

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成21年4月13日

【計算期間】 第2期（自 平成20年1月12日 至 平成21年1月13日）

【ファンド名】 マネックス資産設計ファンド<育成型>

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 長浜 力雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【電話番号】 03-3287-3110

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

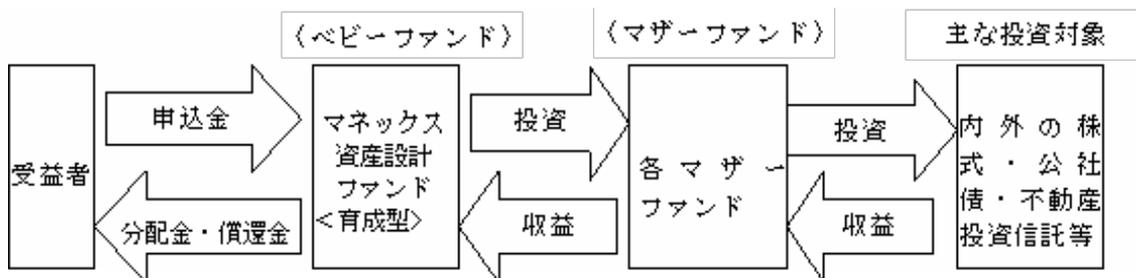
第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ・当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指します。
- ・当ファンドは、追加型株式投資信託に属し、原則としていつでも買付け、解約のお申込みができます。ただし、海外休業日に該当する場合は、お申込みおよび解約のお申込みの受付は行いません。
- ・当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド（国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド）の受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



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

・商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	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目指す旨の記載があるものをいいます。

・属性区分表

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

(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、マザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

対象インデックス

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

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

・投資信託協会への照会

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

(2)【ファンドの仕組み】

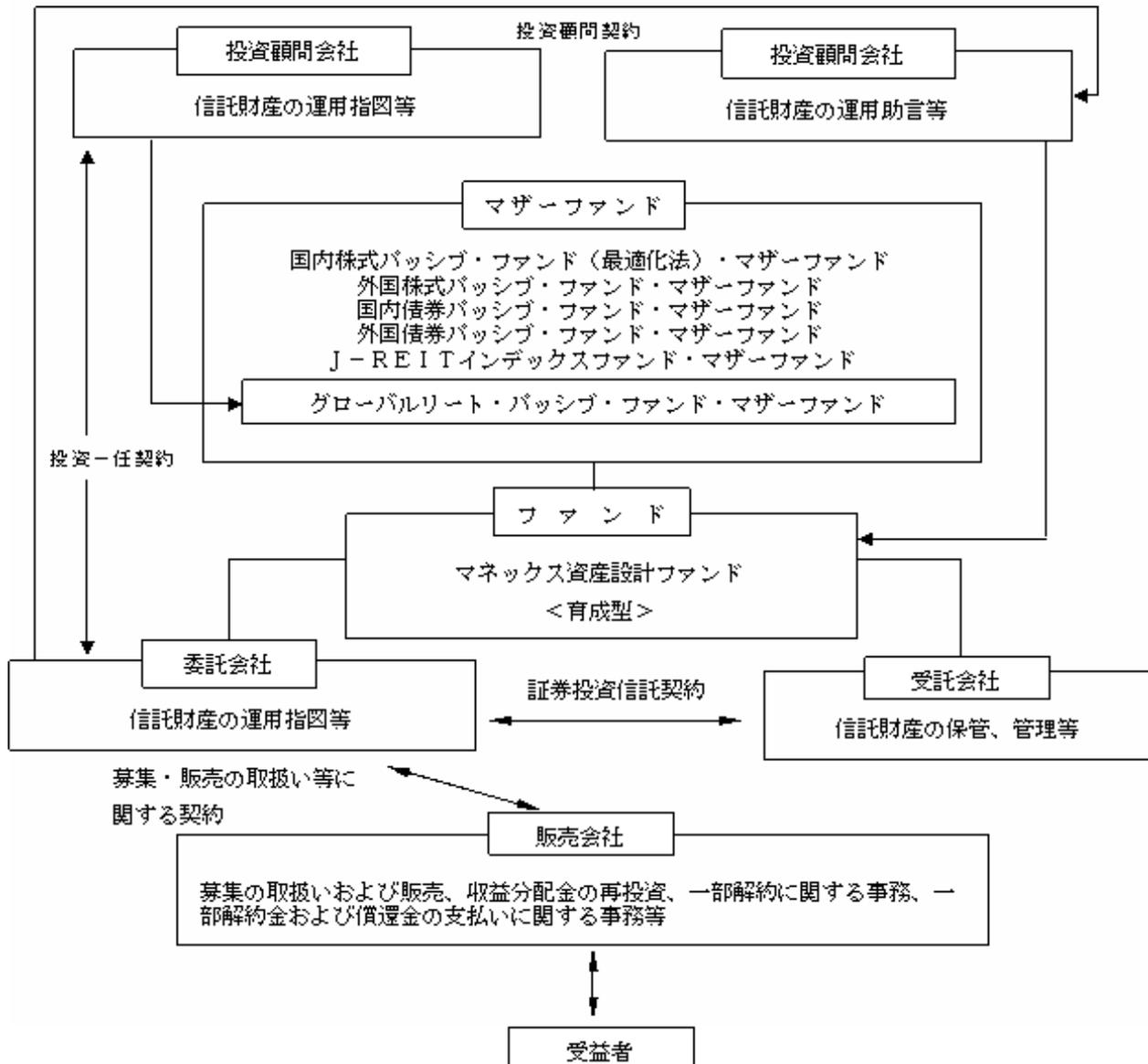
ファンドの関係法人は次の通りです。

- ・委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社
当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。
- ・受託会社：みずほ信託銀行株式会社
当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
- ・販売会社
当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。
- ・投資顧問会社：
イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

DIAM International Ltd

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

ファンドの関係法人



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

- ・「投資顧問契約」の概要

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

- ・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）の間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

委託会社の概況

資本金の額

20億円（平成21年1月30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21年1月30日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<投資態度>

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

国内株式

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国株式

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内債券

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国債券

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内REIT（リート）

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

外国REIT（リート）

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

不動産投資信託証券（REIT）とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

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

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

基本資産配分比率については、原則として各資産の長期のヒストリカルデータをもとに期待リターン・ボラティリティ・相関を推計し、平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導かれた配分とします。ただし、分散投資の観点から、各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への投資比率は50%以下にします。

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

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

(1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

(6) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(7) 株券または新株引受権証券

(8) 国債証券

(9) 地方債証券

(10) 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

(16) コマーシャル・ペーパー

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

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

(19) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）

(20) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

(22) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

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

(24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

- (25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- (26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (27) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- (28) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

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

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

（参考）「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、わが国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

<主な投資対象>

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用プロセス

1) 流動性基準によるユニバース設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。

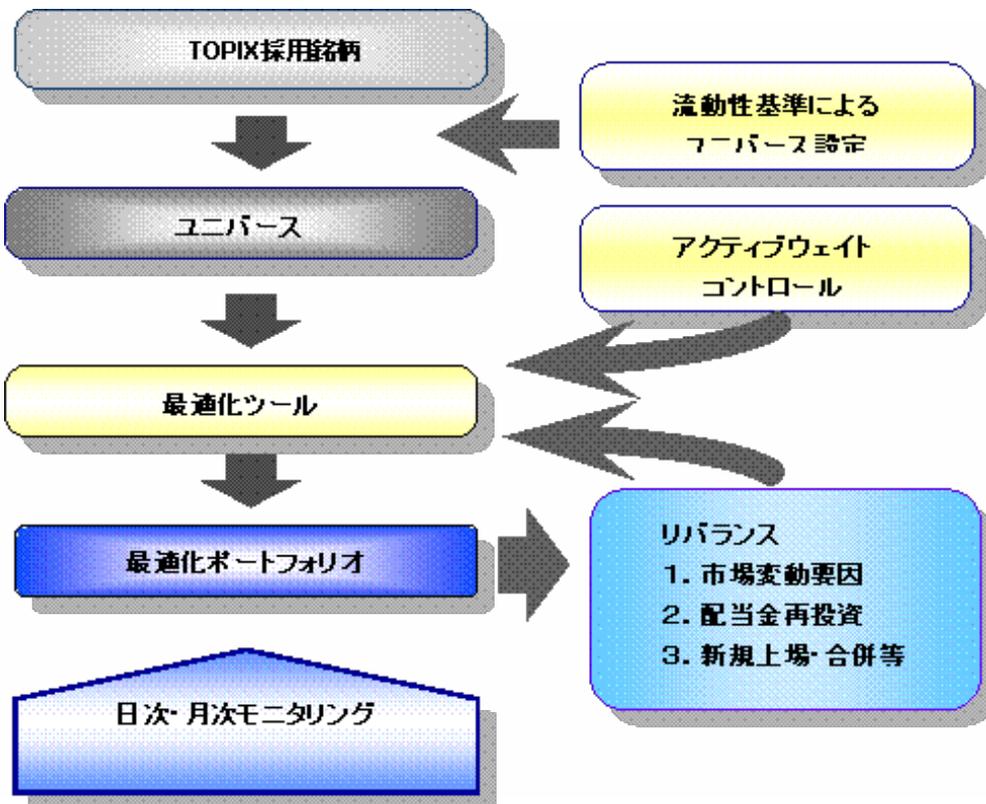
2) 最適化法によるポートフォリオの構築

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

3) リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。リバランス要因には以下のものがあります。

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



3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

< 主な投資制限 >

株式への投資割合には、制限を設けません。

（参考）「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<主な投資対象>

海外の株式を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用プロセス

1)流動性基準によるユニバース設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

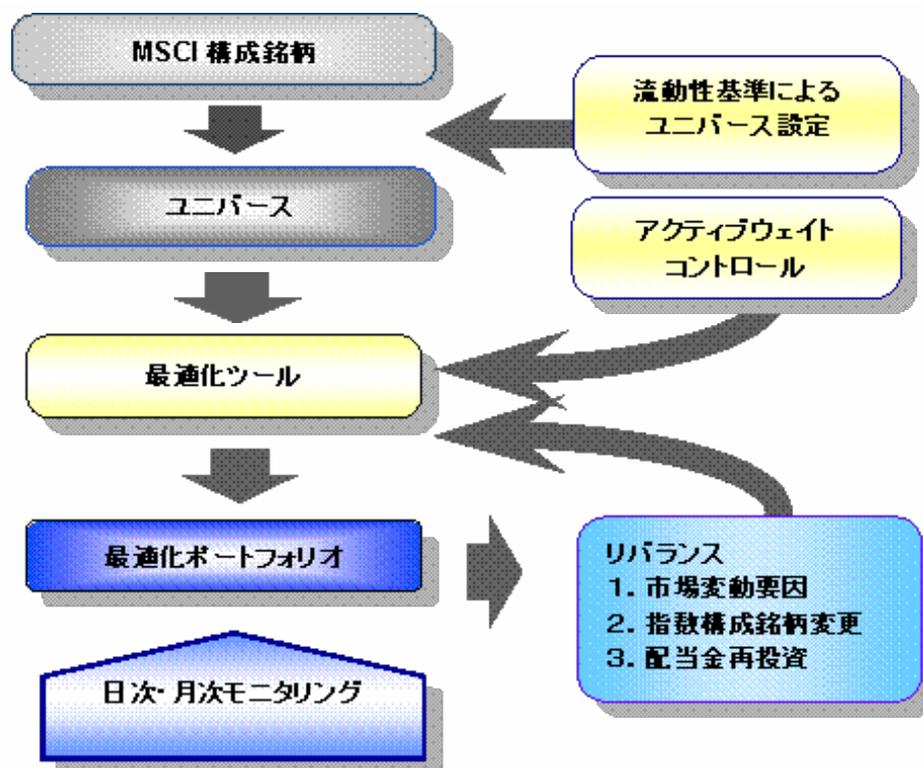
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3)リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。

リバランス要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



3. 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
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。

< 主な投資制限 >

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

（参考）「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

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

<主な投資対象>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用プロセス

1)流動性基準によるユニバース設定

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ユニバースを設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

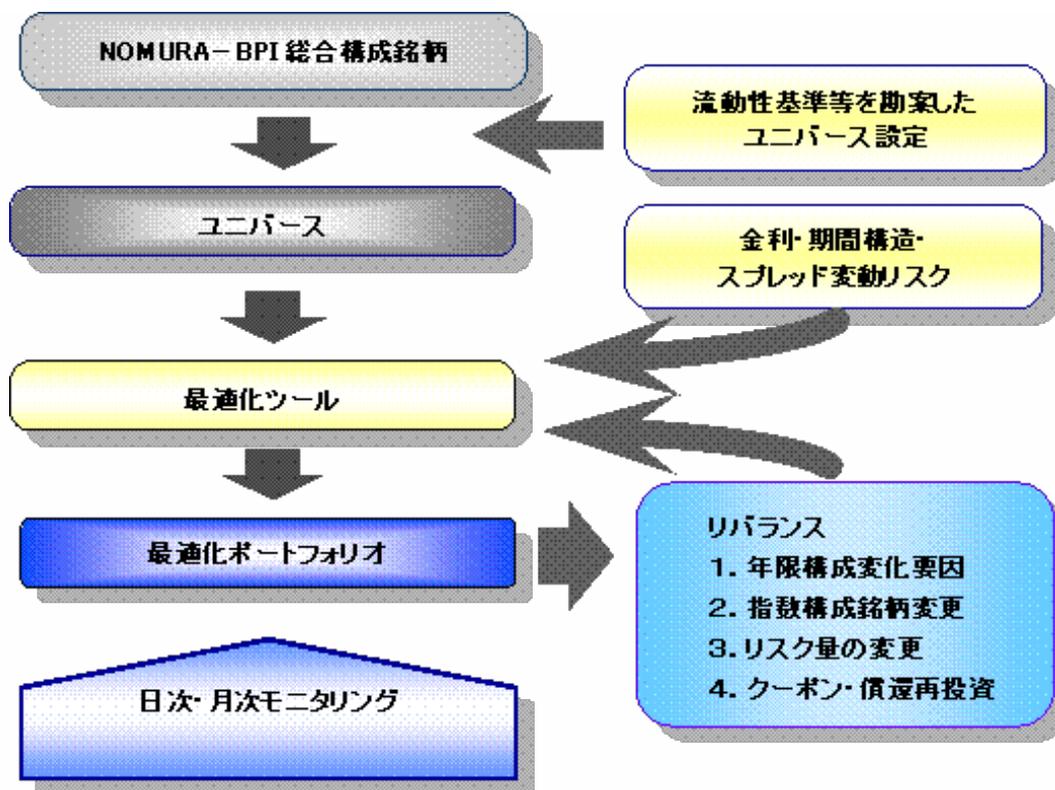
が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3)リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。

リバランス要因には以下のものがあります。

- ・年限構成変化要因
- ・指数構成銘柄変更
- ・リスク量の変更
- ・クーポン、償還再投資



3. 公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

< 主な投資制限 >

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

（参考）「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<主な投資対象>

海外の公社債を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用プロセス

1)流動性基準によるユニバース設定

シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資ユニバースを設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

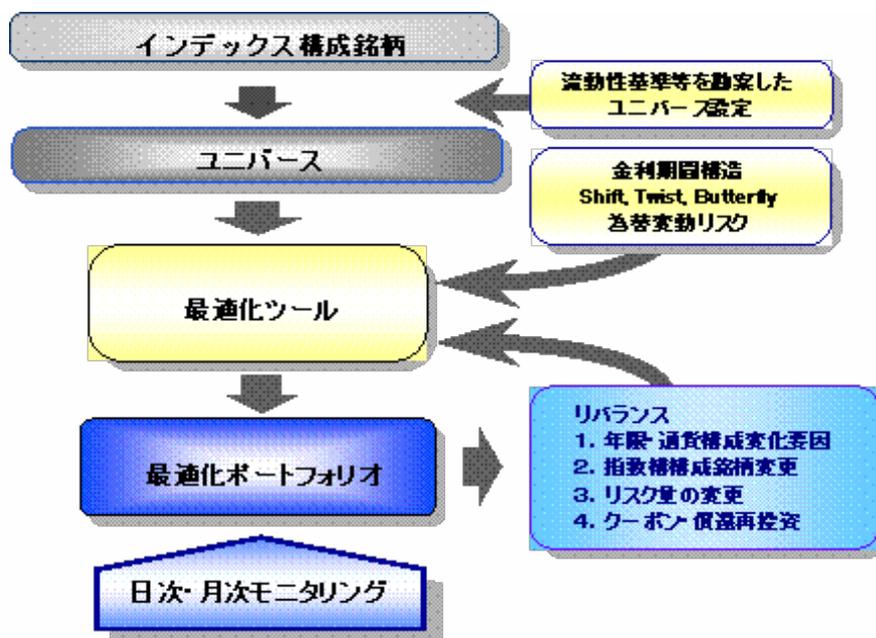
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3)リバランス

日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。

リバランス要因には以下のものがあります。

- ・年限・通貨構成変化要因
- ・指数構成銘柄変更
- ・リスク量の変更
- ・クーポン・償還再投資



3. 外国債券の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
5. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。
シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

< 主な投資制限 >

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

（参考）「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

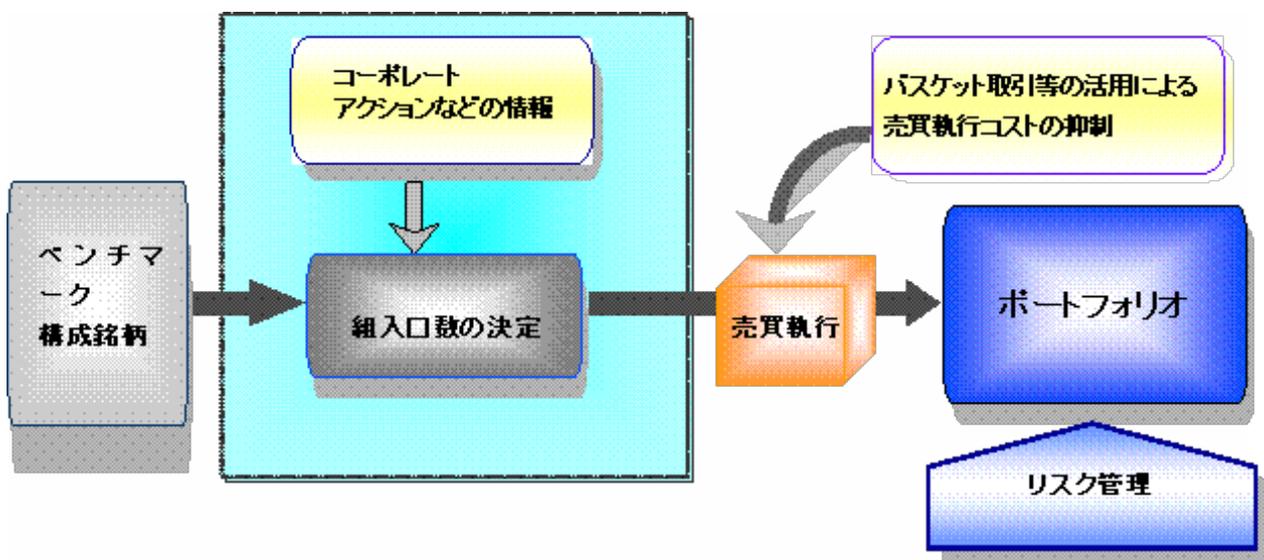
この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

<主な投資対象>

東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

<投資態度>

1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することを目指します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
4. 運用プロセス
 - ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。
 - ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。
 - ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。



東証 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「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証 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(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、東証 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。

(株)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。

(株)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(株)東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドは東証 R E I T 指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額と東証 R E I T 指数の指数値の動向が乖離することがあります。

当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

(株)東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証 R E I T 指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

< 主な投資制限 >

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証 R E I T 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 R E I T 指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

（参考）「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

<基本方針>

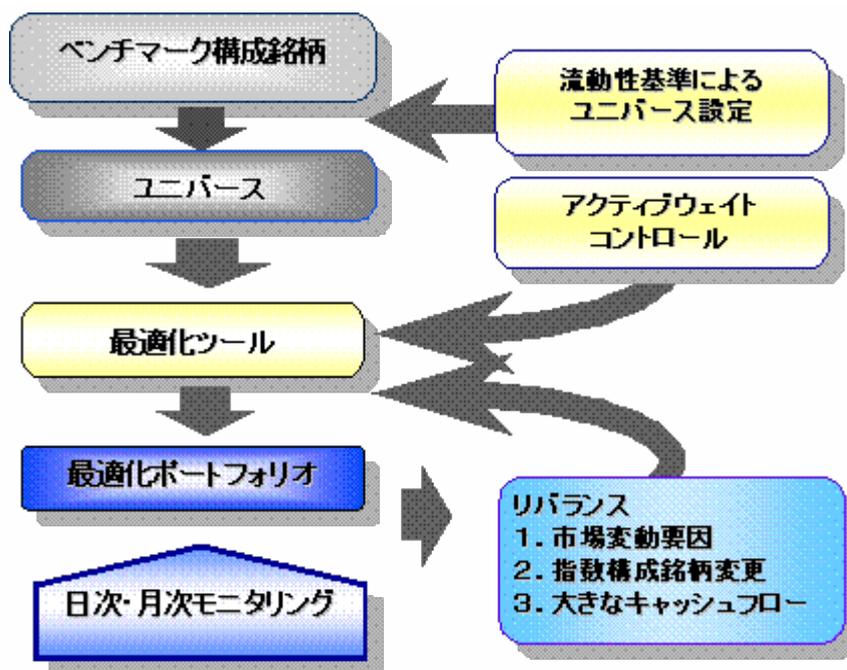
この投資信託は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

<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（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

<投資態度>

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目指して運用を行います。
2. 運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。
3. 運用プロセス
 - 1)流動性基準によるユニバース設定
取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S & P先進国REITインデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。
 - 2)最適化法によるポートフォリオの構築
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
 - 3)リバランス
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。リバランス要因には以下のものがあります。
 - ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
 - ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの
 - ・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



4. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

「Standard & Poor's」、 「S&P」、 は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、また「Citigroup」はCitigroup Global Markets Limitedの商標であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社の使用のためにライセンスされているものです。当マザーファンドは、Standard & Poor'sによって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではなく、また、Standard & Poor'sは、当マザーファンドの投資の妥当性を表明するものではありません。

当マザーファンドは、The McGraw-Hill Companies, Inc. の一部門であるStandard & Poor's（以下「S&P」という）によって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではありません。S&Pは、当マザーファンドの所有者若しくは一般の者に対して、一般に証券について若しくは特に当マザーファンドに対する投資の妥当性に関して、又はS & P先進国REITインデックスの株式市場の運用成績を追跡する能力に関して、明示的にも黙示的にも、表明又は保証するものではありません。S&Pのライセンシーに対する唯一の関係は、S&Pの特定の商標及び商号についてのライセンスを行うこと、並びにS&Pによりライセンシー又は当マザーファンドと関係なく決定、作成及び計算されたS & P先進国REITインデックスについてライセンスすることです。S&Pは、S & P先進国REITインデックスの決定、作成及び計算において、当マザーファンドのライセンシー又は所有者の要求を考慮に入れる義務を負いません。S&Pは、当マザーファンドの価格及び量の決定、当マザーファンドの発行若しくは販売の時期の決定、又は、当マザーファンドを現金に換算する方程式の決定若しくは計算に、責任を負わず、また関わっていません。S&Pは、当マザーファンドの管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を負うものではありません。

S&Pは、S & P先進国REITインデックス、又はそれに含まれるデータの正確性あるいは完全性を保証しません。また、S&Pは、当マザーファンドに含まれる誤り、欠落又は障害に対する責任を負わないものとします。S&Pは、S & P先進国REITインデックス又はそれらに含まれるデータの使用により、ライセンシー、当マザーファンドの所有者又はその他の人や組織に生じた結果に関して、明示的にも黙示的にも保証しないものとします。また、S&Pは、S & P先進国REITインデックス又はそれに含まれるデータに関して、その市場性又は特別な目的若しくは使用への適合性について、明示若しくは黙示の保証を行わず、かつあらゆる保証を放棄します。前述のいずれかを制限することなく、S&Pは、特別な、懲罰的な、間接の又は派生的な損害（逸失利益を含む）の可能性を通知されたとしても、かかる損害に対して何ら責任を負いません。

< 主な投資制限 >

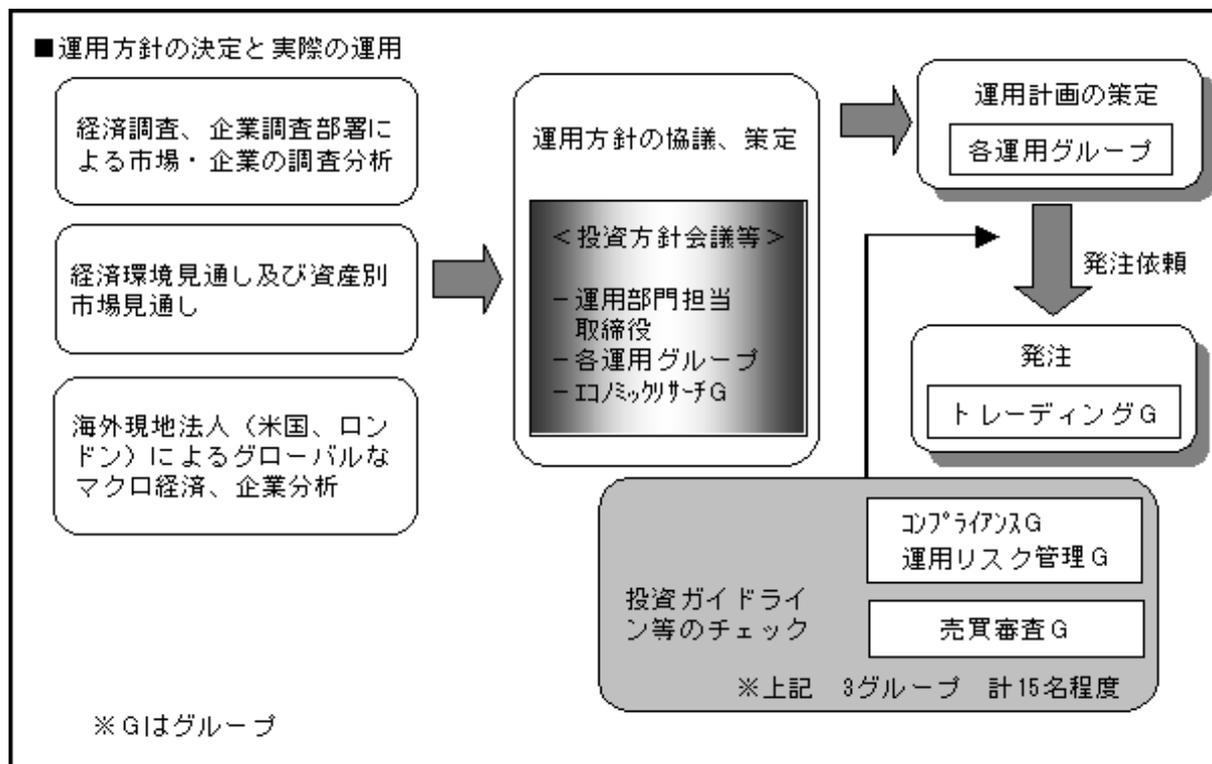
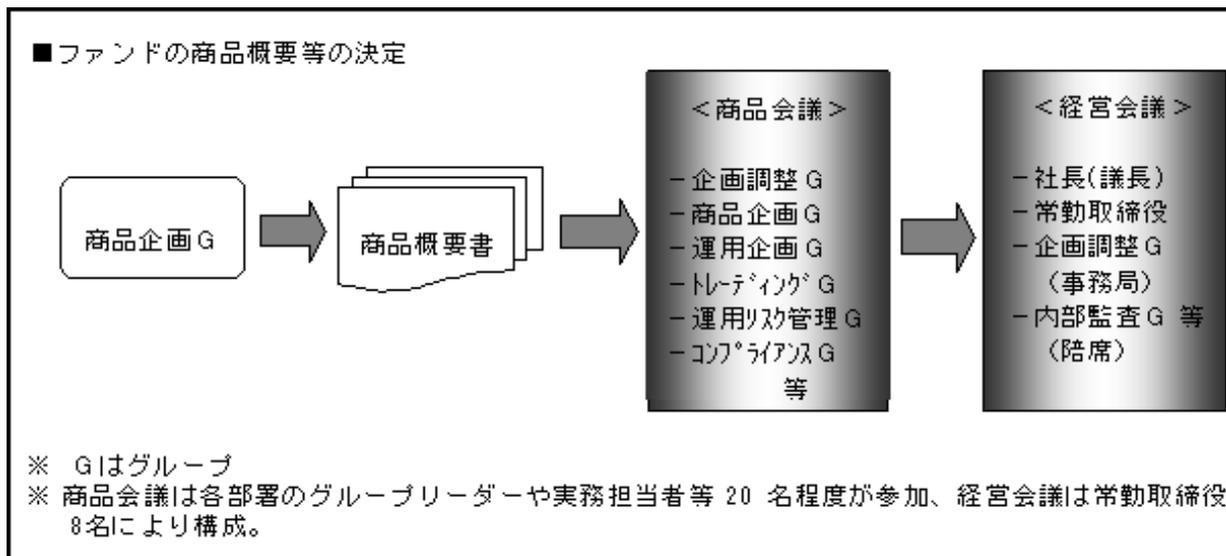
投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

(3)【運用体制】

1. 委託会社の運用体制



<ファンドの商品概要等の決定>

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、各運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

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

個別の有価証券等の発注は、運用担当者の発注依頼に基づき、運用部門から独立したトレーディンググループでその大半が執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループ、運用リスク管理グループにて行われ、有価証券の売買執行等については売買審査グループにてチェックが行われます。

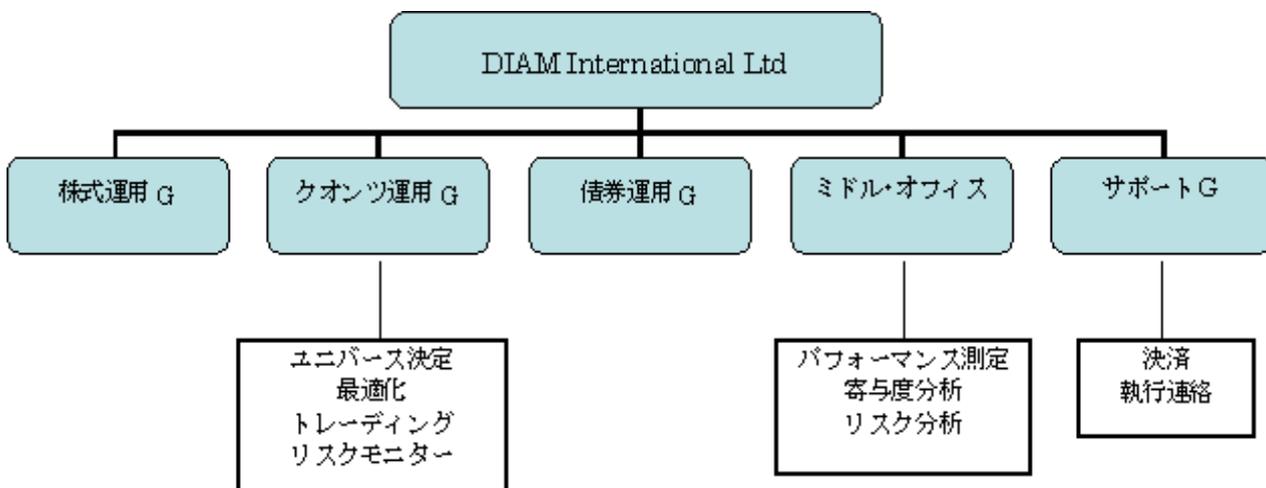
前記体制は平成21年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2. 当ファンドの主要投資対象となるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの信託財産の運用指図に関する権限を委託するDIAM International Ltdの運用体制は以下の通りです。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用はクオンツ運用グループが担当します。当グループは主に日本を除く株式のクオンツ商品を運用しております。当グループでは、ユニバースの決定を行い、ポートフォリオの最適化、トレーディングを行い、主要なリスク要因はリアル・タイムで把握できる体制を敷いています。

ミドル・オフィスは、週次・月次でパフォーマンスを測定し、要因分析を社内CEO以下に向けて報告するとともに、リスクをモニターします。

サポート・グループは、決済を主に担当しており、加えて執行された売買につき委託会社や日本の信託銀行への連絡を行います。



上記運用体制は、平成21年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

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

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

投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

信用取引の指図および範囲（約款第22条）

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

先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

- 1) 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 前項の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れ（約款第28条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第37条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含

みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の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 >

資産配分リスク

当ファンドで行われる各資産毎（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券、国内不動産投資信託証券および外国不動産投資信託証券）の資産配分比率は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

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

株価変動リスク

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

金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券および不動産投資信託証券（REIT）の価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券および不動産投資信託証券（REIT）の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

不動産投資信託証券（REIT）の価格変動リスク

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

不動産投資信託証券は、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

為替リスク

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

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

信用リスク

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

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

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

流動性リスク

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

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

カントリーリスク

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

<その他の留意点>

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

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

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

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

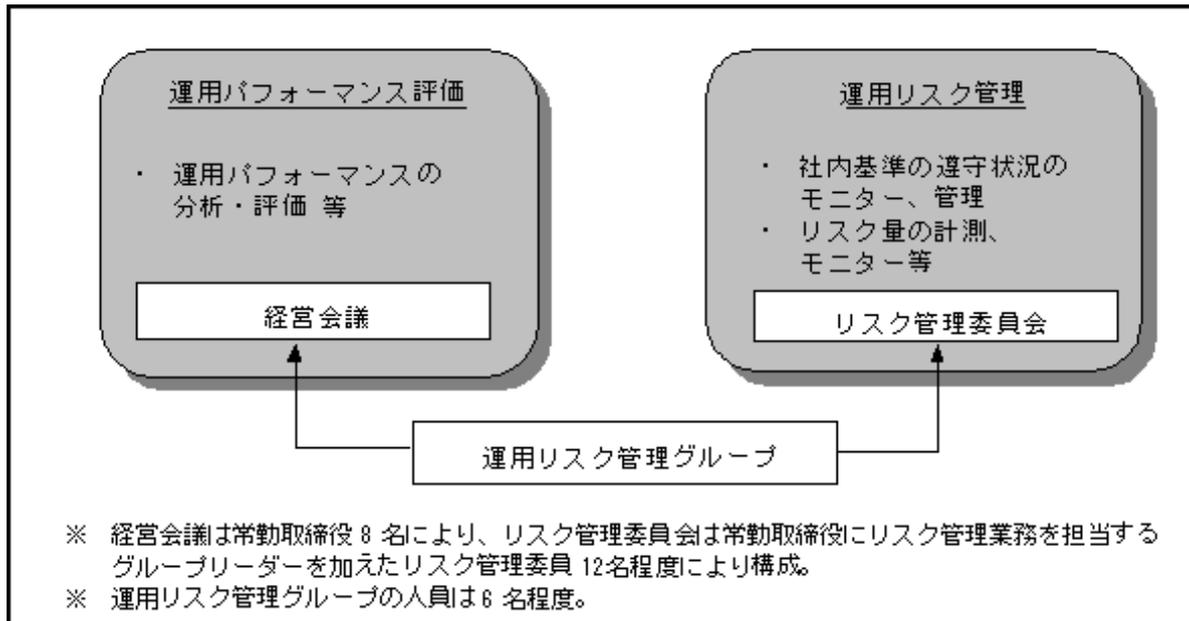
委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

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

リスク管理体制

<運用評価・運用リスク管理体制>

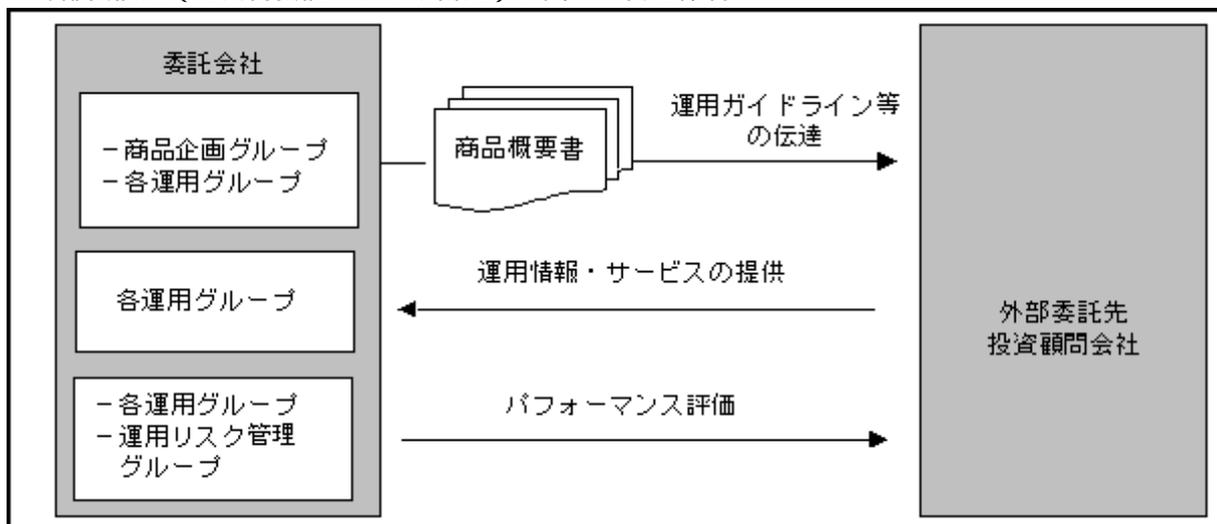


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立した運用リスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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

上記体制は平成21年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<外部委託先（運用再委託および助言先）に関する管理体制>



運用の外部委託先に対しては、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などをまとめた商品概要書によって商品内容を伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、運用リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成21年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用		
		毎日	信託報酬	総額
		配分	委託会社	年率0.441% (税抜0.42%) ~ 0.546% (税抜0.52%)
			販売会社	年率0.378% (税抜0.36%) ~ 0.483% (税抜0.46%)
			受託会社	年率0.0735% (税抜0.07%)

委託会社と販売会社の配分率は、各販売会社の取扱い純資産総額に応じて、以下の通りとします。

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

信託報酬の総額は、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

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

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの純資産総額	報酬率
25億円以下の部分	年率0.20%
25億円超75億円以下の部分	年率0.18%
75億円超の部分	年率0.15%

当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）が受ける報酬は、当ファンドまたはマザーファンドから直接的に支払われません。同社への投資顧問報酬は、委託会社が受け取った報酬の中から支払うものとします。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

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

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

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

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

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

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

(5) 【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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、20%（所得税15%、地方税5%）の税率が適用されます。

ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は、特例措置により、各々1年間の普通分配金など上場株式等の配当等の合計額が100万円（年間の支払金額が1万円以下のものは合計額から除外されます。）までの場合は、10%（所得税7%、地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行われます。なお、前述の合計額が各々1年間で100万円を超える場合は確定申告が必要となります。その際、総合課税または申告分離課税を選択することができますが、申告分離課税を選択した場合、100万円を超える部分については20%（所得税15%、地方税5%）の税率が適用されます。

一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得等として、20%（所得税15%、地方税5%）の税率が適用されます。

ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間は、特例措置により、各々1年間の一部解約時および償還時の譲渡益と上場株式等の譲渡益の合計額が500万円以下の場合は、10%（所得税7%、地方税3%）の軽減税率が適用されます。原則として申告分離課税となりますが、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。なお、前述の合計額が各々1年間で500万円を超える場合は確定申告が必要となり、500万円を超える部分については20%（所得税15%、地方税5%）の税率が適用されます。

買取請求による換金時の課税につきましては、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

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金および一部解約時ならびに償還時の個別元本超過額については、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収されます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

また、地方税の源泉徴収はありません。

なお、収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。

（注）法人の形態等により、税金の取扱いが異なることがありますので、ご注意ください。

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

- ・ 受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ・ 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ・ ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に個別元本の算出が行われず、また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。
- ・ 収益分配金に特別分配金が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、前記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成21年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	5,684,094,775	97.18
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		165,024,374	2.82
合 計（純資産総額）		5,849,119,149	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成21年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	149,281,555,599	96.52
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,376,745,215	3.48
合 計（純資産総額）		154,658,300,814	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

