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	59,253	12.620	747,772.860	
DELTA AIR LINES INC	27,412	13.300	364,579.600	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	81.900	504,422.100	

DISCOVER FINANCIAL	76,225	40.480	3,085,588.000	
COVIDIEN PLC	66,215	60.160	3,983,494.400	
TE CONNECTIVITY LTD	56,488	37.200	2,101,353.600	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	86.400	1,286,582.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,687	70.580	966,028.460	
VMWARE INC	12,728	95.940	1,221,124.320	
TERADATA CORP	23,849	64.660	1,542,076.340	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	9,621	94.320	907,452.720	
INVESCO LTD	65,700	27.560	1,810,692.000	
CALPINE CORP NPR	39,169	18.610	728,935.090	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	238,951	87.290	20,858,032.790	
VISA INC	74,752	160.510	11,998,443.520	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	32,381	45.760	1,481,754.560	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	37.610	1,080,347.250	
LORILLARD INC	19,173	116.090	2,225,793.570	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,070	59.650	660,325.500	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,977	61.660	1,170,121.820	
MARATHON PETROLEUM CORP	47,352	62.790	2,973,232.080	
CAREFUSION CORP	34,028	29.650	1,008,930.200	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	95,271	37.100	3,534,554.100	
XYLEM INC	22,549	27.480	619,646.520	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	45,235	60.610	2,741,693.350	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,354	33.520	1,151,546.080	
LINKEDIN CORP	10,017	118.040	1,182,406.680	
HCA HOLDINGS INC	30,625	33.170	1,015,831.250	
NIELSEN HOLDINGS NV	16,327	30.900	504,504.300	
VERISK ANALYTICS INC	19,955	53.870	1,074,975.850	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	29,958	68.190	2,042,836.020	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,603	34.490	503,657.470	
OLAM INTERNATIONAL-RTS	44,070	0.071	3,128.970	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	29,640	26.560	787,238.400	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,909	79.000	545,811.000	
CIT GROUP INC	24,840	40.000	993,600.000	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.820	584,660.000	
DOLLAR GENERAL CORP	36,287	43.380	1,574,130.060	
AON PLC	46,043	58.080	2,674,177.440	
QEP RESOURCES INC	25,069	29.450	738,282.050	
LIBERTY MEDIA CORP - LIBERTY CAPITAL	16,283	122.620	1,996,621.460	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	33.120	509,816.160	
GENERAL MOTORS CO	116,861	30.440	3,557,248.840	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	34,134	38.810	1,324,740.540	

	PHILLIPS 66	84,316	51.510	4,343,117.160	
	FACEBOOK INC	140,256	31.300	4,390,012.800	
	ADT CORP	34,582	46.500	1,608,063.000	
	KRAFT FOODS GROUP INC	81,921	46.010	3,769,185.210	
	PROTHENA CORP PLC	1,893	6.100	11,547.300	
	ABBVIE INC	222,799	34.000	7,575,166.000	
アメリカ・ドル 小計		44,115,725		1,920,804,478.970 (171,374,175,614)	
イギリス・ポ ンド	ABERDEEN ASSET MGMT	146,610	3.801	557,264.610	
	AMEC PLC	48,992	10.640	521,274.880	
	ANTOFAGASTA PLC	58,006	13.220	766,839.320	
	SEVERN TRENT PLC	38,266	15.860	606,898.760	
	BHP BILLITON PLC	297,000	21.320	6,332,040.000	
	BARCLAYS PLC	1,635,581	2.946	4,818,421.620	
	BALFOUR BEATTY PLC	85,204	2.915	248,369.660	
	BT GROUP PLC	1,104,061	2.463	2,719,302.240	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	167,359	7.735	1,294,521.860	
	AGGREKO PLC	36,191	17.710	640,942.610	
	TULLOW OIL PLC	131,211	12.250	1,607,334.750	
	BUNZL PLC	47,967	10.490	503,173.830	
	CAPITA PLC	102,099	7.720	788,204.280	
	AVIVA PLC	395,238	3.680	1,454,475.840	
	CRODA INTERNATIONAL	18,042	23.280	420,017.760	
	DIAGEO PLC	353,748	17.880	6,325,014.240	
	SCHRODERS PLC	14,393	17.790	256,051.470	
	NATIONAL GRID PLC	524,164	6.870	3,601,006.680	
	GKN PLC	203,239	2.400	487,773.600	
	KINGFISHER PLC	332,300	2.833	941,405.900	
	BAE SYSTEMS PLC	462,694	3.480	1,610,175.120	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	274,937	31.700	8,715,502.900	
	COBHAM PLC	147,144	2.246	330,485.420	
NEXT PLC	25,511	39.250	1,001,306.750		
REXAM PLC	138,079	4.619	637,786.900		
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	138,943	24.590	3,416,608.370		
IMI PLC	40,795	11.170	455,680.150		
JOHNSON MATTHEY PLC	29,088	22.950	667,569.600		
SABMILLER PLC	138,786	28.905	4,011,609.330		

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ANGLO AMERICAN PLC	193,936	20.720	4,018,353.920	
	COMPASS GROUP PLC	259,111	7.390	1,914,830.290	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,606,979	6.734	17,555,396.580	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	803,317	1.508	1,211,402.030	
	ARM HOLDINGS PLC	192,233	8.635	1,659,931.950	
	CENTRICA PLC	753,465	3.359	2,530,888.930	
	UNILEVER PLC	186,527	23.870	4,452,399.490	
	MEGGITT PLC	105,280	4.269	449,440.320	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	333,803	2.519	840,849.750	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	105,557	6.925	730,982.220	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	545,195	1.261	687,490.890	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	46,419	15.200	705,568.800	
	PEARSON PLC	112,381	11.930	1,340,705.330	
	PRUDENTIAL PLC	359,024	9.165	3,290,454.960	
	RIO TINTO PLC	188,398	35.115	6,615,595.770	
	VODAFONE GROUP PLC	6,993,483	1.645	11,504,279.530	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	95,035	39.150	3,720,620.250	
	REED ELSEVIER PLC	180,949	6.490	1,174,359.010	
	OLD MUTUAL PLC	731,719	1.835	1,342,704.360	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	263,327	8.910	2,346,243.570	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	296,058	3.568	1,056,334.940	
	SSE PLC	140,642	14.500	2,039,309.000	
	SERCO GROUP PLC	72,250	5.475	395,568.750	
	BP PLC	2,703,163	4.610	12,461,581.430	
	SHIRE PLC	76,870	20.180	1,551,236.600	
	SAGE GROUP PLC(THE)	187,776	3.103	582,668.920	
	INVENSYS PLC	129,397	3.380	437,361.860	
	SMITHS GROUP PLC	59,731	12.130	724,537.030	
	STANDARD CHARTERED PLC	338,092	16.700	5,646,136.400	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,151,142	0.533	3,278,558.680	
	TATE & LYLE PLC	60,088	7.695	462,377.160	
	BG GROUP PLC	478,677	10.415	4,985,420.950	
	TESCO PLC	1,136,015	3.554	4,037,397.310	
	3I GROUP PLC	119,685	2.341	280,182.580	
	SMITH & NEPHEW PLC	123,146	6.890	848,475.940	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	707,217	13.765	9,734,842.000	
	WEIR GROUP	34,823	19.110	665,467.530	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,945	11.390	341,073.550	
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	9.905	600,876.920	
	WPP PLC	170,169	9.205	1,566,405.640	
	WOLSELEY PLC	41,268	30.200	1,246,293.600	

	ASTRAZENECA PLC	176,680	29.965	5,294,216.200	
	WHITBREAD PLC	22,710	24.310	552,080.100	
	CARNIVAL PLC	25,112	24.180	607,208.160	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,941	3.688	844,334.400	
	XSTRATA PLC	293,974	11.620	3,415,977.880	
	INTERTEK GROUP PLC	25,025	31.000	775,775.000	
	BURBERRY GROUP PLC	65,105	12.980	845,062.900	
	INVESTEC PLC	74,705	4.381	327,282.600	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	40,422	17.500	707,385.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	14,891	12.060	179,585.460	
	ICAP PLC	87,128	3.263	284,298.660	
	ITV PLC	446,892	1.077	481,302.680	
	SAINSBURY (J) PLC	190,870	3.257	621,663.590	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	13,509	59.500	803,785.500	
	G4S PLC	231,452	2.616	605,478.430	
	ADMIRAL GROUP PLC	22,361	11.850	264,977.850	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	533,520	21.415	11,425,330.800	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	370,183	22.030	8,155,131.490	
	INMARSAT PLC	63,120	6.250	394,500.000	
	PETROFAC LTD	38,264	16.670	637,860.880	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	8.260	281,946.840	
	STANDARD LIFE PLC	325,057	3.520	1,144,200.640	
	EXPERIAN PLC	144,647	10.150	1,468,167.050	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	7.240	187,711.480	
	TUI TRAVEL PLC	52,043	2.808	146,136.740	
	MELROSE PLC	105,304	2.411	253,887.940	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	46,617	3.216	149,920.270	
	FRESNILLO PLC NPR	23,779	17.500	416,132.500	
	RESOLUTION LTD	183,507	2.607	478,402.740	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	534,663	3.869	2,068,611.140	
	EVRAZ PLC	71,521	2.812	201,117.050	
	イギリス・ボンド 小計	39,820,667		220,791,135.160 (31,827,042,133)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	16.310	2,176,569.500	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	236,029	13.290	3,136,825.410	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	335,378	4.522	1,516,579.310	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	70,398	47.050	3,312,225.900	
	NICE SYSTEMS LTD	12,796	130.800	1,673,716.800	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	134,402	145.500	19,555,491.000	
	ISRAEL CORP LTD/THE	99	2,552.000	252,648.000	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	4,832	192.400	929,676.800	
	イスラエル・シュケル 小計	927,384		32,553,732.720 (775,755,451)	

オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	27.870	356,596.650	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	392,362	25.150	9,867,904.300	
	AMCOR LTD	172,545	8.290	1,430,398.050	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	435,225	26.600	11,576,985.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	190,644	4.850	924,623.400	
	TELSTRA CORP LTD	619,065	4.480	2,773,411.200	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	8.820	495,516.420	
	AMP LTD	380,894	5.090	1,938,750.460	
	ASX LTD	20,371	32.340	658,798.140	
	BHP BILLITON LTD	454,524	37.410	17,003,742.840	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,948	19.040	475,009.920	
	ALS LTD	34,895	10.620	370,584.900	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	1.900	193,323.100	
	COMPUTERSHARE LT	75,518	9.560	721,952.080	
	CSL LIMITED	70,273	52.390	3,681,602.470	
	TRANSURBAN GROUP	174,256	6.220	1,083,872.320	
	COCA-COLA AMATIL LTD	77,149	13.800	1,064,656.200	
	COCHLEAR LTD	8,697	80.700	701,847.900	
	ORIGIN ENERGY LTD	153,647	11.820	1,816,107.540	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	225,701	61.610	13,905,438.610	
	BORAL LIMITED	107,619	4.520	486,437.880	
	RIO TINTO LIMITED	62,365	67.100	4,184,691.500	
	APA GROUP	122,365	5.480	670,560.200	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	266,750	4.860	1,296,405.000	
	FLIGHT CENTRE LTD	3,699	27.970	103,461.030	
	OZ MINERALS LTD	55,513	7.030	390,256.390	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	68,718	9.400	645,949.200	
	ORICA LTD	50,048	25.560	1,279,226.880	
	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	18.880	410,772.160	
	SYDNEY AIRPORT	66,175	3.260	215,730.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	49,466	36.320	1,796,605.120	
	WORLEYPARSONS LTD	28,202	24.310	685,590.620	
	SUNCORP GROUP LTD	187,045	10.780	2,016,345.100	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	327,136	25.430	8,319,068.480	
	NEWCREST MINING LTD	103,429	21.560	2,229,929.240	
	INCITEC PIVOT LTD	201,547	3.270	659,058.690	
	TOLL HOLDINGS LTD	118,338	4.870	576,306.060	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	186,960	1.540	287,918.400	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	169,191	11.790	1,994,761.890	
	SANTOS LTD	140,142	11.480	1,608,830.160	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	28,753	9.680	278,329.040		
SONIC HEALTHCARE	45,868	13.290	609,585.720		
TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	3.010	388,837.820		