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

株式	米国	94,951,864,786	53.62
	英国	18,435,320,820	10.41
	カナダ	8,176,739,791	4.62
	スイス	7,808,198,794	4.41
	スウェーデン	1,832,305,206	1.03
	デンマーク	838,494,876	0.47
	ノルウェー	584,046,612	0.33
	アイルランド	279,609,745	0.16
	オランダ	2,244,695,501	1.27
	ベルギー	733,650,772	0.41
	ルクセンブルク	444,576,459	0.25
	フランス	9,045,755,724	5.11
	ドイツ	7,466,444,850	4.22
	ポルトガル	292,544,424	0.17
	スペイン	3,882,480,704	2.19
	イタリア	3,102,857,096	1.75
	フィンランド	1,210,546,750	0.68
	オーストリア	284,142,589	0.16
	ギリシャ	431,200,302	0.24
	香港	1,807,451,788	1.02
	中国	10,375,962	0.01
	シンガポール	967,643,638	0.55
	オーストラリア	4,798,309,278	2.71
	ニュージーランド	77,634,118	0.04
	パナマ	132,751,542	0.07
	バミューダ諸島	1,509,938,228	0.85
	オランダ領アンティル	645,993,039	0.36
	ケイマン諸島	167,906,167	0.09
	ジャージー・チャネル諸島	210,536,572	0.12
	マン島	15,028,132	0.01
	リベリア	10,247,994	0.01
	モーリシャス	14,055,279	0.01
小計	172,413,347,538	97.37	
投資証券	米国	1,168,609,022	0.66
	英国	153,567,816	0.09
	カナダ	22,927,005	0.01
	オランダ	28,664,644	0.02
	フランス	205,148,698	0.12
	香港	51,873,931	0.03
	小計	1,630,791,117	0.92
投資信託受益証券	シンガポール	29,409,768	0.02
	オーストラリア	287,036,450	0.16
	小計	316,446,218	0.18

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2,708,582,878	1.53
合 計 (純資産総額)	177,069,167,751	100.00

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	176,922,726,300	74.46
地方債証券	日本	14,847,986,049	6.25
特殊債券	日本	24,583,152,762	10.35
社債券	日本	19,249,630,020	8.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,992,076,077	0.84
合 計 (純資産総額)		237,595,571,208	100.00

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	米国	94,526,618,821	32.21
	英国	26,275,529,505	8.95
	カナダ	6,865,502,498	2.34
	スウェーデン	1,794,287,781	0.61
	デンマーク	2,551,770,547	0.87
	ノルウェー	832,971,780	0.28
	アイルランド	1,474,292,115	0.50
	オランダ	7,204,873,152	2.46
	ベルギー	9,755,792,128	3.32
	フランス	29,951,156,384	10.21
	ドイツ	35,742,036,077	12.18
	ポルトガル	3,318,371,309	1.13
	スペイン	12,034,563,514	4.10
	イタリア	33,723,849,741	11.49
	フィンランド	1,622,994,432	0.55
	ポーランド	2,382,111,612	0.81
	オーストリア	4,969,190,074	1.69
	ギリシャ	7,116,387,008	2.43
	シンガポール	1,240,459,102	0.42
	マレーシア	1,547,300,590	0.53
	小計	284,930,058,168	97.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,507,833,884	2.90
合 計（純資産総額）		293,437,892,052	100.00

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	4,001,588,050	97.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		86,875,788	2.12
合 計（純資産総額）		4,088,463,838	100.00

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

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

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

投資証券	米国	4,093,287,039	64.33
	英国	437,875,475	6.88
	カナダ	160,792,517	2.53
	オランダ	144,829,215	2.28
	ベルギー	110,075,465	1.73
	フランス	589,793,031	9.27
	香港	136,553,249	2.15
	ニュージーランド	23,532,942	0.37
	小計	5,696,738,934	89.53
投資信託受益証券	シンガポール	144,548,777	2.27
	オーストラリア	785,192,178	12.34
	小計	929,740,955	14.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		263,447,266	4.14
合 計（純資産総額）		6,363,032,623	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,615,758,707	10,774.88	1,740,959,987	10,718.00	1,731,770,182	29.61
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,424,984,904	11,495.10	1,638,033,867	11,013.00	1,569,335,874	26.83
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	888,032,157	10,208.96	906,588,783	9,864.00	875,954,919	14.98
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,112,937,401	5,789.85	644,374,131	6,042.00	672,436,777	11.50

5	外国株式パッシブ・ ファンド・マザー ファンド	親投 資信 託受 益証 券	日 本	667,389,297	9,186.65	613,107,228	8,668.00	578,493,042	9.89
6	グローバルリート・ パッシブ・ファンド ・マザーファンド	親投 資信 託受 益証 券	日 本	627,705,836	4,565.77	286,596,254	4,080.00	256,103,981	4.38

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は6銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.18
合計	97.18

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	1,910,300	5,186.61	9,907,990,092	3,040.00	5,807,312,000	3.75
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	8,594,200	876.16	7,529,884,922	477.00	4,099,433,400	2.65
3	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	674,600	4,854.22	3,274,655,779	4,230.00	2,853,558,000	1.85
4	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,270,600	3,041.59	3,864,644,215	2,170.00	2,757,202,000	1.78
5	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	937,000	2,764.59	2,590,417,796	2,775.00	2,600,175,000	1.68
6	武田薬品	株式	日本	医薬品	564,500	5,754.25	3,248,274,832	4,030.00	2,274,935,000	1.47
7	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	14,501	162,609.61	2,358,001,951	151,100.00	2,191,101,100	1.42
8	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	619,300	7,080.36	4,384,869,164	3,520.00	2,179,936,000	1.41
9	任天堂	株式	日本	その他 製品	78,500	46,207.45	3,627,284,918	27,180.00	2,133,630,000	1.38
10	キヤノン	株式	日本	電気機 器	862,100	4,232.55	3,648,878,408	2,440.00	2,103,524,000	1.36
11	みずほフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	8,256,700	430.66	3,555,801,488	221.00	1,824,730,700	1.18
12	パナソニック	株式	日本	電気機 器	1,586,000	2,075.49	3,291,734,000	1,099.00	1,743,014,000	1.13
13	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	277,100	8,446.82	2,340,614,955	5,790.00	1,604,409,000	1.04
14	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,095,900	2,716.40	2,976,897,314	1,354.00	1,483,848,600	0.96
15	東京海上HD	株式	日本	保険業	631,400	3,764.00	2,376,590,671	2,335.00	1,474,319,000	0.95
16	ソニー	株式	日本	電気機 器	788,400	4,212.66	3,321,262,430	1,825.00	1,438,830,000	0.93
17	関西電力	株式	日本	電気・ ガス業	617,200	2,575.13	1,589,370,234	2,330.00	1,438,076,000	0.93
18	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	586,000	2,704.85	1,585,040,279	2,400.00	1,406,400,000	0.91
19	三井物産	株式	日本	卸売業	1,263,000	1,800.55	2,274,099,060	1,045.00	1,319,835,000	0.85

20	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,021,000	2,359.88	2,409,436,560	1,241.00	1,267,061,000	0.82
21	中部電力	株式	日本	電気・ガス業	503,600	2,671.18	1,345,207,500	2,420.00	1,218,712,000	0.79
22	K D D I	株式	日本	情報・通信業	2,278	667,286.91	1,520,079,591	520,000.00	1,184,560,000	0.77
23	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	349,000	4,339.87	1,514,613,244	3,380.00	1,179,620,000	0.76
24	新日本製鐵	株式	日本	鉄鋼	4,085,000	521.25	2,129,312,960	280.00	1,143,800,000	0.74
25	信越化学	株式	日本	化学	259,300	5,339.26	1,384,470,320	4,380.00	1,135,734,000	0.73
26	J F Eホールディングス	株式	日本	鉄鋼	397,100	3,992.82	1,585,550,515	2,570.00	1,020,547,000	0.66
27	第一三共	株式	日本	医薬品	458,300	2,987.30	1,369,078,328	2,000.00	916,600,000	0.59
28	野村ホールディングス	株式	日本	証券、商品先物取引業	1,542,300	1,404.15	2,165,627,290	573.00	883,737,900	0.57
29	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	3,694	512,168.06	1,891,948,808	238,700.00	881,757,800	0.57
30	三菱重工業	株式	日本	機械	2,648,000	433.84	1,148,805,240	326.00	863,248,000	0.56

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.29
	銀行業	10.07
	輸送用機器	8.16
	電気・ガス業	6.77
	情報・通信業	6.36
	化学	5.25
	医薬品	5.00
	陸運業	4.36
	卸売業	4.32
	機械	3.85
	小売業	3.82
	食料品	3.20
	保険業	2.61
	鉄鋼	2.50
	その他製品	2.42
	不動産業	2.17

建設業	2.15
サービス業	1.66
証券、商品先物取引業	1.21
精密機器	1.10
非鉄金属	1.05
ガラス・土石製品	0.97
繊維製品	0.86
石油・石炭製品	0.85
海運業	0.74
その他金融業	0.73
金属製品	0.62
空運業	0.60
ゴム製品	0.56
パルプ・紙	0.46
鉱業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.26
水産・農林業	0.11
合計	96.52

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

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21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	748,875	7,445.50	5,575,748,827	6,944.36	5,200,455,498	2.94
2	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	404,172	5,583.17	2,256,562,790	5,182.78	2,094,735,852	1.18
3	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用 品	425,728	5,847.04	2,489,248,850	4,696.34	1,999,362,754	1.13
4	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,182,003	2,358.74	2,788,037,670	1,665.89	1,969,092,415	1.11
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	296,221	7,270.78	2,153,758,444	6,402.47	1,896,546,658	1.07
6	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	849,350	3,080.76	2,616,639,645	2,205.10	1,872,899,307	1.06
7	BP PLC	株式	英国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	2,706,162	704.39	1,906,199,156	645.76	1,747,537,424	0.99
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	552,124	3,555.31	1,962,972,291	3,046.60	1,682,099,212	0.95
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	194,563	9,155.91	1,781,402,228	8,300.86	1,615,039,952	0.91
10	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コング ロマ リット	1,509,703	2,565.26	3,872,776,873	1,006.87	1,520,073,452	0.86
11	TOTAL SA	株式	フラン ス	石油・ ガス・ 消耗燃 料	308,029	5,434.74	1,674,058,703	4,692.95	1,445,564,818	0.82
12	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・ 生活必 需品小 売り	342,467	4,643.07	1,590,096,994	4,150.88	1,421,538,188	0.80

13	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	7,598,914	203.79	1,548,618,462	176.92	1,344,368,481	0.76
14	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	342,532	4,269.71	1,462,512,751	3,778.95	1,294,411,918	0.73
15	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	971,350	1,836.24	1,783,633,763	1,302.85	1,265,522,765	0.71
16	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	754,649	1,461.52	1,102,937,712	1,638.64	1,236,595,321	0.70
17	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	1,734,476	961.46	1,667,630,566	703.66	1,220,476,786	0.69
18	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	847,026	1,952.76	1,654,039,752	1,416.41	1,199,738,468	0.68
19	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	101,043	14,443.51	1,459,415,763	11,393.90	1,151,274,040	0.65
20	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	513,666	2,298.09	1,180,449,566	2,236.97	1,149,056,100	0.65
21	HEWLETT-PACKARD CO	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	353,936	3,705.61	1,311,548,031	3,221.80	1,140,311,925	0.64
22	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	529,817	3,571.39	1,892,185,086	2,149.66	1,138,924,717	0.64
23	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	299,677	4,860.33	1,456,530,519	3,791.41	1,136,197,775	0.64
24	VERIZON COMM INC	株式	米国	各種電気通信サービス	409,979	3,179.52	1,303,534,591	2,737.15	1,122,172,462	0.63
25	ABBOTT LABORATORIES	株式	米国	医薬品	222,395	4,918.87	1,093,932,278	4,999.47	1,111,857,620	0.63
26	APPLE INC	株式	米国	コンピュータ・周辺機器	127,111	10,878.43	1,382,768,251	8,365.24	1,063,314,149	0.60
27	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	34,330	41,831.02	1,436,058,928	30,671.06	1,052,937,490	0.59

28	PEPSICO INC	株式	米国	飲料	225,164	5,982.03	1,346,938,308	4,604.24	1,036,708,150	0.59
29	TELEFONICA S.A	株式	スペイン	各種電気通信サービス	608,907	2,063.43	1,256,435,714	1,649.66	1,004,491,957	0.57
30	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	805,734	1,687.75	1,359,877,755	1,241.15	1,000,036,432	0.56

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	12.29
	医薬品	7.97
	商業銀行	6.13
	保険	4.17
	各種電気通信サービス	4.08
	電力	2.93
	食品	2.91
	食品・生活必需品小売り	2.90
	金属・鉱業	2.86
	コンピュータ・周辺機器	2.63
	ソフトウェア	2.43
	メディア	2.38
	化学	2.19
	通信機器	2.14
	飲料	2.12
	総合公益事業	1.99
	航空宇宙・防衛	1.95
	コングロマリット	1.95
	資本市場	1.95
	家庭用品	1.85
	バイオテクノロジー	1.73
	各種金融サービス	1.72
	ヘルスケア機器・用品	1.68
	タバコ	1.51
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.43	
機械	1.37	
エネルギー設備・サービス	1.35	
半導体・半導体製造装置	1.33	
専門小売り	1.32	

ホテル・レストラン・レジャー	1.23
無線通信サービス	1.13
情報技術サービス	1.03
電気設備	0.90
インターネットソフトウェア・サービス	0.87
陸運・鉄道	0.78
自動車	0.73
繊維・アパレル・贅沢品	0.59
航空貨物・物流サービス	0.58
建設・土木	0.54
複合小売り	0.51
不動産管理・開発	0.49
商業サービス・用品	0.45
建設資材	0.34
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.32
専門サービス	0.30
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.27
パーソナル用品	0.23
電子装置・機器・部品	0.23
ガス	0.23
家庭用耐久財	0.22
消費者金融	0.22
インターネット販売・カタログ販売	0.21
紙製品・林産品	0.19
運送インフラ	0.18
自動車部品	0.17
建設関連製品	0.16
各種消費者サービス	0.14
容器・包装	0.13
貯蓄・抵当・不動産金融	0.13
商社・流通業	0.12
旅客航空輸送業	0.12
海運業	0.10
販売	0.08
事務用電子機器	0.06
レジャー用品	0.06
水道	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.02
株式計	97.37
投資証券	0.92
投資信託受益証券	0.18
合計	98.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	5 2 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	5,300,000,000	100.19	5,310,001,000	100.69	5,336,623,000	0.80	2010/12/20	2.25
2	5 7 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.98	5,098,886,000	102.11	5,105,350,000	1.40	2011/6/20	2.15
3	4 4 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	4,600,000,000	100.21	4,609,430,000	100.38	4,617,664,000	0.70	2010/3/20	1.94
4	2 9 6 回 利 付国庫債券 (1 0 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.50	4,522,480,000	101.53	4,569,030,000	1.50	2018/9/20	1.92
5	4 9 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.87	4,494,033,000	100.30	4,513,635,000	0.60	2010/9/20	1.90
6	4 7 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	4,000,000,000	99.61	3,984,376,000	100.16	4,006,440,000	0.50	2010/6/20	1.69
7	5 4 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	3,900,000,000	101.06	3,941,388,000	101.34	3,952,416,000	1.10	2011/3/20	1.66
8	6 6 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	3,800,000,000	100.86	3,832,806,000	101.60	3,860,952,000	1.10	2012/9/20	1.63
9	7 2 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	3,700,000,000	102.17	3,780,272,000	103.25	3,820,250,000	1.50	2013/6/20	1.61
10	2 8 6 回 利 付国庫債券 (1 0 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	103.47	3,621,521,000	105.08	3,677,625,000	1.80	2017/6/20	1.55
11	6 0 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	3,600,000,000	101.05	3,637,631,000	101.74	3,662,496,000	1.20	2011/9/20	1.54
12	6 1 回 利付 国庫債券 (5 年)	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.26	3,543,950,000	101.86	3,564,995,000	1.20	2011/12/20	1.50
13	2 5 4 回 利 付国庫債券 (1 0 年)	国債 証券	日本	3,300,000,000	101.90	3,362,686,000	102.92	3,396,294,000	1.40	2013/9/20	1.43

14	63回 利付 国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	3,300,000,000	100.93	3,330,781,000	101.87	3,361,842,000	1.20	2012/3/20	1.41
15	293回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,200,000,000	104.31	3,337,762,000	104.48	3,343,200,000	1.80	2018/6/20	1.41
16	290回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,200,000,000	98.31	3,146,046,000	101.18	3,237,888,000	1.40	2018/3/20	1.36
17	289回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	3,100,000,000	100.94	3,129,261,000	102.12	3,165,565,000	1.50	2017/12/20	1.33
18	75回 利付 国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	3,000,000,000	100.78	3,023,400,000	101.47	3,044,040,000	1.10	2013/9/20	1.28
19	284回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,900,000,000	102.88	2,983,424,000	104.79	3,039,026,000	1.70	2016/12/20	1.28
20	285回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,700,000,000	102.79	2,775,240,000	104.54	2,822,634,000	1.70	2017/3/20	1.19
21	70回 利付 国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	2,800,000,000	99.81	2,794,794,000	100.40	2,811,144,000	0.80	2013/3/20	1.18
22	64回 利付 国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	2,700,000,000	102.18	2,758,794,000	102.91	2,778,570,000	1.50	2012/6/20	1.17
23	280回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,500,000,000	105.59	2,639,801,000	106.79	2,669,700,000	1.90	2016/6/20	1.12
24	256回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,500,000,000	101.90	2,547,607,000	102.93	2,573,125,000	1.40	2013/12/20	1.08
25	68回 利付 国庫債券 (5年)	国債 証券	日本	2,300,000,000	100.09	2,302,093,000	101.60	2,336,731,000	1.10	2012/12/20	0.98
26	297回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,300,000,000	101.32	2,330,327,000	100.65	2,315,019,000	1.40	2018/12/20	0.97
27	263回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,200,000,000	103.20	2,270,312,000	104.04	2,288,924,000	1.60	2014/9/20	0.96
28	288回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,200,000,000	101.23	2,226,965,000	103.94	2,286,702,000	1.70	2017/9/20	0.96
29	260回 利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	2,100,000,000	103.48	2,173,064,000	104.00	2,184,042,000	1.60	2014/6/20	0.92

30	266回利 付国庫債券 (10年)	国債 証券	日 本	2,000,000,000	101.84	2,036,866,000	102.98	2,059,640,000	1.40	2014/12/20	0.87
----	-------------------------	----------	--------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	------	------------	------

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	74.46
地方債証券	6.25
特殊債券	10.35
社債券	8.10
合計	99.16

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 5.75 08/15/10	国債 証券	米国	5,365,200,000	107.59	5,772,304,066	107.76	5,781,378,564	5.75	2010/8/15	1.97
2	US T N/B 3.875 05/15/10	国債 証券	米国	5,365,200,000	103.51	5,553,679,476	104.20	5,590,484,748	3.88	2010/5/15	1.91
3	US T N/B 6.5 02/15/10	国債 証券	米国	4,918,100,000	107.87	5,304,941,356	105.97	5,211,612,208	6.50	2010/2/15	1.78
4	US T N/B 4.5 11/15/10	国債 証券	米国	3,845,060,000	105.12	4,041,794,341	106.43	4,092,412,710	4.50	2010/11/15	1.39
5	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	3,576,800,000	104.31	3,731,127,092	109.25	3,907,654,000	4.00	2012/11/15	1.33
6	US T N/B 4.875 04/30/11	国債 証券	米国	3,576,800,000	105.74	3,782,275,950	108.73	3,889,197,712	4.88	2011/4/30	1.33
7	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	2,235,500,000	106.88	2,389,208,348	110.13	2,461,844,375	4.38	2012/8/15	0.84
8	ITALY BTPS 5.25 08/01/11	国債 証券	イ タ リ ア	2,291,200,000	103.30	2,366,867,796	106.40	2,437,836,800	5.25	2011/8/1	0.83
9	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	国債 証券	イ タ リ ア	2,291,200,000	104.78	2,400,719,360	106.25	2,434,400,000	5.00	2012/2/1	0.83
10	DEUTSCHLAND 5.25 07/04/10	国債 証券	ド イ ツ	2,291,200,000	104.43	2,392,700,160	105.28	2,412,175,360	5.25	2010/7/4	0.82
11	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	2,146,080,000	110.98	2,381,662,233	111.86	2,400,583,627	4.25	2013/11/15	0.82
12	US T N/B 5.0 08/15/11	国債 証券	米国	2,146,080,000	108.16	2,321,114,285	109.95	2,359,679,342	5.00	2011/8/15	0.80
13	ITALY BTPS 2.75 06/15/10	国債 証券	イ タ リ ア	2,291,200,000	97.88	2,242,587,610	101.12	2,316,861,440	2.75	2010/6/15	0.79

14	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米 国	2,056,660,000	107.77	2,216,476,703	111.44	2,291,880,204	4.25	2013/8/15	0.78
15	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米 国	2,056,660,000	103.67	2,132,129,112	110.70	2,276,619,787	4.00	2014/2/15	0.78
16	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/11	国債 証券	ド イ ツ	2,062,080,000	105.54	2,176,347,757	107.81	2,223,025,344	5.00	2011/7/4	0.76
17	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債 証券	ド イ ツ	2,062,080,000	101.92	2,101,688,433	105.49	2,175,288,192	3.75	2013/7/4	0.74
18	ITALY BTPS 5.5 11/01/10	国債 証券	イ タ リ ア	1,947,520,000	104.34	2,032,080,860	105.74	2,059,249,222	5.50	2010/11/1	0.70
19	US TREASURY N/B 4.5 04/30/12	国債 証券	米 国	1,788,400,000	106.55	1,905,611,736	109.58	1,959,692,952	4.50	2012/4/30	0.67
20	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米 国	1,788,400,000	104.34	1,865,931,711	108.98	1,949,069,856	3.88	2013/2/15	0.66
21	US TREASURY N/B 4.5 11/30/11	国債 証券	米 国	1,788,400,000	106.55	1,905,611,736	108.83	1,946,279,952	4.50	2011/11/30	0.66
22	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米 国	1,788,400,000	101.83	1,821,190,153	108.23	1,935,656,856	3.63	2013/5/15	0.66
23	DEUTSCHLAND 5.0 01/04/12	国債 証券	ド イ ツ	1,718,400,000	105.51	1,813,083,840	108.66	1,867,213,440	5.00	2012/1/4	0.64
24	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債 証券	フ ラ ン ス	1,718,400,000	105.10	1,806,085,599	107.96	1,855,184,640	4.75	2012/10/25	0.63
25	FRANCE OAT 5.5 10/25/10	国債 証券	フ ラ ン ス	1,718,400,000	103.47	1,778,009,005	106.47	1,829,580,480	5.50	2010/10/25	0.62
26	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フ ラ ン ス	1,718,400,000	101.25	1,739,874,157	105.35	1,810,334,400	4.00	2013/4/25	0.62
27	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	国債 証券	イ タ リ ア	1,718,400,000	101.29	1,740,554,758	103.80	1,783,699,200	4.25	2013/8/1	0.61

28	BUNDESOBL 2.5 10/08/10	国債 証券	ド イ ツ	1,718,400,000	98.00	1,684,032,000	101.64	1,746,581,760	2.50	2010/10/8	0.60
29	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	国債 証券	フ ラ ン ス	1,603,840,000	104.56	1,677,020,928	107.66	1,726,694,144	5.00	2011/10/25	0.59
30	US T N/B 7.25 05/15/16	国債 証券	米 国	1,341,300,000	124.17	1,665,505,623	127.36	1,708,266,267	7.25	2016/5/15	0.58

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.10
合計	97.10

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J-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21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	841	1,286,958.26	1,082,331,897	946,000.00	795,586,000	19.46
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	687	1,132,783.56	778,222,303	818,000.00	561,966,000	13.75
3	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	473	773,220.67	365,733,375	595,000.00	281,435,000	6.88
4	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	600	576,756.84	346,054,103	413,000.00	247,800,000	6.06
5	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	日本	970	312,212.90	302,846,512	227,100.00	220,287,000	5.39
6	森トラスト総合リート投資法人	投資証券	日本	282	937,603.84	264,404,284	675,000.00	190,350,000	4.66
7	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	390	583,624.25	227,613,459	423,000.00	164,970,000	4.04
8	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	263	811,433.09	213,406,902	569,000.00	149,647,000	3.66
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	312	510,411.70	159,248,450	367,000.00	114,504,000	2.80
10	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	248	704,844.35	174,801,399	461,000.00	114,328,000	2.80
11	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	150	1,128,584.71	169,287,706	668,000.00	100,200,000	2.45
12	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	240	525,472.06	126,113,294	390,000.00	93,600,000	2.29
13	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	190	629,322.47	119,571,270	482,000.00	91,580,000	2.24
14	トップリート投資法人	投資証券	日本	241	381,291.54	91,891,262	334,000.00	80,494,000	1.97
15	D Aオフィス投資法人	投資証券	日本	534	350,969.55	187,417,741	140,500.00	75,027,000	1.84
16	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	310	540,477.98	167,548,173	229,400.00	71,114,000	1.74
17	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	176	504,672.80	88,822,412	388,000.00	68,288,000	1.67
18	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	247	488,219.98	120,590,334	254,000.00	62,738,000	1.53
19	福岡リート投資法人	投資証券	日本	166	550,380.94	91,363,236	368,000.00	61,088,000	1.49
20	プレミア投資法人	投資証券	日本	204	469,152.62	95,707,135	288,000.00	58,752,000	1.44

21	阪急リート投資法人	投資証券	日本	133	544,143.18	72,371,043	362,000.00	48,146,000	1.18
22	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	150	414,581.63	62,187,245	313,000.00	46,950,000	1.15
23	M I Dリート投資法人	投資証券	日本	285	338,260.55	96,404,256	153,000.00	43,605,000	1.07
24	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	日本	118	349,462.65	41,236,593	296,600.00	34,998,800	0.86
25	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	123	410,140.76	50,447,313	232,000.00	28,536,000	0.70
26	日本コマーシャル投資法人	投資証券	日本	399	301,465.24	120,284,629	66,700.00	26,613,300	0.65
27	日本レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	384	292,178.19	112,196,426	55,400.00	21,273,600	0.52
28	ジョイント・リート投資法人	投資証券	日本	162	249,701.91	40,451,710	112,900.00	18,289,800	0.45
29	リプラス・レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	260	196,570.88	51,108,430	69,300.00	18,018,000	0.44
30	クレッシェンド投資法人	投資証券	日本	169	252,507.67	42,673,796	102,700.00	17,356,300	0.42

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.88
合計	97.88

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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21年2月5日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	WESTFIELD GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	634,300	930.08	589,947,000	609.39	386,538,614	6.07
2	UNIBAIL-RODAMCO	投資証券	フランス	29,110	13,750.64	400,281,050	12,099.83	352,225,970	5.54
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	81,800	5,381.77	440,228,648	3,844.17	314,452,762	4.94
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	42,238	6,601.66	278,840,809	5,596.80	236,397,545	3.72
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	100,800	2,722.60	274,437,920	2,094.22	211,097,013	3.32
6	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	47,500	5,823.83	276,631,964	4,416.45	209,781,556	3.30
7	HCP INC	投資証券	米国	91,300	2,327.72	212,520,704	2,155.02	196,753,509	3.09
8	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	46,700	5,372.44	250,893,011	3,791.41	177,058,754	2.78
9	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	英国	154,900	1,485.52	230,106,641	880.06	136,320,721	2.14
10	VENTAS INC	投資証券	米国	51,800	2,554.52	132,323,923	2,480.51	128,490,459	2.02
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	27,800	5,588.65	155,364,453	4,478.15	124,492,670	1.96
12	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	米国	36,701	3,601.79	132,189,442	3,303.17	121,229,818	1.91
13	LINK REIT/THE	投資証券	香港	715,000	166.10	118,763,570	166.26	118,877,759	1.87
14	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	英国	188,200	831.59	156,504,306	588.00	110,660,941	1.74
15	KIMCO REALTY	投資証券	米国	85,299	1,729.03	147,484,624	1,202.70	102,589,022	1.61
16	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	214,100	742.73	159,019,394	459.62	98,404,385	1.55
17	NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	投資証券	米国	41,200	2,330.21	96,004,855	2,344.59	96,597,207	1.52
18	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券	米国	19,800	5,313.86	105,214,376	4,514.82	89,393,353	1.40

19	STOCKLAND	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	479,100	261.34	125,206,586	177.64	85,109,288	1.34
20	LIBERTY PROPERTY TRUST	投資 証券	米国	40,400	1,990.00	80,396,044	1,850.99	74,780,158	1.18
21	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	投資 証券	米国	48,800	1,484.43	72,440,232	1,481.69	72,306,443	1.14
22	PROLOGIS	投資 証券	米国	85,400	1,033.35	88,248,332	826.24	70,560,964	1.11
23	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資 証券	米国	23,600	2,883.19	68,043,315	2,965.17	69,977,946	1.10
24	REGENCY	投資 証券	米国	22,700	3,272.86	74,294,011	2,994.68	67,979,141	1.07
25	MACK CALI	投資 証券	米国	31,800	1,915.99	60,928,350	1,791.08	56,956,427	0.90
26	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	投資 証券	米国	40,300	1,404.65	56,607,203	1,382.43	55,712,058	0.88
27	GPT GROUP	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	1,532,800	44.33	67,945,913	36.22	55,516,023	0.87
28	CORIO NV	投資 証券	オラ ンダ	14,700	4,886.56	71,832,385	3,755.85	55,210,989	0.87
29	CFS RETAIL PROPERTY	投資 信託 受益 証券	オース トラ リア	593,300	120.73	71,628,516	92.56	54,915,195	0.86
30	REALTY INCOME CORP	投資 証券	米国	31,600	1,859.04	58,745,721	1,710.60	54,055,105	0.85

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

種類別業種別投資比率

平成21年2月5日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	89.53
投資信託受益証券	14.61
合計	104.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成21年2月5日）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年1月11日現在）	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2期末（平成21年1月13日現在）	5,934	5,934	0.6383	0.6383
平成20年2月末	7,760	-	0.8855	-
3月末	7,472	-	0.8524	-
4月末	7,887	-	0.8908	-
5月末	8,130	-	0.9026	-
6月末	7,920	-	0.8697	-
7月末	7,999	-	0.8692	-
8月末	7,909	-	0.8560	-
9月末	7,166	-	0.7816	-
10月末	6,046	-	0.6666	-
11月末	5,969	-	0.6502	-
12月末	6,116	-	0.6605	-
平成21年1月末	5,891	-	0.6278	-
2月5日	5,849	-	0.6222	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	8.75
第2期	30.05

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

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成19年1月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みには、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（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11時）までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約を請求をすることができます。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日の場合は午前11時）までに解約の請求が行われ、かつ、解約の請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の請求の受付を行いません。

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

・解約価額

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

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

- ・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、金融商品取引所等おける取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

電話番号：03-3287-3111

（午前9時から午後5時まで。ただし、土、日、祝祭日は除きます。なお、わが国の金融商品取引所の半休日にあたる日は午前11時までとさせていただきます。）

(2)【保管】

該当事項はありません。

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

(3)【信託期間】

信託期間は平成19年1月26日から無期限ですが、下記(5)イ.の場合には信託を終了することがあります。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

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

(5)【その他】

イ. 償還規定

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

b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

c. 委託会社は、前記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

d. 委託会社は前記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

f. 委託会社は、前記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその

理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- g. 前記d. から f. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記d. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、後記「ロ. 信託約款の変更 d. 」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 前記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面にて付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、前記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は前記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる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. 前記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、前記a. ~ e. の規定にしたがいます。
- g. 前記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面にて付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意志表示がない限り、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。

二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として1月11日、休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

2【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資されます。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

受益者集会

該当事項はありません。

第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、第1期計算期間（平成19年1月26日から平成20年1月11日まで）については改正前の、第2期計算期間（平成20年1月12日から平成21年1月13日まで）については改正後の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は、信託約款第40条により、平成19年1月26日から平成20年1月11日までとなっております。
- (3) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成19年1月26日から平成20年1月11日まで）及び第2期計算期間（平成20年1月12日から平成21年1月13日まで）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】

科目	注記 番号	第 1 期 平成20年1月11日現在	第 2 期 平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		151,982,444	214,775,611
親投資信託受益証券		7,895,374,866	5,767,216,104
未収入金		1,319,000	-
流動資産合計		8,048,676,310	5,981,991,715
資産合計		8,048,676,310	5,981,991,715
負債の部			
流動負債			
未払解約金		31,240,205	12,738,939
未払受託者報酬		3,053,966	2,543,496
未払委託者報酬		38,393,125	31,975,886
その他未払費用		218,049	181,584
流動負債合計		72,905,345	47,439,905
負債合計		72,905,345	47,439,905
純資産の部			
元本等			
元本		8,740,470,729	9,297,605,719
剰余金			
期末欠損金	*3	764,699,764	3,363,053,909
(うち分配準備積立金)		(115,943,183)	(260,793,189)
剰余金合計		764,699,764	3,363,053,909
元本等合計		7,975,770,965	5,934,551,810
純資産合計		7,975,770,965	5,934,551,810
負債・純資産合計		8,048,676,310	5,981,991,715

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	注記 番号	第 1 期	第 2 期
		自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
		金額（円）	金額（円）
営業収益			
受取利息		577,186	480,845
有価証券売買等損益		812,254,134	2,434,709,762
営業収益合計		811,676,948	2,434,228,917
営業費用			
受託者報酬		5,065,710	5,391,392
委託者報酬	*1	63,684,014	67,778,454
その他費用		361,658	384,922
営業費用合計		69,111,382	73,554,768
営業損失金額		880,788,330	2,507,783,685
経常損失金額		880,788,330	2,507,783,685
当期純損失金額		880,788,330	2,507,783,685
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		51,904,154	165,542,580
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-	764,699,764
剰余金増加額又は欠損金減少額		114,584,621	159,043,213
当期追加信託に伴う剰余金増加額		114,584,621	-
当期一部解約に伴う欠損金減少額		-	159,043,213
剰余金減少額又は欠損金増加額		50,400,209	415,156,253
当期一部解約に伴う剰余金減少額		50,400,209	-
当期追加信託に伴う欠損金増加額		-	415,156,253
分配金	*2	-	-
期末欠損金		764,699,764	3,363,053,909

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 1 期 自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は計算期間末日が休業日のため、平成20年1月12日から平成21年1月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 1 期 平成20年1月11日現在	第 2 期 平成21年1月13日現在
*1 期首元本額	1,000,000円	8,740,470,729円
期中追加設定元本額	12,251,099,717円	2,271,286,181円
期中解約元本額	3,511,628,988円	1,714,151,191円
*2 計算期間末日における受益権の総数	8,740,470,729口	9,297,605,719口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は764,699,764円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,363,053,909円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第 1 期 自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	*1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	863,771円		1,018,280円
*2 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（115,943,183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（16,641,673円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は132,584,856円（1万口当たり151.69円）であります。分配を行っておりません。</p> <p>なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>		<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（165,016,567円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（48,192,428円）及び分配準備積立金（95,776,622円）より分配対象収益は308,985,617円（1万口当たり332.32円）であります。分配を行っておりません。</p> <p>なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 1 期 自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		第 2 期 自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	7,895,374,866	797,320,879	5,767,216,104	2,347,458,014
合計	7,895,374,866	797,320,879	5,767,216,104	2,347,458,014

（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 1 期 平成20年1月11日現在	第 2 期 平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	0.9125円	0.6383円
(1万口当たり純資産額)	(9,125円)	(6,383円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	878,681,951	897,310,008	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,597,678,607	1,721,498,699	
親投資信託受益証券	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1,101,619,929	637,837,938	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	659,960,562	606,701,744	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,409,221,581	1,620,463,895	
親投資信託受益証券	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	620,275,378	283,403,820	
合 計		6,267,438,008	5,767,216,104	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,961,090,544	9,192,708,527
株式		154,957,868,150	145,520,048,562
派生商品評価勘定		329,781	-
未収入金		2,640,000	-
未収配当金		105,976,085	164,947,125
前払金		2,285,736	-
差入委託証拠金		42,079,264	1,138,523,214
流動資産合計		165,072,269,560	156,016,227,428
資産合計		165,072,269,560	156,016,227,428
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		17,825,736	232,987,333
前受金		-	312,371,214
未払金		9,059,195,954	-
未払解約金		1,740,000	29,227,000
流動負債合計		9,078,761,690	574,585,547
負債合計		9,078,761,690	574,585,547
純資産の部			
元本等			
元本		91,999,220,127	152,215,619,455
剰余金			
剰余金		63,994,287,743	3,226,022,426
剰余金合計		63,994,287,743	3,226,022,426
元本等合計		155,993,507,870	155,441,641,881
純資産合計		155,993,507,870	155,441,641,881
負債・純資産合計		165,072,269,560	156,016,227,428

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。 ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年2月8日から平成20年2月7日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年2月8日から平成21年2月9日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	59,499,799,038円	91,999,220,127円
同期中追加設定元本額	43,202,586,589円	77,841,184,973円
同期中解約元本額	10,703,165,500円	17,624,785,645円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	304,808,047円	968,907,124円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	18,666,075,953円	22,766,945,494円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	349,437,577円	591,561,997円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,435,326,215円	2,158,682,000円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,671,431,540円	2,247,198,505円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	306,604,365円	419,279,933円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	957,091,463円	1,185,642,117円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	770,337,425円	856,792,681円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	168,439,983円	138,523,805円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	862,835,907円	878,681,951円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）<適格機関投資家限定>	975,258,446円	- 円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	10,904,889,123円	12,932,516,408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）	1,850,960,314円	1,954,812,902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）	181,920,081円	228,033,967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）	736,065,714円	808,193,227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）	189,322,185円	247,583,189円

D I A M国内重視バランスファン ド50 V A（適格機関投資家限 定）	273,564,053円	323,704,523円
D I A M世界バランスファンド 40 V A（適格機関投資家限定）	18,203,599,489円	21,701,325,074円
D I A M世界バランスファンド 50 V A（適格機関投資家限定）	6,278,516,395円	6,972,336,458円
D I A Mバランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	3,895,072,899円	5,931,210,392円
D I A Mバランスファンド37.5 V A（適格機関投資家限定）	2,453,451,683円	3,871,851,726円
D I A Mバランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	6,601,210,786円	8,998,344,203円
D I A Mグローバル・アセット ・バランス V A（適格機関投資 家限定）	1,130,533,821円	1,292,960,786円
D I A Mグローバル・アセット ・バランス V A 2（適格機関投資 家限定）	2,007,393,464円	2,822,820,450円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30 V A（適格機 関投資家限定）	789,183,033円	2,320,912,753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）	1,853,330,873円	13,968,390,813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）	260,915,369円	313,326,020円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	437,484,385円	534,502,143円
D I A M世界バランスファンド 55 V A（適格機関投資家限定）	2,569,058,112円	4,803,799,364円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35 V A（適格機関 投資家限定）	4,915,101,427円	10,173,189,856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）	- 円	480,571,932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）	- 円	17,199,366,114円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A（適格機関投資 家限定）	- 円	2,123,651,548円
（合 計）	91,999,220,127円	152,215,619,455円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日に おける受益権の総数	91,999,220,127口	152,215,619,455口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	154,957,868,150	33,761,536,206	145,520,048,562	74,396,588,894
合計	154,957,868,150	33,761,536,206	145,520,048,562	74,396,588,894

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左

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

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成20年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	1,135,580,000	-	1,118,205,000	17,495,955
合 計		1,135,580,000	-	1,118,205,000	17,495,955

平成21年1月13日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	10,189,102,000	-	9,956,850,000	232,987,333
合 計		10,189,102,000	-	9,956,850,000	232,987,333