	WESFARMERS LTD	146,532	37.470	5,490,554.040	
	ALUMINA LIMITED	397,286	1.055	419,136.730	
	ILUKA RESOURCES LIMI	71,975	9.210	662,889.750	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	96,836	34.730	3,363,114.280	
	WOOLWORTHS LTD	172,666	30.020	5,183,433.320	
	METCASH LTD	79,084	3.360	265,722.240	
	TATTS GROUP LTD	225,953	3.110	702,713.830	
	SP AUSNET	234,780	1.120	262,953.600	
	AGL ENERGY LTD	75,845	15.460	1,172,563.700	
	BRAMBLES LTD	217,633	7.900	1,719,300.700	
	WHITEHAVEN COAL LTD	66,260	3.460	229,259.600	
	ASCIANO LTD	108,957	4.800	522,993.600	
	CROWN LTD	46,332	11.370	526,794.840	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	3.440	375,806.240	
	AURIZON HOLDINGS LTD	278,184	3.820	1,062,662.880	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	52,322	4.840	253,238.480	
オーストラリア・ドル	小計	8,601,598		124,388,916.410 (11,747,289,266)	
カナダ・ドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	24,022	49.930	1,199,418.460	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	49.410	787,743.630	
	BARRICK GOLD CORP	145,097	33.950	4,926,043.150	
	TALISMAN ENERGY INC	149,684	11.600	1,736,334.400	
	BANK OF MONTREAL	93,774	62.200	5,832,742.800	
	BANK OF NOVA SCOTIA	161,080	57.560	9,271,764.800	
	NATIONAL BANK OF CANADA	24,396	77.790	1,897,764.840	
	BCE INC	38,612	42.050	1,623,634.600	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	83,934	37.210	3,123,184.140	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	40,292	62.970	2,537,187.240	
	BOMBARDIER INC 'B'	240,632	3.990	960,121.680	
	SAPUTO INC	20,610	49.400	1,018,134.000	
	RESEARCH IN MOTION LTD	79,152	11.790	933,202.080	
	CGI GROUP INC	29,163	23.710	691,454.730	
	CAE INC	31,436	10.600	333,221.600	
	CAMECO CORP	57,534	20.450	1,176,570.300	
	ROGERS COMM-CL B	58,021	44.790	2,598,760.590	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	58,718	81.960	4,812,527.280	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	151,363	29.690	4,493,967.470	
	NEXEN INC	73,875	26.550	1,961,381.250	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	12,753	67.710	863,505.630	
	CANADIAN UTILITIES LTD	7,518	72.470	544,829.460	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,230	92.050	5,636,221.500	
	AGRIUM INC	20,432	103.630	2,117,368.160	
	YAMANA GOLD INC	100,733	17.260	1,738,651.580	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,712	37.200	621,686.400	
	OPEN TEXT CORP	9,281	58.200	540,154.200	
	ELDORADO GOLD CORP	101,418	12.670	1,284,966.060	

OSISKO MINING CORP	52,038	7.780	404,855.640	
KINROSS GOLD CORP	173,556	9.320	1,617,541.920	
FINNING INTERNATIONAL INC	22,545	26.400	595,188.000	
FORTIS INC	29,702	34.240	1,016,996.480	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,329	21.050	1,480,425.450	
TELUS CORP-NON VOTE	20,879	64.700	1,350,871.300	
GREAT WEST LIFECO INC	39,777	24.800	986,469.600	
IAMGOLD CORP	56,614	10.730	607,468.220	
IMPERIAL OIL LTD	44,159	43.490	1,920,474.910	
ENBRIDGE INC	108,193	43.620	4,719,378.660	
IGM FINANCIAL INC	14,041	41.900	588,317.900	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	9.390	460,851.810	
MANULIFE FINANCIAL CORP	250,765	14.090	3,533,278.850	
LOBLAW CO LTD	17,526	40.820	715,411.320	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,573	22.470	956,615.310	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	7,864	32.520	255,737.280	
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,015	51.070	1,583,936.050	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,848	27.680	2,265,552.640	
INMET MINING CORPORATION	6,534	71.920	469,925.280	
METRO INC	13,859	61.810	856,624.790	
HUSKY ENERGY INC	48,062	29.700	1,427,441.400	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,756	38.610	1,689,419.160	
ONEX CORP	17,569	43.000	755,467.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	21,311	18.420	392,548.620	
GOLDCORP INC	117,083	36.680	4,294,604.440	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	120,956	42.230	5,107,971.880	
POWER CORP OF CANADA	51,497	25.600	1,318,323.200	
POWER FINANCIAL CORP	33,495	27.790	930,826.050	
ROYAL BANK OF CANADA	205,513	60.880	12,511,631.440	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	43.090	904,286.740	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,563	108.980	2,676,875.740	
SHAW COMM INC-B	56,820	23.070	1,310,837.400	
SINO-FOREST CORP	38,862	4.810	186,926.220	
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,526	42.660	1,174,259.160	
NEW GOLD INC	62,801	10.460	656,898.460	
SUNCOR ENERGY INC	216,569	33.580	7,272,387.020	
ENCANA CORP	100,783	19.430	1,958,213.690	
TECK RESOURCES LTD-CL B	82,188	37.730	3,100,953.240	
THOMSON REUTERS CORP	53,002	29.100	1,542,358.200	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	129,988	82.070	10,668,115.160	
TRANSCANADA CORP	102,272	48.540	4,964,282.880	
TRANSALTA CORP	34,014	15.760	536,060.640	
WESTON (GEORGE) LTD	7,627	70.160	535,110.320	
CENTERRA GOLD INC	22,699	9.000	204,291.000	

INTACT FINANCIAL CORP	20,440	65.790	1,344,747.600	
SILVER WHEATON CORP	50,604	35.810	1,812,129.240	
CATAMARAN CORP	30,544	52.060	1,590,120.640	
BELL ALIANT INC	14,926	26.340	393,150.840	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,955	55.630	1,110,096.650	
CI FINANCIAL CORP	26,281	25.550	671,479.550	
TOURMALINE OIL CORP	17,376	31.730	551,340.480	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,549	29.250	1,127,558.250	
TIM HORTONS INC	22,995	48.670	1,119,166.650	
DOLLARAMA INC	6,908	58.400	403,427.200	
BAYTEX ENERGY CORP	18,200	44.350	807,170.000	
MEG ENERGY CORP	17,794	34.500	613,893.000	
ATHABASCA OIL CORP	42,987	10.690	459,531.030	
CENOVUS ENERGY INC W/I	108,663	33.630	3,654,336.690	
ENERPLUS CORP	28,113	12.990	365,187.870	
VERMILION ENERGY INC	14,132	52.450	741,223.400	
PENN WEST PETROLEUM LTD	74,986	10.360	776,854.960	
ARC RESOURCES LTD	42,391	23.680	1,003,818.880	
CANADIAN OIL SANDS LTD	63,549	20.220	1,284,960.780	
BONAVISTA ENERGY CORP	22,644	14.330	324,488.520	
PENGROWTH ENERGY CORP	76,902	4.920	378,357.840	
カナダ・ドル 小計	5,439,192		178,301,592.570 (16,188,001,589)	
シンガポール ・ドル				
SINGAPORE TECH ENG	261,000	3.850	1,004,850.000	
SEBFCORP INDUSTRIES	139,000	5.320	739,480.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	4.100	1,070,100.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.660	542,282.400	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	272,000	14.830	4,033,760.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	63,000	12.640	796,320.000	
SEBFCORP MARINE	108,000	4.840	522,720.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	48.680	876,240.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	7.110	1,002,510.000	
CAPITALAND LTD	332,000	3.940	1,308,080.000	
FRASER & NEAVE LTD-ORD	150,500	9.690	1,458,345.000	
GENTING SINGAPORE PLC	887,400	1.475	1,308,915.000	
KEPPEL CORP LTD	208,500	11.250	2,345,625.000	
COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.880	624,160.000	
NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	646,763	1.240	801,986.120	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	350,200	9.710	3,400,442.000	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,072,867	3.370	3,615,561.790	
SINGAPORE AIRLINES LTD	91,400	11.090	1,013,626.000	
KEPPEL LAND LTD	95,000	4.310	409,450.000	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	170,000	19.370	3,292,900.000	
STARHUB LTD	110,000	3.800	418,000.000	
OLAM INTERNATIONAL LTD	140,800	1.605	225,984.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	262,000	3.620	948,440.000	

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	390,000	1.080	421,200.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	288,000	2.160	622,080.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	291,000	2.740	797,340.000	
シンガポール・ドル 小計		7,903,070		33,600,397.310 (2,451,820,992)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	172,733	25.080	4,332,143.640	
	SYNGENTA AG	13,665	379.500	5,185,867.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	458,352	60.850	27,890,719.200	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	73,435	76.000	5,581,060.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	100,046	192.500	19,258,855.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,515	134.500	1,145,267.500	
	SIKA INHABER	363	2,182.000	792,066.000	
	SGS SA-REG	861	2,072.000	1,783,992.000	
	SULZER AG-REG	3,187	145.600	464,027.200	
	NOVARTIS AG-REG SHS	327,697	59.600	19,530,741.200	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,682	83.050	471,890.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	887.500	346,125.000	
	SWISSCOM AG-REG	3,426	409.300	1,402,261.800	
	ABB LTD	309,204	19.630	6,069,674.520	
	ADECCO SA-REG	19,348	49.900	965,465.200	
	GEBERIT AG	4,974	206.900	1,029,120.600	
	LONZA GROUP AG-REG	9,112	54.400	495,692.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	3,164.000	287,924.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	36,300.000	726,000.000	
	UBS AG-REGISTERED	515,732	15.630	8,060,891.160	
	GIVAUDAN-REG	1,136	979.000	1,112,144.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,315	254.500	5,424,667.500	
	HOLCIM LTD-REG	27,289	67.300	1,836,549.700	
	ACTELION	16,792	47.150	791,742.800	
	SONOVA HOLDING AG	7,301	106.500	777,556.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,751	114.300	1,000,239.300	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,262	495.600	2,112,247.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,915	85.350	675,545.250	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	133.400	243,321.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	133.800	475,391.400	
SWISS PRIME SITE AG	8,711	76.100	662,907.100		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	219.000	440,190.000		
ARYZTA AG	13,689	49.900	683,081.100		
JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	34.230	1,056,782.790		
SWISS RE LTD	51,359	69.050	3,546,338.950		

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TRANSOCEAN LTD	54,450	48.940	2,664,783.000	
スイス・フラン 小計		2,288,063		129,323,272.610 (12,615,485,243)	
スウェーデン ・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	93,708	181.400	16,998,631.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	57,497	161.200	9,268,516.400	
	ELEKTA AB	60,652	97.250	5,898,407.000	
	ERICSSON LM-B SHS	436,019	66.500	28,995,263.500	
	GETINGE AB-B SHS	24,930	215.900	5,382,387.000	
	SKF AB-B SHS	55,959	161.700	9,048,570.300	
	SANDVIK AB	132,142	103.700	13,703,125.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	184,986	58.650	10,849,428.900	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	108.200	6,330,457.400	
	SWEDBANK AB	107,424	133.100	14,298,134.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	79,580	143.500	11,419,730.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	67,333	243.800	16,415,785.400	
	VOLVO AB-B SHS	195,639	91.000	17,803,149.000	
	SCANIA AB	49,676	138.000	6,855,288.000	
	SWEDISH MATCH AB	30,526	228.500	6,975,191.000	
	TELE2 AB-B SHS	49,717	117.000	5,816,889.000	
	NORDEA AB	378,297	65.450	24,759,538.650	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	165.100	6,370,218.400	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	57.850	3,069,231.750	
	INVESTOR AB-B SHS	62,766	171.100	10,739,262.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	137,083	219.600	30,103,426.800	
	ASSA ABLOY AB-B	49,467	240.500	11,896,813.500	
	TELIASONERA AB	311,185	45.600	14,190,036.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	34,427	157.900	5,436,023.300	
	BOLIDEN AB	44,557	123.500	5,502,789.500	
	ALFA LAVAL AB	45,040	135.100	6,084,904.000	
KINNEVIK INVESTMENT B	33,473	139.700	4,676,178.100		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	9,909	590.500	5,851,264.500		
HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	40.960	2,237,767.680		
RATOS AB	34,246	64.000	2,191,744.000		
HEXAGON AB	29,365	165.300	4,854,034.500		
スウェーデン・クローナ 小計		3,000,382		324,022,187.180 (4,455,305,074)	
デンマーク・ クローネ	CARLSBERG AS-B	14,623	566.500	8,283,929.500	
	A P MOLLER A/S	168	46,120.000	7,748,160.000	
	AP MOLLER MAERSK A	100	43,720.000	4,372,000.000	
	DANSKE BANK A/S	98,077	107.800	10,572,700.600	
	NOVOZYMES-B SHS	32,498	162.500	5,280,925.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	57,904	958.500	55,500,984.000	
	TDC A/S	58,423	41.800	2,442,081.400	