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.6956円	1.0212円
(1万口当たり純資産額)	(16,956円)	(10,212円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	68,000	200	13,600,000	
日本水産	181,100	228	41,290,800	
マルハニチロホールディングス	289,000	148	42,772,000	
ハウスイ	13,000	84	1,092,000	
サカタのタネ	29,100	1,241	36,113,100	
ホクト	14,500	2,665	38,642,500	
ショーボンドHD	15,400	1,602	24,670,800	
住石ホールディングス	43,100	87	3,749,700	
日鉄鉱業	40,000	325	13,000,000	
三井松島	50,000	133	6,650,000	
国際石油開発帝石	718	644,000	462,392,000	
関東天然瓦斯	19,000	526	9,994,000	
石油資源開発	22,400	4,130	92,512,000	
ダイセキ環境ソリューション	12	200,000	2,400,000	
間組	71,400	82	5,854,800	
東急建設	55,710	220	12,256,200	
コムシスホールディングス	76,000	780	59,280,000	
ミサワホーム	18,400	227	4,176,800	
高松コンストラクションGP	11,900	1,272	15,136,800	
東建コーポレーション	5,250	2,200	11,550,000	
ヤマウラ	5,000	135	675,000	
大成建設	695,000	208	144,560,000	
大林組	439,000	452	198,428,000	
清水建設	446,000	432	192,672,000	
飛島建設	234,500	15	3,517,500	
長谷工コーポレーション	785,500	79	62,054,500	
松井建設	2,000	324	648,000	
鹿島建設	644,000	261	168,084,000	
不動テトラ	113,600	52	5,907,200	
大末建設	47,000	27	1,269,000	
鉄建建設	78,000	90	7,020,000	
安藤建設	54,000	141	7,614,000	

太平工業	14,000	235	3,290,000
西松建設	182,000	128	23,296,000
三井住友建設	84,500	62	5,239,000
大豊建設	46,000	48	2,208,000
前田建設	97,000	319	30,943,000
佐田建設	51,000	29	1,479,000
ナカノフドー建設	13,500	135	1,822,500
奥村組	149,000	391	58,259,000
大和小田急建設	6,000	167	1,002,000
東鉄工業	17,000	560	9,520,000
イチケン	20,000	101	2,020,000
浅沼組	47,000	54	2,538,000
戸田建設	169,000	291	49,179,000
熊谷組	87,000	43	3,741,000
青木あすなろ建設	7,500	385	2,887,500
北野建設	36,000	195	7,020,000
植木組	23,000	110	2,530,000
三井ホーム	21,000	458	9,618,000
矢作建設	20,000	422	8,440,000
ピース三菱	11,300	204	2,305,200
アゼル	28,000	8	224,000
大東建託	70,000	3,820	267,400,000
新日本建設	21,700	92	1,996,400
N I P P Oコーポレーション	32,000	666	21,312,000
東亜道路	31,000	131	4,061,000
前田道路	46,000	769	35,374,000
日本道路	55,000	172	9,460,000
東亜建設	139,000	120	16,680,000
若築建設	76,000	35	2,660,000
あおみ建設	94,000	28	2,632,000
東洋建設	180,000	42	7,560,000
五洋建設	184,000	117	21,528,000
大成ロテック	30,000	119	3,570,000
大林道路	22,000	135	2,970,000
世紀東急	42,000	28	1,176,000
福田組	22,000	157	3,454,000
東北ミサワホーム	10,300	121	1,246,300
住友林業	108,200	626	67,733,200
日本基礎技術	22,900	195	4,465,500
日成ビルド工業	48,000	48	2,304,000
エス・パイ・エル	73,000	37	2,701,000
巴コーポレーション	23,400	157	3,673,800
パナホーム	59,000	497	29,323,000

大和ハウス	391,000	833	325,703,000
ライト工業	35,900	161	5,779,900
積水ハウス	441,000	751	331,191,000
日特建設	38,000	36	1,368,000
北陸電気工事	2,000	325	650,000
コミュニチュア	12,000	570	6,840,000
ユアテック	26,000	524	13,624,000
西部電気工業	1,000	405	405,000
四電工	2,000	481	962,000
中電工	23,100	1,384	31,970,400
関電工	72,000	681	49,032,000
大明	22,000	747	16,434,000
きんでん	93,000	821	76,353,000
東京エネシス	18,000	690	12,420,000
トーエネック	24,000	486	11,664,000
住友電設	13,000	491	6,383,000
日本電設工業	32,000	953	30,496,000
協和エクシオ	57,000	854	48,678,000
新日本空調	12,600	725	9,135,000
日本工営	50,000	201	10,050,000
東電通	22,000	160	3,520,000
日本電話施設	19,000	238	4,522,000
九電工	29,000	684	19,836,000
三機工業	38,000	583	22,154,000
日揮	158,000	1,256	198,448,000
中外炉工業	54,000	266	14,364,000
ヤマト	16,000	292	4,672,000
太平電業	23,000	943	21,689,000
高砂熱学	45,000	718	32,310,000
日立プラントテクノロジー	43,000	333	14,319,000
三晃金属	17,000	337	5,729,000
NEC ネットズエスアイ	13,300	936	12,448,800
朝日工業社	8,000	288	2,304,000
アタカ大機	4,000	199	796,000
大気社	22,700	1,268	28,783,600
ダイダン	15,000	436	6,540,000
日比谷総合設	23,000	757	17,411,000
東芝プラントシステム	26,000	960	24,960,000
日本製粉	100,000	458	45,800,000
日清製粉G本社	142,500	1,033	147,202,500
日東富士製粉	8,000	270	2,160,000
昭和産業	73,000	277	20,221,000
鳥越製粉	14,500	706	10,237,000

日本農産工業	41,000	190	7,790,000
協同飼料	57,000	108	6,156,000
中部飼料	15,000	670	10,050,000
日本配合飼料	45,000	111	4,995,000
ユニ・チャーム ペットケア	9,000	2,960	26,640,000
東洋精糖	27,000	101	2,727,000
日本甜菜糖	89,000	224	19,936,000
三井製糖	62,000	309	19,158,000
日本M & Aセンター	22	378,000	8,316,000
アコーディア・ゴルフ	366	49,650	18,171,900
パソナグループ	144	39,700	5,716,800
テンプホールディングス	16,900	624	10,545,600
森永製菓	169,000	184	31,096,000
明治製菓	236,000	391	92,276,000
中村屋	37,000	467	17,279,000
江崎グリコ	57,000	849	48,393,000
名糖産業	6,300	1,608	10,130,400
不二家	87,000	114	9,918,000
山崎製パン	106,000	1,172	124,232,000
第一屋製パン	25,000	91	2,275,000
モロゾフ	18,000	306	5,508,000
明治乳業	187,000	447	83,589,000
雪印乳業	172,000	304	52,288,000
森永乳業	134,000	314	42,076,000
ヤクルト	84,200	1,852	155,938,400
プリマハム	88,000	166	14,608,000
日本ハム	119,000	1,187	141,253,000
伊藤ハム	101,000	288	29,088,000
林兼産業	54,000	85	4,590,000
丸大食品	65,000	231	15,015,000
米久	15,500	1,010	15,655,000
S Foods	4,500	765	3,442,500
学情	6,200	351	2,176,200
スタジオアリス	7,000	746	5,222,000
シミック	240	21,520	5,164,800
システムプロ	92	45,050	4,144,600
NECフィールドディング	12,000	1,059	12,708,000
新日鉄ソリューションズ	9,200	1,143	10,515,600
総合警備保障	48,800	828	40,406,400
日本駐車場開発	1,503	3,300	4,959,900
コア	5,400	529	2,856,600
カカクコム	112	316,000	35,392,000
アイロムホールディングス	319	3,200	1,020,800

ルネサンス	8,500	321	2,728,500
セキュアードキャピタルJ	47	32,000	1,504,000
新日本科学	5,700	611	3,482,700
ソネット・エムスリー	68	261,400	17,775,200
ディー・エヌ・エー	189	257,900	48,743,100
博報堂DYHLDGS	20,270	4,330	87,769,100
一休	110	29,890	3,287,900
ジャパンベストレスキューS	24	47,150	1,131,600
ジェイコム	16	103,600	1,657,600
パシフィックゴルフGRP	360	29,090	10,472,400
サッポロホールディングス	223,000	487	108,601,000
アサヒビール	294,700	1,415	417,000,500
麒麟HD	642,000	1,074	689,508,000
宝ホールディングス	133,000	478	63,574,000
オエノンホールディングス	43,000	263	11,309,000
メルシャン	49,000	173	8,477,000
養命酒	3,000	815	2,445,000
三国コカ・コ・ラ	21,800	782	17,047,600
四国コカ・コーラ	7,900	822	6,493,800
コカ・コーラウエスト	48,500	1,839	89,191,500
コカコーラセントラルジャパン	18,000	1,309	23,562,000
ダイドードリンコ	7,300	2,595	18,943,500
伊藤園	43,700	1,254	54,799,800
キーコーヒー	13,000	1,448	18,824,000
ユニカフェ	4,100	1,119	4,587,900
ジャパンフーズ	2,800	718	2,010,400
日清オイリオグループ	68,000	432	29,376,000
不二製油	42,200	1,109	46,799,800
J-オイルミルズ	58,000	332	19,256,000
ローソン	43,400	4,780	207,452,000
インターニックス	6,400	278	1,779,200
サンエー	5,400	2,960	15,984,000
麒麟堂	6,400	469	3,001,600
ダイユーエイト	1,900	601	1,141,900
カワチ薬品	9,800	1,750	17,150,000
エービーシー・マート	14,500	2,895	41,977,500
ハードオフコーポレーション	7,200	370	2,664,000
高千穂交易	6,000	1,026	6,156,000
アスクル	13,300	1,694	22,530,200
ゲオ	253	63,700	16,116,100
ポイント	12,410	4,300	53,363,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	128	640,000
伊藤忠食品	3,600	3,350	12,060,000

くらコーポレーション	41	158,500	6,498,500
キャンドゥ	76	77,800	5,912,800
高千穂電気	9,200	798	7,341,600
パル	3,600	802	2,887,200
JALUX	4,400	1,355	5,962,000
エディオン	55,000	424	23,320,000
サーラコーポレーション	14,000	520	7,280,000
トーメンデバイス	2,000	955	1,910,000
バルス	75	124,500	9,337,500
あみやき亭	25	121,500	3,037,500
双日	857,600	151	129,497,600
アルフレッサホールディングス	27,600	3,620	99,912,000
ハニーズ	10,810	660	7,134,600
クリエイトエス・ディー	5,100	1,686	8,598,600
キッコーマン	137,000	955	130,835,000
味の素	427,000	860	367,220,000
キュービー	81,400	1,063	86,528,200
ハウス食品	58,200	1,423	82,818,600
カゴメ	61,100	1,407	85,967,700
焼津水産化工	8,800	976	8,588,800
アリアケジャパン	13,000	1,626	21,138,000
ニチレイ	176,000	380	66,880,000
横浜冷凍	33,000	604	19,932,000
東洋水産	63,000	2,375	149,625,000
日清食品HD	49,900	2,880	143,712,000
永谷園	2,000	818	1,636,000
フジッコ	18,000	1,064	19,152,000
ロックフィールド	7,400	1,078	7,977,200
日本たばこ産業	3,479	296,100	1,030,131,900
わらべや日洋	8,100	1,664	13,478,400
なとり	8,300	701	5,818,300
片倉工業	16,900	891	15,057,900
ゲンゼ	109,000	300	32,700,000
昭栄	23,400	817	19,117,800
神栄	9,000	136	1,224,000
川島織物セルコン	54,000	73	3,942,000
山下医科器械	400	1,056	422,400
ラサ商事	7,900	362	2,859,800
アルペン	10,600	1,603	16,991,800
ビックカメラ	376	30,950	11,637,200
DCM JAPAN HLDGS	69,100	525	36,277,500
あいホールディングス	34,300	288	9,878,400
J. フロントリテイリング	350,000	338	118,300,000

ドトール・日レスHD	20,000	1,666	33,320,000
マツモトキヨシHLDGS	25,800	1,687	43,524,600
ココカラファイン HD	8,000	1,349	10,792,000
三越伊勢丹HD	253,200	708	179,265,600
東洋紡績	489,000	126	61,614,000
ユニチカ	336,000	65	21,840,000
富士紡ホールディングス	62,000	91	5,642,000
日清紡績	104,000	698	72,592,000
倉敷紡績	151,000	138	20,838,000
大和紡績	95,000	375	35,625,000
シキボウ	97,000	118	11,446,000
日東紡績	140,000	184	25,760,000
トヨタ紡織	48,800	806	39,332,800
日本毛織	50,000	546	27,300,000
大東紡織	26,000	61	1,586,000
トーア紡コーポレーション	59,000	60	3,540,000
ダイドーリミテッド	20,200	682	13,776,400
御幸ホールディングス	4,000	195	780,000
東京建物不動産販	7,100	264	1,874,400
野村不動産HLDGS	38,900	1,584	61,617,600
帝国繊維	6,000	340	2,040,000
ブックオフコーポレーション	7,700	822	6,329,400
三井鉱山	90,000	136	12,240,000
ミタチ産業	1,000	345	345,000
JFE商事HLDGS	92,000	266	24,472,000
あさひ	2,200	2,090	4,598,000
サークルKサンクス	34,000	1,577	53,618,000
日本調剤	2,450	1,110	2,719,500
コスモス薬品	6,300	1,421	8,952,300
グリーンホスピタルサプライ	131	47,450	6,215,950
セブン&アイ・HLDGS	551,900	2,670	1,473,573,000
ツルハホールディングス	9,300	3,020	28,086,000
サンマルクホールディングス	4,400	2,480	10,912,000
フェリシモ	4,000	1,830	7,320,000
帝人	600,000	244	146,400,000
東レ	975,000	420	409,500,000
三菱レイヨン	365,000	230	83,950,000
クラレ	216,500	711	153,931,500
旭化成	915,000	364	333,060,000
サカイオーベックス	44,000	86	3,784,000
稲葉製作所	7,400	995	7,363,000
宮地エンジニアリングG	53,000	58	3,074,000
三協・立山HLDGS	187,000	76	14,212,000

トーカロ	9,100	849	7,725,900
アルファCO	5,400	654	3,531,600
SUMCO	78,300	1,124	88,009,200
住江織物	39,000	122	4,758,000
日本フェルト	9,900	393	3,890,700
イチカワ	2,000	293	586,000
日本バイリン	21,000	413	8,673,000
エコナック	35,000	39	1,365,000
日東製網	19,000	89	1,691,000
芦森工業	36,000	98	3,528,000
アツギ	139,000	120	16,680,000
ダイニック	28,000	136	3,808,000
共和レザー	9,500	435	4,132,500
セーレン	36,800	398	14,646,400
東海染工	17,000	68	1,156,000
小松精練	12,000	391	4,692,000
ワコールホールディングス	88,000	1,111	97,768,000
ホギメディカル	7,200	5,460	39,312,000
サンエー・インターナショナル	6,300	784	4,939,200
レナウン	24,700	130	3,211,000
ITホールディングス	44,900	1,163	52,218,700
特種東海HLDGS	102,000	246	25,092,000
ドワンゴ	68	154,900	10,533,200
ベリサーブ	5	122,800	614,000
マクロミル	57	99,100	5,648,700
ティーガイア	111	95,000	10,545,000
GMOペイメントゲートウェイ	24	91,900	2,205,600
インターネットイニシアティブ	80	88,600	7,088,000
ソネットエンタテインメント	77	188,000	14,476,000
SRAホールディングス	6,500	592	3,848,000
JBISホールディングス	17,700	386	6,832,200
朝日ネット	9,000	234	2,106,000
王子製紙	602,000	455	273,910,000
三菱製紙	209,000	181	37,829,000
北越製紙	84,500	466	39,377,000
中越パルプ	59,000	203	11,977,000
巴川製紙	23,000	170	3,910,000
大王製紙	62,000	927	57,474,000
紀州製紙	51,000	106	5,406,000
日本製紙G本社	68,400	2,890	197,676,000
レンゴー	114,000	612	69,768,000
トーモク	48,000	182	8,736,000
ザ・パック	9,500	1,152	10,944,000

コ - プケミカル	19,000	225	4,275,000
昭和電工	760,000	125	95,000,000
住友化学	1,079,000	307	331,253,000
日本化成	29,000	158	4,582,000
住友精化	28,000	251	7,028,000
日産化学	102,000	760	77,520,000
ラサ工業	61,000	133	8,113,000
クレハ	96,000	424	40,704,000
テイカ	20,000	239	4,780,000
石原産業	228,000	80	18,240,000
片倉チツカリン	12,000	318	3,816,000
日本曹達	87,000	312	27,144,000
東ソー	392,000	204	79,968,000
トクヤマ	180,000	675	121,500,000
セントラル硝子	150,000	308	46,200,000
東亜合成	160,000	249	39,840,000
ダイソー	59,000	231	13,629,000
関東電化	33,000	311	10,263,000
電気化学	308,000	203	62,524,000
イビデン	98,200	1,687	165,663,400
信越化学	244,300	4,090	999,187,000
日本カ - バイド	33,000	102	3,366,000
堺 化 学	51,000	251	12,801,000
エア・ウォーター	105,000	784	82,320,000
大陽日酸	228,000	629	143,412,000
日本化学工業	51,000	198	10,098,000
日本パ - カライジング	35,000	757	26,495,000
高压ガス	23,000	441	10,143,000
チタン工業	19,000	175	3,325,000
四国化成	22,000	333	7,326,000
戸田工業	24,000	293	7,032,000
ステラ ケミファ	7,100	1,346	9,556,600
保土谷化学	38,000	162	6,156,000
日本触媒	98,000	575	56,350,000
大日精化	54,000	229	12,366,000
カネカ	183,000	492	90,036,000
協和発酵キリン	201,000	806	162,006,000
三菱瓦斯化学	252,000	367	92,484,000
三井化学	448,000	302	135,296,000
J S R	133,400	1,005	134,067,000
東京応化工業	29,000	1,238	35,902,000
三菱ケミカルH L D G S	851,500	378	321,867,000
日本合成化学	38,000	238	9,044,000

ダイセル化学	190,000	373	70,870,000	
住友ベークライト	150,000	352	52,800,000	
積水化学	328,000	532	174,496,000	
日本ゼオン	126,000	294	37,044,000	
アイカ工業	45,800	836	38,288,800	
宇部興産	614,000	223	136,922,000	
積水樹脂	22,000	642	14,124,000	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
タキロン	37,000	287	10,619,000	
旭有機材	54,000	281	15,174,000	
日立化成	63,300	916	57,982,800	
ニチバン	17,000	296	5,032,000	
リケンテクノス	17,000	177	3,009,000	
大倉工業	37,000	194	7,178,000	
積水化成成品	41,000	283	11,603,000	
群栄化学	41,000	203	8,323,000	
タイガース ポリマー	6,900	346	2,387,400	
日本カ-リット	12,900	365	4,708,500	
日本化薬	111,000	433	48,063,000	
イーピーエス	39	370,000	14,430,000	
パナソニック電工 I S	2,800	1,693	4,740,400	
フェイス	589	6,300	3,710,700	
アミューズ	3,200	1,150	3,680,000	
野村総合研究所	68,300	1,580	107,914,000	
ドリームインキュベータ	46	59,100	2,718,600	
サイバネットシステム	120	34,000	4,080,000	
T A C	8,900	376	3,346,400	
ケネディクス	380	21,430	8,143,400	
電通	145,100	1,648	239,124,800	
テイクアンドギヴニーズ	403	3,300	1,329,900	
びあ	3,700	948	3,507,600	
シンプレクス・テクノロジー	228	31,400	7,159,200	
イオンファンタジー	4,900	704	3,449,600	
ソースネクスト	14	41,400	579,600	
ネクシィーズ	559	1,665	930,735	
日本精化	12,800	496	6,348,800	
A D E K A	63,400	563	35,694,200	
日油	130,000	297	38,610,000	
ミヨシ油脂	53,000	126	6,678,000	
ハリマ化成	9,000	400	3,600,000	
花 王	376,000	2,595	975,720,000	
第一工業製薬	26,000	177	4,602,000	
三洋化成	47,000	493	23,171,000	
武田薬品	531,700	4,400	2,339,480,000	
アステラス製薬	328,700	3,350	1,101,145,000	
大日本住友製薬	104,000	774	80,496,000	
塩野義製薬	214,000	1,913	409,382,000	
田辺三菱製薬	146,000	1,209	176,514,000	

わかもと製薬	4,000	336	1,344,000	
あすか製薬	15,000	829	12,435,000	
日本新薬	37,000	963	35,631,000	
中外製薬	194,800	1,640	319,472,000	
科研製薬	62,000	945	58,590,000	
エーザイ	180,600	3,430	619,458,000	
ロート製薬	67,000	1,111	74,437,000	
小野薬品	73,600	4,520	332,672,000	
久光製薬	45,500	3,240	147,420,000	
有機合成薬品	12,000	477	5,724,000	
持田製薬	60,000	984	59,040,000	
大正製薬	139,000	1,741	241,999,000	
参天製薬	45,400	2,640	119,856,000	
エスエス製薬	38,000	553	21,014,000	
扶桑薬品	50,000	260	13,000,000	
日本ケミファ	24,000	258	6,192,000	
ツムラ	43,100	2,920	125,852,000	
テルモ	100,900	3,700	373,330,000	
みらかホールディングス	29,200	1,709	49,902,800	
キッセイ薬品工業	30,000	2,400	72,000,000	
生化学工業	28,300	906	25,639,800	
栄研化学	10,100	666	6,726,600	
日水製薬	7,100	738	5,239,800	
鳥居薬品	9,200	1,405	12,926,000	
東和薬品	6,000	3,580	21,480,000	
沢井製薬	9,600	4,140	39,744,000	
ゼリア新薬工業	22,000	1,000	22,000,000	
第一三共	431,600	1,971	850,683,600	
キヨーリン	36,000	1,160	41,760,000	
大日本塗料	87,000	92	8,004,000	
日本ペイント	162,000	342	55,404,000	
関西ペイント	166,000	427	70,882,000	
トウパ	13,000	85	1,105,000	
中国塗料	42,000	536	22,512,000	
日本特殊塗料	1,000	342	342,000	
藤倉化成	17,200	427	7,344,400	
太陽インキ製造	11,400	1,585	18,069,000	
D I C	483,000	152	73,416,000	
サカタインクス	31,000	276	8,556,000	
東洋インキ	146,000	231	33,726,000	
アルプス技研	6,800	712	4,841,600	
サニックス	20,600	96	1,977,600	
ダイオーズ	1,400	400	560,000	

日本空調サービス	3,900	686	2,675,400
オリエンタルランド	41,400	6,910	286,074,000
ダスキン	44,100	1,452	64,033,200
パーク24	83,700	615	51,475,500
明光ネットワークジャパン	14,400	448	6,451,200
ファルコバイオシステムズ	8,400	711	5,972,400
クレスコ	2,500	1,124	2,810,000
フジ・メディア・HD	1,440	113,600	163,584,000
秀英予備校	3,500	386	1,351,000
田谷	900	656	590,400
ラウンドワン	21,900	671	14,694,900
リゾートトラスト	24,800	940	23,312,000
オービック	4,320	12,960	55,987,200
ティーディーシーソフトウェア	300	685	205,500
ヤフー	10,313	33,450	344,969,850
ビー・エム・エル	7,700	1,864	14,352,800
ワタベウェディング	4,600	1,272	5,851,200
トレンドマイクロ	67,000	2,615	175,205,000
もしもしホットライン	10,650	2,140	22,791,000
東急コミュニティー	3,900	1,573	6,134,700
リソー教育	1,474	3,720	5,483,280
日本オラクル	22,100	3,630	80,223,000
アルファシステムズ	3,800	1,812	6,885,600
フューチャーアーキテクト	167	31,050	5,185,350
ウェアハウス	4,900	462	2,263,800
シーエーシー	7,600	689	5,236,400
ソフトバンク・テクノ	3,800	515	1,957,000
トーセ	3,700	591	2,186,700
ユー・エス・エス	19,920	4,140	82,468,800
オービックビジネスC	4,400	3,430	15,092,000
日立ビジネスソリュー	4,600	495	2,277,000
伊藤忠テクノソリュー	17,200	2,090	35,948,000
アイティフォー	15,400	278	4,281,200
東京個別指導学院	12,300	113	1,389,900
東計電算	3,400	1,100	3,740,000
カルチュア・コンビニエンス	66,900	800	53,520,000
エクスネット	16	91,900	1,470,400
テー・オー・ダブリュー	3,700	527	1,949,900
大塚商会	11,000	3,970	43,670,000
総合メディカル	3,400	2,760	9,384,000
サイボウズ	199	16,420	3,267,580
ソフトブレーン	181	1,899	343,719
アグレックス	3,100	733	2,272,300

セントラルスポーツ	4,500	870	3,915,000
電通国際情報S	10,200	541	5,518,200
ウェザーニューズ	4,100	1,222	5,010,200
C I J	14,500	368	5,336,000
フルキャストホールディングス	109	4,710	513,390
富士フイルムH L D G S	358,000	2,125	760,750,000
コニカミノルタH L D G S	369,500	659	243,500,500
資生堂	250,000	1,802	450,500,000
ライオン	169,000	514	86,866,000
高砂香料	53,000	557	29,521,000
マンダム	14,900	2,420	36,058,000
ミルボン	6,100	2,500	15,250,000
ファンケル	27,700	1,182	32,741,400
コーセー	23,700	2,170	51,429,000
ドクターシーラボ	99	165,100	16,344,900
エステー	10,400	1,126	11,710,400
コニシ	12,100	760	9,196,000
長谷川香料	16,900	1,096	18,522,400
小林製薬	20,400	3,290	67,116,000
荒川化学工業	12,700	908	11,531,600
メック	9,800	286	2,802,800
日本高純度化学	39	198,000	7,722,000
荏原ユージライト	700	1,720	1,204,000
アース製薬	11,400	2,525	28,785,000
イハラケミカル	28,000	280	7,840,000
北興化学	11,000	275	3,025,000
大成ラミック	4,500	1,930	8,685,000
クミアイ化学	38,000	290	11,020,000
日本農薬	33,000	630	20,790,000
新日本石油	1,019,000	401	408,619,000
昭和シエル石油	115,200	809	93,196,800
コスモ石油	406,000	248	100,688,000
富士興産	55,000	74	4,070,000
ニチレキ	14,000	294	4,116,000
東燃ゼネラル石油	222,000	828	183,816,000
ユシロ化学	7,500	1,035	7,762,500
ビービー・カストロール	2,600	237	616,200
新日鉱ホールディングス	605,500	340	205,870,000
A O Cホールディングス	33,900	490	16,611,000
出光興産	17,400	5,490	95,526,000
横浜ゴム	179,000	423	75,717,000
東洋ゴム	150,000	154	23,100,000
ブリヂストン	459,700	1,321	607,263,700

住友ゴム	125,800	707	88,940,600
藤倉ゴム	10,600	282	2,989,200
オカモト	62,000	330	20,460,000
アキレス	122,000	132	16,104,000
フコク	7,900	495	3,910,500
ニッタ	13,200	1,032	13,622,400
クリエートメディック	5,400	783	4,228,200
東海ゴム	27,200	715	19,448,000
三ツ星ベルト	45,000	434	19,530,000
バンドー化学	54,000	212	11,448,000
鬼怒川ゴム	35,000	142	4,970,000
旭硝子	722,000	508	366,776,000
日本板硝子	466,000	290	135,140,000
石塚硝子	19,000	186	3,534,000
有沢製作所	19,800	303	5,999,400
日本山村硝子	69,000	187	12,903,000
日本電気硝子	238,000	517	123,046,000
オハラ	6,700	773	5,179,100
住友大阪セメント	280,000	207	57,960,000
太平洋セメント	579,000	149	86,271,000
デイ・シイ	13,700	300	4,110,000
リゾートソリューション	6,000	208	1,248,000
日本ヒュ-ム	7,000	303	2,121,000
日本コンクリ-ト	25,000	114	2,850,000
東海カーボン	127,000	385	48,895,000
日本カーボン	72,000	246	17,712,000
東洋炭素	6,300	3,630	22,869,000
ノリタケ	76,000	329	25,004,000
TOTO	227,000	515	116,905,000
日本碍子	176,000	1,082	190,432,000
日本特殊陶業	130,000	711	92,430,000
ダントーホールディングス	21,000	78	1,638,000
MARUWA	4,600	938	4,314,800
日本セラテック	17	35,050	595,850
品川白煉瓦	41,000	167	6,847,000
黒崎播磨	36,000	213	7,668,000
東京窯業	13,000	213	2,769,000
ニッカトー	6,600	457	3,016,200
フジミインコーポレーテッド	14,800	1,026	15,184,800
エーアンドエ-マテリアル	33,000	76	2,508,000
ニチアス	71,000	230	16,330,000
新日本製鐵	3,848,000	287	1,104,376,000
住友金属工業	2,507,000	219	549,033,000

神戸製鋼所	2,032,000	154	312,928,000
日新製鋼	561,000	166	93,126,000
中山製鋼所	80,000	219	17,520,000
合同製鐵	89,000	231	20,559,000
J F Eホールディングス	374,000	2,315	865,810,000
東京製鐵	60,500	948	57,354,000
共英製鋼	11,700	1,651	19,316,700
大和工業	34,300	2,290	78,547,000
東京鐵鋼	29,000	207	6,003,000
大阪製鐵	9,300	1,206	11,215,800
淀川製鋼所	113,000	391	44,183,000
東洋鋼鋳	31,000	362	11,222,000
住友鋼管	10,600	570	6,042,000
丸一鋼管	40,900	2,060	84,254,000
モリ工業	27,000	224	6,048,000
大同特殊鋼	226,000	271	61,246,000
日本高周波	59,000	92	5,428,000
日本金属工業	100,000	120	12,000,000
日本冶金工	80,500	266	21,413,000
山陽特殊鋼	72,000	251	18,072,000
愛知製鋼	78,000	266	20,748,000
日立金属	95,000	493	46,835,000
日本金属	38,000	122	4,636,000
大平洋金属	102,000	465	47,430,000
日本電工	57,000	441	25,137,000
栗本鉄工所	65,000	60	3,900,000
旭テック	32,000	30	960,000
日本鑄鉄管	14,000	117	1,638,000
日本製鋼所	210,000	1,172	246,120,000
三菱製鋼	88,000	213	18,744,000
日亜鋼業	23,000	222	5,106,000
日本精線	12,000	218	2,616,000
日本軽金属	357,000	87	31,059,000
大紀アルミニウム	23,000	168	3,864,000
三井金属	424,000	180	76,320,000
東邦亜鉛	77,000	217	16,709,000
三菱マテリアル	890,000	229	203,810,000
住友鋁山	379,000	906	343,374,000
D O W Aホールディングス	185,000	323	59,755,000
古河機金	248,000	86	21,328,000
エス・サイエンス	613,000	3	1,839,000
大阪チタニウム	14,400	2,250	32,400,000
東邦チタニウム	23,700	1,020	24,174,000

住友軽金属	210,000	80	16,800,000
古河スカイ	70,000	191	13,370,000
古河電工	461,000	381	175,641,000
住友電工	483,400	732	353,848,800
フジクラ	220,000	285	62,700,000
三菱電線工業	97,000	90	8,730,000
昭和電線HLDGS	178,000	73	12,994,000
東京特殊電線	20,000	108	2,160,000
タツタ電線	35,000	210	7,350,000
日立電線	114,000	208	23,712,000
沖電線	14,000	137	1,918,000
カナレ電気	1,900	1,018	1,934,200
平河ヒューテック	4,600	733	3,371,800
リョービ	90,000	174	15,660,000
アサヒプリテック	20,400	1,065	21,726,000
東洋製罐	113,100	1,352	152,911,200
ホッカホールディングス	31,000	246	7,626,000
コロナ	6,700	896	6,003,200
横河ブリッジHLDGS	28,000	764	21,392,000
日本橋梁	7,050	235	1,656,750
松尾橋梁	27,000	97	2,619,000
駒井鉄工	25,000	175	4,375,000
ハルテック	16,000	74	1,184,000
サクラダ	40,000	6	240,000
高田機工	1,000	126	126,000
三和ホールディングス	147,000	295	43,365,000
文化シャツタ-	38,000	366	13,908,000
川田工業	38,000	124	4,712,000
東洋シャツタ-	4,000	620	2,480,000
住生活グループ	176,900	1,234	218,294,600
日本ファイルコン	11,300	420	4,746,000
ノーリツ	24,600	1,133	27,871,800
長府製作所	15,800	2,005	31,679,000
リンナイ	28,300	3,260	92,258,000
ユニプレス	19,600	501	9,819,600
ダイニチ工業	8,700	525	4,567,500
日東精工	20,000	271	5,420,000
三洋工業	24,000	165	3,960,000
岡部	29,300	372	10,899,600
日立ツール	8,600	619	5,323,400
中国工業	22,000	96	2,112,000
東プレ	30,700	570	17,499,000
高周波熱錬	21,600	579	12,506,400

東京製綱	106,000	241	25,546,000
パイオラックス	6,500	1,289	8,378,500
日本発条	95,000	326	30,970,000
中央発條	7,000	270	1,890,000
アドバネクス	28,000	95	2,660,000
三浦工業	21,900	2,135	46,756,500
タクマ	58,000	146	8,468,000
ツガミ	43,000	158	6,794,000
オークマ	88,000	348	30,624,000
東芝機械	80,000	266	21,280,000
アマダ	228,000	453	103,284,000
アイダエンジニア	38,300	305	11,681,500
牧野フライス	68,000	244	16,592,000
オーエスジー	60,300	621	37,446,300
ダイジェット	18,000	186	3,348,000
旭ダイヤモンド	37,000	502	18,574,000
森精機製作所	62,800	722	45,341,600
ディスコ	13,200	1,990	26,268,000
日東工器	8,800	1,676	14,748,800
豊田自動織機	113,300	1,841	208,585,300
豊和工業	85,000	63	5,355,000
大阪機工	50,000	101	5,050,000
石川製作所	30,000	61	1,830,000
東洋機械金属	10,600	150	1,590,000
オ - エム製作所	10,000	331	3,310,000
津田駒工業	36,000	97	3,492,000
エンシュウ	37,000	66	2,442,000
島精機製作所	17,500	1,670	29,225,000
日本スピンドル	20,000	164	3,280,000
日阪製作所	16,000	1,181	18,896,000
やまびこ	4,100	872	3,575,200
ペガサスミシン製造	13,600	194	2,638,400
ナプテスコ	61,000	589	35,929,000
三井海洋開発	9,700	1,681	16,305,700
レオン自動機	4,000	246	984,000
S M C	43,700	8,660	378,442,000
新川	13,100	1,111	14,554,100
ホソカワミクロン	23,000	335	7,705,000
ユニオンツール	8,100	1,899	15,381,900
オイレス工業	17,200	1,091	18,765,200
サトー	15,400	1,026	15,800,400
日本エアーテック	6,300	363	2,286,900
日精樹脂工業	12,000	236	2,832,000

ワイエイシイ	6,500	319	2,073,500
小松製作所	651,300	1,131	736,620,300
住友重機械	368,000	357	131,376,000
日立建機	74,700	1,099	82,095,300
日工	18,000	241	4,338,000
巴工業	5,900	831	4,902,900
井関農機	147,000	263	38,661,000
T O W A	12,700	167	2,120,900
丸山製作所	33,000	181	5,973,000
北川鉄工所	69,000	116	8,004,000
シンニッタン	13,800	320	4,416,000
クボタ	671,000	551	369,721,000
荏原実業	4,100	881	3,612,100
東洋エンジニア	92,000	280	25,760,000
三菱化工機	45,000	228	10,260,000
月島機械	22,000	528	11,616,000
帝国電機製作所	5,400	1,070	5,778,000
東京機械	45,000	163	7,335,000
新東工業	29,700	564	16,750,800
渋谷工業	8,700	759	6,603,300
アイチ コーポレーション	24,600	344	8,462,400
小森コーポレーション	41,700	912	38,030,400
鶴見製作所	1,000	580	580,000
住友精密	27,000	359	9,693,000
酒井重工業	29,000	150	4,350,000
荏原製作所	313,000	200	62,600,000
石井鉄工所	23,000	176	4,048,000
西島製作所	13,000	945	12,285,000
千代田化工建	124,000	477	59,148,000
ダイキン工業	152,900	2,415	369,253,500
オルガノ	25,000	579	14,475,000
ト - ヨ - カネツ	92,000	157	14,444,000
栗田工業	80,800	2,235	180,588,000
椿本チエイン	75,000	254	19,050,000
大同工業	29,000	146	4,234,000
T C M	39,000	141	5,499,000
日本コンベヤ	56,000	79	4,424,000
日機装	41,000	485	19,885,000
木村化工機	13,400	680	9,112,000
新興プランテック	26,100	713	18,609,300
アネスト岩田	29,000	276	8,004,000
ダイフク	59,500	504	29,988,000
加藤製作所	31,000	204	6,324,000

油研工業	27,000	169	4,563,000	
タダノ	68,000	462	31,416,000	
フジテック	41,000	317	12,997,000	
シーケーディ	39,600	359	14,216,400	
キトー	31	74,400	2,306,400	
平和	38,000	802	30,476,000	

[次へ](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
理想科学工業	11,500	814	9,361,000	
SANKYO	38,200	4,380	167,316,000	
日本金銭機械	15,700	866	13,596,200	
マースエンジニアリング	6,900	2,920	20,148,000	
福島工業	4,700	725	3,407,500	
キヤノンファインテック	13,200	971	12,817,200	
アピリット	23,600	148	3,492,800	
オーイズミ	2,400	193	463,200	
ダイコク電機	5,900	1,408	8,307,200	
アマノ	42,700	694	29,633,800	
JUKI	73,000	92	6,716,000	
サンデン	80,000	189	15,120,000	
蛇の目ミシン	120,000	37	4,440,000	
ブラザー工業	168,800	596	100,604,800	
シルバー精工	225,000	6	1,350,000	
マックス	24,000	920	22,080,000	
モリタホールディングス	17,000	400	6,800,000	
グローリー	44,400	1,590	70,596,000	
大和冷機工業	23,000	281	6,463,000	
セガサミーホールディングス	160,000	956	152,960,000	
日本ピストンリング	58,000	89	5,162,000	
リケン	65,000	194	12,610,000	
帝国ピストン	17,300	346	5,985,800	
大豊工業	11,200	452	5,062,400	
日本精工	288,000	334	96,192,000	
N T N	246,000	262	64,452,000	
ジェイテクト	139,700	629	87,871,300	
不二越	141,000	157	22,137,000	
ミネベア	208,000	293	60,944,000	
日本トムソン	45,000	382	17,190,000	
T H K	87,200	1,197	104,378,400	
ユーシン精機	6,400	854	5,465,600	
前澤給装工業	5,900	1,424	8,401,600	
イーグル工業	17,000	296	5,032,000	
前澤工業	12,800	184	2,355,200	
日本ピラ - 工業	16,000	285	4,560,000	
キッツ	63,000	259	16,317,000	
日立	2,343,000	345	808,335,000	
東芝	2,112,000	385	813,120,000	
三菱電機	1,307,000	509	665,263,000	

富士電機H L D G S	324,000	133	43,092,000
東洋電機製造	24,000	266	6,384,000
安川電機	153,000	375	57,375,000
神鋼電機	90,000	277	24,930,000
明電舎	129,000	261	33,669,000
オリジン電気	19,000	253	4,807,000
デンヨー	14,700	651	9,569,700
日立工機	48,100	740	35,594,000
三桜工業	18,300	355	6,496,500
マキタ	87,600	1,922	168,367,200
東芝テック	100,000	273	27,300,000
芝浦メカトロニクス	25,000	356	8,900,000
マブチモーター	22,200	3,450	76,590,000
日本電産	69,300	3,550	246,015,000
高岳製作所	57,000	180	10,260,000
ダイヘン	71,000	328	23,288,000
J V C ケンウッドH D	521,000	37	19,277,000
日新電機	28,000	393	11,004,000
大崎電気	22,000	507	11,154,000
オムロン	166,400	1,151	191,526,400
日東工業	21,200	771	16,345,200
I D E C	18,800	852	16,017,600
エルピーダメモリ	61,700	546	33,688,200
ジーエス・ユアサ コーポ	224,000	511	114,464,000
サクサホールディングス	36,000	112	4,032,000
メルコホールディングス	7,900	869	6,865,100
テクノメディカ	10	258,900	2,589,000
日本電気	1,412,000	271	382,652,000
富士通	1,440,000	394	567,360,000
沖電気	446,000	63	28,098,000
岩崎通信機	63,000	100	6,300,000
電気興業	37,000	530	19,610,000
サンケン電気	82,000	340	27,880,000
エプソントヨコム	49,000	169	8,281,000
ナカヨ通信機	13,000	138	1,794,000
アイホン	10,100	1,539	15,543,900
NECエレクトロニクス	26,700	733	19,571,100
セイコーエプソン	102,400	1,302	133,324,800
ワコム	273	75,900	20,720,700
アルバック	22,300	1,522	33,940,600
ピクセラ	5,400	185	999,000
ナナオ	11,900	1,434	17,064,600
日本信号	35,600	589	20,968,400