	COLOPLAST-B	15,865	288.000	4,569,120.000	
	DSV A/S	29,112	144.500	4,206,684.000	
	WILLIAM DEMANT	4,646	494.300	2,296,517.800	
デンマーク・クローネ 小計		311,416		105,273,102.300 (1,670,684,134)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	152,611	8.670	1,323,137.370	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	407,280	2.300	936,744.000	
ニュージーランド・ドル 小計		559,891		2,259,881.370 (170,101,270)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	136,403	73.450	10,018,800.350	
	NORSK HYDRO ASA	138,196	28.930	3,998,010.280	
	TELENOR ASA	96,967	116.300	11,277,262.100	
	SUBSEA 7 SA	37,286	137.400	5,123,096.400	
	ORKLA ASA	100,689	48.600	4,893,485.400	
	STATOIL ASA	157,454	141.800	22,326,977.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,891	282.100	8,150,151.100	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	118.600	2,245,809.600	
	SEADRILL LTD	48,892	210.300	10,281,987.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	43,012	82.000	3,526,984.000	
ノルウェー・クローネ 小計		806,726		81,842,564.030 (1,322,575,834)	
ユーロ	CRH PLC	106,593	15.015	1,600,493.890	
	KERRY GROUP PLC-A	19,924	38.150	760,100.600	
	UMICORE	13,643	40.435	551,654.700	
	AIR LIQUIDE	43,883	93.160	4,088,140.280	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	58,929	32.040	1,888,085.160	
	AXA	246,451	13.610	3,354,198.110	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,645	8.690	440,105.050	
	ADIDAS AG	31,341	67.250	2,107,682.250	
	ASSICURAZIONI GENERALI	161,234	14.560	2,347,567.040	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	309,702	1.150	356,157.300	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	55,622	12.885	716,689.470	
	DANONE	83,961	49.920	4,191,333.120	
	SAFRAN SA	31,493	33.110	1,042,733.230	
	INTESA SANPAOLO	1,472,486	1.480	2,179,279.280	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	48,464	72.890	3,532,540.960	
	ACCOR SA	19,786	26.855	531,353.030	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	33.950	328,737.850	
	BOUYGUES	30,754	22.315	686,275.510	
	BNP PARIBAS	141,219	45.575	6,436,055.920	
	REED ELSEVIER NV	101,079	11.245	1,136,633.350	
	THALES SA	15,303	26.200	400,938.600	
	CAP GEMINI SA	18,774	33.500	628,929.000	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	70.630	463,827.210	
CHRISTIAN DIOR	8,176	128.500	1,050,616.000		

COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	27,306	21.300	581,617.800	
UNICREDIT SPA	564,372	4.292	2,422,284.620	
NATIXIS	164,630	2.899	477,262.370	
KONINKLIJKE DSM NV	19,732	46.225	912,111.700	
DELHAIZE GROUP	12,505	32.580	407,412.900	
ELAN CORPORATION PLC	77,624	8.130	631,083.120	
COMMERZBANK AG	535,401	1.698	909,110.890	
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,009	84.200	1,432,157.800	
UNITED INTERNET	18,350	16.645	305,435.750	
PUBLICIS GROUPE	19,919	46.980	935,794.620	
MAN SE	5,152	86.940	447,914.880	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	27,530	17.500	481,775.000	
IBERDROLA SA	575,506	4.101	2,360,150.100	
ENI SPA	358,908	19.240	6,905,389.920	
JERONIMO MARTINS	38,183	14.680	560,526.440	
KESKO OYJ-B	13,297	25.330	336,813.010	
KBC GROUPE	38,018	27.205	1,034,279.690	
LAFARGE SA	28,285	48.500	1,371,822.500	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	7,658	59.390	454,808.620	
WARTSILA OYJ	26,436	33.680	890,364.480	
L'OREAL	35,517	104.200	3,700,871.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS V SA	35,796	136.600	4,889,733.600	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	25.565	356,043.750	
GEA GROUP AG	28,135	25.850	727,289.750	
MEDIOBANCA SPA	81,452	5.380	438,211.760	
MICHELIN(CGDE)-B	25,321	71.390	1,807,666.190	
CONTINENTAL AG	15,833	86.770	1,373,829.410	
DEUTSCHE POST AG-REG	123,484	16.755	2,068,974.420	
TELEKOM AUSTRIA AG	30,174	5.763	173,892.760	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,126	30.870	466,939.620	
AXEL SPRINGER AG	6,021	32.760	197,247.960	
OMV AG	24,898	28.840	718,058.320	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	67,989	4.200	285,553.800	
PERNOD-RICARD	30,426	87.290	2,655,885.540	
PEUGEOT SA	36,100	6.149	221,978.900	
PIRELLI & C	30,073	9.435	283,738.750	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	22,597	62.190	1,405,307.430	
RENAULT SA	27,030	40.425	1,092,687.750	
REPSOL SA	118,170	16.425	1,940,942.250	
REMY COINTREAU	3,877	86.100	333,809.700	
MERCK KGAA	9,951	102.250	1,017,489.750	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	113,141	65.050	7,359,822.050	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	56,095	31.910	1,789,991.450	
SAIPEM	35,585	30.400	1,081,784.000	
RWE AG	71,565	30.705	2,197,403.320	

ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	24,597	32.130	790,301.610	
SOCIETE GENERALE-A	102,869	32.700	3,363,816.300	
VINCI S.A.	67,944	36.950	2,510,530.800	
SODEXO	12,740	63.990	815,232.600	
SOLVAY SA	8,874	109.950	975,696.300	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	75,482	55.100	4,159,058.200	
VIVENDI SA	185,920	16.700	3,104,864.000	
SAP AG	129,813	60.610	7,867,965.930	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,114	80.710	1,219,850.940	
TELEFONICA S.A	572,292	10.895	6,235,121.340	
TOTAL SA	301,389	39.550	11,919,934.950	
VALLOUREC	16,668	39.515	658,636.020	
E.ON SE	261,892	14.350	3,758,150.200	
VOEST-ALPINE AG	17,613	26.475	466,304.170	
ZODIAC AEROSPACE	5,696	84.590	481,824.640	
HENKEL AG & CO KGAA	20,540	50.280	1,032,751.200	
METRO AG	22,519	23.340	525,593.460	
SIEMENS AG-REG	116,095	83.320	9,673,035.400	
UPM-KYMMENE OYJ	78,102	8.920	696,669.840	
ING GROEP NV-CVA	555,489	7.750	4,305,039.750	
BAYER AG	116,638	72.010	8,399,102.380	
STORA ENSO OYJ-R SHS	85,853	5.285	453,733.100	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,233	59.820	1,509,438.060	
DAIMLER AG	127,268	42.890	5,458,524.520	
BASF SE	129,522	70.920	9,185,700.240	
CELESIO AG	16,256	13.630	221,569.280	
BEIERSDORF AG	12,865	61.200	787,338.000	
HOCHTIEF AG	4,785	46.260	221,354.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	47.330	1,019,440.870	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	28,617	48.905	1,399,514.380	
FRANCE TELECOM SA	253,314	8.757	2,218,270.690	
SAMPO OYJ-A SHS	59,871	25.300	1,514,736.300	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	28.795	402,698.070	
ALLIANZ SE	63,946	104.900	6,707,935.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,886	2.368	745,650.040	
KONINKLIJKE Ahold NV	151,016	10.465	1,580,382.440	
PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	13,630	23.100	314,853.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	14.775	403,342.720	
ERSTE GROUP BANK AG	33,508	26.195	877,742.060	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	25,699	135.050	3,470,649.950	
ARCELOR MITTAL (NL)	124,180	13.100	1,626,758.000	
SOCIETE BIC SA	4,806	91.630	440,373.780	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	84.760	835,903.120	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,133	19.590	453,175.470	
HEINEKEN NV	31,283	49.900	1,561,021.700	
AKZO NOBEL	35,469	49.440	1,753,587.360	

ASML HOLDING NV	46,343	48.570	2,250,879.510	
AEGON NV	239,953	5.021	1,204,804.010	
SALZGITTER	7,018	38.995	273,666.910	
VOLKSWAGEN AG	5,402	160.750	868,371.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	19,543	173.300	3,386,801.900	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	789,301	7.671	6,054,727.970	
PPR	10,619	147.050	1,561,523.950	
CNP ASSURANCES	31,052	12.605	391,410.460	
ACCIONA S.A.	3,899	64.760	252,499.240	
FORTUM OYJ	65,765	14.370	945,043.050	
AGEAS	30,098	23.505	707,453.490	
UCB SA	15,930	43.310	689,928.300	
THYSSENKRUPP AG	55,869	19.050	1,064,304.450	
UNILEVER NV-CVA	228,527	28.900	6,604,430.300	
CARREFOUR SA	85,148	19.200	1,634,841.600	
GAS NATURAL SDG SA	43,864	13.890	609,270.960	
ATOS	9,475	53.280	504,828.000	
NOKIA OYJ	541,250	3.324	1,799,115.000	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	153,722	20.995	3,227,393.390	
WOLTERS KLUWER-CVA	49,896	15.565	776,631.240	
SANOFI	169,017	73.340	12,395,706.780	
IMMOFINANZ AG	152,609	3.302	503,914.910	
STMICROELECTRONICS NV	97,120	6.029	585,536.480	
ELISA CORP	13,898	17.100	237,655.800	
BANCO SANTANDER SA	1,452,269	6.482	9,413,607.650	
METSO OYJ	15,547	32.410	503,878.270	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	15,682	39.830	624,614.060	
QIAGEN N.V.	39,540	14.405	569,573.700	
LINDE AG	26,754	129.900	3,475,344.600	
FIAT SPA	119,079	4.048	482,031.790	
DEUTSCHE BANK AG-REG	135,005	37.155	5,016,110.770	
BMW VORZUG	7,191	49.810	358,183.710	
K & S	24,444	33.810	826,451.640	
SUEDZUCKER AG	11,866	29.200	346,487.200	
ENEL SPA	957,300	3.210	3,072,933.000	
COLRUYT NV	11,116	36.145	401,787.820	
VOPAK (KON.)	11,504	51.000	586,704.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	391,945	9.129	3,578,065.900	
BANCO POPULAR ESPANOL	720,467	0.760	547,554.920	
FINMECCANICA SPA	70,788	5.055	357,833.340	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	156,734	6.639	1,040,557.020	
KONINKLIJKE KPN NV	156,011	4.285	668,507.130	
DEUTSCHE BOERSE AG	28,550	46.285	1,321,436.750	
BANCO SABADELL	403,644	2.132	860,569.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	60.740	779,294.200	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.001	0.510	
OPAP SA	29,941	6.420	192,221.220	

FRAPORT AG	6,165	44.010	271,321.650	
HEINEKEN HOLDING NV-A	12,515	41.620	520,874.300	
INDITEX	30,530	105.400	3,217,862.000	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	804,540	0.296	238,143.840	
ANDRITZ AG	11,386	50.200	571,577.200	
MAPFRE SA	135,413	2.561	346,792.690	
ESSILOR INTL	28,539	75.500	2,154,694.500	
SNAM SPA	225,511	3.504	790,190.540	
CREDIT AGRICOLE SA	148,220	7.093	1,051,324.460	
ENAGAS	25,191	17.200	433,285.200	
WENDEL	4,087	78.490	320,788.630	
TENARIS SA	71,428	15.660	1,118,562.480	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	137,041	3.880	531,719.080	
TELECOM ITALIA SPA	1,374,164	0.752	1,033,371.320	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.646	511,679.800	
ATLANTIA SPA	45,375	13.350	605,756.250	
ILIAD SA	3,871	137.150	530,907.650	
BELGACOM SA	23,896	23.235	555,223.560	
SES FDR	46,853	21.700	1,016,710.100	
GEMALTO	13,041	66.450	866,574.450	
TERNA SPA	198,330	3.036	602,129.880	
GRIFOLS SA	24,523	25.150	616,753.450	
FERROVIAL SA	63,117	11.990	756,772.830	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	11,028	62.010	683,846.280	
EXOR SPA	9,585	20.410	195,629.850	
NESTE OIL OYJ	23,509	10.600	249,195.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	33.560	305,362.440	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.106	9,679.490	
FUGRO CERT	10,228	44.600	456,168.800	
KONE OYJ	22,765	57.750	1,314,678.750	
GDF SUEZ	185,887	15.525	2,885,895.670	
ALSTOM	28,395	31.875	905,090.620	
TELENET GROUP HOLDING NV	10,182	35.355	359,984.610	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	24.505	427,612.250	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,385	13.885	477,435.720	
ARKEMA SA	9,569	78.750	753,558.750	
LEGRAND SA	33,102	32.355	1,071,015.210	
ADP	4,749	58.600	278,291.400	
ORION OYJ	17,482	23.030	402,610.460	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	12.145	413,148.610	
SCOR SE	22,917	21.445	491,455.060	
REXEL SA	11,894	15.895	189,055.130	
PRYSMIAN SPA	27,099	15.570	421,931.430	
BANCO POPOLARE SPA	305,979	1.528	467,535.910	
CAIXABANK	149,185	2.975	443,825.370	
BUREAU VERITAS SA	7,690	84.720	651,496.800	
GROUPE EUROTUNNEL SA	89,249	6.008	536,207.990	