京三製作所	34,000	295	10,030,000
能美防災	19,000	1,056	20,064,000
ホーチキ	14,000	708	9,912,000
マスプロ電工	11,200	846	9,475,200
日本無線	54,000	132	7,128,000
パナソニック	1,493,000	1,110	1,657,230,000
シャープ	676,000	751	507,676,000
アンリツ	68,000	198	13,464,000
富士通ゼネラル	33,000	165	5,445,000
日立国際電気	41,000	440	18,040,000
ソニー	742,600	2,000	1,485,200,000
NEC トーキン	44,000	316	13,904,000
T D K	73,200	3,380	247,416,000
帝国通信工業	35,000	193	6,755,000
三洋電機	1,384,000	157	217,288,000
宮越商事	3,100	347	1,075,700
ミツミ電機	49,400	1,365	67,431,000
タムラ製作所	43,000	164	7,052,000
アルプス電気	118,400	423	50,083,200
池上通信機	45,000	81	3,645,000
パイオニア	109,400	189	20,676,600
日本電波工業	10,800	1,043	11,264,400
日本トリム	2,100	2,015	4,231,500
ローランド ディー・ジー	5,300	1,121	5,941,300
コロムビアミュージックエンタ	85,000	28	2,380,000
山水電気	732,000	5	3,660,000
フオスタ - 電機	13,500	641	8,653,500
クラリオン	61,000	62	3,782,000
S M K	41,000	264	10,824,000
ヨコオ	12,300	421	5,178,300
東光	65,000	125	8,125,000
ティアック	68,000	34	2,312,000
ホシデン	34,700	1,226	42,542,200
ヒロセ電機	24,300	8,470	205,821,000
日本航空電子	32,000	362	11,584,000
T O A	18,000	551	9,918,000
日立マクセル	30,300	796	24,118,800
ユニデン	41,000	135	5,535,000
アルパイン	30,500	644	19,642,000
スミダ コーポレーション	9,600	481	4,617,600
島田理化工業	8,400	117	982,800
アイコム	7,800	1,846	14,398,800
船井電機	12,500	1,879	23,487,500

横河電機	151,900	524	79,595,600
新電元工業	50,000	154	7,700,000
山武	35,900	1,897	68,102,300
日本光電工業	27,900	1,785	49,801,500
チノー	28,000	205	5,740,000
共和電業	3,000	287	861,000
日本電子材料	5,700	451	2,570,700
堀場製作所	20,300	1,203	24,420,900
アドバンテスト	95,300	1,315	125,319,500
小野測器	11,000	365	4,015,000
エスベック	13,700	525	7,192,500
サンクス	12,800	291	3,724,800
キーエンス	26,200	16,780	439,636,000
日置電機	6,800	1,551	10,546,800
シスメックス	26,700	3,090	82,503,000
メガチップス	12,800	1,463	18,726,400
O B A R A	9,100	545	4,959,500
日本電産コパル電子	14,600	471	6,876,600
ミヤチテクノス	6,900	466	3,215,400
東京電波	4,200	480	2,016,000
澤藤電機	6,000	171	1,026,000
デンソー	307,500	1,577	484,927,500
コーセル	18,800	723	13,592,400
日立メディコ	7,000	820	5,740,000
新日本無線	11,000	170	1,870,000
オプテックス	9,800	766	7,506,800
千代田インテグレ	8,700	1,146	9,970,200
東光電気	4,000	248	992,000
スタンレー電気	98,100	939	92,115,900
岩崎電気	49,000	163	7,987,000
ウシオ電機	78,900	1,228	96,889,200
岡谷電機	8,200	292	2,394,400
フェニックス電機	9,200	125	1,150,000
日本セラミック	10,500	825	8,662,500
新神戸電機	13,000	702	9,126,000
日本デジタル研究所	13,400	890	11,926,000
古河電池	10,000	864	8,640,000
双信電機	7,800	294	2,293,200
山一電機	11,400	233	2,656,200
函研	9,800	557	5,458,600
日本電子	52,000	270	14,040,000
カシオ	133,500	644	85,974,000
ファナック	135,400	5,900	798,860,000

F D K	61,000	175	10,675,000
日本シイエムケイ	27,200	293	7,969,600
エンプラス	8,200	883	7,240,600
ローム	72,300	4,470	323,181,000
浜松ホトニクス	51,000	1,591	81,141,000
三井ハイテック	18,700	475	8,882,500
新光電気工業	40,800	663	27,050,400
京セラ	124,700	6,400	798,080,000
協栄産業	7,000	240	1,680,000
日本インター	15,400	225	3,465,000
太陽誘電	68,000	518	35,224,000
村田製作所	156,700	3,490	546,883,000
ユーシン	16,700	274	4,575,800
双葉電子工業	24,900	1,182	29,431,800
日東電工	128,400	1,678	215,455,200
北陸電気工業	65,000	161	10,465,000
パナソニック電工	229,000	747	171,063,000
東海理化電機	36,900	787	29,040,300
ニチコン	44,200	515	22,763,000
日本ケミコン	72,000	196	14,112,000
K O A	21,000	490	10,290,000
三井造船	506,000	152	76,912,000
日立造船	624,000	83	51,792,000
佐世保重工業	84,000	164	13,776,000
三菱重工業	2,494,000	375	935,250,000
川崎重工業	1,162,000	189	219,618,000
I H I	958,000	113	108,254,000
日本車輛	64,000	262	16,768,000
日本輸送機	13,000	211	2,743,000
近畿車輛	24,000	467	11,208,000
日産自動車	1,769,200	314	555,528,800
いすゞ自動車	663,000	128	84,864,000
トヨタ自動車	1,799,300	2,875	5,172,987,500
日野自動車	200,000	184	36,800,000
三菱自動車工業	3,131,000	133	416,423,000
エフテック	5,100	447	2,279,700
武蔵精密工業	13,600	804	10,934,400
トヨタ車体	30,700	1,115	34,230,500
日産車体	48,000	517	24,816,000
関東自動車	21,500	880	18,920,000
新明和工業	64,000	240	15,360,000
極東開発工業	28,400	328	9,315,200
日信工業	25,600	731	18,713,600

トピー工業	126,000	147	18,522,000
ティラド	42,000	145	6,090,000
曙ブレーキ	38,700	443	17,144,100
タチエス	18,200	428	7,789,600
N O K	75,200	646	48,579,200
フタバ産業	30,300	293	8,877,900
カヤバ工業	97,000	171	16,587,000
シロキ工業	29,000	197	5,713,000
市光工業	36,000	127	4,572,000
大同メタル工業	24,000	271	6,504,000
プレス工業	55,000	133	7,315,000
カルソニックカンセイ	83,000	133	11,039,000
太平洋工業	29,000	266	7,714,000
ケーヒン	32,100	739	23,721,900
河西工業	9,000	190	1,710,000
アイシン精機	128,000	1,245	159,360,000
富士機工	18,000	92	1,656,000
マ ッ ダ	555,000	171	94,905,000
ダイハツ	148,000	773	114,404,000
愛知機械	36,000	155	5,580,000
今仙電機製作所	10,200	497	5,069,400
本田技研	1,196,800	1,938	2,319,398,400
スズキ	283,100	1,251	354,158,100
富士重工業	477,000	266	126,882,000
ヤマハ発動機	161,800	883	142,869,400
ショーワ	30,000	349	10,470,000
小糸製作所	70,000	557	38,990,000
T B K	16,000	146	2,336,000
エクセディ	16,900	952	16,088,800
ミツバ	26,000	297	7,722,000
豊田合成	39,500	1,117	44,121,500
愛三工業	17,200	406	6,983,200
ヨロズ	9,500	709	6,735,500
エフ・シー・シー	20,600	813	16,747,800
新家工業	33,000	148	4,884,000
シマノ	54,200	3,260	176,692,000
タカタ	24,900	653	16,259,700
テイ・エス テック	22,400	560	12,544,000
小野建	11,200	805	9,016,000
はるやま商事	6,900	360	2,484,000
佐鳥電機	11,400	380	4,332,000
カップクリエイト	8,200	2,120	17,384,000
エコートレーディング	1,100	707	777,700

伯東	8,700	731	6,359,700
中山福	10,300	557	5,737,100
ライトオン	11,700	1,246	14,578,200
ナガイレーベン	7,700	1,772	13,644,400
ジーンズメイト	4,600	497	2,286,200
菱食	13,500	1,889	25,501,500
良品計画	14,600	4,090	59,714,000
三城	19,800	788	15,602,400
松田産業	10,000	838	8,380,000
メディセオ・バルタックHD	148,800	1,008	149,990,400
アドヴァン	9,800	348	3,410,400
S P K	4,100	1,111	4,555,100
アズワン	9,100	1,602	14,578,200
スズデン	5,800	572	3,317,600
尾家産業	500	852	426,000
シモジマ	10,100	1,172	11,837,200
ドウシシャ	7,800	1,250	9,750,000
コナカ	17,700	251	4,442,700
高速	9,000	516	4,644,000
ハウス ローゼ	1,600	1,420	2,272,000
G - 7ホールディングス	4,300	371	1,595,300
イオン北海道	11,500	296	3,404,000
コジマ	19,000	253	4,807,000
コーナン商事	16,100	1,136	18,289,600
黒田電気	19,900	815	16,218,500
ネットワンシステムズ	336	164,600	55,305,600
ワタミ	18,300	2,160	39,528,000
マルシェ	4,500	656	2,952,000
ドン・キホーテ	31,300	1,642	51,394,600
丸文	11,000	347	3,817,000
メガネトップ	6,000	1,091	6,546,000
西松屋チェーン	36,300	833	30,237,900
ゼンショー	46,400	516	23,942,400
ハピネット	3,800	1,285	4,883,000
幸楽苑	9,300	1,125	10,462,500
トーマンエレクトロニクス	4,400	1,158	5,095,200
ユニマットライフ	5,900	760	4,484,000
ハークスレイ	4,200	818	3,435,600
サイゼリヤ	15,800	1,206	19,054,800
エクセル	6,100	750	4,575,000
マルカキカイ	5,100	557	2,840,700
アルゴグラフィックス	5,600	1,105	6,188,000
ガリバーインターナショナル	3,300	1,451	4,788,300

日本エム・ディ・エム	13,200	178	2,349,600
ポプラ	5,500	599	3,294,500
ユナイテッドアローズ	18,600	618	11,494,800
進和	7,700	1,301	10,017,700
エスケイジャパン	2,000	152	304,000
ダイトエレクトロン	6,200	429	2,659,800
ハイデイ日高	6,500	1,180	7,670,000
シークス	8,800	267	2,349,600
京都きもの友禅	9,400	647	6,081,800
コロワイド	31,500	526	16,569,000
田中商事	4,000	308	1,232,000
オーハシテクニカ	9,800	571	5,595,800
壱番屋	5,100	2,030	10,353,000
マクニカ	5,500	1,182	6,501,000
白銅	5,000	552	2,760,000
トップカルチャー	5,400	276	1,490,400
スギホールディングス	22,100	2,200	48,620,000
島津製作所	154,000	541	83,314,000
J M S	24,000	405	9,720,000
アロカ	8,800	769	6,767,200
クボテック	40	18,840	753,600
モリテックス	7,800	381	2,971,800
長野計器	8,600	761	6,544,600
スター精密	28,400	906	25,730,400
東京計器	49,000	111	5,439,000
愛知時計	7,000	218	1,526,000
日本電産トーソク	4,800	618	2,966,400
東京精密	26,200	752	19,702,400
ニコン	244,000	1,042	254,248,000
トプコン	32,300	409	13,210,700
オリンパス	153,000	1,694	259,182,000
理研計器	12,100	585	7,078,500
大日本スクリーン	154,000	180	27,720,000
キヤノン電子	12,700	1,237	15,709,900
タムロン	12,200	782	9,540,400
HOYA	321,500	1,544	496,396,000
ノーリツ鋼機	12,700	617	7,835,900
エー・アンド・デイ	11,700	296	3,463,200
キヤノン	812,000	2,905	2,358,860,000
リコー	453,000	1,136	514,608,000
日本電産コパル	13,800	604	8,335,200
日本電産サンヨー	41,000	321	13,161,000
シチズンホールディングス	182,000	328	59,696,000

リズム時計	71,000	85	6,035,000
S R I スポーツ	90	76,300	6,867,000
バンダイナムコH L D G S	152,200	896	136,371,200
共立印刷	14,300	148	2,116,400
フランスベッドH L D G S	95,000	134	12,730,000
パイロットコーポレーション	132	130,400	17,212,800
エイベックス・グループHD	26,200	897	23,501,400
トッパン・フォームズ	30,000	1,065	31,950,000
フジシールインターナショナル	15,600	1,301	20,295,600
タカラトミー	42,100	507	21,344,700
廣濟堂	12,600	247	3,112,200
アーク	40,900	122	4,989,800
スルガ	4,100	996	4,083,600
アロン化成	9,000	292	2,628,000
タカノ	5,900	496	2,926,400
プロネクサス	17,300	687	11,885,100
ホクシン	13,900	142	1,973,800
ウッドワン	28,000	303	8,484,000
大建工業	65,000	190	12,350,000
きもと	11,800	274	3,233,200
シーアイ化成	10,000	240	2,400,000
凸版印刷	426,000	655	279,030,000
大日本印刷	426,000	957	407,682,000
図書印刷	31,000	212	6,572,000
共同印刷	48,000	203	9,744,000
日本写真印刷	21,500	3,560	76,540,000
光村印刷	3,000	312	936,000
藤森工業	9,800	620	6,076,000
宝印刷	7,100	728	5,168,800
前澤化成工業	10,800	817	8,823,600
コ ン ビ	10,000	694	6,940,000
アシックス	139,000	705	97,995,000
ツ ツ ミ	5,400	1,840	9,936,000
ジェイ エス ピー	9,800	562	5,507,600
ニ チ ハ	16,400	487	7,986,800
ローランド	10,000	1,028	10,280,000
エフピコ	7,300	3,770	27,521,000
小松ウオール工業	5,900	1,120	6,608,000
ヤマハ	111,400	829	92,350,600
河合楽器	56,000	85	4,760,000
クリナップ	15,200	353	5,365,600
ピジョン	8,800	2,750	24,200,000
天馬	11,000	1,241	13,651,000

パラマウントベッド	14,100	1,132	15,961,200
兼松日産農林	27,000	68	1,836,000
キングジム	12,100	776	9,389,600
リンテック	26,600	1,171	31,148,600
田崎真珠	21,000	79	1,659,000
信越ポリマー	28,900	402	11,617,800
東リ	42,000	167	7,014,000
イトーキ	29,800	272	8,105,600
任天堂	73,900	34,250	2,531,075,000
三菱鉛筆	13,500	981	13,243,500
タカスタンダ - ド	65,000	514	33,410,000
コクヨ	72,800	627	45,645,600
ナカバヤシ	34,000	177	6,018,000
ニフコ	30,500	913	27,846,500
ダイワ精工	71,000	128	9,088,000
サンウエーブ	21,000	145	3,045,000
岡村製作所	59,000	502	29,618,000
日本バルカー	58,000	228	13,224,000
MUTOHホールディングス	17,000	206	3,502,000
伊藤忠	1,034,000	446	461,164,000
丸紅	1,209,000	329	397,761,000
ムトウ	16,700	491	8,199,700
高島	26,000	156	4,056,000
F & A アクアホールディングス	12,700	883	11,214,100
三陽商会	71,000	338	23,998,000
長瀬産業	72,000	790	56,880,000
ナイガイ	43,000	61	2,623,000
蝶理	88,000	98	8,624,000
豊田通商	138,400	902	124,836,800
オンワ - ドホールディングス	98,000	648	63,504,000
三共生興	25,700	172	4,420,400
兼松	294,000	90	26,460,000
美津濃	70,000	409	28,630,000
シルバーオックス	15,000	46	690,000
ツカモトコーポレーション	27,000	64	1,728,000
ファミリーマート	42,500	3,560	151,300,000
ルック	24,000	81	1,944,000
三井物産	1,190,000	902	1,073,380,000
日本紙パルプ	73,000	275	20,075,000
東京エレクトロン	102,000	3,090	315,180,000
日立ハイテクノロジーズ	47,900	1,438	68,880,200
カメイ	4,000	458	1,832,000
東都水産	25,000	115	2,875,000

日本マタイ	26,000	114	2,964,000	
スターゼン	49,000	225	11,025,000	
セイコーHD	51,000	183	9,333,000	
山 善	53,500	308	16,478,000	
椿本興業	17,000	210	3,570,000	
住友商事	815,700	760	619,932,000	
日本ユニシス	33,200	690	22,908,000	

[前](#) [次](#)

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
内田洋行	33,000	299	9,867,000	
三菱商事	1,032,200	1,238	1,277,863,600	
第一実業	32,000	254	8,128,000	
キャノンマーケティング J P N	52,600	1,404	73,850,400	
西華産業	61,000	209	12,749,000	
佐藤商事	12,800	525	6,720,000	
菱洋エレクトロ	14,100	765	10,786,500	
東京産業	16,500	230	3,795,000	
ユアサ商事	154,000	91	14,014,000	
神鋼商事	35,000	167	5,845,000	
阪和興業	138,000	280	38,640,000	
カナデン	2,000	497	994,000	
菱電商事	21,000	497	10,437,000	
ニプロ	34,000	1,505	51,170,000	
フルサト工業	9,100	874	7,953,400	
岩谷産業	154,000	214	32,956,000	
すてきナイスグループ	57,000	137	7,809,000	
昭光通商	56,000	104	5,824,000	
ニチモウ	23,000	126	2,898,000	
富士通ビジネス	8,200	1,209	9,913,800	
極東貿易	21,000	148	3,108,000	
イワキ	16,000	177	2,832,000	
兼松エレクトロニクス	9,200	706	6,495,200	
三愛石油	34,000	356	12,104,000	
稲畑産業	37,800	292	11,037,600	
G S Iクレオス	37,000	102	3,774,000	
明和産業	13,000	125	1,625,000	
ゴ - ルドウイン	33,000	142	4,686,000	
東京スタイル	49,000	604	29,596,000	
ユニ・チャ - ム	30,000	6,280	188,400,000	
デサント	40,000	374	14,960,000	
ヤマトインタ - ナショナル	11,100	410	4,551,000	
東邦薬品	31,100	1,013	31,504,300	
サンゲツ	23,900	1,756	41,968,400	
ミツウロコ	23,300	564	13,141,200	
シナネン	35,000	395	13,825,000	
伊藤忠エネクス	35,500	623	22,116,500	
ザ・トーカイ	33,000	403	13,299,000	
サンリオ	38,300	866	33,167,800	
サンワ テクノス	7,200	419	3,016,800	

リョーサン	22,400	1,884	42,201,600
新光商事	14,200	721	10,238,200
トーホー	24,000	323	7,752,000
三信電気	16,600	718	11,918,800
東陽テクニカ	15,900	1,107	17,601,300
モスフード サービス	19,800	1,281	25,363,800
加賀電子	15,200	1,036	15,747,200
三益半導体	12,200	734	8,954,800
ソーダニツカ	2,000	303	606,000
立花エレテック	9,700	851	8,254,700
木曽路	15,900	1,742	27,697,800
千趣会	24,900	630	15,687,000
タカキュー	9,000	134	1,206,000
ケーヨー	28,800	566	16,300,800
アデランスホールディングス	16,300	805	13,121,500
上新電機	33,000	730	24,090,000
日本瓦斯	15,000	1,245	18,675,000
ベスト電器	43,000	271	11,653,000
マルエツ	28,000	540	15,120,000
ロイヤルホールディングス	23,300	905	21,086,500
東天紅	4,000	145	580,000
いなげや	5,000	873	4,365,000
島忠	33,500	1,954	65,459,000
チヨダ	20,000	1,523	30,460,000
鈴丹	3,200	219	700,800
ライフコーポレーション	9,200	1,682	15,474,400
カスミ	30,000	462	13,860,000
リンガーハット	10,700	1,145	12,251,500
さが美	11,000	130	1,430,000
MR MAX	15,800	411	6,493,800
テンアライド	10,700	290	3,103,000
AOKIホールディングス	15,000	894	13,410,000
オークワ	20,000	1,193	23,860,000
コメリ	18,900	1,923	36,344,700
青山商事	35,100	1,268	44,506,800
しまむら	14,300	6,400	91,520,000
CFSコーポレーション	13,500	585	7,897,500
高島屋	187,000	651	121,737,000
丸善	70,000	65	4,550,000
松屋	27,900	1,724	48,099,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	90,000	632	56,880,000
丸栄	22,000	190	4,180,000
ニッセンHD	33,600	496	16,665,600

パルコ	39,900	797	31,800,300
丸井グループ	180,700	492	88,904,400
クレディセゾン	118,500	1,118	132,483,000
原信ナルスHLDGS	9,200	978	8,997,600
オーエムシーカード	48,400	166	8,034,400
井筒屋	81,000	59	4,779,000
ダイエー	63,900	420	26,838,000
イズミヤ	46,000	534	24,564,000
イオン	557,100	797	444,008,700
ユニー	104,000	834	86,736,000
イズミ	37,800	1,215	45,927,000
東武ストア	17,000	340	5,780,000
平和堂	28,500	1,274	36,309,000
フジ	15,700	1,649	25,889,300
ヤオコー	8,000	2,740	21,920,000
ゼビオ	14,600	1,613	23,549,800
ケーズホールディングス	24,200	1,392	33,686,400
OLYMPIC	10,100	593	5,989,300
東日カーライフグループ	14,000	44	616,000
新生銀行	807,000	131	105,717,000
あおぞら銀行	503,000	83	41,749,000
三菱UFJフィナンシャルG	8,048,400	526	4,233,458,400
りそなホールディングス	446,200	1,420	633,604,000
中央三井トラストHD	705,000	359	253,095,000
三井住友フィナンシャルG	583,300	3,730	2,175,709,000
第四銀行	193,000	367	70,831,000
北越銀行	158,000	191	30,178,000
西日本シティ銀行	449,000	227	101,923,000
札幌北洋ホール	208,000	326	67,808,000
千葉銀行	545,000	500	272,500,000
横浜銀行	953,000	486	463,158,000
常陽銀行	536,000	465	249,240,000
群馬銀行	322,000	502	161,644,000
武蔵野銀行	21,000	3,060	64,260,000
千葉興業銀行	26,500	1,117	29,600,500
関東つくば銀行	39,000	288	11,232,000
東京都民銀行	26,000	1,412	36,712,000
七十七銀行	233,000	429	99,957,000
青森銀行	87,000	376	32,712,000
秋田銀行	95,000	360	34,200,000
山形銀行	84,000	570	47,880,000
岩手銀行	9,300	5,300	49,290,000
東邦銀行	108,000	363	39,204,000

荘内銀行	70,000	136	9,520,000
東北銀行	74,000	150	11,100,000
みちのく銀行	70,000	194	13,580,000
ふくおかフィナンシャルG	597,000	338	201,786,000
静岡銀行	432,000	946	408,672,000
十六銀行	178,000	372	66,216,000
スルガ銀行	161,000	807	129,927,000
八十二銀行	261,000	472	123,192,000
山梨中央銀行	93,000	477	44,361,000
大垣共立銀行	159,000	397	63,123,000
福井銀行	119,000	316	37,604,000
北國銀行	160,000	299	47,840,000
清水銀行	4,800	3,970	19,056,000
滋賀銀行	129,000	536	69,144,000
南都銀行	137,000	481	65,897,000
百五銀行	136,000	493	67,048,000
京都銀行	236,000	911	214,996,000
三重銀行	63,000	331	20,853,000
池田銀行	12,600	3,730	46,998,000
ほくほくフィナンシャルG	967,000	203	196,301,000
広島銀行	407,000	358	145,706,000
山陰合同銀行	83,000	651	54,033,000
中国銀行	114,000	1,223	139,422,000
鳥取銀行	50,000	278	13,900,000
伊予銀行	158,000	1,043	164,794,000
百十四銀行	162,000	453	73,386,000
四国銀行	101,000	441	44,541,000
阿波銀行	123,000	567	69,741,000
鹿児島銀行	97,000	667	64,699,000
大分銀行	75,000	552	41,400,000
宮崎銀行	72,000	323	23,256,000
肥後銀行	109,000	526	57,334,000
佐賀銀行	85,000	314	26,690,000
十八銀行	88,000	303	26,664,000
沖縄銀行	11,400	3,310	37,734,000
琉球銀行	29,200	842	24,586,400
住友信託	1,311,000	470	616,170,000
みずほ信託銀行	1,315,000	102	134,130,000
八千代銀行	8,300	2,735	22,700,500
みずほフィナンシャルG	7,777,000	252	1,959,804,000
紀陽ホールディングス	547,000	125	68,375,000
山口フィナンシャルG	129,000	933	120,357,000
フィデック	54	5,850	315,900

芙蓉総合リース	14,500	1,673	24,258,500
興銀リース	19,300	1,236	23,854,800
センチュリーリーシングシステム	18,200	728	13,249,600
S B Iホールディングス	10,920	13,140	143,488,800
日本証券金融	52,900	442	23,381,800
大阪証券金融	17,200	198	3,405,600
アイフル	72,550	241	17,484,550
日本アジア投資	62,000	62	3,844,000
ポケットカード	14,000	240	3,360,000
長野銀行	53,000	222	11,766,000
名古屋銀行	134,000	467	62,578,000
愛知銀行	5,100	6,370	32,487,000
第三銀行	86,000	291	25,026,000
中京銀行	65,000	318	20,670,000
東日本銀行	72,000	248	17,856,000
愛媛銀行	87,000	284	24,708,000
トマト銀行	56,000	222	12,432,000
みなと銀行	143,000	129	18,447,000
京葉銀行	124,000	431	53,444,000
関西アーバン銀行	145,000	131	18,995,000
栃木銀行	75,000	501	37,575,000
北日本銀行	4,800	2,500	12,000,000
香川銀行	52,000	493	25,636,000
東和銀行	123,000	68	8,364,000
徳島銀行	41,000	440	18,040,000
福島銀行	174,000	51	8,874,000
大東銀行	96,000	61	5,856,000
武富士	87,740	698	61,242,520
リコーリース	9,600	1,380	13,248,000
シンキ	23,000	62	1,426,000
イオン クレジットサービス	61,500	929	57,133,500
N I Sグループ	66,300	36	2,386,800
アコム	62,460	3,330	207,991,800
プロミス	64,500	2,005	129,322,500
ロプロ	49,800	25	1,245,000
東京リース	16,800	712	11,961,600
ジャックス	84,000	154	12,936,000
日立キャピタル	32,600	1,011	32,958,600
セントラルファイナンス	57,000	141	8,037,000
オリックス	68,150	4,580	312,127,000
三菱UFJリース	35,010	2,010	70,370,100
ジャフコ	21,000	2,285	47,985,000
S F C G	3,120	2,625	8,190,000

大和証券G本社	916,000	486	445,176,000
野村ホールディングス	1,453,000	662	961,886,000
新光証券	352,000	186	65,472,000
みずほインベスタズ証	320,000	70	22,400,000
岡三証券グループ	118,000	348	41,064,000
丸三証券	45,800	421	19,281,800
東洋証券	51,000	167	8,517,000
東海東京証券	161,000	211	33,971,000
光世証券	40,000	78	3,120,000
水戸証券	46,000	250	11,500,000
いちよし証券	32,300	638	20,607,400
松井証券	105,400	690	72,726,000
だいこう証券ビジ	6,100	663	4,044,300
マネックスG	711	25,790	18,336,690
カブドットコム証券	296	101,800	30,132,800
極東証券	17,200	397	6,828,400
岩井証券	14,200	677	9,613,400
三井住友海上HD	329,800	2,415	796,467,000
SONY FH	491	283,500	139,198,500
小林洋行	4,200	357	1,499,400
日本興亜損害保険	533,000	620	330,460,000
損害保険ジャパン	644,000	540	347,760,000
ニッセイ同和損害保険	153,000	475	72,675,000
あいおい損害保険	361,000	396	142,956,000
富士火災	144,000	131	18,864,000
東京海上HD	594,700	2,215	1,317,260,500
アサックス	16	65,200	1,043,200
NECキャピタルソリューション	5,000	765	3,825,000
T&Dホールディングス	182,050	3,080	560,714,000
三井不動産	613,000	1,295	793,835,000
三菱地所	962,000	1,291	1,241,942,000
平和不動産	97,500	221	21,547,500
東京建物	207,000	323	66,861,000
ダイビル	35,500	864	30,672,000
サンケイビル	20,900	502	10,491,800
東急不動産	278,000	329	91,462,000
京阪神不動産	18,000	386	6,948,000
住友不動産	352,000	1,181	415,712,000
東宝不動産	14,900	531	7,911,900
藤和不動産	45,000	56	2,520,000
太平洋興発	45,000	53	2,385,000
有楽土地	12,000	108	1,296,000
大京	149,000	73	10,877,000

テーオーシー	53,500	396	21,186,000
東京楽天地	27,000	392	10,584,000
レオパレス21	96,900	861	83,430,900
フジ住宅	16,700	258	4,308,600
空港施設	14,700	500	7,350,000
明和地所	6,900	417	2,877,300
住友不動産販売	6,150	2,460	15,129,000
ゴールドクレスト	10,840	1,882	20,400,880
ジョイント・コーポレーション	17,600	140	2,464,000
東栄住宅	10,000	163	1,630,000
日本エスリード	4,600	452	2,079,200
日本綜合地所	20,800	122	2,537,600
東急リバブル	14,400	384	5,529,600
飯田産業	5,500	395	2,172,500
日神不動産	8,100	175	1,417,500
クリード	91	11,790	1,072,890
アーネストワン	22,100	181	4,000,100
タカラレーベン	6,700	246	1,648,200
パシフィックHD	284	10,240	2,908,160
サンヨーハウジ名古屋	58	82,300	4,773,400
イオンモール	62,900	1,599	100,577,100
フージャースコーポレーション	113	3,100	350,300
サンシティ	165	1,550	255,750
ゼクス	81	3,010	243,810
タクトホーム	64	27,100	1,734,400
ランド	40	12,700	508,000
リサ・パートナーズ	189	35,950	6,794,550
エヌ・ティ・ティ都市開発	857	85,500	73,273,500
サンフロンティア不動産	127	23,400	2,971,800
大和システム	6,200	181	1,122,200
ランドビジネス	82	13,490	1,106,180
アトリウム	15,000	252	3,780,000
東武鉄道	600,000	500	300,000,000
相模鉄道	184,000	387	71,208,000
東京急行	770,000	389	299,530,000
京浜急行	351,000	688	241,488,000
小田急電鉄	450,000	701	315,450,000
京王電鉄	365,000	490	178,850,000
京成電鉄	226,000	513	115,938,000
富士急行	39,000	404	15,756,000
新京成電鉄	6,000	341	2,046,000
東日本旅客鉄道	261,000	6,440	1,680,840,000
西日本旅客鉄道	1,306	388,000	506,728,000

東海旅客鉄道	1,169	718,000	839,342,000
アートコーポレーション	2,800	1,215	3,402,000
西日本鉄道	185,000	364	67,340,000
ハマキョウレックス	4,400	1,800	7,920,000
サカイ引越センター	2,700	1,960	5,292,000
近畿鉄道	1,266,000	375	474,750,000
阪急阪神HLDGS	940,000	495	465,300,000
南海電鉄	294,000	402	118,188,000
京阪電鉄	316,000	397	125,452,000
名糖運輸	6,800	771	5,242,800
名古屋鉄道	493,000	278	137,054,000
日本通運	601,000	355	213,355,000
ヤマトホールディングス	278,000	996	276,888,000
山九	170,000	298	50,660,000
日新	53,000	216	11,448,000
丸運	10,400	258	2,683,200
丸全昭和運輸	43,000	270	11,610,000
センコー	49,000	357	17,493,000
トナミホールディングス	35,000	211	7,385,000
日本梱包運輸	39,000	905	35,295,000
日石輸送	12,000	181	2,172,000
福山通運	110,000	410	45,100,000
セイノーホールディングス	108,000	456	49,248,000
神奈川中央交通	5,000	510	2,550,000
日立物流	29,200	1,217	35,536,400
日本郵船	749,000	532	398,468,000
商船三井	734,000	583	427,922,000
川崎汽船	333,000	396	131,868,000
新和海運	56,000	232	12,992,000
乾汽船	16,500	630	10,395,000
明治海運	12,500	399	4,987,500
飯野海運	67,400	521	35,115,400
太平洋海運	26,000	108	2,808,000
共栄タンカー	12,000	236	2,832,000
第一中央汽船	91,000	245	22,295,000
全日本空輸	1,444,000	330	476,520,000
日本航空	2,023,000	200	404,600,000
パスコ	17,000	125	2,125,000
国際航業HLDGS	11,000	183	2,013,000
三菱倉庫	99,000	1,010	99,990,000
三井倉庫	61,000	429	26,169,000
住友倉庫	111,000	415	46,065,000
渋沢倉庫	43,000	430	18,490,000

ヤマタネ	74,000	98	7,252,000
東陽倉庫	26,000	171	4,446,000
日本トランスシティ	30,000	325	9,750,000
ケイヒン	31,000	118	3,658,000
安田倉庫	10,300	805	8,291,500
東洋埠頭	43,000	135	5,805,000
宇徳	10,400	300	3,120,000
上組	167,000	735	122,745,000
サンリツ	1,700	537	912,900
キムラユニティー	3,400	677	2,301,800
キューソー流通システム	4,400	909	3,999,600
郵船航空サービス	11,000	1,072	11,792,000
近鉄エクスプレス	12,500	1,771	22,137,500
東海運	10,400	277	2,880,800
バンテックHD	65	127,700	8,300,500
東京放送	82,800	1,249	103,417,200
日本テレビ放送網	13,240	8,500	112,540,000
テレビ朝日	351	111,500	39,136,500
テレビ東京	5,400	4,000	21,600,000
スカパーJ S A T H D	1,053	37,350	39,329,550
アイ・ティー・シーネットワーク	33	141,100	4,656,300
イー・アクセス	619	48,950	30,300,050
NECモバイルリング	5,200	1,368	7,113,600
日本電信電話	635,400	4,580	2,910,132,000
K D D I	2,145	571,000	1,224,795,000
光通信	17,700	1,595	28,231,500
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	13,659	161,900	2,211,392,100
インボイス	7,637	394	3,008,978
GMOインターネット	25,800	437	11,274,600
学習研究社	46,000	138	6,348,000
ゼンリン	19,900	839	16,696,100
昭文社	8,000	420	3,360,000
角川グループH L D G S	11,900	1,683	20,027,700
インプレスホールディングス	10,400	119	1,237,600
東京電力	882,500	2,725	2,404,812,500
中部電力	474,300	2,395	1,135,948,500
関西電力	581,300	2,310	1,342,803,000
中国電力	209,800	2,180	457,364,000
北陸電力	143,800	2,315	332,897,000
東北電力	349,900	2,140	748,786,000
四国電力	148,000	2,710	401,080,000
九州電力	309,300	2,130	658,809,000
北海道電力	131,200	2,075	272,240,000

沖縄電力	9,900	5,590	55,341,000
電源開発	101,400	3,180	322,452,000
東京瓦斯	1,773,000	400	709,200,000
大阪瓦斯	1,502,000	364	546,728,000
東邦瓦斯	365,000	533	194,545,000
北海道瓦斯	31,000	257	7,967,000
西部瓦斯	161,000	235	37,835,000
静岡瓦斯	43,000	490	21,070,000
アイネット	7,200	497	3,578,400
松竹	77,000	618	47,586,000
東宝	98,700	1,631	160,979,700
エイチ・アイ・エス	13,400	1,638	21,949,200
東映	58,000	366	21,228,000
葵プロモーション	3,000	348	1,044,000
ベンチャーリンク	56,400	19	1,071,600
NTTデータ	853	316,000	269,548,000
共立メンテナンス	6,000	1,698	10,188,000
イチネンホールディングス	14,800	480	7,104,000
建設技術研究所	8,500	603	5,125,500
燦ホールディングス	3,300	1,823	6,015,900
スバル興業	3,000	297	891,000
東京テアトル	54,000	189	10,206,000
テクモ	10,600	747	7,918,200
光栄	12,200	885	10,797,000
吉本興業	22,300	1,047	23,348,100
ホリプロ	5,500	905	4,977,500
よみうりランド	33,000	254	8,382,000
東京都競馬	101,000	127	12,827,000
常磐興産	52,000	143	7,436,000
カナモト	19,000	323	6,137,000
東京ドーム	109,000	298	32,482,000
D T S	13,100	801	10,493,100
スクウェア・エニックス・HD	35,100	2,605	91,435,500
シーイーシー	8,500	762	6,477,000
日立ソフトウェア	19,600	1,266	24,813,600
カプコン	29,300	1,854	54,322,200
東海観光	58,000	25	1,450,000
日本空港ビルデング	33,200	1,146	38,047,200
トランス・コスモス	19,100	583	11,135,300
乃村工藝社	29,000	254	7,366,000
ジャステック	7,600	482	3,663,200
住商情報システム	14,200	1,309	18,587,800
藤田観光	43,000	375	16,125,000

近畿日本ツーリスト	47,000	159	7,473,000
日本管財	5,400	1,605	8,667,000
白洋舎	5,000	261	1,305,000
セコム	142,000	4,180	593,560,000
C S Kホールディングス	41,700	505	21,058,500
日本システムウエア	3,400	323	1,098,200
セントラル警備保障	7,100	868	6,162,800
日立情報	11,300	1,725	19,492,500
アイネス	16,700	484	8,082,800
丹青社	5,000	200	1,000,000
メイテック	24,700	1,503	37,124,100
T K C	13,500	1,923	25,960,500
アサツー ディ・ケイ	29,400	1,871	55,007,400
富士ソフト	17,100	1,749	29,907,900
ソラン	14,400	465	6,696,000
応用地質	16,900	1,034	17,474,600
船井総合研究所	19,300	471	9,090,300
日システム	24,400	611	14,908,400
進学会	6,500	296	1,924,000
丸紅建材リース	9,000	105	945,000
コナミ	62,400	1,928	120,307,200
ベネッセコーポレーション	50,900	3,790	192,911,000
イオンディライト	10,800	1,968	21,254,400
ナック	4,400	802	3,528,800
福井コンピュータ	1,500	261	391,500
ニチイ学館	17,600	1,145	20,152,000
ダイセキ	21,500	1,476	31,734,000
元気寿司	4,900	1,202	5,889,800
トラスコ中山	16,200	1,067	17,285,400
ヤマダ電機	67,040	5,470	366,708,800
オートバックスセブン	22,200	2,030	45,066,000
アークランドサカモト	10,100	1,008	10,180,800
ニトリ	29,850	6,360	189,846,000
ユーエスシー	5,500	873	4,801,500
グルメ杵屋	1,000	670	670,000
愛眼	11,900	484	5,759,600
吉野家ホールディングス	317	102,600	32,524,200
日商エレクトロニクス	7,100	517	3,670,700
加藤産業	20,200	1,412	28,522,400
イエローハット	14,400	307	4,420,800
富士エレクトロニクス	8,200	733	6,010,600
松屋フーズ	7,100	1,256	8,917,600
J B C Cホールディングス	12,100	720	8,712,000

ＪＫホールディングス	11,700	551	6,446,700	
ユニダックス	6,000	402	2,412,000	
サガミチェーン	15,000	952	14,280,000	
日 伝	5,800	2,470	14,326,000	
バイタルネット	18,100	583	10,552,300	
北沢産業	11,000	159	1,749,000	
杉本商事	8,300	920	7,636,000	
因幡電機産業	13,400	2,045	27,403,000	
セシール	15,900	125	1,987,500	
住金物産	71,000	228	16,188,000	
ブレナス	17,400	1,362	23,698,800	
ミニストップ	10,500	1,714	17,997,000	
イマージュホールディングス	5,600	193	1,080,800	
アークス	16,600	1,495	24,817,000	
バ ロ ー	27,800	852	23,685,600	
ミスミグループ本社	46,500	1,007	46,825,500	
江守商事	3,200	736	2,355,200	
アルテック	4,400	167	734,800	
大 庄	8,500	1,372	11,662,000	
タキヒヨー	27,000	442	11,934,000	
ファーストリテイリング	32,300	12,650	408,595,000	
ソフトバンク	563,900	1,505	848,669,500	
スズケン	49,000	2,235	109,515,000	
サンドラッグ	26,400	2,225	58,740,000	
ジェコス	10,600	451	4,780,600	
ヤマザワ	1,800	1,209	2,176,200	
や ま や	1,800	450	810,000	
ベルーナ	17,150	241	4,133,150	
合計	200,405,600		145,520,048,562	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		783,699,395	1,859,189,572
コール・ローン		337,888,529	268,956,619
株式		229,001,139,262	175,616,714,659
投資証券		2,279,990,514	1,701,645,395
投資信託受益証券		721,369,731	409,511,076
派生商品評価勘定		5,260,503	17,744,449
未収入金		151,055,568	-
未収配当金		321,106,704	345,286,491
差入委託証拠金		5,598,399,454	1,374,242,357
流動資産合計		239,199,909,660	181,593,290,618
資産合計		239,199,909,660	181,593,290,618
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		119,211,601	105,250,691
未払金		-	9,784,908
未払解約金		61,829,000	201,296,000
流動負債合計		181,040,601	316,331,599
負債合計		181,040,601	316,331,599
純資産の部			
元本等			
元本		124,701,083,143	197,183,673,045
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	114,317,785,916	15,906,714,026
剰余金合計		114,317,785,916	15,906,714,026
元本等合計		239,018,869,059	181,276,959,019
純資産合計		239,018,869,059	181,276,959,019
負債・純資産合計		239,199,909,660	181,593,290,618