	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	39,059	9.000	351,531.000	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	AMADEUS IT HOLDING SA	46,558	18.515	862,021.370	
	TNT EXPRESS NV W/I	48,800	8.500	414,800.000	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12,189	57.050	695,382.450	
	ENEL GREEN POWER SPA	221,755	1.522	337,511.110	
	BRENTAG AG	7,743	102.000	789,786.000	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	151,868	2.407	365,546.270	
	FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	9.075	1,080,641.920	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	111,285	5.159	574,119.310	
	DELTA LLOYD NV	19,898	14.060	279,765.880	
	EDENRED	27,224	23.080	628,329.920	
	ZIGGO NV	13,146	23.960	314,978.160	
	DE MASTER BLENDERS1753 NVW	93,884	9.122	856,409.840	
	IBERDROLA SA - RTS	575,506	0.147	84,599.380	
	HUGO BOSS AG -ORD	4,016	81.360	326,741.760	
	ユーロ 小計	25,657,276		345,956,991.770 (40,954,388,686)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	37,600	95.450	3,588,920.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	290,000	31.250	9,062,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	193,260	30.950	5,981,397.000	
	CLP HOLDINGS LTD	240,500	65.350	15,716,675.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	13,000	34.200	444,600.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	14.740	3,110,140.000	
	LI & FUNG LTD	812,400	14.120	11,471,088.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	203,000	127.100	25,801,300.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	95,000	47.400	4,503,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	156,400	147.400	23,053,360.000	
	MTR CORP	245,000	31.000	7,595,000.000	
	FIRST PACIFIC CO	380,000	9.160	3,480,800.000	
	HANG SENG BANK LTD	122,800	119.000	14,613,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	137,000	58.750	8,048,750.000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	206,500	65.600	13,546,400.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	203,750	63.900	13,019,625.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	767,855	21.100	16,201,740.500	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	318,000	84.550	26,886,900.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	39.600	3,484,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	292,000	32.800	9,577,600.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	88,000	41.250	3,630,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	535,000	24.950	13,348,250.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	25.700	2,210,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	551,700	13.640	7,525,188.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	43,000	55.050	2,367,150.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	16.840	3,873,200.000	
	SINO LAND CO	429,400	15.060	6,466,764.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	230,000	124.500	28,635,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	98,000	98.100	9,613,800.000	
	WHEELOCK & CO LTD	162,000	44.300	7,176,600.000	
	SJM HOLDINGS LTD	290,000	20.400	5,916,000.000	
	WYNN MACAU LTD	273,200	23.350	6,379,220.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	199,600	15.940	3,181,624.000	
	AIA GROUP LTD	1,507,000	30.200	45,511,400.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	104,000	7.090	737,360.000	
	SANDS CHINA LTD	361,200	37.350	13,490,820.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	27.500	4,488,000.000	
香港・ドル	小計	10,364,365		383,738,371.500 (4,416,828,656)	
合計		149,795,755		299,969,453,942 (299,969,453,942)	

(2) 株式以外の有価証券

平成25年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	234,445.000	541,567.950	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	338,821.000	664,089.160	
		DEXUS PROPERTY GROUP	742,478.000	746,190.390	
		GOODMAN GROUP	264,780.000	1,162,384.200	
		GPT GROUP	198,416.000	716,281.760	
		LEND LEASE GROUP	79,483.000	774,164.420	
		MIRVAC GROUP	519,514.000	800,051.560	
		STOCKLAND	357,887.000	1,256,183.370	
		WESTFIELD GROUP	314,611.000	3,388,360.470	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	418,064.000	1,266,733.920	
	オーストラリア・ドル	小計	3,468,499.000	11,316,007.200	

				(1,068,683,720)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	295,906.000	719,051.580	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	355,535.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	636,768.000	
	シンガポール・ドル 小計		801,706.000	1,711,354.580 (124,877,543)	
投資信託受益証券 合計			4,270,205	1,193,561,263 (1,193,561,263)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	1,418,494.320	
		AMERICAN TOWER CORP	56,422.000	4,438,718.740	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	148,978.000	2,194,445.940	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,275.000	2,231,139.750	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,606.000	2,427,884.400	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	432,785.100	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,583.000	1,147,875.260	
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	562,225.750	
		EQUITY RESIDENTIAL	47,487.000	2,771,816.190	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.000	1,069,489.860	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	65,628.000	1,254,807.360	
		HCP INC	63,246.000	2,906,153.700	
		HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	1,895,530.220	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	107,557.000	1,817,713.300	
		KIMCO REALTY	53,036.000	1,050,643.160	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	604,337.500	
		PLUM CREEK TIMBER CO	21,734.000	1,012,804.400	
		PROLOGIS INC	67,853.000	2,581,128.120	
		PUBLIC STORAGE	20,653.000	3,021,120.840	
		RAYONIER INC	16,734.000	909,660.240	
		REALTY INCOME CORP	10,561.000	452,010.800	
		REGENCY CENTERS CORP	15,096.000	732,457.920	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	43,217.000	6,910,398.300	
		SL GREEN	14,333.000	1,133,166.980	
		THE MACERICH COMPANY	19,817.000	1,152,953.060	
		UDR INC	31,804.000	776,017.600	
		VENTAS INC	42,850.000	2,792,106.000	
		VORNADO REALTY TRUST	24,478.000	1,983,941.900	
		WEYERHAEUSER CO	80,733.000	2,465,585.820	
	アメリカ・ドル 小計		1,154,874.000	54,147,412.530 (4,831,032,146)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	113,808.000	646,998.480	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	89,110.000	325,162.390	

		HAMMERSON PLC	101,418.000	495,021.250	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.000	900,240.640	
		SEGRO PLC	93,543.000	230,115.780	
	イギリス・ポンド 小計		506,081.000	2,597,538.540 (374,435,181)	
	カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	35,844.000	592,501.320	
		H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	233,349.380	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	431,933.600	
	カナダ・ドル 小計		61,339.000	1,257,784.300 (114,194,237)	
	ユーロ	CORIO NV	7,710.000	280,335.600	
		GECINA SA	4,223.000	363,980.370	
		KLEPIERRE	13,172.000	390,418.080	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	12,957.000	2,286,910.500	
	ユーロ 小計		38,062.000	3,321,644.550 (393,216,282)	
	香港・ドル	LINK REIT/THE	336,500.000	13,224,450.000	
	香港・ドル 小計		336,500.000	13,224,450.000 (152,213,420)	
投資証券 合計			2,096,856	5,865,091,266 (5,865,091,266)	
合計				7,058,652,529 (7,058,652,529)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	株式 579銘柄	54.92%	-%	-%	57.39%
	投資証券 29銘柄	-%	-%	1.55%	
イギリス・ポンド	株式 101銘柄	10.20%	-%	-%	10.49%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.25%	-%	-%	0.25%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	3.76%	-%	-%	4.17%
	投資信託受益証券 10銘柄	-%	0.34%	-%	
カナダ・ドル	株式 93銘柄	5.19%	-%	-%	5.31%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.04%	
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	0.79%	-%	-%	0.84%
	投資信託受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	4.04%	-%	-%	4.11%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.43%	-%	-%	1.45%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	0.54%	-%	-%	0.54%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	0.05%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.42%	-%	-%	0.43%
ユーロ	株式 226銘柄	13.12%	-%	-%	13.47%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.13%	

香港・ドル	株式	37銘柄	1.42%	-%	-%	1.49%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産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

「(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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,821,539,025	2,694,113,013
コール・ローン		1,479,680,769	215,455,666
国債証券		346,635,059,718	391,575,850,371
派生商品評価勘定		756,767	2,611
未収利息		4,092,985,592	4,422,869,430
前払費用		173,177,455	78,430,631
流動資産合計		356,203,199,326	398,986,721,722
資産合計		356,203,199,326	398,986,721,722
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		376,064	1,627,128
未払金		1,730,575,372	-
未払解約金		26,875,000	104,449,000
流動負債合計		1,757,826,436	106,076,128
負債合計		1,757,826,436	106,076,128
純資産の部			
元本等			
元本	1	320,315,770,753	286,407,723,256
剰余金			
剰余金又は欠損金()		34,129,602,137	112,472,922,338
元本等合計		354,445,372,890	398,880,645,594
純資産合計		354,445,372,890	398,880,645,594
負債純資産合計		356,203,199,326	398,986,721,722

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p>
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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>

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1 . 1 本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	350,943,197,818円	320,315,770,753円
同期中追加設定元本額	34,916,229,537円	20,040,695,235円
同期中一部解約元本額	65,543,656,602円	53,948,742,732円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	1,999,508,906円	1,850,163,418円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C年金>	3,985,025,882円	4,311,702,246円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	336,613,649円	343,786,882円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,167,060,872円	1,211,058,264円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,182,837,108円	1,225,792,520円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	337,866,678円	323,665,802円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	657,766,156円	655,695,333円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	401,779,916円	415,250,363円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	161,278,829円	121,221,242円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,764,418,944円	1,496,007,439円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,413,592円	8,724,668円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	- 円	12,613円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	- 円	16,817円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	- 円	21,021円
クルーズコントロール	- 円	8,741,221円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	6,140,558,650円	4,451,690,602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)	8,280,258,279円	7,131,480,399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)	6,776,955,433円	5,734,231,221円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	946,676,260円	945,275,864円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	240,836,858円	189,689,387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)	46,312,994,177円	41,361,461,845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)	2,510,570,901円	2,419,766,409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)	443,974,690円	415,543,665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)	727,637,617円	677,038,410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)	199,244,006円	174,534,936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)	87,637,321円	82,504,720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)	27,250,002,344円	25,235,045,884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)	5,992,515,436円	5,574,133,390円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	11,070,345,668円	9,751,296,935円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,030,172,400円	4,469,007,110円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,104,841,199円	6,375,815,282円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	2,746,963,331円	2,394,947,927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)	8,428,452,355円	7,335,988,361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)	9,873,989,080円	8,363,346,865円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	50,572,642,858円	43,960,553,746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)	267,315,107円	191,554,608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)	6,625,486,509円	5,767,871,794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)	14,994,966,188円	14,182,632,850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)	290,931,174円	263,993,496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)	25,427,832,054円	22,830,229,976円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	31,042,712,077円	28,194,161,543円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	813,502,633円	664,615,246円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	230,982円	223,959円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	140,632円	140,474円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	27,256,172,658円	24,532,037,030円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	229,549,307円	237,498,841円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	621,742,683円	527,215,625円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	218,810円	207,824円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	130,544円	127,183円
計	320,315,770,753円	286,407,723,256円
2 . 受益権の総数	320,315,770,753口	286,407,723,256口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(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)デリバティブ取引 「(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)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	14,933,279,836	6,527,210,258
合計	14,933,279,836	6,527,210,258

(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期末日までの期間（平成23年2月22日から平成24年1月11日まで及び平成24年2月22日から平成25年1月11日まで）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

種類	平成24年1月11日 現在			平成25年1月11日 現在				
	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1 年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	93,786,574	-	93,776,430	10,144	89,283,643	-	90,908,160	1,624,517
ユーロ	93,786,574	-	93,776,430	10,144	89,283,643	-	90,908,160	1,624,517
買 建	1,289,812,771	-	1,290,183,330	370,559	-	-	-	-
アメリカ・ドル	645,078,900	-	645,330,720	251,820	-	-	-	-
イギリス・ポンド	90,259,500	-	90,348,800	89,300	-	-	-	-
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	-	-	-	-
合計	1,383,599,345	-	1,383,959,760	380,703	89,283,643	-	90,908,160	1,624,517

(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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1065円	1.3927円
(1万口当たり純資産額)	(11,065円)	(13,927円)

[前](#) [次](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 07/31/14	15,000,000.000	14,979,450.000	
		US T N/B 0.25 05/31/14	20,000,000.000	20,011,600.000	
		US T N/B 0.25 09/15/14	40,000,000.000	40,029,600.000	
		US T N/B 0.375 06/15/15	20,000,000.000	20,035,000.000	
		US T N/B 0.5 07/31/17	10,000,000.000	9,909,700.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	20,000,000.000	19,970,200.000	
		US T N/B 0.75 06/15/14	20,000,000.000	20,155,400.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	20,000,000.000	20,357,800.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	7,000,000.000	6,903,960.000	
		US T N/B 1.0 10/31/16	19,000,000.000	19,333,070.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,000,000.000	5,890,500.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	15,000,000.000	14,980,050.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	30,000,000.000	30,725,100.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	23,000,000.000	23,570,400.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	10,000,000.000	9,997,200.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	10,000,000.000	10,179,200.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	12,000,000.000	12,270,840.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	15,000,000.000	15,434,700.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	15,000,000.000	15,310,500.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	8,000,000.000	7,844,640.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	9,000,000.000	8,782,650.000	
		US T N/B 1.75 03/31/14	40,000,000.000	40,754,400.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	16,000,000.000	15,933,600.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	20,000,000.000	20,871,000.000	
US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.000	8,290,240.000			
US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.000	15,579,450.000			
US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.000	8,424,640.000			