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券、投資信託受益証券及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、投資証券及び投資信託受益証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式、投資証券及び投資信託受益証券の配当落ち日に、当該金額を計上しております。 ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式、投資証券及び投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左

	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年2月16日から平成20年2月15日までとなっております。	(2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年2月16日から平成21年2月16日までとなっております。
--	--	--

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	72,377,761,950円	124,701,083,143円
同期中追加設定元本額	91,847,202,417円	96,703,815,127円
同期中解約元本額	39,523,881,224円	24,221,225,225円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	13,160,695,788円	16,560,290,908円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1安定型	82,818,864円	175,689,561円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2安定・成長型	504,944,698円	991,386,929円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3成長型	705,495,146円	1,228,056,438円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	136,863,264円	229,937,066円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	366,329,700円	541,631,759円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	273,835,827円	354,718,783円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	127,051,092円	102,477,003円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	649,799,425円	659,960,562円
外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家限定)	773,020,981円	- 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)	646,012,327円	631,822,232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)	3,129,281,337円	4,123,509,093円
グローバル株式パッシブファン ド (適格機関投資家限定)	11,747,386,403円	7,525,103,936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)	20,307,578,384円	15,905,789,526円

D I A Mグローバル・バランス ファンド25 V A (適格機関投資 家限定)	9,567,464,408円	14,891,663,410円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50 V A (適格機関投資 家限定)	1,624,051,730円	2,250,386,931円
D I A M国際分散バランスファ ンド30 V A (適格機関投資家限 定)	159,628,071円	262,602,330円
D I A M国際分散バランスファ ンド50 V A (適格機関投資家限 定)	968,943,973円	1,396,327,777円
D I A M国内重視バランスファ ンド30 V A (適格機関投資家限 定)	82,954,019円	142,487,190円
D I A M国内重視バランスファ ンド50 V A (適格機関投資家限 定)	159,955,799円	248,487,137円
D I A M世界バランスファンド 40 V A (適格機関投資家限定)	15,971,804,476円	24,990,963,724円
D I A M世界バランスファンド 50 V A (適格機関投資家限定)	8,267,596,005円	12,047,030,908円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	2,276,951,274円	4,551,898,323円
D I A Mバランスファンド37.5 V A (適格機関投資家限定)	1,883,271,342円	3,901,217,085円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	5,791,772,835円	10,363,500,181円
D I A Mグローバル・アセット ・バランス V A (適格機関投資 家限定)	5,170,822,646円	7,399,009,299円
D I A Mグローバル・アセット ・バランス V A 2 (適格機関投資 家限定)	5,507,742,736円	9,683,336,319円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30 V A (適格機 関投資家限定)	1,385,474,271円	5,348,131,820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)	540,859,367円	5,356,366,572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)	144,158,022円	160,554,143円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド (適格機関投資家向け)	381,726,568円	602,491,188円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限定)	10,472,369,037円	24,372,738,008円

D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35 V A（適格機関投資家限定）	1,732,423,328円	4,511,403,629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）	- 円	172,067,685円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A（適格機関投資家限定）	- 円	13,203,618,731円
D I A M世界アセットバランスファンド40 V A（適格機関投資家限定）	- 円	2,297,016,859円
（合 計）	124,701,083,143円	197,183,673,045円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	124,701,083,143口	197,183,673,045口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,906,714,026円であります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	229,001,139,262	7,124,755,294	175,616,714,659	67,395,978,461
投資証券	2,279,990,514	896,814,885	1,701,645,395	1,041,328,042
投資信託受益証券	721,369,731	180,987,959	409,511,076	209,602,024
合計	232,002,499,507	8,202,558,138	177,727,871,130	68,646,908,527

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成20年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	351,644,459	-	342,511,601	9,132,858
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	298,107,000	-	296,942,808	1,164,192
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,736,369,159	-	1,706,449,897	29,919,262
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	798,150,791	-	778,697,879	19,452,912
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,447,292,349	-	3,392,943,015	54,349,334
	合 計	6,631,563,758	-	6,517,545,200	114,018,558

平成21年1月13日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	100,652,950	-	100,349,550	303,400
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	197,808,164	-	193,828,800	3,979,364
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	767,386,758	-	754,048,794	13,337,964
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	351,995,423	-	349,219,464	2,775,959
	米ドル S&P 500 FUTURE	1,851,227,113	-	1,786,584,524	64,642,589
	合 計	3,269,070,408	-	3,184,031,132	85,039,276

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（通貨関連）

平成20年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	オーストラリアドル	43,965,050	-	44,131,000	165,950
	カナダドル	22,792,770	-	22,793,400	630
	ユーロ	205,693,240	-	206,067,500	374,260
	英ポンド	86,121,780	-	86,076,200	45,580
	米ドル	395,432,200	-	395,004,400	427,800
合 計		754,005,040	-	754,072,500	67,460

平成21年1月13日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	オーストラリアドル	24,264,800	-	24,264,000	800
	カナダドル	44,051,400	-	44,046,000	5,400
	シンガポール・ドル	25,741,716	-	25,740,000	1,716
	ユーロ	172,944,650	-	170,531,800	2,412,850
	英ポンド	79,328,400	-	79,320,000	8,400
米ドル	225,502,200	-	225,464,400	37,800	
合 計		571,833,166	-	569,366,200	2,466,966

（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もっとも近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.9167円	0.9193円
（1万口当たり純資産額）	（19,167円）	（9,193円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	163,628	41.350	6,766,017.800	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	65,261	23.250	1,517,318.250	
	COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	23,589	28.470	671,578.830	
	XL CAPITAL LTD-CLASS A	33,189	3.710	123,131.190	
	WEATHERFORD INTL LTD	91,074	11.820	1,076,494.680	
	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	953	271.990	259,206.470	
	INGERSOLL-RAND CO-CL A	41,651	18.420	767,211.420	
	EVEREST RE GROUP LTD	7,855	72.770	571,608.350	
	PARTNERRE LTD	8,109	69.860	566,494.740	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,979	26.810	535,636.990	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,057	48.950	345,440.150	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,318	66.700	421,410.600	
	ACCENTURE LTD-CL A	81,779	33.030	2,701,160.370	
	WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	24,390	25.800	629,262.000	
	BUNGE LTD	16,967	48.310	819,675.770	
	FOSTER WHEELER LTD	21,229	23.890	507,160.810	
	WARNER CHILCOTT LTD - CLASS A	11,387	14.000	159,418.000	
	COVIDIEN LTD	68,969	37.290	2,571,854.010	
	TYCO ELECTRONICS LTD	64,880	16.990	1,102,311.200	
	INVESCO LTD	55,239	13.100	723,630.900	
	ULTRA PETROLEUM CORP	21,411	35.180	753,238.980	
	ACE LTD	46,466	47.200	2,193,195.200	
	TRANSOCEAN LTD	43,647	50.530	2,205,482.910	
	SEAGATE TECHNOLOGY	57,999	4.760	276,075.240	
	NOBLE CORP	35,550	21.820	775,701.000	
	GARMIN LTD	14,471	18.270	264,385.170	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,029	11.360	193,449.440	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	60,973	22.490	1,371,282.770	
	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	34,109	11.110	378,950.990	

	FLEXTRONICS INTL LTD	124,958	2.790	348,632.820	
	AMAZON.COM INC	44,841	51.920	2,328,144.720	
	ABBOTT LABORATORIES	213,093	50.060	10,667,435.580	
	AES CORP	94,510	8.860	837,358.600	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	10,507	21.220	222,958.540	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	187,040	85.710	16,031,198.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,913	2.520	193,820.760	
	ADOBE SYSTEMS INC	72,486	23.760	1,722,267.360	
	AGCO CORP	14,077	22.430	315,747.110	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	29,208	55.800	1,629,806.400	
	ENERGEN CORP	8,197	29.620	242,795.140	
	ALLERGAN INC	40,874	39.160	1,600,625.840	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	123,279	24.930	3,073,345.470	
	POLO RALPH LAUREN CORP	9,417	40.780	384,025.260	
	ALLSTATE CORP	70,383	29.810	2,098,117.230	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	97,468	33.770	3,291,494.360	
	ALTERA CORPORATION	42,109	15.000	631,635.000	
	ALCOA INC	110,747	10.060	1,114,114.820	
	AMGEN INC	145,896	57.060	8,324,825.760	
	HESS CORP	40,493	52.190	2,113,329.670	
	ALLEGHENY ENERGY INC	21,868	33.660	736,076.880	
	FORTUNE BRANDS INC	19,802	40.310	798,218.620	
	AMERICAN EXPRESS CO	144,505	18.830	2,721,029.150	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	54,271	32.790	1,779,546.090	
	AFLAC INC	65,333	41.550	2,714,586.150	
	WYETH	183,911	36.920	6,789,994.120	
	AMERICAN INTL GROUP	315,474	1.540	485,829.960	
	ANALOG DEVICES	40,575	19.050	772,953.750	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	65,023	38.730	2,518,340.790	
	AMYLIN PHARMACEUTICALS INC	17,739	11.000	195,129.000	
	QWEST COMMUNICATIONS INTL	217,595	3.530	768,110.350	
	AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	12,751	45.470	579,787.970	
	NABORS INDUSTRIES LTD	41,537	11.580	480,998.460	
	ARCH COAL INC	18,193	16.390	298,183.270	
	TIME WARNER	491,804	9.890	4,863,941.560	
	VALERO ENERGY CORP	72,423	22.950	1,662,107.850	
	APOLLO GROUP INC	18,542	86.520	1,604,253.840	
	APACHE CORP	46,384	75.220	3,489,004.480	
	APPLE INC	122,192	88.660	10,833,542.720	
	APPLIED MATERIALS INC	186,244	10.000	1,862,440.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	79,532	26.900	2,139,410.800	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	20,584	9.760	200,899.840	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	14,880	32.970	490,593.600	

AMEREN CORP	28,639	32.580	933,058.620	
ARROW ELECTRONICS INC	18,235	18.810	343,000.350	
ASSOCIATED BANC-CORP	18,348	16.790	308,062.920	
AUTODESK INC	33,412	18.780	627,477.360	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	70,594	38.560	2,722,104.640	
AUTOZONE INC	5,969	128.770	768,628.130	
AVERY DENNISON CORP	14,419	30.560	440,644.640	
AVNET INC	23,051	17.500	403,392.500	
AVON PRODUCTS INC	59,034	22.340	1,318,819.560	
BMC SOFTWARE INC	26,841	26.730	717,459.930	
BJ SERVICES CO	42,449	11.350	481,796.150	
BAKER HUGHES INC	43,090	32.550	1,402,579.500	
BALL CORP	12,044	40.670	489,829.480	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,399	3,139.000	4,391,461.000	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	26,200	27.100	710,020.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	158,035	25.050	3,958,776.750	
CR BARD INC	13,413	83.240	1,116,498.120	
BAXTER INTERNATIONAL INC	86,467	53.020	4,584,480.340	
BED BATH & BEYOND INC	35,104	25.730	903,225.920	
BECKMAN COULTER INC	8,936	43.050	384,694.800	
BECTON DICKINSON & CO	33,349	71.000	2,367,779.000	
AMETEK INC	11,810	29.130	344,025.300	
NII HOLDINGS INC	24,744	20.270	501,560.880	
VERIZON COMM INC	393,513	31.790	12,509,778.270	
WR BERKLEY CORP	21,076	27.850	586,966.600	
BEST BUY CO INC	47,599	27.560	1,311,828.440	
YUM! BRANDS INC	63,424	30.520	1,935,700.480	
FIRSTENERGY CORP	41,720	48.680	2,030,929.600	
BLACK & DECKER CORP	7,050	41.190	290,389.500	
SLM CORP	68,934	11.300	778,954.200	
AMERICAN CAPITAL LTD	23,065	5.130	118,323.450	
H&R BLOCK INC	43,163	20.920	902,969.960	
ENSCO INTERNATIONAL INC	20,855	27.120	565,587.600	
BOEING CO	96,968	43.740	4,241,380.320	
ROBERT HALF INTL INC	22,574	18.770	423,713.980	
BORGWARNER INC	17,478	22.090	386,089.020	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	181,139	7.350	1,331,371.650	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	23,709	48.460	1,148,938.140	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	273,107	22.150	6,049,320.050	
ONEOK INC	14,893	29.140	433,982.020	
SEMPRA ENERGY	32,905	43.580	1,433,999.900	
FEDEX CORP	40,460	60.310	2,440,142.600	
VERISIGN INC	27,766	17.390	482,850.740	

AMPHENOL CORP	26,079	24.710	644,412.090
BROWN-FORMAN CORP	9,865	48.710	480,524.150
QUANTA SERVICES INC	22,688	18.820	426,988.160
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	46,998	70.150	3,296,909.700
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	186,753	1.210	225,971.130
SYNOVUS FINANCIAL CORP	37,990	6.610	251,113.900
CSX CORP	55,781	32.220	1,797,263.820
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,737	18.080	591,884.960
CABOT OIL & GAS CORP	16,232	25.580	415,214.560
CAMPBELL SOUP CO	30,752	29.310	901,341.120
CONSTELLATION BRANDS INC	31,178	15.140	472,034.920
CARDINAL HEALTH INC	48,696	36.890	1,796,395.440
CATERPILLAR INC	83,321	41.190	3,431,991.990
CELGENE CORP	62,522	49.670	3,105,467.740
CITRIX SYSTEMS INC	25,608	22.340	572,082.720
CHESAPEAKE ENERGY CORP	76,392	16.050	1,226,091.600
CENTURYTEL INC	15,230	26.750	407,402.500
CEPHALON INC	9,566	75.670	723,859.220
JPMORGAN CHASE & CO	508,565	24.910	12,668,354.150
CHUBB CORP	49,400	44.800	2,213,120.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,587	53.090	455,883.830
CIGNA CORP	39,703	16.030	636,439.090
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,871	26.930	562,056.030
CINTAS CORP	19,177	23.400	448,741.800
CISCO SYSTEMS INC	815,666	16.400	13,376,922.400
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,586	24.740	410,337.640
CLOROX COMPANY	18,717	52.670	985,824.390
COCA-COLA CO/THE	287,555	43.730	12,574,780.150
COCA-COLA ENTERPRISES INC	35,915	11.770	422,719.550
COLGATE-PALMOLIVE CO	69,788	65.590	4,577,394.920
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	39,208	18.810	737,502.480
AON CORP	34,055	42.940	1,462,321.700
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	116,700	14.870	1,735,329.000
COMERICA INC	22,166	16.230	359,754.180
NRG ENERGY, INC.	31,665	24.100	763,126.500
COMCAST CORP-CL A	269,364	15.700	4,229,014.800
CA INC	58,428	18.280	1,068,063.840
COMPUTER SCIENCES CORP	20,645	36.060	744,458.700
CONAGRA FOODS INC	62,686	16.530	1,036,199.580
CONSOLIDATED EDISON INC	37,307	40.290	1,503,099.030
SARA LEE CORP	97,418	9.960	970,283.280
CAMERON INTERNATIONAL CORP	31,494	22.320	702,946.080

	MOLSON COORS BREWING CO	17,038	43.850	747,116.300	
	CORNING INC	216,094	9.960	2,152,296.240	
	DIRECTV GROUP INC	83,379	21.550	1,796,817.450	
	COVANCE INC	9,828	40.860	401,572.080	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	26,016	13.410	348,874.560	
	SEALED AIR CORP	19,424	14.720	285,921.280	
	BROADCOM CORP-CL A	60,905	16.700	1,017,113.500	
	XTO ENERGY INC	75,983	35.860	2,724,750.380	
	CUMMINS INC	28,433	26.180	744,375.940	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	16,626	76.250	1,267,732.500	
	DR HORTON INC	48,360	7.230	349,642.800	
	DANAHER CORP	35,616	54.580	1,943,921.280	
	MOODY'S CORP	26,609	22.990	611,740.910	
	AMERICAN TOWER CORP	55,917	28.020	1,566,794.340	
	IMS HEALTH INC	28,888	15.770	455,563.760	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	39,257	19.710	773,755.470	
	TARGET CORP	100,973	35.110	3,545,162.030	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,231	58.920	602,810.520	
	DEERE & CO	58,364	41.560	2,425,607.840	
	DELL INC	249,171	10.650	2,653,671.150	
	MORGAN STANLEY	135,017	18.790	2,536,969.430	
	REPUBLIC SERVICES INC	50,112	24.270	1,216,218.240	
	THE WALT DISNEY CO	244,913	21.860	5,353,798.180	
	DOLLAR TREE INC	13,346	40.990	547,052.540	
	RR DONNELLEY & SONS CO	23,864	12.420	296,390.880	
	DOVER CORP	25,844	31.970	826,232.680	
	DOW CHEMICAL	125,839	15.760	1,983,222.640	
	OMNICOM GROUP	42,087	27.210	1,145,187.270	
	DTE ENERGY CO	23,521	35.750	840,875.750	
	DST SYSTEMS INC	3,833	38.000	145,654.000	
	DUKE ENERGY CORP	172,611	15.370	2,653,031.070	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	38,010	19.120	726,751.200	
	FLOWERVE CORP	7,120	52.610	374,583.200	
	DARDEN RESTAURANTS INC	18,676	25.710	480,159.960	
	EBAY INC	151,069	14.010	2,116,476.690	
	EMC CORP/MASS	283,241	11.570	3,277,098.370	
	BANK OF AMERICA CORP	882,321	11.430	10,084,929.030	
	EL PASO CORP	106,266	7.860	835,250.760	
	CITIGROUP INC	750,843	5.600	4,204,720.800	
	EASTMAN CHEMICAL CO	11,841	31.080	368,018.280	
	EASTMAN KODAK CO	37,588	7.290	274,016.520	

	EATON CORP	22,048	49.450	1,090,273.600	
	DISH NETWORK CORP	31,646	12.690	401,587.740	
	ECOLAB INC	33,118	33.570	1,111,771.260	
	ELECTRONIC ARTS INC	44,424	17.510	777,864.240	
	SALESFORCE.COM INC	16,410	30.850	506,248.500	
	EMERSON ELECTRIC CO	106,315	34.710	3,690,193.650	
	ENTERGY CORP	26,443	80.820	2,137,123.260	
	EOG RESOURCES INC	34,398	63.570	2,186,680.860	
	EQUIFAX INC	15,791	26.810	423,356.710	
	EQUITABLE RESOURCES INC	15,901	32.900	523,142.900	
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	15,735	29.510	464,339.850	
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	29,582	31.040	918,225.280	
	EXPRESS SCRIPTS INC	28,632	52.270	1,496,594.640	
	EXXON MOBIL CORP	718,614	76.540	55,002,715.560	
	FPL GROUP INC	53,391	49.720	2,654,600.520	
	FAMILY DOLLAR STORES	18,795	28.110	528,327.450	
	ASSURANT INC	17,619	30.240	532,798.560	
	FASTENAL CO	17,651	32.620	575,775.620	
	FIFTH THIRD BANCORP	71,062	6.870	488,195.940	
	M&T BANK CORP	10,024	45.460	455,691.040	
	FISERV INC	20,922	35.510	742,940.220	
	FLIR SYSTEMS INC	19,526	29.990	585,584.740	
	MACY'S INC	65,836	9.930	653,751.480	
	FORD MOTOR CO	247,313	2.640	652,906.320	
	FOREST CITY ENTERPRISES INC	6,981	7.440	51,938.640	
	FOREST LABORATORIES INC	42,446	24.570	1,042,898.220	
	FRANKLIN RESOURCES INC	22,256	59.540	1,325,122.240	
	FTI CONSULTING INC	6,516	45.320	295,305.120	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	53,849	25.440	1,369,918.560	
	FIRST AMERICAN CORP	10,535	26.650	280,757.750	
	GANNETT CO	27,468	8.000	219,744.000	
	GAP INC/THE	72,365	12.120	877,063.800	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	20,099	27.540	553,526.460	
	GENERAL DYNAMICS CORP	46,722	57.680	2,694,924.960	
	GENERAL MOTORS CORP	52,439	4.150	217,621.850	
	GENERAL MILLS INC	46,093	59.870	2,759,587.910	
	GENUINE PARTS CO	20,814	36.570	761,167.980	
	GENZYME CORP-GENL DIVISION	36,766	62.890	2,312,213.740	
	GILEAD SCIENCES INC	126,804	47.650	6,042,210.600	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	28,710	19.050	546,925.500	
	GOODRICH CORP	17,936	39.340	705,602.240	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	26,533	6.740	178,832.420	
	MCKESSON CORP	38,469	39.720	1,527,988.680	

	NVIDIA CORP	80,161	7.610	610,025.210	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,448,768	15.830	22,933,997.440	
	WW GRAINGER INC	9,392	75.830	712,195.360	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,946	22.990	550,518.540	
	PEPSI BOTTLING GROUP INC	24,163	20.660	499,207.580	
	HALLIBURTON CO	118,695	17.930	2,128,201.350	
	HANSEN NATURAL CORP	9,232	31.150	287,576.800	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	53,896	77.670	4,186,102.320	
	HARLEY-DAVIDSON INC	33,232	14.130	469,568.160	
	HARRIS CORP	18,805	38.320	720,607.600	
	HARSCO CORP	10,146	28.070	284,798.220	
	CONSOL ENERGY INC	25,268	28.970	732,013.960	
	HASBRO INC	18,941	27.200	515,195.200	
	HENRY SCHEIN INC	13,010	36.370	473,173.700	
	DENBURY RESOURCES INC	31,474	10.910	343,381.340	
	HEALTH NET INC	10,668	13.600	145,084.800	
	HJ HEINZ CO	42,540	36.100	1,535,694.000	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,757	23.520	370,604.640	
	HERSHEY FOODS CORP	22,245	34.870	775,683.150	
	HEWLETT-PACKARD CO	340,455	36.980	12,590,025.900	
	REYNOLDS AMERICAN INC	24,466	39.590	968,608.940	
	JUNIPER NETWORKS INC	74,781	17.070	1,276,511.670	
	HOLOGIC INC	37,856	12.330	466,764.480	
	UNUM GROUP	48,414	16.120	780,433.680	
	HOME DEPOT INC	233,434	22.970	5,361,978.980	
	HORMEL FOODS CORP	12,265	30.680	376,290.200	
	HUDSON CITY BANCORP INC	68,256	13.810	942,615.360	
	GENENTECH INC	65,470	87.470	5,726,660.900	
	CENTERPOINT ENERGY INC	45,412	12.800	581,273.600	
	HUMANA INC	24,584	35.230	866,094.320	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	11,189	23.220	259,808.580	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,736	6.010	256,843.360	
	BIOGEN IDEC INC	39,752	48.450	1,925,984.400	
	ILLINOIS TOOL WORKS	55,997	35.590	1,992,933.230	
	INTUIT INC	42,612	24.180	1,030,358.160	
	INTEL CORP	775,027	13.790	10,687,622.330	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,369	28.780	298,419.820	
	INTL GAME TECH	39,427	13.040	514,128.080	
	INTERNATIONAL PAPER CO	59,664	11.210	668,833.440	
	ITT CORP	23,844	47.080	1,122,575.520	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	74,501	3.860	287,573.860	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,813	46.210	823,138.730	

	JOHNSON & JOHNSON	387,439	58.340	22,603,191.260	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,272	14.780	580,440.160	
	JOHNSON CONTROLS INC	82,115	18.340	1,505,989.100	
	KLA-TENCOR CORP	25,031	21.460	537,165.260	
	DEVON ENERGY CORP	58,649	63.150	3,703,684.350	
	KELLOGG CO	36,514	43.700	1,595,661.800	
	KEYCORP	72,687	6.970	506,628.390	
	KIMBERLY-CLARK CORP	57,522	50.560	2,908,312.320	
	KOHL'S CORP	38,816	36.730	1,425,711.680	
	KROGER CO	84,564	24.510	2,072,663.640	
	LSI CORP	77,712	3.250	252,564.000	
	LAM RESEARCH CORP	15,536	22.280	346,142.080	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	26,381	14.330	378,039.730	
	LAMAR ADVERTISING CO	6,992	13.990	97,818.080	
	LEGG MASON INC	21,861	22.520	492,309.720	
	LEGGETT & PLATT INC	20,637	14.270	294,489.990	
	PACTIV CORP	18,686	23.080	431,272.880	
	LEXMARK INTL INC	12,137	28.350	344,083.950	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	28,206	19.390	546,914.340	
	ELI LILLY & CO	141,184	38.130	5,383,345.920	
	LIMITED BRANDS	48,940	9.040	442,417.600	
	LINCOLN NATIONAL CORP	35,955	17.490	628,852.950	
	LINEAR TECH CORP	32,387	21.690	702,474.030	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	93,885	50.650	4,755,275.250	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	50,193	18.520	929,574.360	
	LOCKHEED MARTIN CORP	46,434	79.660	3,698,932.440	
	LOEWS CORP	43,958	26.560	1,167,524.480	
	RANGE RESOURCES CORP	21,984	34.790	764,823.360	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	11,021	26.000	286,546.000	
	LOWE'S COS INC	201,031	20.230	4,066,857.130	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	79,232	35.140	2,784,212.480	
	DYNEGY INC-CL A	51,810	2.340	121,235.400	
	IRON MOUNTAIN INC	27,531	22.940	631,561.140	
	SCANA CORP	16,559	35.150	582,048.850	
	MDU RESOURCES GROUP INC	27,660	19.710	545,178.600	
	MGM MIRAGE	17,686	12.400	219,306.400	
	MCCORMICK & CO INC	16,884	31.050	524,248.200	
	MCDONALD'S CORPORATION	154,465	60.160	9,292,614.400	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	41,553	22.850	949,486.050	
	MCAFEE INC	21,304	31.480	670,649.920	
	MANPOWER INC	9,851	32.340	318,581.340	
	MARSH & MCLENNAN COS	70,594	22.650	1,598,954.100	
	MARSHALL & ILSLEY CORP	35,065	10.790	378,351.350	

	ENERGIZER HOLDINGS INC	8,833	53.230	470,180.590	
	MASCO CORP	52,102	10.820	563,743.640	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,858	87.880	514,801.040	
	MATTEL INC	51,462	15.190	781,707.780	
	METLIFE INC	107,660	29.060	3,128,599.600	
	MEDTRONIC INC	155,151	32.450	5,034,649.950	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	78,691	9.100	716,088.100	
	CVS CAREMARK CORP	197,494	24.930	4,923,525.420	
	MERCK & CO. INC.	295,638	28.500	8,425,683.000	
	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	33,006	15.920	525,455.520	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,836	60.620	959,978.320	
	MICROSOFT CORP	1,134,889	19.470	22,096,288.830	
	MICRON TECH INC	119,947	3.160	379,032.520	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,390	17.300	473,847.000	
	MILLIPORE CORP	8,184	50.650	414,519.600	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	75,472	6.520	492,077.440	
	3M CO	90,842	57.080	5,185,261.360	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	39.620	354,915.960	
	PROGRESS ENERGY INC	34,514	38.160	1,317,054.240	
	CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,889	23.680	186,811.520	
	JANUS CAPITAL GROUP INC	19,690	8.170	160,867.300	
	MOTOROLA INC	318,465	4.500	1,433,092.500	
	MURPHY OIL CORPORATION	24,875	45.280	1,126,340.000	
	ILLUMINA INC	15,220	24.330	370,302.600	
	XCEL ENERGY INC	60,433	18.360	1,109,549.880	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	57,242	25.710	1,471,691.820	
	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	29,314	9.850	288,742.900	
	NETAPP INC	47,046	14.180	667,112.280	
	SEARS HOLDINGS CORP	8,509	46.520	395,838.680	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	16,687	20.460	341,416.020	
	NEWELL RUBBERMAID INC	41,919	10.060	421,705.140	
	DUN & BRADSTREET CORP	7,711	74.580	575,086.380	
	NEWMONT MINING CORP	59,709	35.910	2,144,150.190	
	NIKE INC-CL B	50,828	50.120	2,547,499.360	
	NOBLE ENERGY INC	24,611	47.130	1,159,916.430	
	NORDSTROM INC	28,984	13.370	387,516.080	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	51,781	43.310	2,242,635.110	
	NISOURCE INC	40,523	10.990	445,347.770	
	COACH INC	47,608	17.260	821,714.080	
	NORTHERN TRUST CORP	28,258	48.490	1,370,230.420	

	NORTHROP GRUMMAN CORP	44,100	47.520	2,095,632.000	
	WELLS FARGO & CO	545,425	23.800	12,981,115.000	
	NUCOR CORP	43,162	40.870	1,764,030.940	
	MONSANTO CO	75,591	78.050	5,899,877.550	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,387	27.140	1,394,643.180	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	113,433	54.370	6,167,352.210	
	OLD REPUBLIC INTL CORP	32,771	11.790	386,370.090	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	ORACLE CORP	569,420	17.050	9,708,611.000	
	OWENS-ILLINOIS INC	25,046	23.750	594,842.500	
	PACCAR INC	45,888	29.200	1,339,929.600	
	PALL CORP	16,031	26.850	430,432.350	
	EXELON CORP	90,432	54.600	4,937,587.200	
	PARKER HANNIFIN CORP	22,272	40.850	909,811.200	
	PATTERSON-UTI ENERGY INC	26,675	10.880	290,224.000	
	PATTERSON COS INC	11,401	19.050	217,189.050	
	PAYCHEX INC	43,784	25.130	1,100,291.920	
	JC PENNEY CO INC HOLDING CO	30,111	20.680	622,695.480	
	PPL CORPORATION	50,466	32.580	1,644,182.280	
	PEPSICO INC	216,361	51.390	11,118,791.790	
	PENTAIR INC	15,263	23.660	361,122.580	
	PERRIGO CO	10,393	29.290	304,410.970	
	PFIZER INC	931,790	17.360	16,175,874.400	
	AQUA AMERICA INC	20,390	19.430	396,177.700	
	CONOCOPHILLIPS	200,159	50.470	10,102,024.730	
	PETSMART INC	15,526	17.860	277,294.360	
	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	15,778	25.850	407,861.300	
	RELIANT ENERGY INC	42,362	4.920	208,421.040	
	PG&E CORP	49,063	38.710	1,899,228.730	
	PITNEY BOWES INC	29,737	25.770	766,322.490	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,029	18.050	271,273.450	
	ALTRIA GROUP INC	283,408	15.790	4,475,012.320	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	58,600	45.990	2,695,014.000	
	AETNA INC	66,479	28.170	1,872,713.430	
	FLUOR CORP (NEW)	23,658	45.120	1,067,448.960	
	PPG INDUSTRIES INC	23,194	42.580	987,600.520	
	PRAXAIR INC	42,744	60.890	2,602,682.160	
	PRECISION CASTPARTS CORP	19,359	60.490	1,171,025.910	
	COSTCO WHOLESALE CORP	59,417	49.430	2,936,982.310	
	T ROWE PRICE GROUP INC	33,359	30.760	1,026,122.840	
	QUEST DIAGNOSTICS	22,504	47.610	1,071,415.440	
	PROCTER & GAMBLE CO	408,059	59.940	24,459,056.460	
	PROGRESSIVE CORP	88,314	14.460	1,277,020.440	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	69,229	30.370	2,102,484.730	
	PULTE HOMES INC	34,707	10.730	372,406.110	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	48,779	12.030	586,811.370	

	FOREST OIL CORP	10,320	16.430	169,557.600	
	QUALCOMM INC	226,190	34.860	7,884,983.400	
	QUESTAR CORP	24,247	33.530	813,001.910	
	US BANCORP	240,146	21.680	5,206,365.280	
	RALCORP HOLDINGS INC	7,042	56.520	398,013.840	
	ROSS STORES INC	16,662	29.510	491,695.620	
	ROHM & HAAS CO	18,193	63.550	1,156,165.150	
	ROPER INDUSTRIES INC	11,143	42.360	472,017.480	
	ROWAN COS INC	17,226	14.980	258,045.480	
	PEABODY ENERGY CORP	38,119	24.480	933,153.120	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	20,481	30.260	619,755.060	
	RAYTHEON COMPANY	57,336	50.540	2,897,761.440	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	12,228	42.220	516,266.160	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	9,721	44.360	431,223.560	
	FMC TECHNOLOGIES INC	18,561	25.250	468,665.250	
	KRAFT FOODS INC-A	201,091	28.530	5,737,126.230	
	SANDISK CORP	26,701	11.690	312,134.690	
	SAFEWAY INC	61,835	23.140	1,430,861.900	
	ROCKWELL COLLINS INC	21,881	38.830	849,639.230	
	ST JUDE MEDICAL INC	48,121	31.350	1,508,593.350	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	81,324	41.030	3,336,723.720	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	28,641	16.270	465,989.070	
	SCHERING-PLOUGH CORP	223,646	17.840	3,989,844.640	
	PRICELINE.COM INC	4,683	72.160	337,925.280	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	133,642	15.190	2,030,021.980	
	JOY GLOBAL INC	13,146	22.670	298,019.820	
	ZIMMER HOLDINGS INC	31,163	41.070	1,279,864.410	
	SPX CORP	6,515	39.910	260,013.650	
	SEI INVESTMENTS CO	15,639	14.150	221,291.850	
	WELLPOINT INC	70,110	40.960	2,871,705.600	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	21,191	35.860	759,909.260	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	24,985	15.950	398,510.750	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,239	18.550	653,683.450	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,132	58.620	769,797.840	
	SIGMA-ALDRICH	17,035	37.900	645,626.500	
	SMITH INTERNATIONAL INC	29,576	23.990	709,528.240	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	56,803	27.750	1,576,283.250	
	ADVANCE AUTO PARTS	14,592	30.830	449,871.360	
	SOVEREIGN BANCORP INC	67,063	2.770	185,764.510	
	UNITED STATES STEEL CORP	18,483	31.970	590,901.510	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	48,007	28.340	1,360,518.380	
	EDISON INTERNATIONAL	42,701	31.930	1,363,442.930	

	SOUTHERN CO	105,694	35.790	3,782,788.260	
	BB&T CORP	75,266	22.170	1,668,647.220	
	SOUTHWEST AIRLINES	22,258	8.620	191,863.960	
	AT&T INC	814,407	25.940	21,125,717.580	
	CHEVRON CORP	284,839	70.820	20,172,297.980	
	MEADWESTVACO CORP	22,385	11.560	258,770.600	
	STANLEY WORKS/THE	7,828	34.020	266,308.560	
	STAPLES INC	94,678	18.510	1,752,489.780	
	STATE STREET CORP	59,104	39.000	2,305,056.000	
	STARBUCKS CORP	97,324	9.590	933,337.160	
	STRYKER CORP	40,146	39.990	1,605,438.540	
	DEAN FOODS CO	21,394	18.630	398,570.220	
	SUNOCO INC	17,359	41.230	715,711.570	
	SUN MICROSYSTEMS INC	93,793	4.500	422,068.500	
	STERICYCLE INC	12,347	48.750	601,916.250	
	SUNTRUST BANKS INC	47,245	23.670	1,118,289.150	
	SYMANTEC CORP	116,550	13.580	1,582,749.000	
	SUPERVALU INC	28,006	18.510	518,391.060	
	SYNOPSYS INC	22,150	19.370	429,045.500	
	SYSCO CORP	81,289	23.700	1,926,549.300	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,497	100.750	553,822.750	
	TELEPHONE & DATA SYSTEMS INC	6,066	32.860	199,328.760	
	TEREX CORP	12,723	15.440	196,443.120	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	179,094	14.730	2,638,054.620	
	TEXTRON INC	35,765	14.870	531,825.550	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,746	34.150	2,006,175.900	
	TIFFANY & CO	19,629	22.060	433,015.740	
	TOLL BROTHERS INC	19,860	19.520	387,667.200	
	TORCHMARK CORP	10,524	41.030	431,799.720	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25,113	14.310	359,367.030	
	DAVITA INC	13,969	46.510	649,698.190	
	TYSON FOODS INC	34,526	8.400	290,018.400	
	MARATHON OIL CORP	97,861	27.760	2,716,621.360	
	UNION PACIFIC CORP	69,534	45.510	3,164,492.340	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	127,119	52.360	6,655,950.840	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	167,447	25.620	4,289,992.140	
	SPRINT NEXTEL CORP	379,037	2.450	928,640.650	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,794	34.060	572,003.640	
	VF CORP	12,608	50.480	636,451.840	
	CBS CORP	84,976	7.820	664,512.320	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,805	29.520	614,163.600	
	VULCAN MATERIALS CO	15,822	57.170	904,543.740	
	URBAN OUTFITTERS INC	14,627	14.420	210,921.340	

	WALGREEN CO	135,650	25.900	3,513,335.000	
	WAL-MART STORES INC	327,022	51.390	16,805,660.580	
	WASTE MANAGEMENT INC	66,518	32.540	2,164,495.720	
	WATERS CORP	12,585	36.180	455,325.300	
	WASHINGTON POST	698	413.400	288,553.200	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	16,280	43.510	708,342.800	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	69,376	41.160	2,855,516.160	
	WESTERN DIGITAL CORP	26,702	13.370	357,005.740	
	WEYERHAEUSER CO	29,858	29.960	894,545.680	
	WHIRLPOOL CORP	11,229	42.830	480,938.070	
	WYNN RESORTS LTD	7,887	41.000	323,367.000	
	WHOLE FOODS MARKET INC	17,546	12.670	222,307.820	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	19,747	21.050	415,674.350	
	CME GROUP INC	8,579	189.180	1,622,975.220	
	WILLIAMS COS INC	81,909	15.080	1,235,187.720	
	PEPCO HOLDINGS INC	31,737	17.680	561,110.160	
	ALLIANT ENERGY CORP	16,420	28.520	468,298.400	
	WISCONSIN ENERGY CORP	19,085	43.020	821,036.700	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	13,850	21.860	302,761.000	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	10,905	43.680	476,330.400	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	35,834	12.910	462,616.940	
	CARMAX INC	27,027	7.830	211,621.410	
	XEROX CORP	112,891	8.270	933,608.570	
	XILINX INC	40,009	15.950	638,143.550	
	YAHOO! INC	180,224	12.220	2,202,337.280	
	CIMAREX ENERGY CO	10,702	25.900	277,181.800	
	TJX COMPANIES INC	56,982	20.640	1,176,108.480	
	ZIONS BANCORP	16,224	20.820	337,783.680	
	HOSPIRA INC	20,450	25.830	528,223.500	
	GENWORTH FINANCIAL INC	57,138	2.590	147,987.420	
	PETROHAWK ENERGY CORP	33,432	16.840	562,994.880	
	LIBERTY GLOBAL INC	26,175	17.790	465,653.250	
	REGIONS FINANCIAL CORP	92,270	7.020	647,735.400	
	GOOGLE INC	32,980	312.690	10,312,516.200	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	31,817	16.010	509,390.170	
	LAS VEGAS SANDS CORP	35,384	5.930	209,827.120	
	MOSAIC CO/THE	22,778	34.560	787,207.680	
	NEWS CORP CLASS B	57,265	9.170	525,120.050	
	NEWS CORP INC CLASS A	250,961	8.450	2,120,620.450	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	6,445	32.070	206,691.150	
	CELANESE CORP	16,008	13.620	218,028.960	
	HUNTSMAN CORP	19,889	3.240	64,440.360	
	WINDSTREAM CORP	58,015	8.780	509,371.700	