US T N/B 1.875 09/30/17	18,000,000.000	18,952,560.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	17,000,000.000	17,363,120.000	
US T N/B 2.0 04/30/16	18,000,000.000	18,925,920.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	13,000,000.000	13,330,980.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	15,000,000.000	15,583,500.000	
US T N/B 2.125 11/30/14	30,000,000.000	31,055,700.000	
US T N/B 2.25 01/31/15	25,000,000.000	26,016,500.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	19,000,000.000	20,352,230.000	
US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.000	24,027,640.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.000	21,251,400.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	12,000,000.000	12,943,560.000	
US T N/B 2.375 09/30/14	35,000,000.000	36,283,450.000	
US T N/B 2.5 03/31/15	30,000,000.000	31,483,500.000	
US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.000	21,013,200.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	18,000,000.000	19,449,720.000	
US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.000	31,062,600.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	14,000,000.000	15,218,420.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	19,000,000.000	20,622,410.000	
US T N/B 2.625 12/31/14	25,000,000.000	26,168,750.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	11,000,000.000	12,104,290.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	12,000,000.000	11,258,400.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	6,500,000.000	6,085,625.000	
US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.000	21,685,800.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	11,042,500.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.000	21,945,200.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	11,000,000.000	10,894,290.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.000	21,818,600.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	11,000,000.000	11,182,160.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	19,892,700.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	14,619,800.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	11,000,000.000	12,340,130.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	11,000,000.000	11,195,030.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	12,000,000.000	13,314,840.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.000	27,384,750.000	

US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.000	22,098,400.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	12,000,000.000	13,681,800.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	15,880,060.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	7,000,000.000	7,705,460.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	16,100,000.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	20,843,280.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	15,000,000.000	17,421,000.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	10,404,810.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	8,000,000.000	9,152,480.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	15,000,000.000	17,370,600.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	9,258,080.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	8,500,000.000	9,950,950.000	
US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.000	41,670,000.000	
US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.000	21,557,000.000	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	14,027,760.000	
US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.000	19,606,500.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	6,000,000.000	7,458,240.000	
US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.000	29,796,760.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.000	16,516,950.000	
US T N/B 4.25 11/15/14	36,500,000.000	39,180,195.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.000	16,330,160.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	9,000,000.000	11,199,690.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	4,000,000.000	5,057,800.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	8,000,000.000	10,150,560.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	6,000,000.000	7,616,220.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	9,000,000.000	11,413,080.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.000	18,016,160.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	5,000,000.000	6,423,800.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	5,000,000.000	6,442,950.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	5,000,000.000	6,461,700.000	
US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.000	20,106,540.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	22,000,000.000	25,580,060.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	8,000,000.000	10,536,800.000	
US T N/B 4.75 02/15/37	1,500,000.000	1,996,875.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	7,000,000.000	9,407,860.000	

	US T N/B 4.75 05/15/14	40,000,000.000	42,438,800.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	17,751,450.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.000	19,636,190.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	2,000,000.000	2,754,060.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	3,000,000.000	4,075,290.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.000	4,066,860.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	4,000,000.000	5,592,160.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,000,000.000	1,387,570.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.000	5,697,160.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.000	8,759,520.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	4,000,000.000	6,066,240.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	7,000,000.000	9,910,740.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	1,500,000.000	2,240,730.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	3,000,000.000	4,469,280.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.000	12,250,700.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.000	4,466,460.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.000	17,702,300.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	1,000,000.000	1,570,390.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	9,172,020.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	5,783,400.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.000	9,435,230.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	5,862,160.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,684,500,000.000 (150,291,090,000)	1,831,903,455.000 (163,442,426,255)	
	イギリス・ポンド			
	UK TREASURY 1.0 09/07/17	6,000,000.000	5,998,200.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	6,000,000.000	6,214,800.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	4,500,000.000	4,366,800.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	8,500,000.000	8,851,900.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	5,000,000.000	5,107,000.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,000,000.000	9,420,300.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,000,000.000	976,600.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,500,000.000	3,763,900.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	5,000,000.000	5,735,000.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	6,500,000.000	7,469,800.000	

	UK TREASURY 3.75 09/07/21	6,500,000.000	7,471,490.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,000,000.000	4,598,000.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	5,000,000.000	5,858,500.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	8,000,000.000	8,954,400.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	5,000,000.000	5,923,500.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	5,500,000.000	6,576,350.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	4,000,000.000	4,719,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	4,000,000.000	4,812,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	5,000,000.000	5,897,500.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	5,500,000.000	6,503,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	4,500,000.000	5,335,650.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	4,000,000.000	4,794,000.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	5,500,000.000	6,535,650.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,000,000.000	6,141,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	5,800,000.000	7,140,960.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,000,000.000	7,298,400.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	6,000,000.000	6,676,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,500,000.000	5,723,100.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	5,000,000.000	6,377,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.000	6,574,150.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	5,000,000.000	6,423,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	7,000,000.000	7,529,900.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	3,500,000.000	5,042,800.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	3,500,000.000	5,209,750.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	2,000,000.000	2,434,600.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	2,500,000.000	3,383,750.000	
	イギリス・ポンド 小計	182,800,000.000 (26,350,620,000)	211,840,250.000 (30,536,772,038)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,500,000.000	5,965,245.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	5,000,000.000	5,605,050.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	6,000,000.000	7,066,740.000	

	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	6,000,000.000	6,291,660.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,000,000.000	925,270.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	800,000.000	732,744.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,000,000.000	2,210,680.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	6,000,000.000	6,371,760.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	4,500,000.000	5,026,545.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	4,000,000.000	4,707,080.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,700,000.000	4,405,812.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	7,000,000.000	7,847,630.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	6,500,000.000	6,988,345.000	
オーストラリア・ドル 小計		58,000,000.000 (5,477,520,000)	64,144,561.000 (6,057,812,341)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,500,000.000	2,553,525.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	3,000,000.000	3,006,150.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,000,000.000	949,250.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	3,000,000.000	3,002,790.000	
	CANADA 2.0 03/01/14	2,700,000.000	2,725,785.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	12,000,000.000	12,180,240.000	
	CANADA 2.25 08/01/14	3,000,000.000	3,048,960.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	4,000,000.000	4,272,200.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.000	4,187,760.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	6,000,000.000	6,287,280.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	3,000,000.000	3,320,580.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,500,000.000	5,036,175.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,400,000.000	2,937,360.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,500,000.000	6,194,265.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	7,500,000.000	8,151,075.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.000	3,875,690.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	5,000,000.000	6,511,250.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.000	3,990,490.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.000	8,615,120.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.000	10,522,600.000	
CANADA 5.0 06/01/37	4,000,000.000	5,785,400.000		
CANADA 5.75 06/01/29	4,000,000.000	5,833,560.000		
CANADA 5.75 06/01/33	4,000,000.000	6,084,880.000		
CANADA 9.0 06/01/25	800,000.000	1,395,192.000		
カナダ・ドル 小計		105,900,000.000 (9,614,661,000)	120,467,577.000 (10,937,251,316)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.75 04/01/42	800,000.000	833,248.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	3,000,000.000	3,190,830.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.000	884,688.000	

	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,200,000.000	2,549,074.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.000	3,222,240.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,500,000.000	2,960,250.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	3,000,000.000	3,149,730.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.000	3,372,660.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	3,000,000.000	3,563,970.000	
シンガポール・ドル 小計		21,100,000.000 (1,539,667,000)	23,726,690.000 (1,731,336,569)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	8,000,000.000	7,734,720.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	15,000,000.000	15,993,300.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	14,000,000.000	16,462,740.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	24,000,000.000	27,536,400.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	18,000,000.000	20,042,640.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	21,000,000.000	24,450,090.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	18,000,000.000	19,632,420.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	15,000,000.000	18,717,300.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	25,000,000.000	26,940,500.000	
スウェーデン・クローナ 小計		158,000,000.000 (2,172,500,000)	177,510,110.000 (2,440,764,013)	
デンマーク・クロー ネ	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.000	6,224,400.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	24,000,000.000	27,502,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	35,000,000.000	38,888,500.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	21,000,000.000	24,597,930.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	29,500,000.000	35,774,650.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	33,500,000.000	49,325,735.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	8,000,000.000	12,744,800.000	
デンマーク・クローネ 小計		157,000,000.000 (2,491,590,000)	195,058,815.000 (3,095,583,394)	
ノルウェー・クロー ネ	NORWAY 3.75 05/25/21	11,500,000.000	13,044,450.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	15,000,000.000	16,702,500.000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		NORWAY 4.5 05/22/19	12,000,000.000	13,956,000.000	
		NORWAY 5.0 05/15/15	19,000,000.000	20,563,700.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		57,500,000.000 (929,200,000)	64,266,650.000 (1,038,549,064)	
	ポーランド・ズロチ	POLAND 4.75 10/25/16	9,000,000.000	9,396,000.000	
		POLAND 5.0 04/25/16	7,000,000.000	7,322,000.000	
		POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.000	12,936,000.000	
		POLAND 5.25 10/25/20	9,000,000.000	9,934,650.000	
		POLAND 5.5 04/25/15	7,000,000.000	7,307,650.000	
		POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.000	10,016,100.000	
		POLAND 5.75 04/25/14	13,000,000.000	13,375,050.000	
		POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.000	3,625,950.000	
		POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.000	10,395,000.000	
		POLAND 5.75 10/25/21	3,500,000.000	4,000,500.000	
		POLAND 6.25 10/24/15	13,500,000.000	14,485,500.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		95,000,000.000 (2,751,200,000)	102,794,400.000 (2,976,925,824)	
	マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,962,750.000	
		MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.000	4,892,450.000	
		MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.000	7,164,570.000	
		MALAYSIA 3.835 08/12/15	12,000,000.000	12,218,280.000	
		MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,000,000.000	2,062,420.000	
		MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,181,920.000	
		MALAYSIA 4.24 02/07/18	10,000,000.000	10,451,300.000	
		MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.000	7,264,180.000	
		MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,000,000.000	8,484,400.000	
		MALAYSIA 5.094 04/30/14	7,000,000.000	7,180,320.000	
		MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.000	2,352,820.000	
	マレーシア・リンギット 小計		69,000,000.000 (2,039,640,000)	71,215,410.000 (2,105,127,520)	
	メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	15,000,000.000	21,666,000.000	
		MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.000	76,793,200.000	
		MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	10,000,000.000	10,416,600.000	
		MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	25,000,000.000	27,043,750.000	
		MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.000	78,290,100.000	
		MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	70,000,000.000	82,173,700.000	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	52,000,000.000	65,556,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	48,000,000.000	60,721,440.000	
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	102,000,000.000	110,914,800.000	
メキシコ・ペソ 小計		447,000,000.000 (3,160,290,000)	533,575,990.000 (3,772,382,249)	
ユーロ	AUSTRIA 3.15 06/20/44	800,000.000	864,536.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,700,000.000	1,883,260.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.000	3,171,300.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,800,000.000	2,049,444.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	4,000,000.000	4,329,600.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,500,000.000	5,172,750.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,500,000.000	2,904,500.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	4,500,000.000	5,293,350.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,500,000.000	5,076,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,700,000.000	4,669,400.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	2,500,000.000	2,653,650.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	3,000,000.000	3,498,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	4,000,000.000	4,769,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.000	4,758,800.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.000	3,240,000.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	2,200,000.000	3,248,520.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.000	3,220,590.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,500,000.000	1,644,300.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	4,000,000.000	4,384,000.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.000	5,357,450.000	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	2,000,000.000	2,232,160.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.000	5,461,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	5,500,000.000	6,301,955.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	2,000,000.000	2,093,640.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	5,500,000.000	6,237,880.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	3,000,000.000	3,455,790.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	3,500,000.000	4,063,185.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	4,500,000.000	5,231,295.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	2,000,000.000	2,280,020.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,500,000.000	4,153,240.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	4,000,000.000	4,277,120.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	4,500,000.000	5,320,035.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	4,000,000.000	4,713,680.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	2,000,000.000	2,407,820.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,200,000.000	6,758,492.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	4,700,000.000	6,291,937.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	3,000,000.000	3,630,000.000	
	BUNDESOBL 2.75 04/08/16	11,000,000.000	11,898,480.000	
	DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	5,000,000.000	4,974,450.000	
	DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	7,000,000.000	7,140,420.000	
	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	6,000,000.000	6,285,600.000	

DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	5,000,000.000	5,402,000.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	5,000,000.000	5,363,000.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	6,500,000.000	7,128,550.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,000,000.000	2,032,200.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	6,000,000.000	6,809,400.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	7,000,000.000	8,058,050.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	13,500,000.000	14,538,150.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	5,500,000.000	6,346,450.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,600,000.000	5,433,520.000	
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	14,000,000.000	15,373,400.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	7,000,000.000	8,143,310.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	14,000,000.000	15,010,940.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	14,000,000.000	15,864,520.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	8,000,000.000	9,380,000.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.000	8,172,150.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	7,000,000.000	9,086,000.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	12,000,000.000	13,542,960.000	
DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	12,000,000.000	12,492,600.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	17,000,000.000	18,040,400.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	12,000,000.000	14,006,400.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,500,000.000	7,744,945.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,800,000.000	5,193,840.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	3,500,000.000	4,714,150.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	6,000,000.000	8,448,600.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,000,000.000	7,379,000.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,300,000.000	7,842,410.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	4,200,000.000	6,113,520.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	3,500,000.000	5,106,850.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,000,000.000	4,717,800.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	3,500,000.000	5,479,600.000	

FINLAND 1.625 09/15/22	1,000,000.000	990,700.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.000	3,140,700.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,000,000.000	1,064,150.000	
FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.000	1,575,525.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	2,000,000.000	2,295,600.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.000	1,734,750.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	2,000,000.000	2,300,000.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.000	3,402,140.000	
FINLAND 4.25 07/04/15	2,500,000.000	2,752,000.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.000	2,417,100.000	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	8,000,000.000	8,562,480.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	3,000,000.000	4,751,730.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	19,000,000.000	20,409,800.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,000,000.000	2,048,600.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	10,000,000.000	10,621,000.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	9,000,000.000	9,743,490.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	19,000,000.000	20,422,340.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	15,000,000.000	16,397,400.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	10,000,000.000	11,086,400.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	9,000,000.000	10,222,110.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	10,000,000.000	11,062,000.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	17,000,000.000	19,180,250.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	8,500,000.000	9,783,755.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	9,000,000.000	10,369,710.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/14	12,000,000.000	12,612,000.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.000	10,389,240.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,000,000.000	4,584,000.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,000,000.000	3,436,050.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/14	20,000,000.000	21,374,000.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	7,300,000.000	8,420,550.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	9,500,000.000	11,210,190.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.000	9,272,000.000	

FRANCE OAT 4.25 10/25/18	7,000,000.000	8,215,200.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,000,000.000	13,072,950.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	7,000,000.000	8,714,300.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,500,000.000	8,275,215.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	9,000,000.000	10,494,180.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,000,000.000	10,864,400.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,300,000.000	8,973,846.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.000	8,332,800.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	4,390,500.000	
IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.000	3,067,200.000	
IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.000	3,065,100.000	
IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.000	3,055,950.000	
IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.000	3,145,200.000	
IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.000	3,198,390.000	
IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.000	2,088,800.000	
IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.000	3,129,000.000	
IRISH 5.9 10/18/19	2,000,000.000	2,211,300.000	
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	13,000,000.000	13,364,000.000	
ITALY BTPS 3.5 06/01/14	7,000,000.000	7,218,400.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	7,000,000.000	7,056,350.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.000	10,524,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.000	15,702,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.000	14,735,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	9,000,000.000	9,037,800.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	16,000,000.000	16,937,600.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	8,000,000.000	7,145,600.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	8,000,000.000	8,225,600.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	11,000,000.000	11,612,700.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.000	8,450,400.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	8,000,000.000	8,361,600.000	
ITALY BTPS 4.25 08/01/14	16,000,000.000	16,723,680.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	8,000,000.000	8,428,000.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.000	9,679,500.000	

ITALY BTPS 4.5 02/01/20	6,500,000.000	6,905,600.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,500,000.000	8,015,250.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	5,500,000.000	5,557,200.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	9,000,000.000	9,662,400.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.000	7,365,400.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	7,000,000.000	7,483,700.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	5,500,000.000	5,931,750.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,000,000.000	7,431,970.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	6,500,000.000	6,655,350.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	6,000,000.000	6,164,400.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	6,000,000.000	6,154,800.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.000	8,862,400.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	7,500,000.000	7,950,750.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	6,000,000.000	6,678,660.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,000,000.000	3,333,360.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	4,000,000.000	4,464,400.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	9,000,000.000	10,290,600.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	7,500,000.000	8,926,500.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.000	4,435,550.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.000	5,590,400.000	
NETHERLANDS 0.75 04/15/15	1,000,000.000	1,012,550.000	
NETHERLANDS 1.0 01/15/14	2,500,000.000	2,524,625.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	3,000,000.000	3,134,220.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	5,500,000.000	5,926,690.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,000,000.000	2,019,440.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.000	5,256,500.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.000	6,450,600.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.000	5,700,000.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	4,500,000.000	5,206,050.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	4,000,000.000	5,074,000.000	

	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	6,500,000.000	6,854,900.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,200,000.000	5,346,600.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.000	5,620,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.000	6,987,600.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	5,000,000.000	5,896,000.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.000	5,851,500.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,000,000.000	5,657,600.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,000,000.000	6,098,400.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.000	6,072,900.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.000	7,037,800.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	6,000,000.000	6,111,480.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,500,000.000	5,615,225.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.000	6,056,400.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	7,000,000.000	6,834,100.000	
	SPAIN 4.0 07/30/15	5,000,000.000	5,186,500.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.000	6,059,700.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,500,000.000	4,511,980.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	9,000,000.000	9,256,500.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	5,000,000.000	5,178,050.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.000	5,522,275.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.000	7,260,050.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,000,000.000	6,136,800.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,000,000.000	4,695,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,500,000.000	3,007,200.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	8,000,000.000	8,345,440.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	5,500,000.000	5,332,525.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	6,000,000.000	6,098,100.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,500,000.000	3,067,750.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	6,500,000.000	6,831,175.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,500,000.000	5,945,500.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,500,000.000	4,650,390.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	3,000,000.000	3,210,360.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	2,593,500.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	6,000,000.000	6,354,180.000	
	ユーロ 小計	1,222,600,000.000 (144,731,388,000)	1,360,939,780.000 (161,108,051,156)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	50,000,000.000	64,933,000.000	
	SOUTH AFRICA 13.5 09/15/15	25,000,000.000	30,015,000.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	30,000,000.000	24,741,600.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	50,000,000.000	51,610,000.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	50,000,000.000	55,192,500.000	
	南アフリカ・ランド 小計	205,000,000.000	226,492,100.000	

		(2,111,500,000)	(2,332,868,630)	
国債証券 合計		353,660,866,000	391,575,850,371	
		(353,660,866,000)	(391,575,850,371)	
合計		353,660,866,000	391,575,850,371	
		(353,660,866,000)	(391,575,850,371)	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 118銘柄	40.98%	41.74%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	7.66%	7.80%
オーストラリア・ドル	国債証券 13銘柄	1.52%	1.55%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	2.74%	2.79%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.43%	0.44%
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	0.61%	0.62%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.78%	0.79%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	0.26%	0.27%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.75%	0.76%
マレーシア・リングgit	国債証券 11銘柄	0.53%	0.54%
メキシコ・ペソ	国債証券 9銘柄	0.95%	0.96%
ユーロ	国債証券 200銘柄	40.39%	41.14%
南アフリカ・ランド	国債証券 5銘柄	0.58%	0.60%

(注) 「組入時価比率」は、純資産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

「(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](#)

「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

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		24,403,112	26,075,947
コール・ローン		13,859,446	23,776,901
投資信託受益証券		362,196,875	445,484,133
投資証券		2,104,604,573	2,412,674,916
未収配当金		10,714,409	14,406,397
流動資産合計		2,515,778,415	2,922,418,294
資産合計		2,515,778,415	2,922,418,294
負債の部			
流動負債			
未払解約金		175,000	700,000
流動負債合計		175,000	700,000
負債合計		175,000	700,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	3,472,218,155	2,807,145,592
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	956,614,740	114,572,702
元本等合計		2,515,603,415	2,921,718,294
純資産合計		2,515,603,415	2,921,718,294
負債純資産合計		2,515,778,415	2,922,418,294

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1 . 1 本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	5,089,591,953円	3,472,218,155円
同期中追加設定元本額	66,409,391円	198,987,156円
同期中一部解約元本額	1,683,783,189円	864,059,719円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	46,062,427円	38,177,163円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	503,071,359円	470,694,534円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	39,015,043円	41,933,299円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	2,708,943,679円	2,111,558,594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）	175,125,647円	144,782,002円
計	3,472,218,155円	2,807,145,592円
2 . 受益権の総数	3,472,218,155口	2,807,145,592口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は956,614,740円であります。	

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成23年1月12日 至 平成24年1月11日	自 平成24年1月12日 至 平成25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

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年1月11日現在	平成25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ぬ。	同左
2． 時価の算定方法	(1)有価証券 「（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)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）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。	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つた場合、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

種類	平成24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
	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	7,098,111	9,044,830
投資証券	7,160,175	93,659,538
合計	14,258,286	102,704,368

(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期末日までの期間(平成23年11月8日から平成24年1月11日まで及び平成24年11月7日から平成25年1月11日まで)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24年1月11日現在	平成25年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.7245円	1.0408円
(1万口当たり純資産額)	(7,245円)	(10,408円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	16,920.000	36,547.200		
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,590.000	70,770.000		
		BWP TRUST	20,500.000	45,920.000		
		CENTRO RETAIL AUSTRALIA	50,000.000	115,500.000		
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	93,529.000	183,316.840		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	8,480.000	31,460.800		
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	152,300.000	157,630.500		
		DEXUS PROPERTY GROUP	247,400.000	248,637.000		
		GOODMAN GROUP	67,152.000	294,797.280		
		GPT GROUP	86,000.000	310,460.000		
		INVESTA OFFICE FUND	40,270.000	119,601.900		
		MIRVAC GROUP	191,854.000	295,455.160		
		STOCKLAND	110,440.000	387,644.400		
		WESTFIELD GROUP	92,058.000	991,464.660		
	WESTFIELD RETAIL TRUST	113,200.000	342,996.000			
	オーストラリア・ドル 小計			1,313,693.000	3,632,201.740 (343,025,132)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	92,000.000	223,560.000		
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	150,000.000	252,750.000		
		CAPITAMALL TRUST	106,000.000	228,960.000		
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	71,000.000	117,505.000		
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	58,000.000	114,550.000		
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110,000.000	117,700.000		
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	50,000.000	66,000.000		
STARHILL GLOBAL REIT		120,000.000	97,200.000			
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		110,000.000	185,900.000			
シンガポール・ドル 小計			867,000.000	1,404,125.000 (102,459,001)		
投資信託受益証券 合計			2,180,693	445,484,133 (445,484,133)		
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	4,585.000	117,009.200		
		AGREE REALTY CORP	1,100.000	30,899.000		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,450.000	248,124.000		
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,209.000	150,630.460		
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7,715.000	211,776.750		
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,700.000	84,161.000		

AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,798.000	657,757.820	
BIOMED REALTY TRUST INC	8,300.000	164,091.000	
BOSTON PROPERTIES INC	6,888.000	739,771.200	
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,700.000	71,535.000	
BRE PROPERTIES -CL A	2,500.000	127,500.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,800.000	261,668.000	
CAPLEASE INC	7,000.000	40,110.000	
CBL & ASSOCIATES	5,530.000	118,286.700	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,300.000	26,712.000	
COLONIAL PROPERTIES TRUST	3,500.000	74,970.000	
COMMONWEALTH REIT	4,325.000	67,945.750	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,800.000	95,988.000	
COUSINS PROPERTIES INC	909.000	7,762.860	
CUBESMART	8,900.000	127,092.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,000.000	106,400.000	
DDR CORP	12,882.000	201,216.840	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,372.000	77,859.600	
DIGITAL REALTY TRUST INC	5,510.000	381,402.200	
DOUGLAS EMMETT INC	5,445.000	129,373.200	
DUKE REALTY TRUST	10,100.000	148,975.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	3,500.000	86,345.000	
EAST GROUP	2,300.000	124,821.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.000	82,446.000	
EPR PROPERTIES	2,200.000	101,134.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,855.000	130,350.850	
EQUITY RESIDENTIAL	13,600.000	793,832.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,060.000	311,595.600	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,900.000	223,020.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,390.000	357,339.900	
FELCOR LODGING TR INC	4,700.000	22,748.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	4,600.000	65,642.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,400.000	31,248.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.000	73,302.000	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	19,997.000	382,342.640	
GETTY REALTY CORP	1,700.000	31,399.000	
GLIMCHER REALTY TRUST	9,200.000	102,488.000	
HCP INC	20,900.000	960,355.000	
HEALTH CARE REIT INC	11,201.000	694,349.990	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.000	144,362.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,400.000	53,872.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,300.000	114,510.000	
HOME PROPERTIES INC	2,400.000	150,768.000	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,000.000	168,210.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	35,768.000	604,479.200	
INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.000	42,385.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	11,500.000	104,535.000	
KILROY REALTY CORP	4,400.000	215,072.000	
KIMCO REALTY	17,422.000	345,129.820	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,000.000	133,000.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	3,521.000	37,463.440	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,128.000	190,710.320	
LTC PROPERTIES INC	1,601.000	58,228.370	
MACK CALI	5,300.000	141,139.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,900.000	49,218.000	
MID AMERICA	2,200.000	144,606.000	
NATIONAL HEALTH INVS INC	2,000.000	119,180.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,000.000	160,100.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	3,500.000	86,485.000	
PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.000	75,754.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	700.000	16,975.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600.000	103,992.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,400.000	135,420.000	
POST PROPERTIES, INC	2,200.000	110,088.000	
PROLOGIS INC	20,797.000	791,117.880	
PS BUSINESS PARKS	400.000	27,296.000	
PUBLIC STORAGE	6,644.000	971,884.320	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.000	77,616.000	
REALTY INCOME CORP	7,290.000	312,012.000	
REGENCY CENTERS CORP	5,020.000	243,570.400	
ROUSE PROPERTIES INC	1,311.000	23,624.220	
SAUL CENTERS INC	800.000	34,944.000	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	6,800.000	164,628.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	13,724.000	2,194,467.600	
SL GREEN	3,825.000	302,404.500	
SOVRAN SELF STORAGE INC	1,016.000	64,180.720	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.000	52,880.000	
SUN COMMUNITIES INC	1,200.000	49,896.000	
TANGER FACTORY OUTLET	4,700.000	164,171.000	
TAUBMAN CENTERS INC	3,100.000	250,232.000	
THE MACERICH COMPANY	6,020.000	350,243.600	
UDR INC	10,969.000	267,643.600	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.000	47,700.000	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.000	51,064.000	
VENTAS INC	13,568.000	884,090.880	
VORNADO REALTY TRUST	7,429.000	602,120.450	

	WASHINGTON REIT	4,000.000	108,400.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	7,100.000	196,670.000	
アメリカ・ドル 小計		583,974.000	20,782,315.880 (1,854,198,222)	
イギリス・ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.000	37,500.000	
	BRITISH LAND CO PLC	45,200.000	256,962.000	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	17,804.000	64,966.790	
	DERWENT LONDON PLC	4,700.000	102,554.000	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	21,400.000	105,266.600	
	HAMMERSON PLC	27,200.000	132,763.200	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,978.000	274,376.960	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	36,000.000	39,636.000	
	SEGRO PLC	40,990.000	100,835.400	
	SHAFTESBURY PLC	16,000.000	90,000.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	7,067.000	21,639.150	
イギリス・ポンド 小計		259,339.000	1,226,500.100 (176,799,989)	
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	900.000	56,961.000	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVST TR	3,400.000	100,266.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	2,681.000	66,676.470	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.000	117,369.000	
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	1,300.000	13,871.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVST TR	1,200.000	27,000.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	5,400.000	129,492.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVST TR	4,500.000	18,675.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVST TR	5,900.000	107,085.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	4,900.000	130,389.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	8,800.000	241,120.000	
	カナダ・ドル 小計		41,681.000	1,008,904.470 (91,598,437)
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	73,600.000	74,704.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.000	56,250.000	
ニュージーランド・ドル 小計		123,600.000	130,954.000 (9,856,907)	
ユーロ	BEFIMMO	1,104.000	54,719.760	
	COFINIMMO SA	1,090.000	97,010.000	
	CORIO NV	5,123.000	186,272.280	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	2,120.000	64,310.200	
	FONCIERE DES REGIONS	2,000.000	124,600.000	
	GECINA SA	1,470.000	126,699.300	

	ICADE	325.000	21,099.000	
	KLEPIERRE	5,470.000	162,130.800	
	MERCIALYS	3,065.000	51,859.800	
	NIEUWE STEEN INVS	2,691.000	18,826.230	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,040.000	713,060.000	
	VASTNED RETAIL	700.000	23,345.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	904.000	39,776.000	
	WERELDHAVE NV	1,500.000	79,395.000	
	ユーロ 小計	31,602.000	1,763,103.370 (208,716,177)	
	香港・ドル			
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	78,000.000	499,200.000	
	LINK REIT/THE	127,000.000	4,991,100.000	
	PROSPERITY REIT	106,000.000	261,820.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100,000.000	221,000.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000.000	239,320.000	
	香港・ドル 小計	473,000.000	6,212,440.000 (71,505,184)	
投資証券 合計		1,513,196	2,412,674,916 (2,412,674,916)	
合計			2,858,159,049 (2,858,159,049)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 93銘柄	-%	63.46%	64.87%
イギリス・ポンド	投資証券 11銘柄	-%	6.05%	6.19%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 15銘柄	11.74%	-%	12.00%
カナダ・ドル	投資証券 11銘柄	-%	3.14%	3.20%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 9銘柄	3.51%	-%	3.58%
ニュージーランド・ドル	投資証券 2銘柄	-%	0.34%	0.34%
ユーロ	投資証券 14銘柄	-%	7.14%	7.30%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	-%	2.45%	2.50%

(注) 「組入時価比率」は、純資産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25年1月31日現在

資産総額	9,140,736,073円
負債総額	23,055,411円
純資産総額（ - ）	9,117,680,662円
発行済数量	11,061,204,985口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8243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25年1月31日現在

資産総額	299,424,675,909円
負債総額	1,039,479,754円
純資産総額（ - ）	298,385,196,155円
発行済数量	232,265,488,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2847円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産総額	453,745,432,493円
負債総額	14,141,791,000円
純資産総額（ - ）	439,603,641,493円
発行済数量	377,787,759,741口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1636円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産総額	18,228,350,659円
負債総額	541,261,000円
純資産総額（ - ）	17,687,089,659円
発行済数量	16,480,207,376口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0732円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産総額	315,130,058,346円
負債総額	866,785,701円
純資産総額（ - ）	314,263,272,645円
発行済数量	185,761,272,634口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6918円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年1月31日現在

資産総額	406,188,017,945円
負債総額	883,091,530円
純資産総額（ - ）	405,304,926,415円
発行済数量	284,183,259,725口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4262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25年1月31日現在

資産総額	3,018,856,752円
負債総額	0円
純資産総額(-)	3,018,856,752円
発行済数量	2,796,376,901口
1口当たり純資産額(/)	1.0796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、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。

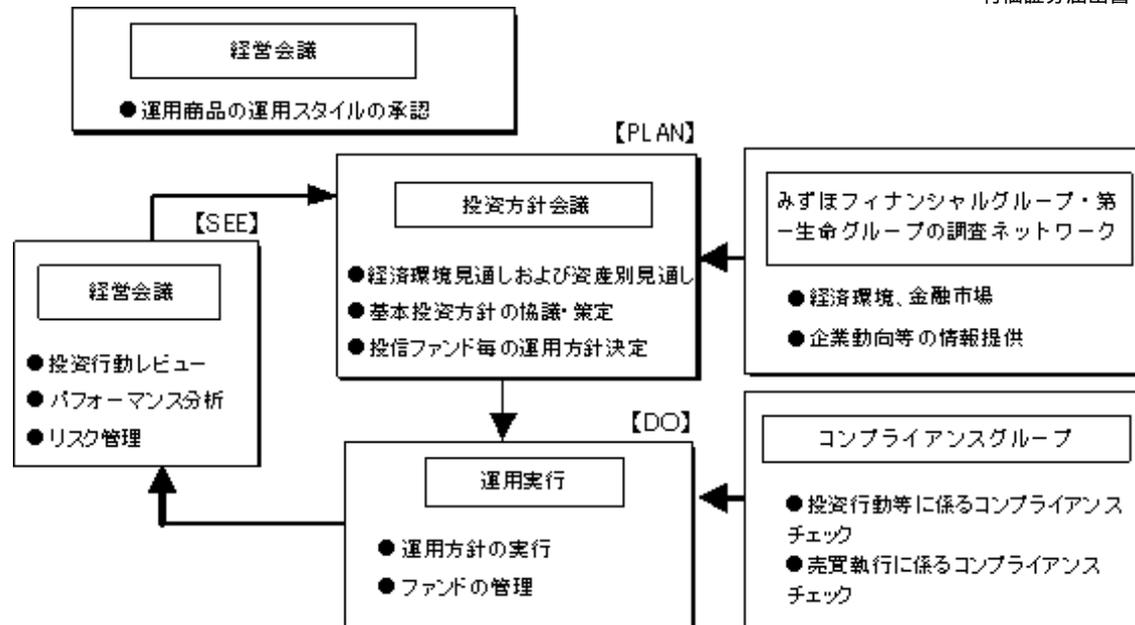
投資運用の意思決定機構

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25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」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。平成25年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は281本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	12	56,036,323,987
追加型株式投資信託	260	4,460,166,095,770
単位型公社債投資信託	8	83,948,092,514
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	165,486,740
合計	281	4,600,315,999,011

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。

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、第27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24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28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,220,759	12,520,748
金銭の信託	5,967,344	6,548,577
前払費用	27,593	25,744
未収委託者報酬	2,942,180	2,780,527
未収運用受託報酬	1,061,935	1,167,998
未収投資助言報酬	2 267,240	2 241,851
未収収益	186,483	212,226
繰延税金資産	403,201	344,793
その他	102,404	22,264
流動資産計	23,179,143	23,864,733
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 183,704	1 167,433
車両運搬具	-	1 4,752
器具備品	1 206,306	1 188,367
建設仮勘定	10,956	109,529
無形固定資産		
商標権	1 510	1 383
ソフトウェア	1 780,190	1 1,101,685
ソフトウェア仮勘定	478,971	152,513
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 451	1 371
投資その他の資産		
投資有価証券	4,252,397	3,982,258
関係会社株式	604,498	450,882
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
繰延税金資産	402,191	590,822
長期差入保証金	702,696	731,197
その他	85,690	90,282
固定資産計	5,920,638	5,714,444
資産合計	29,099,782	29,579,177

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	120,910	132,805
未払金	1,479,756	1,460,128
未払収益分配金	3,223	670
未払償還金	98,362	86,391
未払手数料	1,134,992	1,088,348
その他未払金	243,178	284,718
未払費用	2 1,226,658	2 1,105,512
未払法人税等	1,706,391	1,195,056
未払消費税等	143,728	92,354
賞与引当金	575,326	574,646
その他	10,000	-
流動負債計	5,262,771	4,560,503
固定負債		
退職給付引当金	579,063	680,768
役員退職慰労引当金	100,260	56,690
固定負債計	679,324	737,458
負債合計	5,942,095	5,297,962
（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	18,512,674	19,716,594
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	13,430,000	15,630,000
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	4,459,380	3,463,300
株主資本計	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216,534	136,143
評価・換算差額等計	216,534	136,143
純資産合計	23,157,686	24,281,215
負債・純資産合計	29,099,782	29,579,177

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		24,367,005		23,208,602
運用受託報酬		4,458,894		4,966,992
投資助言報酬		1,019,727		943,057
その他営業収益		789,867		697,063
営業収益計		30,635,495		29,815,715
営業費用				
支払手数料		10,405,593		10,154,958
広告宣伝費		272,928		164,286
公告費		2,297		-
調査費		4,755,890		4,590,302
調査費		2,611,173		2,888,013
委託調査費		2,144,716		1,702,289
委託計算費		338,206		335,754
営業雑経費		671,721		496,565
通信費		30,286		26,941
印刷費		585,041		399,066
協会費		23,561		25,014
諸会費		38		41
支払販売手数料		32,794		45,500
営業費用計		16,446,637		15,741,867
一般管理費				
給料		4,576,265		4,630,102
役員報酬	1	235,289	1	245,224
給料・手当		3,768,114		3,824,122
賞与		572,860		560,755
交際費		38,997		35,987
寄付金		13,335		3,156
旅費交通費		255,190		213,642
租税公課		89,571		84,346
不動産賃借料		718,929		656,463
退職給付費用		139,773		164,627
固定資産減価償却費		486,987		475,556
福利厚生費		20,476		24,887
修繕費		20,842		6,721
賞与引当金繰入		575,326		574,646
役員退職慰労引当金繰入		42,036		30,048
役員退職金		13,140		27,503
機器リース料		1,951		1,510
事務委託費		331,935		323,740
消耗品費		70,952		58,739
器具備品費		575		2,889
諸経費		124,218		114,695
一般管理費計		7,520,506		7,429,267
営業利益		6,668,351		6,644,580