	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,587	16.910	145,206.170	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	18,504	14.590	269,973.360	
	EXPEDIA INC	24,311	8.640	210,047.040	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,977	46.930	374,360.610	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	28,708	20.940	601,145.520	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	18,684	16.480	307,912.320	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	25,998	16.820	437,286.360	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	22,845	25.470	581,862.150	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	7,962	61.250	487,672.500	
	SUNPOWER CORP-CLASS A	7,319	34.890	255,359.910	
	VIACOM INC-CLASS B	74,826	17.630	1,319,182.380	
	MIRANT CORP	24,904	18.120	451,260.480	
	TIM HORTONS INC	25,839	25.540	659,928.060	
	NYSE EURONEXT	20,780	24.120	501,213.600	
	VIRGIN MEDIA INC	30,107	4.750	143,008.250	
	MASTERCARD INC	12,261	148.040	1,815,118.440	
	EMBARQ CORPORATION	19,631	35.220	691,403.820	
	LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	88,253	3.400	300,060.200	
	WESTERN UNION CO	97,681	14.670	1,432,980.270	
	SAIC INC	27,557	19.100	526,338.700	
	KBR INC	28,692	15.950	457,637.400	
	FIRST SOLAR INC	5,794	149.930	868,694.420	
	SPECTRA ENERGY CORP	84,328	15.520	1,308,770.560	
	TIME WARNER CABLE INC	25,551	19.660	502,332.660	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	47,006	16.300	766,197.800	
	TFS FINANCIAL CORP	14,755	12.800	188,864.000	
	DISCOVER FINANCIAL	62,096	8.660	537,751.360	
	VMWARE INC	5,168	23.750	122,740.000	
	TERADATA CORP	21,942	15.050	330,227.100	
	SANDRIDGE ENERGY INC	12,295	7.010	86,187.950	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	284,380	41.830	11,895,615.400	
	VISA INC	61,487	52.960	3,256,351.520	
	LIBERTY MEDIA CORP-ENT SER A	66,405	17.030	1,130,877.150	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	36,785	15.780	580,467.300	
	LORILLARD INC	24,398	57.680	1,407,276.640	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	12,968	23.660	306,822.880	
	SUNPOWER CORP-CLASS B	4,509	28.500	128,506.500	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,810	14.380	270,487.800	
米ドル小計	銘柄数 : 577	41,408,142		1,094,959,098.180	

	組入時価比率：54.05%			(97,976,940,105)	
	合計時価比率：55.13%				
英ポンド	XSTRATA PLC	84,703	8.130	688,635.390	
	AMEC PLC	51,473	5.395	277,696.830	
	ANTOFAGASTA PLC	60,925	4.247	258,748.470	
	SEVERN TRENT PLC	31,329	11.430	358,090.470	
	BHP BILLITON PLC	301,395	12.420	3,743,325.900	
	BARCLAYS PLC	1,117,338	1.846	2,062,605.940	
	BALFOUR BEATTY PLC	75,077	3.585	269,151.040	
	BRITISH AIRWAYS PLC	81,025	1.768	143,252.200	
	BT GROUP PLC	1,068,597	1.346	1,438,331.560	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	154,474	4.282	661,457.660	
	TULLOW OIL PLC	101,094	7.070	714,734.580	
	BUNZL PLC	44,194	5.630	248,812.220	
	CABLE & WIRELESS PLC	326,189	1.614	526,469.040	
	CAPITA GROUP PLC	88,748	7.105	630,554.540	
	AVIVA PLC	362,512	4.355	1,578,739.760	
	THOMSON REUTERS PLC	26,753	14.340	383,638.020	
	DIAGEO PLC	345,549	9.345	3,229,155.400	
	SCHRODERS PLC	16,093	8.150	131,157.950	
	NATIONAL GRID PLC	333,512	6.740	2,247,870.880	
	LONMIN	17,545	10.200	178,959.000	
	GKN PLC	88,163	1.190	104,913.970	
	KINGFISHER PLC	346,708	1.400	485,391.200	
	BAE SYSTEMS PLC	481,739	3.805	1,833,016.890	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	261,211	18.440	4,816,730.840	
	MAN GROUP PLC	244,590	2.300	562,557.000	
	COBHAM PLC	164,685	2.030	334,310.550	
	FIRSTGROUP PLC	69,352	4.122	285,868.940	
	STAGECOACH GROUP PLC	53,209	1.447	76,993.420	
	HAYS PLC	185,717	0.765	142,073.500	
	NEXT PLC	30,331	11.670	353,962.770	
	REXAM PLC	79,499	3.445	273,874.050	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	138,925	18.920	2,628,461.000	
	IMI PLC	34,270	3.025	103,666.750	
	JOHNSON MATTHEY PLC	32,747	10.160	332,709.520	
	SABMILLER PLC	123,271	11.100	1,368,308.100	
	ANGLO AMERICAN PLC	180,031	14.510	2,612,249.810	
	LADBROKES PLC	65,895	1.815	119,599.420	
	LOGICA PLC	157,747	0.730	115,155.310	
	COMPASS GROUP PLC	261,723	3.287	860,283.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,665,350	6.387	10,636,590.450	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	818,045	0.781	638,893.140	

	CENTRICA PLC	692,397	2.642	1,829,312.870	
	UNILEVER PLC	176,408	15.450	2,725,503.600	
	MEGGITT PLC	107,980	1.632	176,223.360	
	HBOS PLC	706,271	0.841	593,973.910	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	340,991	2.755	939,430.200	
	CADBURY PLC	183,599	5.795	1,063,956.200	
	NATIONAL EXPRESS GROUP PLC	19,753	4.872	96,236.610	
	INTL POWER PLC	202,975	2.720	552,092.000	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	97,077	5.945	577,122.760	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	469,974	1.481	696,031.490	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	50,499	7.145	360,815.350	
	PEARSON PLC	107,361	5.975	641,481.970	
	PRUDENTIAL PLC	337,116	3.920	1,321,494.720	
	RIO TINTO PLC	136,379	16.070	2,191,610.530	
	VODAFONE GROUP PLC	7,284,136	1.383	10,073,960.080	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	82,750	27.250	2,254,937.500	
	REED ELSEVIER PLC	157,224	5.240	823,853.760	
	OLD MUTUAL PLC	673,685	0.604	406,905.740	
	ROLLS ROYCE GROUP	258,616	3.370	871,535.920	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,464,617	0.550	1,355,539.350	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	120,619	12.000	1,447,428.000	
	SERCO GROUP PLC	71,999	4.342	312,619.650	
	BP PLC	2,600,303	5.090	13,235,542.270	
	SAGE GROUP PLC(THE)	195,168	1.825	356,181.600	
	INVENSYS PLC	100,055	1.724	172,494.820	
	SMITHS GROUP PLC	53,067	9.435	500,687.140	
	STANDARD CHARTERED PLC	259,255	8.750	2,268,481.250	
	LLOYDS TSB GROUP PLC	817,958	1.407	1,150,866.900	
	TATE & LYLE PLC	55,882	3.867	216,095.690	
	BG GROUP PLC	466,780	9.500	4,434,410.000	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP PLC	30,635	1.050	32,166.750	
	TESCO PLC	1,079,761	3.503	3,782,402.780	
	3I GROUP PLC	43,651	3.317	144,790.360	
	TOMKINS PLC	145,057	1.347	195,391.770	
	SMITH & NEPHEW PLC	116,835	4.785	559,055.470	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	722,429	13.050	9,427,698.450	
	DAILY MAIL & GENERAL TST-A NV	26,397	2.635	69,556.090	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	19,820	5.640	111,784.800	
	WOLSELEY PLC	97,827	3.770	368,807.790	
	ASTRAZENECA PLC	199,894	27.590	5,515,075.460	
	WHITBREAD PLC	27,936	9.155	255,754.080	
	FRIENDS PROVIDENT PLC	342,290	0.845	289,235.050	

	CARNIVAL PLC	24,039	14.970	359,863.830	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	225,233	2.392	538,757.330	
	BURBERRY GROUP PLC	44,005	2.117	93,158.580	
	INVESTEC PLC	64,219	2.975	191,051.520	
	CAIRN ENERGY	19,825	18.680	370,331.000	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	42,614	6.020	256,536.280	
	VEDANTA RESOURCES PLC	22,500	6.485	145,912.500	
	ICAP PLC	60,050	2.962	177,868.100	
	ITV PLC	513,493	0.392	201,289.250	
	SAINSBURY (J) PLC	137,391	3.157	433,743.380	
	G4S PLC	185,918	2.015	374,624.770	
	ADMIRAL GROUP PLC	28,516	9.785	279,029.060	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,547	8.885	102,595.090	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	493,095	17.730	8,742,574.350	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	374,896	17.070	6,399,474.720	
	BRITISH ENERGY GROUP	134,356	7.725	1,037,900.100	
	KAZAKHMYS PLC	23,764	2.467	58,625.780	
	DRAX GROUP PLC	41,028	5.675	232,833.900	
	STANDARD LIFE PLC	311,747	2.325	724,811.770	
	HOME RETAIL GROUP	113,731	2.237	254,416.240	
	EXPERIAN PLC	147,444	4.125	608,206.500	
	THOMAS COOK GROUP PLC	67,703	1.910	129,312.730	
	TUI TRAVEL PLC	60,864	2.305	140,291.520	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	42,545	3.347	142,398.110	
	SHIRE PLC	78,425	10.150	796,013.750	
	WPP PLC	144,772	3.982	576,482.100	
	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	31,408	4.992	156,788.730	
英ポンド小計	銘柄数 : 110	35,760,287		146,380,432.060	
	組入時価比率 : 10.68%			(19,354,420,727)	
	合計時価比率 : 10.89%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	19,748	56.370	1,113,194.760	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	18,836	14.010	263,892.360	
	BARRICK GOLD CORP	119,797	37.990	4,551,088.030	
	ASTRAL MEDIA INC	8,125	23.200	188,500.000	
	TMX GROUP INC	12,123	29.000	351,567.000	
	TALISMAN ENERGY INC	153,396	11.950	1,833,082.200	
	BANK OF MONTREAL	75,642	32.810	2,481,814.020	
	BANK OF NOVA SCOTIA	140,786	31.270	4,402,378.220	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,377	34.000	862,818.000	
	BCE INC	37,744	24.620	929,257.280	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	72,310	20.920	1,512,725.200	
	BIOVAIL CORP	20,030	13.140	263,194.200	

	BOMBARDIER INC 'B'	196,237	4.460	875,217.020	
	SAPUTO INC	24,714	19.840	490,325.760	
	RESEARCH IN MOTION LTD	70,121	56.350	3,951,318.350	
	CGI GROUP INC	40,664	9.690	394,034.160	
	CAE INC	33,745	7.620	257,136.900	
	CAMECO CORP	47,339	21.770	1,030,570.030	
	ROGERS COMM-CL B	71,506	32.200	2,302,493.200	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	53,379	50.710	2,706,849.090	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	75,839	48.070	3,645,580.730	
	NEXEN INC	67,710	19.840	1,343,366.400	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	10,445	43.150	450,701.750	
	CANADIAN UTILITIES LTD	11,472	39.920	457,962.240	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,330	44.330	2,896,078.900	
	GERDAU AMERISTEEL CORP	19,154	7.200	137,908.800	
	AGRIUM INC	22,392	38.840	869,705.280	
	YAMANA GOLD INC	101,901	7.760	790,751.760	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,693	13.540	212,483.220	
	NOVA CHEMICALS CORP	8,798	6.730	59,210.540	
	ELDORADO GOLD CORP	45,411	8.590	390,080.490	
	EMPIRE CO LTD	3,430	46.250	158,637.500	
	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	15,674	12.000	188,088.000	
	KINROSS GOLD CORP	92,872	20.410	1,895,517.520	
	FINNING INTERNATIONAL INC	22,936	13.940	319,727.840	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	16,791	24.390	409,532.490	
	FORTIS INC	25,644	24.090	617,763.960	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,428	22.000	273,416.000	
	TELUS CORP-NON VOTE	28,563	33.180	947,720.340	
	GREAT WEST LIFECO INC	41,689	20.880	870,466.320	
	IMPERIAL OIL LTD	44,585	39.040	1,740,598.400	
	ENBRIDGE INC	49,811	39.210	1,953,089.310	
	IGM FINANCIAL INC	19,491	33.250	648,075.750	
	IVANHOE MINES LTD/CA	60,072	3.640	218,662.080	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	208,496	22.740	4,741,199.040	
	LOBLAW CO LTD	18,293	35.380	647,206.340	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,259	23.890	316,757.510	
	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	15,253	38.700	590,291.100	
	MDS INC	19,292	7.450	143,725.400	
	MANITOBA TELECOM SERVICES INC	3,734	34.970	130,577.980	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	80,641	27.730	2,236,174.930	

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,501	378.910	947,653.910	
	INMET MINING CORPORATION	9,314	23.260	216,643.640	
	METRO INC	15,852	35.760	566,867.520	
	HUSKY ENERGY INC	38,205	31.610	1,207,660.050	
	NIKO RESOURCES LTD	8,304	47.110	391,201.440	
	METHANEX CORP	12,636	11.990	151,505.640	
	ONEX CORP	13,986	18.100	253,146.600	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	15,209	19.280	293,229.520	
	GOLDCORP INC	99,849	30.400	3,035,409.600	
	PETRO-CANADA	68,607	29.140	1,999,207.980	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	42,093	89.500	3,767,323.500	
	POWER CORP OF CANADA	48,860	21.330	1,042,183.800	
	POWER FINANCIAL CORP	38,443	23.130	889,186.590	
	ROYAL BANK OF CANADA	188,109	35.740	6,723,015.660	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	22,574	36.140	815,824.360	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	23,342	42.070	981,997.940	
	SHAW COMM INC-B	50,543	20.350	1,028,550.050	
	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	63,085	3.550	223,951.750	
	SINO-FOREST CORP	17,746	9.300	165,037.800	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	30,306	42.560	1,289,823.360	
	SUNCOR ENERGY INC	134,167	26.560	3,563,475.520	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	25,045	7.190	180,073.550	
	ENCANA CORP	104,912	54.860	5,755,472.320	
	TECK COMINCO LTD-CL B	58,290	6.600	384,714.000	
	THOMSON REUTERS CORP	34,211	29.200	998,961.200	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	112,831	44.870	5,062,726.970	
	TRANSCANADA CORP	82,721	33.070	2,735,583.470	
	TRANSALTA CORP	30,279	23.150	700,958.850	
	WESTON (GEORGE) LTD	6,932	57.600	399,283.200	
	ING CANADA INC	5,843	31.800	185,807.400	
	SILVER WHEATON CORP	30,384	6.760	205,395.840	
	GROUPE AEROPLAN INC	25,575	8.180	209,203.500	
	ADDAX PETROLEUM CORP	13,144	20.900	274,709.600	
カナダドル小計	銘柄数 : 84	3,952,616		107,708,299.830	
	組入時価比率 : 4.36%			(7,907,943,374)	
	合計時価比率 : 4.45%				
スイスフラン	JULIUS BAER HOLDING	30,028	42.500	1,276,190.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	147,605	29.600	4,369,108.000	
	SYNGENTA AG	13,598	224.900	3,058,190.200	
	LOGITECH INTL-REG	27,879	15.100	420,972.900	
	SYNTHES INC	8,345	132.100	1,102,374.500	
	OC OERLIKON CORP AG	1,041	70.500	73,390.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	530,204	40.380	21,409,637.520	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	69,477	19.240	1,336,737.480	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	96,925	166.100	16,099,242.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,699	53.300	357,056.700	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	651	1,154.000	751,254.000	
	SWISS RE-REG	45,710	50.700	2,317,497.000	
	SULZER AG-REG	3,050	66.000	201,300.000	

	NOVARTIS AG-REG SHS	328,798	53.500	17,590,693.000	
	BALOISE HOLDING -R	6,215	80.100	497,821.500	
	SWISSCOM AG-REG	3,324	348.000	1,156,752.000	
	ABB LTD	302,466	15.210	4,600,507.860	
	ADECCO SA-REG	18,811	34.800	654,622.800	
	GEBERIT AG	6,032	118.000	711,776.000	
	LONZA GROUP AG-REG	6,652	102.300	680,499.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	1,943.000	266,191.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	14	22,010.000	308,140.000	
	UBS AG-REGISTERED	404,410	15.840	6,405,854.400	
	GIVAUDAN-REG	837	846.500	708,520.500	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	19,514	235.400	4,593,595.600	
	HOLCIM LTD-REG	27,408	59.400	1,628,035.200	
	ACTELION	13,669	60.000	820,140.000	
	SONOVA HOLDING AG	7,380	59.950	442,431.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,164	69.900	570,663.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	800	183.700	146,960.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,169	139.900	443,343.100	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	11,958	27.500	328,845.000	
	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	13,608	22.080	300,464.640	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,410	76.250	336,262.500	
	BKW FMB ENERGIE AG	2,890	99.200	286,688.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	4,757	72.000	342,504.000	
	EFG INTERNATIONAL AG	7,086	18.650	132,153.900	
	ARYZTA AG	9,835	33.700	331,439.500	
スイスフラン 小計	銘柄数 : 38	2,193,556		97,057,856.000	
	組入時価比率 : 4.29%			(7,775,304,844)	
	合計時価比率 : 4.37%				
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	9,092	339.500	3,086,734.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	93,102	63.750	5,935,252.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	55,625	57.250	3,184,531.250	
	ERICSSON LM-B SHS	403,984	60.500	24,441,032.000	
	GETINGE AB-B SHS	31,028	98.750	3,064,015.000	
	SKF AB-B SHS	60,871	71.250	4,337,058.750	
	SANDVIK AB	132,518	50.500	6,692,159.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	64,616	55.750	3,602,342.000	
	SKANSKA AB-B SHS	55,202	72.500	4,002,145.000	
	SWEDBANK AB	43,840	42.700	1,871,968.000	
	SSAB-B	8,435	67.500	569,362.500	
	SSAB SVENSKT STAL AB-SER A	22,177	72.750	1,613,376.750	

	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	75,169	69.500	5,224,245.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	65,126	118.500	7,717,431.000	
	VOLVO AB-A SHS	56,662	40.200	2,277,812.400	
	VOLVO AB-B SHS	153,836	39.500	6,076,522.000	
	HOLMEN AB-B SHS	6,209	198.500	1,232,486.500	
	SCANIA AB	56,446	73.750	4,162,892.500	
	SWEDISH MATCH AB	35,570	112.000	3,983,840.000	
	TELE2 AB-B SHS	46,212	71.500	3,304,158.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	9,822	160.500	1,576,431.000	
	NORDEA AB	288,824	56.800	16,405,203.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	41,890	69.750	2,921,827.500	
	SECURITAS AB-B SHS	39,893	64.500	2,573,098.500	
	INVESTOR AB-B SHS	56,708	116.750	6,620,659.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	69,706	320.000	22,305,920.000	
	ASSA ABLOY AB-B	43,831	85.500	3,747,550.500	
	TELIASONERA AB	313,257	40.200	12,592,931.400	
	LUNDIN PETROLEUM AB	35,389	45.500	1,610,199.500	
	ALFA LAVAL AB	47,836	66.000	3,157,176.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	36,913	44.800	1,653,702.400	
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 31	2,459,789		171,544,063.650	
	組入時価比率 : 1.05%			(1,902,423,666)	
	合計時価比率 : 1.07%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	47,016	10.830	509,183.280	
	OMV AG	25,108	19.590	491,865.720	
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	9,275	33.100	307,002.500	
	VOEST-ALPINE AG	14,060	16.510	232,130.600	
	ERSTE GROUP BANK AG	27,961	14.600	408,230.600	
	WIENERBERGER AG	13,872	12.060	167,296.320	
	RAIFFEISEN INT'L BANK	9,099	18.600	169,241.400	
	VIENNA INSURANCE GROUP	3,909	23.750	92,838.750	
	STRABAG SE	8,665	17.280	149,731.200	
	UMICORE	15,052	15.130	227,736.760	
	DELHAIZE GROUP	13,848	45.545	630,707.160	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	18,829	21.965	413,578.980	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	64,040	19.000	1,216,760.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.002	78.810	
	SOLVAY SA	8,384	57.190	479,480.960	
	MOBISTAR SA	4,634	55.910	259,086.940	
	FORTIS	325,795	1.283	417,994.980	
	UCB SA	15,173	24.680	374,469.640	
	COLRUYT NV	2,444	159.380	389,524.720	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,505	60.060	690,990.300	

	GRUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.004	2.060	
	DEXIA	78,609	3.411	268,135.290	
	BELGACOM SA	22,508	27.085	609,629.180	
	NATIONALE A PORTEFEUILLE	6,077	35.800	217,556.600	
	KBC ANCORA	2,640	11.830	31,231.200	
	ADIDAS AG	27,187	26.850	729,970.950	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,064	22.250	1,002,674.000	
	COMMERZBANK AG	91,394	4.560	416,756.640	
	FRESENIUS AG	4,536	33.190	150,549.840	
	UNITED INTERNET	12,425	6.030	74,922.750	
	MAN AG	15,037	39.010	586,593.370	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	10,684	23.700	253,210.800	
	GEA GROUP AG	19,089	11.660	222,577.740	
	FRESENIUS SE	10,766	40.250	433,331.500	
	DEUTSCHE POST AG-REG	116,007	10.360	1,201,832.520	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	11,860	54.150	642,219.000	
	MERCK KGAA	8,975	66.300	595,042.500	
	RWE AG	60,436	61.400	3,710,770.400	
	RWE AG-N VTG PFD	6,189	52.160	322,818.240	
	SAP AG	119,426	27.025	3,227,487.650	
	E.ON AG	262,248	27.750	7,277,382.000	
	HENKEL AG & CO KGAA	16,060	19.510	313,330.600	
	METRO AG	16,034	26.280	421,373.520	
	SIEMENS AG-REG	119,384	49.500	5,909,508.000	
	PUMA AG	1,092	149.000	162,708.000	
	BAYER AG	105,209	44.010	4,630,248.090	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,323	23.490	594,837.270	
	DAIMLER AG	120,132	26.930	3,235,154.760	
	BASF SE	129,483	25.570	3,310,880.310	
	CELESIO AG	13,447	17.750	238,684.250	
	BEIERSDORF AG	12,101	40.230	486,823.230	
	HOCHTIEF AG	6,449	30.690	197,919.810	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,204	34.050	109,096.200	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	27,600	33.190	916,044.000	
	ALLIANZ SE	62,348	73.000	4,551,404.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	10.920	405,110.160	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28,222	115.720	3,265,849.840	
	SALZGITTER	6,089	52.920	322,229.880	
	VOLKSWAGEN AG	16,055	260.000	4,174,300.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	14,613	39.030	570,345.390	
	THYSSENKRUPP AG	50,739	18.510	939,178.890	

TUI AG	31,210	7.840	244,686.400	
LINDE AG	18,369	60.190	1,105,630.110	
DEUTSCHE BANK AG-REG	74,625	24.495	1,827,939.370	
BMW VORZUG	10,111	14.450	146,103.950	
K & S	20,920	37.880	792,449.600	
SOLARWORLD AG	14,050	13.760	193,328.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	389,659	10.535	4,105,057.560	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	83,868	0.915	76,739.220	
DEUTSCHE BOERSE AG	26,569	48.250	1,281,954.250	
FRAPORT AG	5,722	29.800	170,515.600	
HYPO REAL ESTATE HOLDING	26,766	2.350	62,900.100	
DEUTSCHE POSTBANK AG	9,898	12.850	127,189.300	
Q-CELLS SE	7,432	21.900	162,760.800	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	71.510	174,698.930	
HAMBURGER HAFEN UND LOGISTIK AG	2,187	25.660	56,118.420	
IBERIA	50,749	2.050	104,035.450	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	37,658	12.450	468,842.100	
IBERDROLA SA	477,807	6.170	2,948,069.190	
INDRA SISTEMAS SA	13,423	15.840	212,620.320	
GAMESA	26,875	14.130	379,743.750	
REPSOL YPF SA	103,202	15.630	1,613,047.260	
TELEFONICA S.A	584,320	15.850	9,261,472.000	
UNION FENOSA,S.A.	48,479	17.520	849,352.080	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	24,622	34.050	838,379.100	
BANKINTER S.A.	32,756	6.430	210,621.080	
ACERINOX SA	15,243	11.920	181,696.560	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	492,625	8.360	4,118,345.000	
SACYR VALLEHERMOSO	8,239	7.000	57,673.000	
ACCIONA S.A.	4,488	88.900	398,983.200	
GAS NATURAL SDG SA	15,497	20.880	323,577.360	
GRUPO FERROVIAL	6,552	23.650	154,954.800	
BANCO DE VALENCIA	26,881	7.790	209,402.990	
BANCO SANTANDER SA	1,105,613	6.840	7,562,392.920	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	14,114	35.190	496,671.660	
ZARDOYA OTIS	20,780	13.790	286,556.200	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,160	22.410	115,635.600	
BANCO POPULAR ESPANOL	106,777	6.100	651,339.700	
BANCO SABADELL	119,846	5.080	608,817.680	
INDITEX	30,867	29.900	922,923.300	
MAPFRE SA	101,263	2.550	258,220.650	
ENAGAS	28,703	15.250	437,720.750	

	GESTEVISION TELECINCO SA	14,976	7.860	117,711.360	
	GRIFOLS SA	15,526	13.120	203,701.120	
	CINTRA CONCESIONES DE INFRAE	37,515	4.910	184,198.650	
	CRITERIA CAIXACORP SA	125,317	2.840	355,900.280	
	IBERDROLA RENOVABLES	129,546	3.030	392,524.380	
	EDP RENOVAVEIS SA	26,748	5.465	146,177.820	
	KESKO OYJ-B	8,936	18.050	161,294.800	
	WARTSILA OYJ	14,419	22.000	317,218.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	11,249	8.960	100,791.040	
	OUTOKUMPU OYJ	12,601	9.580	120,717.580	
	RAUTARUUKKI OYJ	8,984	13.100	117,690.400	
	UPM-KYMMENE OYJ	75,587	8.800	665,165.600	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	82,878	5.420	449,198.760	
	SAMPO OYJ-A SHS	58,665	13.700	803,710.500	
	FORTUM OYJ	59,888	16.400	982,163.200	
	NOKIA OYJ	523,396	11.140	5,830,631.440	
	POHJOLA BANK PLC	14,763	10.620	156,783.060	
	ELISA CORP	18,391	12.370	227,496.670	
	METSO OYJ	16,546	8.860	146,597.560	
	SANOMA OYJ	12,269	9.350	114,715.150	
	NESTE OIL OYJ	23,859	11.340	270,561.060	
	KONE OYJ	18,849	15.950	300,641.550	
	ORION OYJ	13,200	12.230	161,436.000	
	AIR LIQUIDE	33,593	65.450	2,198,661.850	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	43,972	13.220	581,309.840	
	ERAMET	710	162.815	115,598.650	
	AXA	214,043	15.250	3,264,155.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,406	21.220	1,069,615.320	
	GROUPE DANONE	60,215	44.385	2,672,642.770	
	SAFRAN SA	23,727	9.686	229,819.720	
	ACCOR SA	25,048	33.060	828,086.880	
	BOUYGUES	32,199	30.940	996,237.060	
	BNP PARIBAS	113,372	34.160	3,872,787.520	
	THALES SA	12,307	32.295	397,454.560	
	CAP GEMINI SA	20,188	27.040	545,883.520	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,477	50.725	328,545.820	
	CHRISTIAN DIOR	7,932	39.625	314,305.500	
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	19,202	11.320	217,366.640	
	ALCATEL-LUCENT	328,376	1.604	526,715.100	
	NATIXIS	152,697	1.390	212,248.830	
	EIFFAGE	4,561	37.600	171,493.600	
	PUBLICIS GROUPE	19,130	18.440	352,757.200	

	IMERYS SA	3,261	33.200	108,265.200	
	LAFARGE SA	17,146	48.860	837,753.560	
	L'OREAL	33,262	60.970	2,027,984.140	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	33,489	45.455	1,522,242.490	
	LAGARDERE S.C.A.	17,407	30.820	536,483.740	
	MICHELIN(CGDE)-B	20,091	39.125	786,060.370	
	PERNOD-RICARD	23,016	52.860	1,216,625.760	
	PEUGEOT SA	21,628	14.555	314,795.540	
	RENAULT SA	24,000	20.445	490,680.000	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,083	34.265	1,339,178.990	
	SOCIETE GENERALE-A	65,491	36.285	2,376,340.930	
	VINCI S.A.	56,156	30.310	1,702,088.360	
	SODEXO	13,636	39.205	534,599.380	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	30,533	54.470	1,663,132.510	
	VIVENDI SA	160,564	21.470	3,447,309.080	
	TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,456	24.630	380,681.280	
	TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	14,241	10.060	143,264.460	
	TOTAL SA	297,262	39.485	11,737,390.070	
	AIR FRANCE	17,277	9.960	172,078.920	
	VALLOUREC	7,628	89.000	678,892.000	
	VALEO	7,627	10.760	82,066.520	
	ZODIAC SA	7,512	29.035	218,110.920	
	FRANCE TELECOM SA	251,764	19.650	4,947,162.600	
	HERMES INTL	9,746	90.535	882,354.110	
	BIC	4,918	42.900	210,982.200	
	DASSAULT SYSTEMES SA	7,284	32.550	237,094.200	
	PPR	11,211	45.640	511,670.040	
	CNP ASSURANCES	5,609	56.900	319,152.100	
	NEOPOST SA	4,710	63.735	300,191.850	
	CARREFOUR SA	86,797	27.500	2,386,917.500	
	ATOS ORIGIN	7,757	18.830	146,064.310	
	SANOFI-AVENTIS	145,107	47.160	6,843,246.120	
	STMICROELECTRONICS NV	95,985	4.667	447,961.990	
	M6-METROPOLE TELEVISION	9,651	13.570	130,964.070	
	EURAZEO	2,639	32.750	86,427.250	
	JC DECAUX INTERNATIONAL	9,237	12.550	115,924.350	
	ESSILOR INTL	28,424	32.895	935,007.480	
	CREDIT AGRICOLE SA	119,173	8.838	1,053,250.970	
	WENDEL	5,446	36.550	199,051.300	
	ILIAD SA	1,846	64.620	119,288.520	
	PAGESJAUNES GROUPE SA	12,809	7.689	98,488.400	
	SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-R	2,718	50.000	135,900.000	

	GDF SUEZ	151,212	32.750	4,952,193.000	
	ALSTOM	29,319	38.250	1,121,451.750	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,410	17.020	194,198.200	
	ELECTRICITE DE FRANCE	28,173	42.795	1,205,663.530	
	LEGRAND SA	13,899	14.205	197,435.290	
	ADP	3,889	47.630	185,233.070	
	SCOR SE	26,944	16.050	432,451.200	
	BUREAU VERITAS SA	5,387	28.500	153,529.500	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	37,433	12.525	468,848.320	
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
	BANK OF PIRAEUS	36,616	6.300	230,680.800	
	ALPHA BANK A.E.	58,236	6.640	386,687.040	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	19,209	11.600	222,824.400	
	NATIONAL BANK OF GREECE	70,326	13.560	953,620.560	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	8,238	14.360	118,297.680	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	40,269	12.600	507,389.400	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	36,456	5.700	207,799.200	
	GREEK ORGANIZATION OF FOOTBALL	32,032	21.900	701,500.800	
	PUBLIC POWER CORP	15,583	13.300	207,253.900	
	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	94,560	2.980	281,788.800	
	ALLIED IRISH BANKS PLC	136,171	2.160	294,129.360	
	CRH PLC	74,527	18.890	1,407,815.030	
	KERRY GROUP PLC-A	21,477	15.010	322,369.770	
	BANK OF IRELAND	180,286	0.939	169,288.550	
	ELAN CORPORATION PLC	72,415	5.950	430,869.250	
	ANGLO IRISH BANK CORP	91,316	0.316	28,855.850	
	ALLEANZA ASSICURAZIONI	58,512	6.120	358,093.440	
	ASSICURAZIONI GENERALI	145,335	18.760	2,726,484.600	
	BANCA POPOLARE DI MILANO	60,971	4.425	269,796.670	
	INTESA SANPAOLO	1,014,866	2.652	2,691,424.630	
	INTESA SANPAOLO-RNC	179,269	1.973	353,697.730	
	UNICREDIT SPA	1,568,187	1.805	2,830,577.530	
	ENI SPA	363,989	17.120	6,231,491.680	
	MEDIOBANCA SPA	64,355	7.670	493,602.850	
	PIRELLI & C	324,749	0.291	94,501.950	
	SAIPEM	34,749	12.750	443,049.750	
	LUXOTTICA GROUP SPA	16,192	12.890	208,714.880	
	MEDIASET SPA	110,462	4.262	470,789.040	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO-PFD	278,490	0.899	250,362.510	
	AUTOGRILL SPA	17,657	5.790	102,234.030	
	BULGARI SPA	40,484	3.992	161,612.120	

	A2A SPA	157,187	1.363	214,245.880	
	MEDIOLANUM SPA	32,441	3.127	101,443.000	
	IFIL-INVESTMENT SPA	33,873	2.165	73,335.040	
	FIAT SPA	94,338	5.450	514,142.100	
	ENEL SPA	594,085	4.395	2,611,003.570	
	FINMECCANICA SPA	53,929	11.180	602,926.220	
	ITALCEMENTI RNC	37,829	5.880	222,434.520	
	FONDIARIA - SAI ORD	7,966	13.370	106,505.420	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	328,387	1.489	488,968.240	
	SNAM RETE GAS	91,502	3.912	357,955.820	
	BANCA CARIGE SPA	79,037	1.740	137,524.380	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	78,751	11.400	897,761.400	
	TELECOM ITALIA SPA	1,369,678	1.149	1,573,760.020	
	TELECOM ITALIA-RNC	816,861	0.812	663,291.130	
	ATLANTIA SPA	37,691	13.040	491,490.640	
	TERNA SPA	162,853	2.355	383,518.810	
	SARAS SPA	68,873	2.700	185,957.100	
	PARMALAT SPA	198,820	1.182	235,005.240	
	LOTTOMATICA SPA	8,823	16.710	147,432.330	
	PRYSMIAN SPA	11,585	9.140	105,886.900	
	BANCO POPOLARE SPA	85,713	5.790	496,278.270	
	UNICREDIT SPA RTS	1,459,222	0.000	0.000	
	TENARIS SA	66,543	8.220	546,983.460	
	SES FDR	41,445	14.140	586,032.300	
	ARCELORMITTAL (FR)	119,295	19.405	2,314,919.470	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,724	16.445	127,021.180	
	REED ELSEVIER NV	89,131	8.870	790,591.970	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,918	19.950	397,364.100	
	SBM OFFSHORE NV	23,274	10.150	236,231.100	
	ING GROEP NV-CVA	270,377	8.580	2,319,834.660	
	RANDSTAD HOLDINGS	13,290	15.670	208,254.300	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	167,373	8.970	1,501,335.810	
	HEINEKEN NV	33,189	24.280	805,828.920	
	AKZO NOBEL	32,334	31.010	1,002,677.340	
	ASML HOLDING NV	61,030	12.205	744,871.150	
	AEGON NV	185,433	5.180	960,542.940	
	TNT NV	53,187	15.410	819,611.670	
	UNILEVER NV-CVA	224,163	17.335	3,885,865.600	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	136,394	14.430	1,968,165.420	
	WOLTERS KLUWER-CVA	39,729	14.715	584,612.230	
	KONINKLIJKE KPN NV	245,584	10.625	2,609,330.000	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	15,589	22.095	344,438.950	

	FUGRO CERT	9,449	22.835	215,767.910	
	SNS REAAL	13,108	3.660	47,975.280	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	27,395	6.500	178,067.500	
	CIMPOR-CIMENTOS	35,802	3.894	139,412.980	
	JERONIMO MARTINS	24,909	3.692	91,964.020	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	89,515	6.280	562,154.200	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	258,320	2.681	692,555.920	

[前](#) [次](#)

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	BRISA	49,309	5.512	271,791.200	
	ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE TEL	17,607	4.049	71,290.740	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	294,824	0.845	249,126.280	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	29,069	7.660	222,668.540	
ユーロ小計	銘柄数 : 280	24,968,381		261,379,415.190	
	組入時価比率 : 17.20%			(31,174,722,850)	
	合計時価比率 : 17.54%				
デンマーク クローネ	DANISCO A/S	7,822	214.250	1,675,863.500	
	CARLSBERG AS-B	10,276	203.750	2,093,735.000	
	A P MOLLER A/S	153	30,000.000	4,590,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	81	30,000.000	2,430,000.000	
	DANSKE BANK A/S	64,334	65.500	4,213,877.000	
	NOVOZYMES-B SHS	6,411	444.000	2,846,484.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	60,977	299.500	18,262,611.500	
	FLSMIDTH & CO A/S	8,466	176.250	1,492,132.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25,887	338.500	8,762,749.500	
	TOPDANMARK A/S	2,455	736.000	1,806,880.000	
	COLOPLAST-B	2,338	344.000	804,272.000	
	DSV A/S	24,158	63.000	1,521,954.000	
	WILLIAM DEMANT	3,754	208.000	780,832.000	
	JYSKE BANK	5,143	150.000	771,450.000	
	TRYGVESTA AS	4,323	330.500	1,428,751.500	
デンマーク クローネ小計	銘柄数 : 15	226,578		53,481,592.500	
	組入時価比率 : 0.47%			(856,240,296)	
	合計時価比率 : 0.48%				
ノルウェー クローネ	FRONTLINE LTD	8,488	213.250	1,810,066.000	
	SEADRILL LTD	27,878	56.100	1,563,955.800	
	DNB HOLDING ASA	107,633	26.200	2,819,984.600	
	NORSK HYDRO ASA	103,727	27.000	2,800,629.000	
	TELENOR ASA	111,978	47.500	5,318,955.000	
	ORKLA ASA	116,006	45.150	5,237,670.900	
	STATOILHYDRO ASA	181,222	117.000	21,202,974.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	25,634	150.250	3,851,508.500	
	AKER SOLUTIONS ASA	31,925	41.300	1,318,502.500	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	18,500	69.500	1,285,750.000	

ノルウェー クローネ小計	銘柄数 : 10	732,991		47,209,996.300	
	組入時価比率 : 0.33%			(600,039,053)	
	合計時価比率 : 0.34%				
香港ドル	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	99,000	8.720	863,280.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	72,500	15.020	1,088,950.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	14,000	17.900	250,600.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	321,000	2.340	751,140.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	303,000	2.920	884,760.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	302,000	17.300	5,224,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	172,000	16.180	2,782,960.000	
	CLP HOLDINGS LTD	282,500	52.400	14,803,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	79,000	24.600	1,943,400.000	
	PCCW LTD	533,600	3.770	2,011,672.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	132,000	8.780	1,158,960.000	
	LI & FUNG LTD	324,200	13.300	4,311,860.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	190,000	75.000	14,250,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	51,000	27.800	1,417,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	142,900	74.750	10,681,775.000	
	MTR CORP	207,500	18.000	3,735,000.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	147,700	43.050	6,358,485.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	136,000	24.700	3,359,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	106,500	100.400	10,692,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	139,000	31.500	4,378,500.000	
	HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	13,200	69.200	913,440.000	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	187,000	43.500	8,134,500.000	
	(THE) WHARF HOLDINDS LTD	206,750	20.150	4,166,012.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	566,943	12.740	7,222,853.820	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	274,000	41.900	11,480,600.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	63,000	12.840	808,920.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	18.940	2,007,640.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	553,000	8.810	4,871,930.000	
	NWS HOLDINGS LTD	80,000	9.360	748,800.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	429,800	8.240	3,541,552.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	148,000	10.120	1,497,760.000	
	SINO LAND CO	190,000	8.000	1,520,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	192,000	68.100	13,075,200.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	107,500	52.050	5,595,375.000	
	TELEVISION BROADCASTS LTD	67,000	25.200	1,688,400.000	
	WING HANG BANK LTD	21,500	40.950	880,425.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	116,000	15.800	1,832,800.000	

	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	49,500	6.650	329,175.000	
	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	190,000	4.180	794,200.000	
	HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS	180,000	2.200	396,000.000	
	ASM PACIFIC TECH	46,600	27.900	1,300,140.000	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	90,500	13.080	1,183,740.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 42	7,633,693		164,938,005.320	
	組入時価比率 : 1.05%			(1,903,384,581)	
	合計時価比率 : 1.07%				
シンガポール ・ドル	GENTING INTERNATIONAL PLC	597,000	0.460	274,620.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	791,000	0.295	233,345.000	
	SINGAPORE TECH ENG	231,000	2.460	568,260.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,000	2.220	310,800.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	209,000	3.020	631,180.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,000	8.110	1,281,380.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	74,000	6.060	448,440.000	
	SEMBCORP MARINE	123,000	1.610	198,030.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	91,000	0.815	74,165.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	21,000	10.160	213,360.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	128,000	5.200	665,600.000	
	CAPITALAND LTD	234,000	2.900	678,600.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	108,500	3.140	340,690.000	
	KEPPEL CORP LTD	183,000	4.480	819,840.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	287,000	1.480	424,760.000	
	NEPTUNE ORIENT	73,000	1.200	87,600.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	172,200	1.110	191,142.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	337,200	5.150	1,736,580.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,083,867	2.550	2,763,860.850	
	PARKWAY HOLDINGS	89,466	1.380	123,463.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,400	11.340	877,716.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	171,000	12.560	2,147,760.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	164,800	1.270	209,296.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	105,000	2.990	313,950.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD RTS	79,000	2.670	210,930.000	
シンガポール ・ドル小計	銘柄数 : 25	5,728,433		15,825,367.930	
	組入時価比率 : 0.52%			(949,680,329)	
	合計時価比率 : 0.53%				
オーストラリア ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	276,033	15.080	4,162,577.640	
	AMCOR LTD	121,786	5.820	708,794.520	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	378,852	16.440	6,228,326.880	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,216	2.000	298,432.000	

	TELSTRA CORP LTD	612,410	3.650	2,235,296.500	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	35,071	10.300	361,231.300	
	AMP LTD	259,838	5.480	1,423,912.240	
	ASX LTD	23,867	31.930	762,073.310	
	BHP BILLITON LTD	463,343	30.830	14,284,864.690	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	7.450	158,178.400	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	48,781	2.450	119,513.450	
	COMPUTERSHARE LT	58,151	7.330	426,246.830	
	CSL LIMITED	82,632	32.500	2,685,540.000	
	TRANSURBAN GROUP	170,611	4.950	844,524.450	
	COCA-COLA AMATIL LTD	74,952	9.460	709,045.920	
	COCHLEAR LTD	8,540	53.220	454,498.800	
	ORIGIN ENERGY LTD	128,850	15.720	2,025,522.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	198,990	28.320	5,635,396.800	
	BORAL LIMITED	71,545	4.500	321,952.500	
	RIO TINTO LIMITED	40,550	41.300	1,674,715.000	
	CSR LIMITED	191,241	1.610	307,898.010	
	ARISTOCRAT LEISU	37,366	3.640	136,012.240	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	264,023	3.790	1,000,647.170	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	20,159	8.110	163,489.490	
	ONESTEEL LIMITED	96,868	2.540	246,044.720	
	NUFARM LTD	20,945	10.500	219,922.500	
	FOSTER'S GROUP LTD	268,856	5.400	1,451,822.400	
	OZ MINERALS LTD	316,028	0.550	173,815.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	59,593	4.470	266,380.710	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP	292,113	1.720	502,434.360	
	ORICA LTD	46,051	14.700	676,949.700	
	FAIRFAX MEDIA LTD	226,824	1.620	367,454.880	
	LEIGHTON HLDGS LTD	20,905	22.050	460,955.250	
	LEND LEASE CORP LTD	56,037	7.050	395,060.850	
	BLUESCOPE STEEL LTD	130,530	3.760	490,792.800	
	LION NATHAN LTD	50,499	7.890	398,437.110	
	MACQUARIE AIRPORTS	101,861	2.340	238,354.740	
	MACQUARIE GROUP LTD	39,707	30.720	1,219,799.040	
	WORLEYPARSONS LTD	24,901	14.870	370,277.870	
	SUNCORP-METWAY LTD	137,903	8.730	1,203,893.190	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	129,146	5.080	656,061.680	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	253,661	20.640	5,235,563.040	
	NEWCREST MINING LTD	64,132	31.380	2,012,462.160	
	INCITEC PIVOT LTD	207,611	2.660	552,245.260	

	TOLL HOLDINGS LTD	97,280	6.060	589,516.800	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	2.550	456,549.450	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	135,012	25.740	3,475,208.880	
	SANTOS LTD	81,525	14.090	1,148,687.250	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,965	19.150	439,779.750	
	SONIC HEALTHCARE	47,151	13.320	628,051.320	
	TABCORP HOLDINGS LTD	80,897	7.040	569,514.880	
	WESFARMERS LTD	92,300	18.010	1,662,323.000	
	ALUMINA LIMITED	205,492	1.520	312,347.840	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	67,519	35.700	2,410,428.300	
	WOOLWORTHS LTD	164,380	26.300	4,323,194.000	
	METCASH LTD	118,626	4.260	505,346.760	
	TATTS GROUP LTD	168,506	2.710	456,651.260	
	GOODMAN FIELDER LTD	180,002	1.450	261,002.900	
	AGL ENERGY LTD	57,872	14.190	821,203.680	
	BRAMBLES LTD	197,249	6.800	1,341,293.200	
	ASCIANO GROUP	47,029	1.355	63,724.290	
	WESFARMERS LTD-PPS	20,060	18.000	361,080.000	
	CROWN LTD	74,398	5.950	442,668.100	
オーストラリア ドル小計	銘柄数 : 63	8,319,512		84,535,989.460	
	組入時価比率 : 2.83%			(5,129,643,840)	
	合計時価比率 : 2.89%				
ニュージーランド ドル	CONTACT ENERGY L	53,095	7.330	389,186.350	
	FLETCHER BUILDING LTD	70,594	5.950	420,034.300	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	359,026	2.470	886,794.220	
ニュージーランド ドル小計	銘柄数 : 3	482,715		1,696,014.870	
	組入時価比率 : 0.05%			(85,970,994)	
	合計時価比率 : 0.05%				
合計				175,616,714,659	
				(175,616,714,659)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	17,121.00	832,080.600	
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	12,720.00	133,941.600	
	SL GREEN	6,205.00	112,931.000	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	75,341.00	1,170,799.140	
	AMB PROPERTY CORP	10,783.00	221,806.310	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,687.00	545,571.350	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	9,542.00	261,737.060	
	DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY CO	12,872.00	77,489.440	
	DUKE REALTY TRUST	15,814.00	146,753.920	
	EQUITY RESIDENTIAL	36,260.00	882,931.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,826.00	462,923.700	
	HCP INC	35,247.00	765,917.310	
	HEALTH CARE REIT INC	12,304.00	444,420.480	
	KIMCO REALTY	34,029.00	556,714.440	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,108.00	228,720.120	
	THE MACERICH COMPANY	7,247.00	109,864.520	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	70,352.00	471,358.400	
	PLUM CREEK TIMBER CO	22,818.00	691,385.400	
	REGENCY	10,566.00	401,508.000	
	UDR INC	15,885.00	179,182.800	
	PROLOGIS	40,881.00	505,697.970	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,746.00	1,388,252.580	
	PUBLIC STORAGE	17,470.00	1,113,537.800	
	VENTAS INC	19,744.00	515,120.960	
	VORNADO REALTY TRUST	18,859.00	980,290.820	
米ドル小計	銘柄数 : 25	565,427.00	13,200,936.720	
	組入時価比率 : 0.65%		(1,181,219,818)	
	合計時価比率 : 0.66%			
	BRITISH LAND CO PLC	71,730.00	405,991.800	
	HAMMERSON PLC	41,511.00	228,518.050	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	65,075.00	611,379.620	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	41,207.00	211,597.940	
	SEGRO PLC	69,847.00	184,186.530	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	289,370.00	1,641,673.940	
	組入時価比率 : 0.12%		(217,062,128)	
	合計時価比率 : 0.12%			
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	28,223.00	239,048.810	
カナダドル小計	銘柄数 : 1	28,223.00	239,048.810	
	組入時価比率 : 0.01%		(17,550,964)	
	合計時価比率 : 0.01%			

	GECINA SA	1,548.00	90,349.020	
	ICADE EMGP	2,184.00	132,656.160	
	UNIBAIL-RODAMCO	11,204.00	1,215,073.800	
	KLEPIERRE	13,151.00	255,721.190	
	CORIO NV	7,632.00	278,110.080	
ユーロ小計	銘柄数 : 5	35,719.00	1,971,910.250	
	組入時価比率 : 0.13%		(235,189,736)	
	合計時価比率 : 0.13%			
	LINK REIT/THE	312,000.00	4,386,720.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	312,000.00	4,386,720.000	
	組入時価比率 : 0.03%		(50,622,749)	
	合計時価比率 : 0.03%			
投資証券計			1,701,645,395	
			(1,701,645,395)	
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	182,000.00	303,940.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	173,350.00	244,423.500	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	355,350.00	548,363.500	
	組入時価比率 : 0.02%		(32,907,294)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	MIRVAC GROUP	275,646.00	355,583.340	
	CFS RETAIL PROPERTY	264,580.00	481,535.600	
	GPT GROUP	621,318.00	562,292.790	
	MACQUARIE OFFICE TRUST	357,047.00	92,832.220	
	STOCKLAND	195,908.00	746,409.480	
	WESTFIELD GROUP	230,316.00	3,182,967.120	
	DEXUS PROPERTY GROUP	520,714.00	429,589.050	
	GOODMAN GROUP	355,181.00	355,181.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 8	2,820,710.00	6,206,390.600	
	組入時価比率 : 0.21%		(376,603,782)	
	合計時価比率 : 0.21%			
投資信託受益証券計			409,511,076	
			(409,511,076)	
合計			2,111,156,471	
			(2,111,156,471)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 577銘柄	54.05%	55.13%
米ドル	投資証券 25銘柄	0.65%	0.66%
英ポンド	株式 110銘柄	10.68%	10.89%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.12%	0.12%
カナダドル	株式 84銘柄	4.36%	4.45%
カナダドル	投資証券 1銘柄	0.01%	0.01%
スイスフラン	株式 38銘柄	4.29%	4.37%
スウェーデンクローネ	株式 31銘柄	1.05%	1.07%
ユーロ	株式 280銘柄	17.20%	17.54%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.13%	0.13%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	0.47%	0.48%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.33%	0.34%
香港ドル	株式 42銘柄	1.05%	1.07%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.03%	0.03%
シンガポール・ドル	株式 25銘柄	0.52%	0.53%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.02%	0.02%
オーストラリアドル	株式 63銘柄	2.83%	2.89%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 8銘柄	0.21%	0.21%
ニュージーランドドル	株式 3銘柄	0.05%	0.05%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,261,343,174	2,386,084,185
国債証券		160,061,297,200	186,077,472,400
地方債証券		12,789,946,440	14,950,467,933
特殊債券		21,119,860,749	24,934,298,135
社債券		18,203,244,790	19,447,349,960
未収利息		594,359,318	722,947,146
前払費用		46,380,168	45,629,609
流動資産合計		216,076,431,839	248,564,249,368
資産合計		216,076,431,839	248,564,249,368
負債の部			
流動負債			
未払解約金		20,078,000	18,789,000
流動負債合計		20,078,000	18,789,000
負債合計		20,078,000	18,789,000
純資産の部			
元本等			
元本		206,022,402,240	230,660,804,354
剰余金			
剰余金		10,033,951,599	17,884,656,014
剰余金合計		10,033,951,599	17,884,656,014
元本等合計		216,056,353,839	248,545,460,368
純資産合計		216,056,353,839	248,545,460,368
負債・純資産合計		216,076,431,839	248,564,249,368

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年2月15日から平成20年2月14日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年2月15日から平成21年2月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	142,754,789,468円	206,022,402,240円
同期中追加設定元本額	94,585,676,386円	111,781,251,678円
同期中解約元本額	31,318,063,614円	87,142,849,564円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	3,825,968,957円	5,068,576,676円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	2,095,599,871円	2,024,563,623円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,564,511,120円	3,103,818,097円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,594,149,223円	1,236,935,719円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,381,927,074円	1,100,494,716円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,436,399,769円	1,047,832,558円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	189,324,687円	148,900,624円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	367,370,577円	249,245,034円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,861,931,265円	1,597,678,607円
みずほエマージングボンドオープン	29,420,418円	29,420,418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	- 円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	- 円	28,698,739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）	20,905,325,712円	19,419,364,576円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A（適格機関投資家限定）	22,790,431,358円	15,485,332,238円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	1,286,161,133円	779,457,379円
D I A M国際分散バランスファンド30V A（適格機関投資家限定）	739,748,330円	531,075,698円
D I A M国際分散バランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	1,921,476,631円	1,209,716,448円
D I A M国内重視バランスファンド30V A（適格機関投資家限定）	824,187,482円	617,743,134円
D I A M国内重視バランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	634,806,105円	430,663,603円
D I A M世界バランスファンド40V A（適格機関投資家限定）	47,551,707,479円	32,482,916,746円
D I A M世界バランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	16,395,984,713円	10,436,372,017円
D I A Mバランスファンド25V A（適格機関投資家限定）	18,079,628,198円	15,787,099,724円
D I A Mバランスファンド37.5V A（適格機関投資家限定）	6,404,944,056円	5,795,328,102円
D I A Mバランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	11,486,122,070円	8,977,725,861円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	2,952,803,420円	1,935,655,430円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	8,737,435,830円	7,060,375,945円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30V A（適格機関投資家限定）	4,122,546,168円	6,952,018,354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）	3,223,484,962円	13,936,342,628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）	15,042,222円	317,688,496円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	1,517,780,242円	1,067,802,637円
D I A M世界バランスファンド 55V A（適格機関投資家限定）	13,407,734,767円	14,388,106,796円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35V A（適格機関 投資家限定）	6,668,839,483円	7,832,993,787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）	- 円	1,618,991,252円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A（適格機関投資 家限定）	- 円	45,767,617,391円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A（適格機関投資 家限定）	- 円	2,175,192,373円
（合 計）	206,022,402,240円	230,660,804,354円
*2 本有価証券報告書における 開示対象ファンドの計算期間末 日における受益権の総数	206,022,402,240口	230,660,804,354口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	160,061,297,200	2,840,161,700	186,077,472,400	3,671,046,400
地方債証券	12,789,946,440	310,920,434	14,950,467,933	244,646,498
特殊債券	21,119,860,749	371,687,818	24,934,298,135	299,645,272
社債券	18,203,244,790	264,419,840	19,447,349,960	22,820,970
合計	212,174,349,179	3,787,189,792	245,409,588,428	4,238,159,140

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.0487円	1.0775円
（1万口当たり純資産額）	（10,487円）	（10,775円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	2 6 5 回 利付国庫債券（2年）	1,200,000,000	1,202,844,000	
	2 6 6 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	501,730,000	
	2 6 7 回 利付国庫債券（2年）	1,700,000,000	1,706,103,000	
	2 6 8 回 利付国庫債券（2年）	1,300,000,000	1,306,435,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券（2年）	1,000,000,000	1,008,140,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券（2年）	1,300,000,000	1,310,998,000	
	2 7 1 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,510,830,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券（2年）	700,000,000	704,046,000	
	2 7 3 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	503,855,000	
	2 7 4 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	502,180,000	
	4 4 回 利付国庫債券（5年）	4,600,000,000	4,621,206,000	
	4 7 回 利付国庫債券（5年）	4,000,000,000	4,009,920,000	
	4 9 回 利付国庫債券（5年）	5,200,000,000	5,221,632,000	
	5 2 回 利付国庫債券（5年）	5,300,000,000	5,345,103,000	
	5 4 回 利付国庫債券（5年）	3,200,000,000	3,249,984,000	
	5 7 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,118,800,000	
	6 0 回 利付国庫債券（5年）	4,600,000,000	4,693,104,000	
	6 1 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,575,810,000	
	6 3 回 利付国庫債券（5年）	3,300,000,000	3,373,722,000	
	6 4 回 利付国庫債券（5年）	3,700,000,000	3,822,618,000	
	6 6 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,874,594,000	
	6 8 回 利付国庫債券（5年）	2,300,000,000	2,345,448,000	
	6 9 回 利付国庫債券（5年）	1,000,000,000	1,012,080,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,000,000,000	4,030,080,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	3,700,000,000	3,836,086,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	3,000,000,000	3,057,090,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	500,000,000	504,760,000	
	2 2 2 回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	306,264,000	
	2 2 3 回 利付国庫債券（10年）	600,000,000	613,602,000	

2 2 5 回	利付国庫債券（10年）	300,000,000	308,895,000	
2 2 9 回	利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,533,000,000	
2 3 2 回	利付国庫債券（10年）	1,150,000,000	1,171,804,000	
2 3 4 回	利付国庫債券（10年）	1,300,000,000	1,333,540,000	
2 3 5 回	利付国庫債券（10年）	1,700,000,000	1,746,886,000	
2 3 7 回	利付国庫債券（10年）	1,540,000,000	1,588,833,400	
2 4 0 回	利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,539,360,000	
2 4 3 回	利付国庫債券（10年）	1,400,000,000	1,428,000,000	
2 4 6 回	利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,916,036,000	
2 4 7 回	利付国庫債券（10年）	700,000,000	705,264,000	
2 5 0 回	利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,046,259,800	
2 5 4 回	利付国庫債券（10年）	3,300,000,000	3,410,781,000	
2 5 6 回	利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,583,925,000	
2 5 8 回	利付国庫債券（10年）	1,500,000,000	1,543,770,000	
2 6 0 回	利付国庫債券（10年）	2,100,000,000	2,197,041,000	
2 6 3 回	利付国庫債券（10年）	2,200,000,000	2,303,686,000	
2 6 6 回	利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,071,980,000	
2 7 0 回	利付国庫債券（10年）	1,600,000,000	1,648,880,000	
2 7 2 回	利付国庫債券（10年）	1,700,000,000	1,763,529,000	
2 7 4 回	利付国庫債券（10年）	1,600,000,000	1,674,048,000	
2 7 7 回	利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,112,820,000	
2 8 0 回	利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,694,600,000	
2 8 2 回	利付国庫債券（10年）	2,200,000,000	2,329,712,000	
2 8 4 回	利付国庫債券（10年）	2,900,000,000	3,063,705,000	
2 8 5 回	利付国庫債券（10年）	3,200,000,000	3,375,584,000	
2 8 6 回	利付国庫債券（10年）	3,500,000,000	3,713,220,000	
2 8 8 回	利付国庫債券（10年）	2,200,000,000	2,310,946,000	
2 8 9 回	利付国庫債券（10年）	3,100,000,000	3,199,479,000	
2 9 0 回	利付国庫債券（10年）	3,200,000,000	3,269,088,000	
2 9 3 回	利付国庫債券（10年）	4,900,000,000	5,164,208,000	
2 9 6 回	利付国庫債券（10年）	4,500,000,000	4,607,055,000	
2 9 7 回	利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,014,140,000	
1 回	利付国庫債券（30年）	100,000,000	116,030,000	
3 回	利付国庫債券（30年）	200,000,000	214,754,000	
5 回	利付国庫債券（30年）	200,000,000	211,230,000	
7 回	利付国庫債券（30年）	300,000,000	322,269,000	
1 2 回	利付国庫債券（30年）	300,000,000	309,819,000	
1 4 回	利付国庫債券（30年）	500,000,000	547,225,000	
1 8 回	利付国庫債券（30年）	820,000,000	881,180,200	
2 2 回	利付国庫債券（30年）	870,000,000	971,372,400	
2 4 回	利付国庫債券（30年）	600,000,000	671,382,000	
2 6 回	利付国庫債券（30年）	900,000,000	988,011,000	

	27回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,120,730,000	
	28回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,122,090,000	
	37回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	697,812,000	
	39回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	448,308,000	
	40回 利付国庫債券(20年)	720,000,000	786,960,000	
	42回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	899,088,000	
	43回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	879,776,000	
	45回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	888,880,000	
	47回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	816,367,500	
	50回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	716,862,800	
	51回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	425,180,000	
	52回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	482,616,000	
	54回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	541,705,000	
	55回 利付国庫債券(20年)	410,000,000	433,743,100	
	57回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	448,464,200	
	58回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	624,750,000	
	60回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	574,595,100	
	61回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	552,660,000	
	62回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	532,506,000	
	64回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	619,182,000	
	65回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	824,440,000	
	67回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	824,264,000	
	70回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	932,390,500	
	72回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	791,542,500	
	73回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	925,778,000	
	75回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	990,205,400	
	78回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	971,897,500	
	81回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	932,049,000	
	83回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,048,440,000	
	85回 利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,203,935,000	
	88回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,075,590,000	
	90回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,272,036,000	
	92回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,252,176,000	
	93回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	616,854,000	
	94回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	626,358,000	
	95回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,181,818,000	
	97回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,165,571,000	
	99回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,356,004,000	
	100回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,379,027,000	
	102回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,531,908,000	
	105回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,358,630,000	
	107回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	731,871,000	

国債証券計			186,077,472,400	
地方債証券	5 8 2 回 東京都公募公債	100,000,000	102,599,000	
	5 8 3 回 東京都公募公債	200,000,000	205,292,000	
	5 8 9 回 東京都公募公債	100,000,000	102,109,000	
	6 0 0 回 東京都公募公債	100,000,000	100,261,000	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	209,620,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	168,221,630	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	102,472,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	204,832,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	206,360,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	204,206,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	108,546,180	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	203,632,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	103,182,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	103,660,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	300,000,000	308,169,000	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,065,455	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,535,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	211,842,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	211,494,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	156,996,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	104,919,000	
	1 2 年度 3 回 北海道公募公債	100,000,000	101,804,000	
	1 3 年度 1 回 北海道公募公債	100,000,000	101,571,000	
	1 3 年度 2 回 北海道公募公債	100,000,000	101,634,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	100,000,000	100,270,000	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	100,000,000	100,630,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	200,682,225	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	105,708,000	
	1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,582,000	
	1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,958,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	159,787,914	
	1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	207,030,000	
	1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,964,000	
	2 4 6 回 大阪府公募公債	100,000,000	101,643,000	
	2 5 2 回 大阪府公募公債	100,000,000	99,385,000	
	2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	201,130,000	
	2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	101,809,000	
	2 8 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	203,722,000	
	2 8 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	208,042,000	
	3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	103,311,000	

	17回 大阪府公募公債 5年	100,000,000	99,831,000	
	26回 大阪府公募公債 5年	120,000,000	121,731,600	
	16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	102,948,000	
	18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	103,825,000	
	14年度5回 兵庫県公募公債	100,000,000	99,458,000	
	17年度9回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,290,000	
	17年度10回 兵庫県公募公債 5年	100,000,000	100,217,000	
	18年度2回 兵庫県公募公債 5年	200,000,000	203,150,000	
	15年度1回 静岡県公募公債	100,000,000	98,500,000	
	15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	118,940,346	
	18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	136,523,640	
	15年度1回 愛知県公募公債	100,000,000	102,467,000	
	17年度5回 愛知県公募公債 5年	155,000,000	156,016,800	
	13年度1回 広島県公募公債	100,000,000	102,168,000	
	14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,002,000	
	15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,369,000	
	17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,224,000	
	18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	210,640,000	
	16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	133,265,059	
	17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	102,216,000	
	15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	102,380,000	
	17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	203,216,000	
	19年度5回 千葉県公募公債	100,000,000	104,339,000	
	13年度1回 新潟県公募公債	110,000,000	111,982,200	
	2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,990,000	
	9回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,857,000	
	12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,114,800	
	18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,517,000	
	19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,498,000	
	20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,880,000	
	21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,927,000	
	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,699,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	310,776,160	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,266,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,278,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,688,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,548,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,830,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,975,500	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	181,498,800	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	160,993,500	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	168,781,504	

	6 1 回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,707,000	
	1 7 年度 3 回 大阪市公募公債	100,000,000	100,472,000	
	1 7 年度 8 回 大阪市公募公債	200,000,000	204,638,000	
	1 8 年度 3 回 大阪市公募公債	150,000,000	158,847,000	
	1 9 年度 5 回 大阪市公募公債	135,000,000	140,771,250	
	1 2 回 さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	99,008,000	
	1 2 回 せ号 名古屋市公募公債	220,000,000	225,022,600	
	1 8 年度 3 回 京都市公募公債	101,700,000	106,856,190	
	1 7 年度 1 3 回 神戸市公募公債	103,000,000	105,869,580	
	1 3 年度 3 回 横浜市公募公債	100,000,000	102,026,000	
	1 4 年度 1 回 横浜市公募公債	100,000,000	102,331,000	
	1 4 年度 5 回 横浜市公募公債	100,000,000	100,033,000	
	1 6 年度 1 回 横浜市公募公債	200,000,000	206,804,000	
	1 7 年度 1 回 横浜市公募公債	300,000,000	305,172,000	
	1 4 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	99,482,000	
	1 6 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	102,863,000	
	1 4 年度 2 回 北九州市公募公債	100,000,000	100,762,000	
	1 4 年度 1 回 福岡市公募公債	100,000,000	101,971,000	
	1 8 年度 4 回 福岡市公募公債	100,000,000	104,638,000	
	1 6 年度 1 回 広島市公募公債	100,000,000	102,194,000	
	1 2 年度 1 回 仙台市公募公債	100,000,000	102,269,000	
	1 6 年度 2 回 千葉市公募公債	100,000,000	102,237,000	
地方債証券計			14,950,467,933	
特殊債券	4 回 政保日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,355,000	
	8 回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	107,165,280	
	1 6 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,735,000	
	7 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,076,000	
	9 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,347,000	
	1 3 回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,217,000	
	4 6 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,144,000	
	1 2 回 日本道路・機構承継債	100,000,000	101,614,000	
	3 4 回 日本道路・機構承継債	200,000,000	205,520,000	
	3 1 2 回 政保道路債	200,000,000	203,938,000	
	3 1 4 回 政保道路債	200,000,000	202,412,000	
	3 2 2 回 政保道路債	106,000,000	109,490,580	
	3 2 4 回 政保道路債	200,000,000	205,600,000	
	3 2 9 回 政保道路債	100,000,000	103,956,000	
	3 3 3 回 政保道路債	300,000,000	312,024,000	
	3 3 5 回 政保道路債	237,000,000	243,766,350	
	3 3 8 回 政保道路債	264,000,000	273,155,520	
	3 3 9 回 政保道路債	301,000,000	309,455,090	

3 4 2 回 政保道路債	100,000,000	100,593,000	
1 5 回 高速道路機構債	400,000,000	420,992,000	
2 5 回 高速道路機構債	300,000,000	308,247,000	
3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,599,000	
5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	109,000,000	113,679,370	
8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	112,735,800	
9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,951,000	
1 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,392,000	
1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	322,554,610	
1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,461,000	
2 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,554,000	
3 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,846,000	
3 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	185,000,000	193,053,050	
4 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	349,555,860	
4 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,028,000	
1 6 回 日本道路・機構承継債	130,000,000	130,205,400	
5 回 公営企業債券	100,000,000	99,433,000	
7 9 4 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,076,000	
7 9 6 回 政保公営企業債券	210,000,000	215,426,400	
7 9 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,984,000	
8 0 0 回 政保公営企業債券	100,000,000	101,980,000	
8 0 5 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,506,000	
8 0 7 回 政保公営企業債券	100,000,000	102,356,000	
8 1 2 回 政保公営企業債券	230,000,000	236,536,600	
8 1 5 回 政保公営企業債券	204,000,000	209,326,440	
8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	109,503,800	
8 2 1 回 政保公営企業債券	100,000,000	101,629,000	
8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	200,840,000	
8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	207,608,100	
8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	444,432,960	
8 3 8 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,363,000	
8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,459,000	
8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	205,760,000	
8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,572,000	
8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	270,098,460	
8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	306,777,000	
8 5 4 回 政保公営企業債券	100,000,000	102,840,000	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,852,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	214,367,130	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	252,881,120	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,560,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	211,050,000	

8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	106,547,930	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	107,491,680	
8 7 5 回 政保公営企業債券	300,000,000	313,152,000	
4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	100,807,000	
6 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	197,778,000	
1 2 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,502,000	
1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,978,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	303,528,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,733,000	
1 9 1 回 政保首都高速道路債券	113,000,000	118,673,730	
1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	109,321,900	
5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,548,000	
1 6 2 回 政保中小企業債券	126,000,000	128,676,240	
1 7 3 回 政保中小企業債券	100,000,000	100,343,000	
1 7 6 回 政保中小企業債券	100,000,000	103,770,000	
1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	149,145,440	
1 8 5 回 政保中小企業債券	200,000,000	201,392,000	
1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	106,274,480	
1 0 回 中小企業債券	100,000,000	100,781,000	
1 8 回 中小企業債券	100,000,000	99,807,000	
1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	206,924,000	
1 2 回 国際協力銀行債券	200,000,000	205,384,000	
2 回 都市再生債券	100,000,000	105,295,000	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	207,802,000	
2 回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	103,768,000	
3 6 回 政保関西国際空港債	100,000,000	101,848,000	
6 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	102,805,000	
1 0 8 回 政保預金保険機構債券	100,000,000	102,427,000	
8 回 政保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,107,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	228,501,000	234,403,180	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	156,574,000	159,976,353	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	236,841,000	242,513,341	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	256,785,000	263,777,255	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	152,445,000	152,928,250	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,907,000	88,101,923	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	345,480,000	354,649,039	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	270,498,000	277,338,894	
8 回 政保国民生活債券	300,000,000	301,086,000	
1 4 回 政保国民生活債券	132,000,000	136,536,840	
2 7 回 国民生活金融公庫債券	200,000,000	205,238,000	
8 回 日本学生支援機構債	200,000,000	204,026,000	
6 6 1 号 利附商工債	100,000,000	99,400,000	

6 6 2号 利附商工債	100,000,000	99,357,000	
6 6 6号 利附商工債	100,000,000	100,019,000	
6 7 3号 利附商工債	100,000,000	101,290,000	
6 7 4号 利附商工債	200,000,000	203,626,000	
6 7 8号 利附商工債	200,000,000	201,972,000	
6 8 0号 利附商工債	110,000,000	111,312,300	
6 8 3号 利附商工債	100,000,000	100,691,000	
6 8 5号 利附商工債	100,000,000	101,329,000	
6 9 1号 利附商工債	200,000,000	201,436,000	
6 5 9号 利附農林債	100,000,000	99,720,000	
6 6 4号 利附農林債	100,000,000	99,597,000	
6 6 7号 利附農林債	100,000,000	100,088,000	
6 7 1号 利附農林債	300,000,000	304,005,000	
6 7 2号 利附農林債	100,000,000	101,478,000	
6 7 3号 利附農林債	100,000,000	101,269,000	
6 7 5号 利附農林債	100,000,000	101,581,000	
6 8 1号 利附農林債	300,000,000	303,279,000	
6 8 4号 利附農林債	250,000,000	252,265,000	
6 8 8号 利附農林債	100,000,000	100,874,000	
6 3 0回 利附長期信用債	100,000,000	90,694,000	
5 7 7回 あおぞら債券（5年）	100,000,000	87,075,000	
1 8 3回 利附しんきん中金債	100,000,000	99,812,000	
1 8 6回 利附しんきん中金債	100,000,000	99,668,000	
1 8 9回 利附しんきん中金債	200,000,000	199,504,000	
1 9 1回 利附しんきん中金債	100,000,000	100,062,000	
1 9 4回 利附しんきん中金債	100,000,000	100,035,000	
1 9 5回 利附しんきん中金債	200,000,000	200,660,000	
1 9 6回 利附しんきん中金債	100,000,000	100,538,000	
2 0 0回 利附しんきん中金債	100,000,000	102,042,000	
2 0 3回 利附しんきん中金債	100,000,000	101,371,000	
2 0 4回 利附信金中金債	100,000,000	101,241,000	
2 0 8回 利附信金中金債	150,000,000	151,335,000	
2 1 0回 利附信金中金債	100,000,000	101,037,000	
2 2 2回 利附信金中金債	200,000,000	201,950,000	
6 6 7号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	99,707,000	
6 7 2号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	99,402,000	
6 7 6号 みずほコーポレート銀行債券	120,000,000	120,088,800	
6 7 7号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	99,973,000	
6 7 9号 みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,205,000	
9 7号 利附商工債（3年）	100,000,000	99,935,000	
1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,128,880	
2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	104,518,840	

	4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	177,335,500	
	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,105,700	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	310,506,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	209,216,880	
	5回 政保西日本高速道路債券	129,000,000	135,722,190	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	123,019,650	
特殊債券計			24,934,298,135	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	98,470,000	
	10回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	93,639,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	80,978,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	91,625,000	
	14回 シティグループ円貨社債	100,000,000	96,255,000	
	22回 シティグループ円貨社債	100,000,000	96,881,000	
	7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	98,614,000	
	20回 王子製紙社債	100,000,000	102,546,000	
	31回 住友化学社債	100,000,000	99,657,000	
	25回 三菱化学社債	100,000,000	102,032,000	
	19回 新日本石油社債	100,000,000	102,144,000	
	3回 ブリヂストン社債	100,000,000	99,724,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	102,227,000	
	4回 神戸製鋼所社債	100,000,000	106,360,000	
	11回 豊田自動織機社債	100,000,000	100,378,000	
	12回 日立製作所社債	100,000,000	97,927,000	
	23回 富士通社債	100,000,000	100,001,000	
	19回 ソニー社債	100,000,000	101,270,000	
	4回 デンソー社債	100,000,000	100,481,000	
	41回 日産自動車社債	100,000,000	98,462,000	
	6回 トヨタ自動車社債	100,000,000	101,299,000	
	45回 三井物産社債	100,000,000	98,440,000	
	17回 住友商事社債	100,000,000	99,985,000	
	16回 三菱商事社債	100,000,000	108,652,000	
	14回 クレディセゾン社債	100,000,000	91,288,000	
	8回 三菱東京フィナンシャルG社債	100,000,000	99,613,000	
	12回 三菱UFJフィナンシャルG社債	100,000,000	100,696,000	
	1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	199,250,000	
	3回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	101,110,000	
	6回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	101,544,000	
	11回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	199,126,000	
	2回 みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	101,670,000	
	29回 東京三菱銀行社債	200,000,000	203,894,000	
	82回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,345,000	

	3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	200,000,000	194,806,000	
	6回 東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	98,116,000	
	5回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,663,000	
	4回 住友信託銀行劣後社債	100,000,000	94,582,000	
	30回 三井住友銀行社債	100,000,000	99,784,000	
	34回 三井住友銀行社債	100,000,000	99,994,000	
	7回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	99,829,000	
	9回 三井住友銀行劣後社債	100,000,000	97,234,000	
	1回 みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	96,838,000	
	6回 ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,422,000	
	13回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,433,000	
	14回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,454,000	
	18回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	202,158,000	
	19回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	103,351,000	
	23回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,306,000	
	39回 アコム社債	100,000,000	83,877,000	
	86回 オリックス社債	100,000,000	93,312,000	
	106回 オリックス社債	100,000,000	89,202,000	
	115回 オリックス社債	100,000,000	82,358,000	
	118回 オリックス社債	100,000,000	73,356,000	
	6回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	98,220,000	
	3回 野村ホールディングス社債	100,000,000	99,715,000	
	24回 三井不動産社債	100,000,000	100,397,000	
	53回 三菱地所社債	100,000,000	101,718,000	
	18回 京王電鉄社債	100,000,000	107,003,000	
	7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,862,000	
	14回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,164,000	
	25回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,422,000	
	31回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,693,000	
	41回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,410,000	
	1回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	117,929,000	
	6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,425,000	
	23回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,424,000	
	43回 日本電信電話社債	200,000,000	203,978,000	
	44回 日本電信電話社債	100,000,000	102,152,000	
	47回 日本電信電話社債	400,000,000	398,864,000	
	2回 KDDI社債	100,000,000	100,575,000	
	8回 NTTドコモ社債	100,000,000	101,574,000	
	441回 東京電力社債	200,000,000	225,498,000	
	455回 東京電力社債	200,000,000	208,350,000	
	457回 東京電力社債	100,000,000	103,973,000	
	473回 東京電力社債	300,000,000	311,631,000	

	4 8 9 回 東京電力社債	300,000,000	305,166,000	
	4 9 1 回 東京電力社債	217,000,000	221,494,070	
	4 9 3 回 東京電力社債	500,000,000	510,515,000	
	4 9 5 回 東京電力社債	200,000,000	203,998,000	
	4 9 8 回 東京電力社債	300,000,000	302,148,000	
	5 0 1 回 東京電力社債	200,000,000	199,902,000	
	5 0 2 回 東京電力社債	200,000,000	200,186,000	
	5 0 5 回 東京電力社債	100,000,000	99,218,000	
	5 1 0 回 東京電力社債	200,000,000	203,558,000	
	5 1 1 回 東京電力社債	100,000,000	102,729,000	
	5 1 5 回 東京電力社債	200,000,000	203,114,000	
	5 1 6 回 東京電力社債	100,000,000	101,248,000	
	5 1 7 回 東京電力社債	100,000,000	100,841,000	
	5 1 8 回 東京電力社債	300,000,000	302,343,000	
	5 1 9 回 東京電力社債	172,000,000	176,052,320	
	5 2 2 回 東京電力社債	300,000,000	316,071,000	
	5 2 7 回 東京電力社債	300,000,000	306,369,000	
	5 3 5 回 東京電力社債	300,000,000	306,306,000	
	5 3 6 回 東京電力社債	200,000,000	202,482,000	
	5 4 2 回 東京電力社債	300,000,000	301,293,000	
	4 0 7 回 中部電力社債	100,000,000	113,893,000	
	4 5 7 回 中部電力社債	100,000,000	101,866,000	
	4 6 0 回 中部電力社債	200,000,000	201,966,000	
	4 6 2 回 中部電力社債	100,000,000	99,917,000	
	4 6 7 回 中部電力社債	100,000,000	102,463,000	
	4 6 8 回 中部電力社債	100,000,000	101,746,000	
	4 7 1 回 中部電力社債	300,000,000	302,457,000	
	4 7 6 回 中部電力社債	100,000,000	104,988,000	
	4 7 8 回 中部電力社債	100,000,000	104,135,000	
	4 8 0 回 中部電力社債	200,000,000	206,256,000	
	4 8 4 回 中部電力社債	200,000,000	203,664,000	
	4 2 7 回 関西電力社債	100,000,000	102,346,000	
	4 2 9 回 関西電力社債	200,000,000	205,146,000	
	4 3 1 回 関西電力社債	100,000,000	102,140,000	
	4 3 2 回 関西電力社債	300,000,000	305,778,000	
	4 3 3 回 関西電力社債	100,000,000	101,129,000	
	4 4 1 回 関西電力社債	200,000,000	203,488,000	
	3 3 4 回 中国電力社債	112,000,000	113,979,040	
	3 3 7 回 中国電力社債	219,000,000	223,132,530	
	3 4 1 回 中国電力社債	100,000,000	102,625,000	
	2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	106,673,000	
	2 6 4 回 北陸電力社債	100,000,000	101,645,000	

	2 8 1 回 北陸電力社債	100,000,000	103,871,000	
	3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	115,600,000	
	4 0 1 回 東北電力社債	100,000,000	101,907,000	
	4 0 5 回 東北電力社債	100,000,000	101,795,000	
	4 0 8 回 東北電力社債	100,000,000	102,107,000	
	4 2 0 回 東北電力社債	100,000,000	101,638,000	
	2 4 9 回 四国電力社債	200,000,000	203,888,000	
	2 5 7 回 四国電力社債	200,000,000	203,034,000	
	3 5 8 回 九州電力社債	100,000,000	102,172,000	
	3 8 2 回 九州電力社債	100,000,000	101,803,000	
	3 8 3 回 九州電力社債	100,000,000	101,744,000	
	3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	206,522,000	
	2 8 2 回 北海道電力社債	200,000,000	204,084,000	
	2 8 6 回 北海道電力社債	100,000,000	102,434,000	
	7 回 沖縄電力社債	100,000,000	102,296,000	
	2 回 電源開発社債	100,000,000	102,783,000	
	1 4 回 電源開発社債	100,000,000	102,137,000	
	1 7 回 電源開発社債	100,000,000	105,560,000	
	2 4 回 東京瓦斯社債	100,000,000	101,874,000	
社債券計			19,447,349,960	
合計			245,409,588,428	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		9,645,796,177	6,407,319,363
コール・ローン		285,209,266	278,720,242
国債証券		330,500,732,087	288,232,591,008
派生商品評価勘定		4,215,414	-
未収入金		238,291,746	-
未収利息		5,183,598,531	4,400,304,312
前払費用		500,857,528	217,032,842
流動資産合計		346,358,700,749	299,535,967,767
資産合計		346,358,700,749	299,535,967,767
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,452,670	393,273
未払解約金		4,190,658,000	68,261,000
流動負債合計		4,203,110,670	68,654,273
負債合計		4,203,110,670	68,654,273
純資産の部			
元本等			
元本		242,099,924,618	260,422,854,222
剰余金			
剰余金		100,055,665,461	39,044,459,272
剰余金合計		100,055,665,461	39,044,459,272
元本等合計		342,155,590,079	299,467,313,494
純資産合計		342,155,590,079	299,467,313,494
負債・純資産合計		346,358,700,749	299,535,967,767