（単位：千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）		第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	4	341,775		61,720
受取利息		9,168		3,921
時効成立分配金		2,574		11,383
為替差益		-		1,660
投資信託解約益		157,213		-
先物利益		9,816		-
金銭の信託運用益		69,014		-
雑収入		8,602		5,992
営業外収益計		598,165		84,678
営業外費用				
為替差損		755		-
時効成立後支払分配金		-		36
金銭の信託運用損		-		417,812
雑損失		6,089		1,152
営業外費用計		6,844		419,001
経常利益		7,259,672		6,310,257
特別利益				
ゴルフ会員権売却益		-		1,959
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		1,959
特別損失				
固定資産除却損	2	31,419	2	36,415
固定資産売却損		1,440		381
関係会社株式評価損		3,825		338,244
特別損失計		36,684		375,042
税引前当期純利益		7,332,518		5,937,173
法人税、住民税及び事業税		2,885,426		2,582,251
法人税等調整額		7,586		56,997
法人税等合計		2,877,839		2,525,253
当期純利益		4,454,678		3,411,920

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	11,650,000	13,430,000
当期変動額	1,780,000	2,200,000
当期末残高	13,430,000	15,630,000
研究開発積立金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	3,464,702	4,459,380
当期変動額		
剰余金の配当	1,680,000	2,208,000
別途積立金の積立	1,780,000	2,200,000
当期純利益	4,454,678	3,411,920
当期末残高	4,459,380	3,463,300
利益剰余金合計		
当期首残高	15,737,995	18,512,674
当期変動額	2,774,678	1,203,920
当期末残高	18,512,674	19,716,594
株主資本合計		
当期首残高	20,166,473	22,941,152

	当期変動額	2,774,678	1,203,920
	当期末残高	22,941,152	24,145,072
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	231,525	216,534
	当期変動額（純額）	14,991	80,390
	当期末残高	216,534	136,143
純資産合計			
	当期首残高	20,397,999	23,157,686
	当期変動額	2,759,687	1,123,529
	当期末残高	23,157,686	24,281,215

[次へ](#)

重要な会計方針

項目	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (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。 (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。
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. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

追加情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
建物	484,832	513,080
車両運搬具	-	171
器具備品	499,620	462,449
商標権	2,428	2,555
ソフトウェア	809,403	961,584
電話施設利用権	1,145	1,225

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。

（千円）

		第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	266,194	238,121
流動負債	未払費用	291,628	292,536

（損益計算書関係）

1. 役員報酬の限度額

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
取締役（年額）	250,000	250,000
監査役（年額）	50,000	50,000

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
建物	15,317	1,892
器具備品	3,597	18,917
ソフトウェア	12,503	15,606

3. 過年度損益修正益の内訳

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

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。

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

該当事項はありません。

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。

(千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
受取配当金	331,240	-
過年度損益修正益	105,241	-

(株主資本等変動計算書関係)

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	当事業年度期首 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

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 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

(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24年6月29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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

（リース取引関係）

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

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）			第27期 （平成24年3月31日現在）		
	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額	取得価額 相当額	減価償却累 計額相当額	期末残高 相当額
器具備品	46,681	46,138	543	-	-	-
その他	-	-	-	-	-	-
合計	46,681	46,138	543	-	-	-

未経過リース料期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
	一年以内	586
一年超	-	-
合計	586	-

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
	支払リース料	15,998
減価償却費相当額	14,995	543
支払利息相当額	234	1

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期末残高相当額

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
	一年以内	1,475
一年超	-	-

合計	1,475	-
----	-------	---

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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。

デリバティブ取引は、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

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）。

第26期（平成23年3月31日現在）

	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	-

第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	12,520,748	12,520,748	-
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	370,636	370,636	-
資産計	19,439,962	19,439,962	-
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	-
負債計	1,195,056	1,195,056	-

（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

（千円）

区分	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,457,319	2,119,074
長期差入保証金	702,696	731,197

非上場株式は、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等であり、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

第26期（平成23年3月31日現在）

	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	-	-	-

第27期（平成24年3月31日現在）

	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	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

（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）

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（第26期の貸借対照表計上額2,457,319千円、第27期の貸借対照表計上額2,119,074千円）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

第26期（平成23年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
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。

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
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）	7,614	10,000	2,386
小計	7,614	10,000	2,386
合計	370,636	159,101	211,534

（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其他有価証券
第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

（千円）

区分	売却額	売却益の合計	売却損の合計
その他（投資信託）	719,016	162,043	4,830

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
当事業年度において、関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託
第26期（平成23年3月31日現在）

	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

第27期（平成24年3月31日現在）

	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	6,548,577	495,939

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）

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）

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

（千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
（1） 退職給付債務	636,624	740,560
（2） 未認識数理計算上の差異	57,560	59,792
退職給付引当金	579,063	680,768

3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
（1） 勤務費用	85,216	102,728
（2） 利息費用	7,954	9,549
（3） 数理計算上の差異の費用処理額	9,383	13,388
（4） 確定拠出年金 拠出額	37,218	38,960
退職給付費用	139,773	164,627

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
1.5%	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

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

(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26期	第27期
	(平成23年3月31日現在)	(平成24年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	128,299	87,682
未払事業所税	6,141	5,792
賞与引当金	234,157	218,423
未払法定福利費	28,823	24,791
未払確定拠出年金掛金	2,739	2,607
減価償却超過額（一括償却資産）	3,039	5,496
減価償却超過額	36,256	150,369
繰延資産償却超過額（税法上）	139,027	47,261
退職給付引当金	235,678	243,845
役員退職慰労引当金	40,806	20,204
ゴルフ会員権評価損	5,577	2,138
投資有価証券評価損	763	4,410
関係会社株式評価損	1,556	121,913
その他有価証券評価差額金	-	678
貸倒引当金繰入額	-	-
繰延税金資産合計	862,867	935,615
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	57,474	-
繰延税金負債合計	57,474	-
差引繰延税金資産の純額	805,393	935,615

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

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。

3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は98,284千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は108,988千円増加し、その他有価証券評価差額金は10,703千円増加しております。

（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。

第27期（自平成23年4月1日 至平成24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	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（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。

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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 2名, 転籍 3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	687,972	未収投資 助言報酬	177,282

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

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	-	-

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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	523,845	未払 費用	158,645
	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	203,092	未払 費用	75,484

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

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

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 預金の預入 (純額) 受取利息	1,538,792 112,401 156	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	108,444 524,914 -
	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 預金の引出 (純額) 受取利息	536,163 1,524,876 7,802	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	89,649 11,047,758 -
	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 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	198,967 17,740	未払 費用 未払 費用	94,085 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) 信託報酬の 支払	5,500,000 3,163	金銭の 信託	5,967,344

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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 預金の引出 (純額) 受取利息	1,548,354 91,135 104	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	122,786 433,779 -
	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 預金の預入 (純額) 受取利息	450,766 392,267 3,654	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	83,446 11,440,025 -
	みずほ第 一ファイ 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 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	237,031	未払 費用	127,757
								業務委託料 の支払	15,140	未払 費用	6,373
	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) 信託報酬の 支払	1,000,000 5,087	金銭の 信託	6,548,577

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) 資産の助言の顧問料は、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26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
1株当たり純資産額	964,903円60銭	1,011,717円32銭
1株当たり当期純利益金額	185,611円60銭	142,163円33銭

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、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2）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26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）
当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,454,678千円	3,411,920千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第28期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,242,702
金銭の信託		7,499,425
前払費用		92,263
未収委託者報酬		2,663,804
未収運用受託報酬		1,676,248
未収投資助言報酬		229,963
未収収益		208,987
繰延税金資産		353,360
その他		20,041
	流動資産計	22,986,796
固定資産		
有形固定資産		410,173
建物	1	154,028
車両運搬具	1	3,761
器具備品	1	141,266
建設仮勘定		111,117
無形固定資産		1,414,348
商標権	1	336
ソフトウェア	1	1,104,659
ソフトウェア仮勘定		301,872
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	331
投資その他の資産		3,941,169
投資有価証券		352,985
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		649,103
長期差入保証金		731,564
その他		88,442
	固定資産計	5,765,691
資産合計		28,752,487

	第28期中間会計期間末 （平成24年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	90,304
未払金	1,586,848
未払収益分配金	670
未払償還金	84,932
未払手数料	1,045,061
その他未払金	456,184
未払費用	1,144,835
未払法人税等	1,153,892
未払消費税等	94,807
前受収益	4,645
賞与引当金	592,564
流動負債計	4,667,898
固定負債	
退職給付引当金	745,286
役員退職慰労引当金	83,600
固定負債計	828,887
負債合計	5,496,785
（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	18,754,087
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	16,330,000
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	1,800,793
株主資本計	23,182,565
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	73,136
評価・換算差額等計	73,136
純資産合計	23,255,702
負債・純資産合計	28,752,487

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	11,666,848	
運用受託報酬	2,624,179	
投資助言報酬	432,133	
その他営業収益	323,176	
営業収益計		15,046,337
営業費用		
支払手数料	5,650,162	
広告宣伝費	74,513	
公告費	1,649	
調査費	2,242,409	
調査費	1,509,414	
委託調査費	732,994	
委託計算費	164,548	
営業雑経費	214,207	
通信費	12,777	
印刷費	185,164	
協会費	12,746	
諸会費	18	
支払販売手数料	3,500	
営業費用計		8,347,489
一般管理費		
給料	2,141,911	
役員報酬	120,924	
給料・手当	2,020,987	
交際費	16,251	
寄付金	2,693	
旅費交通費	89,758	
租税公課	49,433	
不動産賃借料	337,699	
退職給付費用	85,485	
固定資産減価償却費	1 250,300	
福利厚生費	9,221	
修繕費	5,343	
賞与引当金繰入	592,564	
役員退職慰労引当金繰入	26,910	
機器リース料	23	
事務委託費	123,542	
消耗品費	30,045	
器具備品費	894	
諸経費	51,882	
一般管理費計		3,813,961
営業利益		2,884,886

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	4,243	
受取利息	1,821	
時効成立分配金	1,459	
為替差益	4,637	
雑収入	4,289	
営業外収益計		16,451
営業外費用		
金銭の信託運用損	48,384	
営業外費用計		48,384
経常利益		2,852,953
特別損失		
固定資産除却損	124	
特別損失計		124
税引前中間純利益		2,852,828
法人税、住民税及び事業税		1,135,292
法人税等調整額		31,957
法人税等合計		1,103,335
中間純利益		1,749,493

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24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		15,630,000
	当中間期変動額		700,000
	当中間期末残高		16,330,000
	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		3,463,300
	当中間期変動額		
	剰余金の配当		2,712,000
	別途積立金の積立		700,000
	中間純利益		1,749,493
	当中間期末残高		1,800,793
	利益剰余金合計		
	当期首残高		19,716,594
	当中間期変動額		962,506
	当中間期末残高		18,754,087
	株主資本合計		
	当期首残高		24,145,072
	当中間期変動額		962,506
	当中間期末残高		23,182,565
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高		136,143
	当中間期変動額（純額）		63,006
	当中間期末残高		73,136
純資産合計			

当期首残高	24,281,215
当中間期変動額	1,025,513
当中間期末残高	23,255,702

[前へ](#) [次へ](#)

重要な会計方針

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24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：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 車両運搬具 ... 6年 器具備品 ... 3～20年 (会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。 (2) 無形固定資産：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。
5. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4) 役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. 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。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第28期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	1,162千円
	器具備品	509,550千円
	商標権	602千円
	ソフトウェア	871,599千円
	電話施設利用権	1,265千円

(中間損益計算書関係)

項目	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	188,803千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日 至平成24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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

(金融商品関係)

第28期中間会計期間末（平成24年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成24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	10,242,702	10,242,702	-
(2) 金銭の信託	7,499,425	7,499,425	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	272,739	272,739	-
資産計	18,014,867	18,014,867	-
(1) 未払法人税等	1,153,892	1,153,892	-
負債計	1,153,892	1,153,892	-

(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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,119,074
長期差入保証金	731,564

非上場株式は、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等であり、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28期中間会計期間末（平成24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2,119,074千円）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	262,099	146,101	115,997
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,454	3,000	454
小計	265,553	149,101	116,451
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）	7,186	10,000	2,814
小計	7,186	10,000	2,814
合計	272,739	159,101	113,637

（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28期中間会計期間末（平成24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（運用目的及び満期保有目的以外）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24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	11,666,848	3,056,312	323,176	15,046,337

（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。

（1株当たり情報）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）	
1株当たり純資産額	968,987円 59銭
1株当たり中間純利益金額	72,895円 54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28期中間会計期間 （自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
中間純利益	1,749,493千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,749,493千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

(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24年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託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。

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。

*平成24年3月末日現在

(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24年3月末日現在 9,557.5万円

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24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25年2月27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24年1月12日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成25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。

利害関係

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

以 上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月8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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態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。

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24年12月7日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士	山内 正彦
業務執行社員	士	印
指定有限責任社員	公認会計士	浅野 功
業務執行社員	士	印
指定有限責任社員	公認会計士	近藤 敏弘
業務執行社員	士	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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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](#)