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年2月22日から平成20年2月21日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年2月22日から平成21年2月23日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象 ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	211,106,438,344円	242,099,924,618円
同期中追加設定元本額	100,161,622,379円	105,958,371,413円
同期中解約元本額	69,168,136,105円	87,635,441,809円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国債券インデックスファンド < D C年金 >	1,840,683,713円	2,510,271,389円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 >1安定型	186,064,025円	220,196,414円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 >2安定・成長型	723,966,063円	761,587,886円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 >3成長型	853,454,737円	792,794,357円
D I A M D C バランス30インデックス ファンド	290,142,124円	285,763,112円
D I A M D C バランス50インデックス ファンド	586,868,013円	547,789,280円
D I A M D C バランス70インデックス ファンド	394,007,301円	340,051,271円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配 型 >	250,531,967円	219,505,871円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,272,360,828円	1,409,221,581円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	27,373,694,343円	20,868,909,416円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッ シブ私募ファンド（適格機関投資家向 け）	3,026,368,517円	3,968,896,263円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッ シブファンド（適格機関投資家向け）	382,998,093円	- 円
D I A M外国債券パッシブファンド（適 格機関投資家向け）	5,589,719,269円	5,901,262,819円
D I A M外国債券パッシブファンド2（適 格機関投資家向け）	15,288,988,148円	2,066,624,626円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資 家限定)	1,361,558,549円	1,316,631,738円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25V A（適格機関投資家限定）	66,671,192,310円	54,943,466,549円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50V A（適格機関投資家限定）	3,758,071,447円	2,765,892,318円
D I A M国際分散バランスファンド30V A（適格機関投資家限定）	539,898,692円	470,836,754円
D I A M国際分散バランスファンド50V A（適格機関投資家限定）	931,870,504円	714,876,865円

D I A M国内重視バランスファンド30 V A（適格機関投資家限定）	240,358,865円	219,002,327円
D I A M国内重視バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	115,887,595円	95,379,349円
D I A M世界バランスファンド40 V A（適格機関投資家限定）	34,758,822,213円	28,798,434,971円
D I A M世界バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	7,980,601,918円	6,167,327,135円
D I A Mバランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	11,502,613,424円	12,246,373,194円
D I A Mバランスファンド37.5 V A（適格機関投資家限定）	5,042,051,243円	5,566,268,229円
D I A Mバランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	8,379,611,750円	7,959,385,391円
D I A Mグローバル・アセット・バランス V A（適格機関投資家限定）	3,578,945,287円	2,855,131,008円
D I A Mグローバル・アセット・バランス V A 2（適格機関投資家限定）	8,899,690,909円	8,730,755,788円
D I A M アクサ グローバル バランス ファンド30 V A（適格機関投資家限定）	4,051,984,722円	8,214,643,255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）	8,854,315,127円	45,298,468,587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）	406,657,850円	320,214,088円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルア セット私募ファンド（適格機関投資家向 け）	1,102,529,284円	952,165,907円
D I A M世界バランスファンド55 V A（適 格機関投資家限定）	4,876,597,764円	6,354,134,156円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファ ンド35 V A（適格機関投資家限定）	10,986,818,024円	16,114,987,928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）	- 円	286,171,339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）	- 円	10,139,433,061円
（合 計）	242,099,924,618円	260,422,854,222円
*2 本有価証券報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日における受益権 の総数	242,099,924,618口	260,422,854,222口

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	330,500,732,087	3,830,853,497	288,232,591,008	13,451,229,993
合計	330,500,732,087	3,830,853,497	288,232,591,008	13,451,229,993

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成20年1月11日現在						
区分	種 類	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					
	カナダドル	52,819,895	-	52,646,750	173,145	
	スイスフラン	101,934,374	-	102,607,890	673,516	
	ユーロ	2,466,412,728	-	2,478,187,440	11,774,712	
	英ポンド	313,833,520	-	313,345,760	487,760	
	米ドル	1,140,686,499	-	1,137,131,990	3,554,509	
	買建					
	ユーロ	46,407,218	-	46,403,500	3,718	
米ドル	19,860,044	-	19,859,320	724		
合 計		4,141,954,278	-	4,150,182,650	8,237,256	

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.4133円	1.1499円
(1万口当たり純資産額)	(14,133円)	(11,499円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 6.5 02/15/10	55,000,000.00	58,609,100.000	
	US T N/B 3.875 05/15/10	60,000,000.00	62,845,200.000	
	US T N/B 5.75 08/15/10	60,000,000.00	65,090,400.000	
	US T N/B 4.5 11/15/10	43,000,000.00	46,107,180.000	
	US T N/B 4.875 04/30/11	40,000,000.00	43,809,200.000	
	US T N/B 5.0 08/15/11	24,000,000.00	26,681,040.000	
	US TREASURY N/B 4.5 11/30/11	20,000,000.00	22,009,200.000	
	US TREASURY N/B 4.75 01/31/12	15,000,000.00	16,665,150.000	
	US T N/B 4.875 02/15/12	15,000,000.00	16,742,550.000	
	US TREASURY N/B 4.5 03/31/12	10,000,000.00	11,098,400.000	
	US TREASURY N/B 4.5 04/30/12	20,000,000.00	22,235,800.000	
	US T N/B 4.375 08/15/12	25,000,000.00	28,066,250.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	40,000,000.00	44,550,000.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	20,000,000.00	22,309,200.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	20,000,000.00	22,100,000.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	15,000,000.00	17,121,000.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	7,000,000.00	8,017,170.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	23,000,000.00	26,194,700.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	8,000,000.00	9,454,960.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	16,000,000.00	18,484,960.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	13,000,000.00	15,118,480.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	11,200,000.00	12,824,000.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	8,000,000.00	9,212,480.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	7,000,000.00	8,142,960.000	

	US T N/B 4.5 11/15/15	5,000,000.00	5,938,250.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	11,000,000.00	12,973,070.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	15,000,000.00	20,022,600.000	
	US TREASURY N/B 4.875 08/15/16	15,000,000.00	17,925,000.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	19,057,500.000	
	US TREASURY N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	14,167,440.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	10,257,170.000	
	US TREASURY N/B 4.75 08/15/17	12,000,000.00	14,313,720.000	
	US TREASURY N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	16,237,760.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	18,000,000.00	19,805,580.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	5,000,000.00	5,683,550.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	10,000,000.00	11,484,300.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	12,000,000.00	13,515,000.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	10,727,500.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	10,308,550.000	
	US T N/B 8.5 02/15/20	2,000,000.00	3,024,360.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	12,000,000.00	18,575,520.000	
	US T N/B 7.875 02/15/21	3,000,000.00	4,417,950.000	
	US T N/B 8.125 05/15/21	5,000,000.00	7,522,650.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	12,000,000.00	18,031,800.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	7,000,000.00	10,047,170.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	4,000,000.00	5,723,120.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	8,000,000.00	10,757,440.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	3,000,000.00	4,695,930.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,753,590.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	6,000,000.00	8,910,000.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	3,000,000.00	4,091,700.000	
	US T N/B 6.75 08/15/26	3,000,000.00	4,420,770.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	4,315,290.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,457,500.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	6,000,000.00	8,545,260.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	9,000,000.00	12,560,580.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	3,937,950.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	4,000,000.00	5,116,840.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	4,000,000.00	5,130,600.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	4,000,000.00	5,678,720.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	8,000,000.00	11,613,680.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,000,000.00	6,618,750.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	9,000,000.00	11,335,770.000	
	US TREASURY N/B 4.75 02/15/37	5,000,000.00	6,604,650.000	
	US TREASURY N/B 5.0 05/15/37	6,000,000.00	8,235,000.000	
	US TREASURY N/B 4.375 02/15/38	6,000,000.00	7,606,860.000	

	US T N/B 4.5 05/15/38	7,000,000.00	9,056,250.000	
米ドル小計	銘柄数 : 67	890,200,000.00	1,048,692,070.000	
	組入時価比率 : 31.33%		(93,836,966,424)	
	合計時価比率 : 32.56%			
	UK TREASURY 4.75 06/07/10	5,000,000.00	5,260,000.000	
	UK TREASURY 6.25 11/25/10	4,500,000.00	4,938,300.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/11	9,500,000.00	10,039,600.000	
	UK TREASURY 3.25 12/07/11	1,000,000.00	1,033,500.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	8,000,000.00	8,691,200.000	
	UK TREASURY 5.25 06/07/12	6,500,000.00	7,138,300.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	8,000,000.00	8,655,200.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	2,500,000.00	3,106,500.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	5,500,000.00	6,167,150.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	7,500,000.00	8,316,000.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	4,000,000.00	5,200,000.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	7,000,000.00	7,486,500.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	4,500,000.00	6,319,800.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	9,000,000.00	10,325,700.000	
	TSY 4 1/2% 2019 4.5 03/07/19	2,000,000.00	2,188,800.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	5,500,000.00	6,102,250.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	7,700,000.00	11,148,830.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	8,200,000.00	9,219,260.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	5,700,000.00	5,877,840.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	5,500,000.00	6,998,750.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	5,500,000.00	6,054,400.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	8,500,000.00	8,772,000.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	8,000,000.00	8,401,600.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,500,000.00	7,514,000.000	
	TSY 4.5 2042 4.5 12/07/42	6,500,000.00	7,185,100.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,000,000.00	6,420,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,000,000.00	3,185,100.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	6,606,600.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 28	167,100,000.00	188,352,880.000	
	組入時価比率 : 8.32%		(24,904,017,794)	
	合計時価比率 : 8.64%			
	CANADA 5.5 06/01/10	2,000,000.00	2,124,640.000	
	CANADA 4.0 09/01/10	4,500,000.00	4,718,295.000	
	CANADA 2.75 12/01/10	1,500,000.00	1,547,820.000	
	CANADA 6.0 06/01/11	5,000,000.00	5,564,850.000	
	CANADA 3.75 09/01/11	4,500,000.00	4,784,895.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	7,000,000.00	7,864,150.000	
	CANADA 5.25 06/01/13	7,000,000.00	8,038,800.000	

	CANADA 5.0 06/01/14	4,000,000.00	4,623,480.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	4,500,000.00	5,120,055.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	4,000,000.00	4,431,440.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	4,000,000.00	4,426,560.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	4,500,000.00	5,055,075.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	2,700,000.00	4,077,378.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,700,000.00	2,832,744.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,500,000.00	3,920,925.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	6,000,000.00	7,734,180.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	5,500,000.00	7,317,200.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,000,000.00	6,237,500.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 18	75,900,000.00	90,419,987.000	
	組入時価比率 : 2.22%		(6,638,635,446)	
	合計時価比率 : 2.30%			
	SWEDEN 5.25 03/15/11	11,000,000.00	11,887,810.000	
	SWEDEN 5.5 10/08/12	16,000,000.00	18,093,600.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	29,000,000.00	35,594,600.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	18,000,000.00	20,346,300.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	13,000,000.00	13,476,190.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	23,000,000.00	25,127,040.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	15,000,000.00	17,166,750.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	24,000,000.00	29,321,520.000	
スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 8	149,000,000.00	171,013,810.000	
	組入時価比率 : 0.63%		(1,896,543,153)	
	合計時価比率 : 0.66%			
	AUSTRIA 5.25 01/04/11	7,000,000.00	7,434,280.000	
	AUSTRIA 5.0 07/15/12	5,000,000.00	5,364,850.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	7,000,000.00	7,396,200.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	5,000,000.00	5,130,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	5,000,000.00	5,322,500.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	5,000,000.00	5,155,000.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	3,000,000.00	2,958,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	3,000,000.00	2,815,500.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	3,000,000.00	3,712,500.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,000,000.00	1,965,000.000	
	BELGIUM 3.0 03/28/10	2,000,000.00	2,027,600.000	
	BELGIUM 5.75 09/28/10	10,000,000.00	10,595,000.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/11	4,000,000.00	4,246,400.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/12	9,000,000.00	9,619,200.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	3,000,000.00	3,096,000.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,450,000.000	

	BELGIUM 4.25 09/28/14	9,000,000.00	9,412,200.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,046,000.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	7,000,000.00	6,763,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	4,000,000.00	4,049,600.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	2,000,000.00	2,249,600.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	5,000,000.00	5,031,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	3,000,000.00	2,977,500.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,000,000.00	5,765,000.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,000,000.00	5,452,050.000	
	BUNDESOBL 3.25 04/09/10	12,000,000.00	12,246,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.25 07/04/10	20,000,000.00	21,067,000.000	
	BUNDESOBL 2.5 10/08/10	15,000,000.00	15,217,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.25 01/04/11	10,000,000.00	10,700,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/11	15,000,000.00	16,199,250.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 01/04/12	15,000,000.00	16,311,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	13,000,000.00	14,234,350.000	
	BUNDESOBL 4.25 10/12/12	13,000,000.00	13,978,900.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	9,000,000.00	9,758,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	18,000,000.00	19,121,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	11,000,000.00	12,001,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	8,000,000.00	8,744,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	9,000,000.00	9,585,450.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	12,000,000.00	12,420,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	5,000,000.00	5,222,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	14,000,000.00	15,054,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	7,000,000.00	7,445,900.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	8,000,000.00	8,768,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	10,000,000.00	10,820,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	5,000,000.00	5,511,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	4,000,000.00	5,112,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	5,000,000.00	6,657,500.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,500,000.00	6,704,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	5,000,000.00	5,575,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	4,000,000.00	5,228,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	6,500,000.00	7,874,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	8,500,000.00	9,530,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	9,000,000.00	9,274,860.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	6,000,000.00	6,511,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,000,000.00	1,178,100.000	
	SPAIN 3.25 07/30/10	13,000,000.00	13,248,300.000	
	SPAIN 5.4 07/30/11	10,000,000.00	10,686,400.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	10,000,000.00	10,673,300.000	

	SPAIN 6.15 01/31/13	7,500,000.00	8,353,350.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	5,000,000.00	5,212,900.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	5,500,000.00	5,884,725.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	5,000,000.00	5,150,000.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.00	6,815,200.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	5,000,000.00	5,012,500.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	8,000,000.00	9,012,560.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	2,000,000.00	2,026,200.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,000,000.00	1,051,800.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	5,000,000.00	5,929,700.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,000,000.00	5,758,100.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,000,000.00	4,686,450.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,000,000.00	3,208,500.000	
	FINLAND 5.75 02/23/11	1,500,000.00	1,613,025.000	
	FINLAND 4.25 09/15/12	3,000,000.00	3,147,000.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	3,000,000.00	3,299,400.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	3,000,000.00	3,155,100.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	3,000,000.00	3,067,500.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/10	9,000,000.00	9,432,000.000	
	FR TREASURY 2.5 07/12/10	5,000,000.00	5,063,500.000	
	FRANCE OAT 5.5 10/25/10	15,000,000.00	15,954,000.000	
	FRANCE OAT 6.5 04/25/11	13,000,000.00	14,284,400.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/11	14,000,000.00	15,057,000.000	
	FRANCE OAT 5.0 04/25/12	13,000,000.00	14,069,900.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	12,000,000.00	12,966,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	15,000,000.00	15,835,500.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	11,000,000.00	11,628,100.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	7,000,000.00	7,406,700.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	5,000,000.00	5,302,000.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	9,000,000.00	9,291,600.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	7,000,000.00	6,997,200.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	8,000,000.00	8,058,400.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	9,000,000.00	10,081,800.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	8,000,000.00	8,252,800.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,524,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	10,000,000.00	10,466,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	8,000,000.00	8,499,200.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,000,000.00	5,720,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	8,000,000.00	8,016,000.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	5,000,000.00	7,526,500.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.00	5,207,500.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,000,000.00	5,005,600.000	

	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	6,000,000.00	7,145,400.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	7,000,000.00	8,694,000.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,000,000.00	7,765,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,000,000.00	2,003,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	7,000,000.00	7,067,200.000	
	HELLENIC REPUBLIC 3.1 04/20/10	3,000,000.00	3,007,500.000	
	HELLENIC REPUBLIC 3.8 03/20/11	5,000,000.00	4,965,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 3.9 08/20/11	8,000,000.00	7,932,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 5.25 05/18/12	5,000,000.00	5,062,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.1 08/20/12	3,000,000.00	2,942,400.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.6 05/20/13	4,000,000.00	3,981,200.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.5 05/20/14	5,000,000.00	4,831,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 3.7 07/20/15	2,000,000.00	1,866,300.000	
	HELLENIC REPUBLIC 3.6 07/20/16	3,000,000.00	2,739,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.3 07/20/17	7,000,000.00	6,497,400.000	
	HELLENIC REPUBLIC 6.5 10/22/19	2,000,000.00	2,159,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 5.9 10/22/22	4,000,000.00	4,102,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.7 03/20/24	4,000,000.00	3,504,600.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.5 09/20/37	4,000,000.00	3,108,000.000	
	HELLENIC REPUBLIC 4.6 09/20/40	3,000,000.00	2,296,200.000	
	IRISH 4.0 11/11/11	1,500,000.00	1,531,380.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	2,000,000.00	2,101,480.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	2,000,000.00	2,056,440.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,967,300.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	2,000,000.00	1,949,140.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,951,340.000	
	ITALY BTPS 4.0 03/01/10	7,000,000.00	7,159,670.000	
	ITALY BTPS 2.75 06/15/10	20,000,000.00	20,062,000.000	
	ITALY BTPS 5.5 11/01/10	17,000,000.00	17,907,970.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/11	20,000,000.00	21,082,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	20,000,000.00	21,078,000.000	
	BTPS 4.25 10/15/12	5,000,000.00	5,145,500.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	10,000,000.00	10,451,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	15,000,000.00	15,405,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	9,000,000.00	9,243,900.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	9,000,000.00	9,221,400.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	9,000,000.00	8,982,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	11,000,000.00	10,886,700.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	10,000,000.00	9,985,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	8,590,400.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,000,000.00	5,091,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	11,000,000.00	11,158,400.000	

	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.00	7,998,400.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	9,000,000.00	9,016,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	8,000,000.00	7,352,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,000,000.00	2,985,000.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	5,000,000.00	7,160,000.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	4,000,000.00	4,960,800.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	11,000,000.00	12,669,800.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000,000.00	10,015,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	12,000,000.00	12,942,000.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	6,000,000.00	6,315,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,000,000.00	7,756,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	7,500,000.00	6,196,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	5,000,000.00	4,795,000.000	
	NETHERLANDS 5.5 07/15/10	9,500,000.00	10,020,600.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/11	10,000,000.00	10,692,000.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/12	5,000,000.00	5,390,000.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	2,600,000.00	2,756,260.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	4,000,000.00	4,153,200.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	4,000,000.00	4,020,400.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,219,000.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,344,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	3,000,000.00	3,093,000.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,000,000.00	5,541,200.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,500,000.00	4,123,350.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	5,000,000.00	4,970,000.000	
	PORTUGUESE 5.85 05/20/10	3,000,000.00	3,145,800.000	
	PORTUGUESE 5.15 06/15/11	4,000,000.00	4,251,560.000	
	PORTUGUESE 5.0 06/15/12	3,000,000.00	3,167,100.000	
	PORTUGUESE 4.375 06/16/14	3,000,000.00	3,124,800.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	5,132,500.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	2,062,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	3,091,170.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	2,891,370.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	2,846,400.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 176	1,205,600,000.00	1,274,600,230.000	
	組入時価比率 : 50.76%		(152,021,569,432)	
	合計時価比率 : 52.74%			
	DENMARK 4.0 11/15/10	13,000,000.00	13,345,800.000	
	DENMARK 6.0 11/15/11	24,000,000.00	26,356,800.000	
	DENMARK 5.0 11/15/13	25,000,000.00	27,300,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	23,000,000.00	24,131,600.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	20,000,000.00	20,960,000.000	

	DENMARK 7.0 11/10/24	15,000,000.00	20,175,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	33,000,000.00	36,638,250.000	
デンマーク クローネ小計	銘柄数 : 7	153,000,000.00	168,907,450.000	
	組入時価比率 : 0.90%		(2,704,208,275)	
	合計時価比率 : 0.94%			
	NORWAY 6.0 05/16/11	16,000,000.00	17,216,000.000	
	NORWAY 6.5 05/15/13	16,000,000.00	18,280,000.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	10,000,000.00	10,875,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	17,000,000.00	17,763,300.000	
ノルウェー クローネ小計	銘柄数 : 4	59,000,000.00	64,134,300.000	
	組入時価比率 : 0.27%		(815,146,953)	
	合計時価比率 : 0.28%			
	POLAND 5.75 03/24/10	3,000,000.00	3,028,500.000	
	POLAND 6.0 11/24/10	12,000,000.00	12,212,400.000	
	POLAND 4.25 05/24/11	10,000,000.00	9,820,000.000	
	POLAND 4.75 04/25/12	12,000,000.00	11,952,000.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25 04/25/13	7,000,000.00	7,070,070.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	12,000,000.00	12,000,000.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	12,000,000.00	12,625,200.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,940,000.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.00	9,270,000.000	
ポーランド ズロチ小計	銘柄数 : 9	89,000,000.00	89,918,170.000	
	組入時価比率 : 0.87%		(2,612,122,839)	
	合計時価比率 : 0.91%			
	SINGAPORE 4.625 07/01/10	2,600,000.00	2,746,198.000	
	SINGAPORE 2.625 04/01/12	4,000,000.00	4,172,240.000	
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	2,000,000.00	2,070,900.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	3,000,000.00	3,311,760.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	2,000,000.00	2,247,800.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,000,000.00	1,154,680.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	3,017,616.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,000,000.00	1,045,450.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,000,000.00	1,075,920.000	
シンガポール ・ドル小計	銘柄数 : 9	19,400,000.00	20,842,564.000	
	組入時価比率 : 0.42%		(1,250,762,266)	
	合計時価比率 : 0.43%			
	MALAYSIA 3.869 04/13/10	20,600,000.00	20,808,472.000	
	MALAYSIA 3.718 06/15/12	22,500,000.00	23,030,100.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	5,900,000.00	6,317,425.000	

	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,219,800.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,878,350.000	
マレーシア リングット小計	銘柄数 : 5	61,000,000.00	62,254,147.000	
	組入時価比率 : 0.52%		(1,552,618,426)	
	合計時価比率 : 0.54%			
合計			288,232,591,008	
			(288,232,591,008)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 67銘柄	31.33%	32.56%
英ポンド	国債証券 28銘柄	8.32%	8.64%
カナダドル	国債証券 18銘柄	2.22%	2.30%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.63%	0.66%
ユーロ	国債証券 176銘柄	50.76%	52.74%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.90%	0.94%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.27%	0.28%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.87%	0.91%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.42%	0.43%
マレーシアリングット	国債証券 5銘柄	0.52%	0.54%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,756,967,657	3,693,672
投資証券		12,127,188,000	3,886,712,900
未収配当金		89,696,976	98,295,769
流動資産合計		13,973,852,633	3,988,702,341
資産合計		13,973,852,633	3,988,702,341
負債の部			
流動負債			
未払金		1,744,999,000	-
未払解約金		419,000	15,000
流動負債合計		1,745,418,000	15,000
負債合計		1,745,418,000	15,000
純資産の部			
元本等			
元本		11,407,773,374	6,889,410,246
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	820,661,259	2,900,722,905
剰余金合計		820,661,259	2,900,722,905
元本等合計		12,228,434,633	3,988,687,341
純資産合計		12,228,434,633	3,988,687,341
負債・純資産合計		13,973,852,633	3,988,702,341

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 同左
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日に、当該金額を計上しております。 ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年6月7日から平成20年6月6日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年6月7日から平成21年6月8日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	1,859,132,746円	11,407,773,374円
同期中追加設定元本額	15,817,173,929円	4,127,083,127円
同期中解約元本額	6,268,533,301円	8,645,446,255円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	186,990,802円	173,770,268円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	942,691,486円	1,101,619,929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）	8,500,431,040円	2,551,902,247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）	453,237,343円	593,062,407円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,324,422,703円	1,868,756,714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）	- 円	600,298,681円
（合計）	11,407,773,374円	6,889,410,246円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	11,407,773,374口	6,889,410,246口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,900,722,905円であります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資証券	12,127,188,000	2,389,166,517	3,886,712,900	2,340,753,887
合計	12,127,188,000	2,389,166,517	3,886,712,900	2,340,753,887

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.0719円	0.5790円
（1万口当たり純資産額）	（10,719円）	（5,790円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	178	66,928,000	
	M I Dリート投資法人	288	38,736,000	
	日本コマースシャル投資法人	404	32,926,000	
	森ヒルズリート投資法人	250	70,800,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	152	43,791,200	
	産業ファンド投資法人	124	30,764,400	
	日本ビルファンド投資法人	850	761,600,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	695	512,215,000	
	日本リテールファンド投資法人	606	229,674,000	
	オリックス不動産投資法人	395	169,850,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	980	211,680,000	
	プレミア投資法人	206	45,320,000	
	東急リアル・エステート投資法人	266	145,236,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	152	98,800,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	479	265,845,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	316	106,808,000	
	森トラスト総合リート投資法人	286	200,486,000	
	日本レジデンシャル投資法人	388	24,676,800	
	東京グロースリート投資法人	85	5,780,000	
	フロンティア不動産投資法人	251	114,958,000	
	クレッシェンド投資法人	170	16,660,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	192	100,416,000	

	福岡リート投資法人	168	63,000,000	
	プロスペクト・レジデンシャル投資法人	118	6,572,600	
	ジャパン・シングルレジデンス投資法人	88	4,576,000	
	ケネディクス不動産投資法人	314	70,022,000	
	ジョイント・リート投資法人	164	17,810,400	
	ラサールジャパン投資法人	189	13,154,400	
	F Cレジデンシャル投資法人	51	6,737,100	
	D Aオフィス投資法人	539	94,864,000	
	阪急リート投資法人	134	51,054,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	119	33,082,000	
	エルシーピー投資法人	144	6,292,800	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	144	14,443,200	
	トップリート投資法人	243	72,900,000	
	クリード・オフィス投資法人	209	13,940,300	
	ビ・ライフ投資法人	77	14,060,200	
	日本ホテルファンド投資法人	66	10,705,200	
	リプラス・レジデンシャル投資法人	263	18,962,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	242	80,586,000	
合計		10,985	3,886,712,900	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		260,323,005	62,722,086
コール・ローン		44,478,603	60,186,213
投資証券		12,169,436,341	5,723,679,832
投資信託受益証券		3,436,969,479	1,256,332,274
未収配当金		143,203,053	76,119,114
流動資産合計		16,054,410,481	7,179,039,519
資産合計		16,054,410,481	7,179,039,519
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	7,000
流動負債合計		-	7,000
負債合計		-	7,000
純資産の部			
元本等			
元本		15,439,118,319	15,713,809,346
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	615,292,162	8,534,776,827
剰余金合計		615,292,162	8,534,776,827
元本等合計		16,054,410,481	7,179,032,519
純資産合計		16,054,410,481	7,179,032,519
負債・純資産合計		16,054,410,481	7,179,039,519

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式（*）、投資証券及び投資信託受益証券 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）、金融商品取引所等が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 （*）当期間中に、権利による株式配当を受けたものです。	投資証券及び投資信託受益証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券及び投資信託受益証券の配当落ち日に、当該金額を計上しております。 ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、投資証券及び投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、いまだ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成19年11月7日から平成20年11月6日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成20年11月7日から平成21年11月6日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における		
当該親投資信託の元本額	12,430,043,311円	15,439,118,319円
同期中追加設定元本額	6,684,730,854円	3,909,683,658円
同期中解約元本額	3,675,655,846円	3,634,992,631円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	80,561,785円	95,637,011円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	409,244,993円	620,275,378円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	14,707,328,848円	14,557,853,138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）	241,982,693円	440,043,819円
（合計）	15,439,118,319円	15,713,809,346円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	15,439,118,319口	15,713,809,346口
*3 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,534,776,827円であります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日		自平成20年1月12日 至平成21年1月13日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資証券	12,169,436,341	2,042,620,858	5,723,679,832	1,029,910,739
投資信託受益証券	3,436,969,479	780,590,906	1,256,332,274	163,706,643
合計	15,606,405,820	2,823,211,764	6,980,012,106	1,193,617,382

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

区分	自平成19年1月26日 至平成20年1月11日	自平成20年1月12日 至平成21年1月13日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組みと利用目的	当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし、信託約款、社団法人投資信託協会の定めた諸規則及びデリバティブ取引に関する社内基準に従って行われております。	同左
3. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
4. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用管理部門がコンプライアンス担当者の承認を得て行っております。また、運用部門から独立した部署が投資信託約款および関連法令等に基づき管理しており、定期的に経営層に報告しております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成20年1月11日現在	平成21年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.0399円	0.4569円
（1万口当たり純資産額）	（10,399円）	（4,569円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,700.00	566,286.000	
	ALEXANDER'S INC.	700.00	149,135.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	40,400.00	1,963,440.000	
	CEDAR SHOPPING CENTERS INC	14,800.00	102,416.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7,900.00	65,254.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	30,500.00	396,500.000	
	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	30,137.00	317,342.610	
	AGREE REALTY CORP	4,300.00	61,533.000	
	BRE PROPERTIES -CL A	11,000.00	269,390.000	
	MAGUIRE PROPERTIES INC.	16,500.00	33,000.000	
	NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	31,200.00	761,904.000	
	SL GREEN	19,805.00	360,451.000	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	12,800.00	316,672.000	
	AMB PROPERTY CORP	31,000.00	637,670.000	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,800.00	1,419,190.000	
	LEXINGTON REALTY TRUST	25,500.00	126,990.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,200.00	526,656.000	
	CBL & ASSOCIATES	16,700.00	108,216.000	
	MACK CALI	18,800.00	391,040.000	
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	11,600.00	89,784.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,300.00	335,615.000	
	COUSINS PROPERTIES INC	12,100.00	144,111.000	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	9,800.00	98,098.000	
	EQUITY ONE INC	9,800.00	145,138.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,100.00	112,023.000	
	DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY CO	45,800.00	275,716.000	
	DUKE REALTY TRUST	53,800.00	499,264.000	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	29,300.00	37,797.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,500.00	536,435.000	
	EQUITY RESIDENTIAL	89,800.00	2,186,630.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,800.00	1,038,510.000	
	FIRST INDUSTRIAL RT	12,500.00	92,750.000	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	75,300.00	111,444.000	
	GLIMCHER REALTY TRUST	11,800.00	39,766.000	
	FELCOR LODGING TR INC	16,700.00	28,724.000	

HOME PROPERTIES INC	9,400.00	300,612.000	
HCP INC	79,300.00	1,723,189.000	
HRPT PROPERTIES TRUST	69,100.00	227,339.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13,500.00	246,780.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	22,400.00	468,608.000	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS	24,000.00	39,120.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27,600.00	381,432.000	
HEALTH CARE REIT INC	36,701.00	1,325,640.120	
EAST GROUP	6,800.00	213,112.000	
KIMCO REALTY	85,299.00	1,395,491.640	
KILROY REALTY CORP	11,000.00	296,560.000	
LTC PROPERTIES INC	7,100.00	123,895.000	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	32,800.00	488,064.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	27,400.00	517,586.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	30,500.00	192,760.000	
THE MACERICH COMPANY	24,200.00	366,872.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,500.00	230,360.000	
ACADIA REALTY TRUST	12,600.00	165,312.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	164,100.00	1,099,470.000	
MID AMERICA	11,900.00	355,810.000	
NATIONAL HEALTH INVS INC	6,800.00	174,896.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	14,100.00	137,898.000	
PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	75,166.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500.00	70,245.000	
GETTY REALTY CORP	7,300.00	139,649.000	
POST PROPERTIES, INC	11,300.00	158,652.000	
PS BUSINESS PARKS	4,700.00	179,540.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	37,240.000	
REALTY INCOME CORP	31,600.00	616,516.000	
REGENCY	22,700.00	862,600.000	
UDR INC	44,300.00	499,704.000	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15,700.00	368,322.000	
SAUL CENTERS INC	3,600.00	120,564.000	
PROLOGIS	85,400.00	1,056,398.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	70,800.00	3,096,084.000	
SOVRAN SELF STORAGE INC	5,800.00	152,714.000	
PUBLIC STORAGE	37,238.00	2,373,550.120	
SUN COMMUNITIES INC	7,400.00	92,130.000	
TAUBMAN CENTERS INC	24,400.00	513,132.000	
TANGER FACTORY OUTLET	8,500.00	266,220.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600.00	76,492.000	
VENTAS INC	42,200.00	1,100,998.000	

	VORNADO REALTY TRUST	47,500.00	2,469,050.000	
	WASHINGTON REIT	18,400.00	427,616.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	19,800.00	325,908.000	
	CAPLEASE INC	16,700.00	33,233.000	
	GRAMERCY CAPITAL CORP	7,136.00	9,134.080	
	BIOMED REALTY TRUST INC	20,000.00	212,200.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	17,309.00	323,678.300	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	36,500.00	325,945.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	17,000.00	215,560.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	20,400.00	108,936.000	
	U-STORE-IT TRUST	18,400.00	79,120.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,600.00	699,976.000	
	INLAND REAL ESTATE CORP	15,900.00	168,540.000	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	39,468.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,300.00	160,181.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	38,000.00	198,360.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	43,000.00	491,060.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	47,000.00	181,890.000	
米ドル小計	銘柄数 : 95	2,424,125.00	43,141,468.870	
	組入時価比率 : 53.77%		(3,860,298,634)	
	合計時価比率 : 55.31%			
	BRITISH LAND CO PLC	188,200.00	1,065,212.000	
	BRIXTON PLC	74,000.00	117,808.000	
	DERWENT LONDON PLC	29,400.00	235,200.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	46,000.00	115,000.000	
	HAMMERSON PLC	97,200.00	535,086.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	154,900.00	1,455,285.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	56,300.00	38,284.000	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	89,000.00	457,015.000	
	SHAFTESBURY PLC	40,000.00	137,280.000	
	SEGRO PLC	136,892.00	360,984.200	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	62,400.00	162,240.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 11	974,292.00	4,679,394.700	
	組入時価比率 : 8.62%		(618,709,567)	
	合計時価比率 : 8.86%			
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	9,100.00	107,016.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,900.00	126,647.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	20,000.00	226,000.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	24,400.00	198,372.000	
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	23,400.00	127,530.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	10,100.00	227,048.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	38,300.00	547,690.000	

	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	10,500.00	167,475.000	
	DUNDEE REAL ESTATE INV TRUST	7,800.00	91,728.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	8,000.00	86,240.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	21,000.00	87,570.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,000.00	290,950.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 12	192,500.00	2,284,266.000	
	組入時価比率 : 2.34%		(167,710,810)	
	合計時価比率 : 2.40%			
	BEFIMMO	4,633.00	333,576.000	
	COFINIMMO SA	5,000.00	508,900.000	
	INTERVEST OFFICES	4,300.00	84,710.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	3,100.00	108,190.000	
	GECINA SA	6,600.00	385,209.000	
	ICADE EMGP	5,400.00	327,996.000	
	UNIBAIL-RODAMCO	27,010.00	2,929,234.500	
	ACANTHE DEVELOPMEN	89,500.00	132,460.000	
	KLEPIERRE	26,300.00	511,403.500	
	SILIC	4,900.00	369,239.500	
	FONCIERE DES REGIONS	8,700.00	426,169.500	
	MERCIALYS	5,565.00	127,883.700	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES	10,900.00	258,221.000	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL	6,000.00	50,400.000	
	VASTNED RETAIL	5,300.00	205,110.000	
	CORIO NV	14,700.00	535,668.000	
	WERELDHAVE NV	6,100.00	385,764.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 17	234,008.00	7,680,134.700	
	組入時価比率 : 12.76%		(916,009,666)	
	合計時価比率 : 13.12%			
	LINK REIT/THE	715,000.00	10,052,900.000	
	GZI REAL ESTATE INVESTMENT TRU	393,000.00	707,400.000	
	CHAMPION REIT	430,000.00	838,500.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 3	1,538,000.00	11,598,800.000	
	組入時価比率 : 1.86%		(133,850,152)	
	合計時価比率 : 1.92%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	148,600.00	144,142.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	220,000.00	228,800.000	
	ING PROPERTY TRUST	245,000.00	161,700.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 3	613,600.00	534,642.000	
	組入時価比率 : 0.38%		(27,101,003)	
	合計時価比率 : 0.39%			
投資証券計			5,723,679,832	

			(5,723,679,832)	
投資信託受益証券	FORTUNE REAL ESTATE INVESTME	478,000.00	1,099,400.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	478,000.00	1,099,400.000	
	組入時価比率 : 0.18%		(12,687,076)	
	合計時価比率 : 0.18%			
	CAPITAMALL TRUST	530,000.00	885,100.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	345,000.00	486,450.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	570,000.00	555,750.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	790,000.00	639,900.000	
シンガポール・ドル 小計	銘柄数 : 4	2,235,000.00	2,567,200.000	
	組入時価比率 : 2.15%		(154,057,672)	
	合計時価比率 : 2.21%			
	MACQUARIE LEISURE	109,974.00	120,971.400	
	BUNNINGS WAREHOUSE	181,500.00	292,215.000	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	458,300.00	531,628.000	
	MIRVAC GROUP	542,300.00	699,567.000	
	ING OFFICE FUND	530,600.00	392,644.000	
	MACQUARIE COUNTRYWIDE TRUST	402,400.00	100,600.000	
	CFS RETAIL PROPERTY	593,300.00	1,079,806.000	
	GPT GROUP	1,532,800.00	1,387,184.000	
	ING INDUSTRIAL FUND	795,800.00	155,181.000	
	ABACUS PROPERTY GR	344,600.00	91,319.000	
	VALAD PROPERTY GROUP	696,000.00	73,080.000	
	MACQUARIE OFFICE TRUST	664,200.00	172,692.000	
	MACQUARIE DDR TRUST	398,100.00	28,265.100	
	STOCKLAND	479,100.00	1,825,371.000	
	WESTFIELD GROUP	634,300.00	8,766,026.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	1,326,400.00	1,094,280.000	
	GOODMAN GROUP	1,020,200.00	1,020,200.000	
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUND	154,000.00	26,180.000	
	BABCOCK & BROWN JA	235,900.00	99,078.000	
オーストラリアドル 小計	銘柄数 : 19	11,099,774.00	17,956,287.500	
	組入時価比率 : 15.18%		(1,089,587,526)	
	合計時価比率 : 15.61%			
投資信託受益証券計			1,256,332,274	
			(1,256,332,274)	
合計			6,980,012,106	
			(6,980,012,106)	

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
 3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 95銘柄	53.77%	55.31%
英ポンド	投資証券 11銘柄	8.62%	8.86%
カナダドル	投資証券 12銘柄	2.34%	2.40%
ユーロ	投資証券 17銘柄	12.76%	13.12%
香港ドル	投資証券 3銘柄	1.86%	1.92%
香港ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.18%	0.18%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	2.15%	2.21%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 19銘柄	15.18%	15.61%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.38%	0.39%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	5,857,849,469円
負債総額	8,730,320円
純資産総額（ - ）	5,849,119,149円
発行済数量	9,399,976,960口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6222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21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	154,878,728,521円
負債総額	220,427,707円
純資産総額（ - ）	154,658,300,814円
発行済数量	156,795,815,863口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9864円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	177,121,899,311円
負債総額	52,731,560円
純資産総額（ - ）	177,069,167,751円
発行済数量	204,281,343,079口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8668円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	237,644,771,208円
負債総額	49,200,000円
純資産総額（ - ）	237,595,571,208円
発行済数量	221,684,357,182口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0718円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	295,239,501,749円
負債総額	1,801,609,697円
純資産総額（ - ）	293,437,892,052円
発行済数量	266,444,297,907口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1013円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	4,113,463,838円
負債総額	25,000,000円
純資産総額（ - ）	4,088,463,838円
発行済数量	6,766,981,470口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6042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21年2月5日現在

項目	金額又は口数
資産総額	6,801,338,074円
負債総額	438,305,451円
純資産総額（ - ）	6,363,032,623円
発行済数量	15,597,221,119口
1口当たり純資産額（ / ）	0.4080円

第5【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	12,252,099,717	3,511,628,988
第2期	2,271,286,181	1,714,151,191

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図

会社の意思決定機構

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

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

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

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決めます。

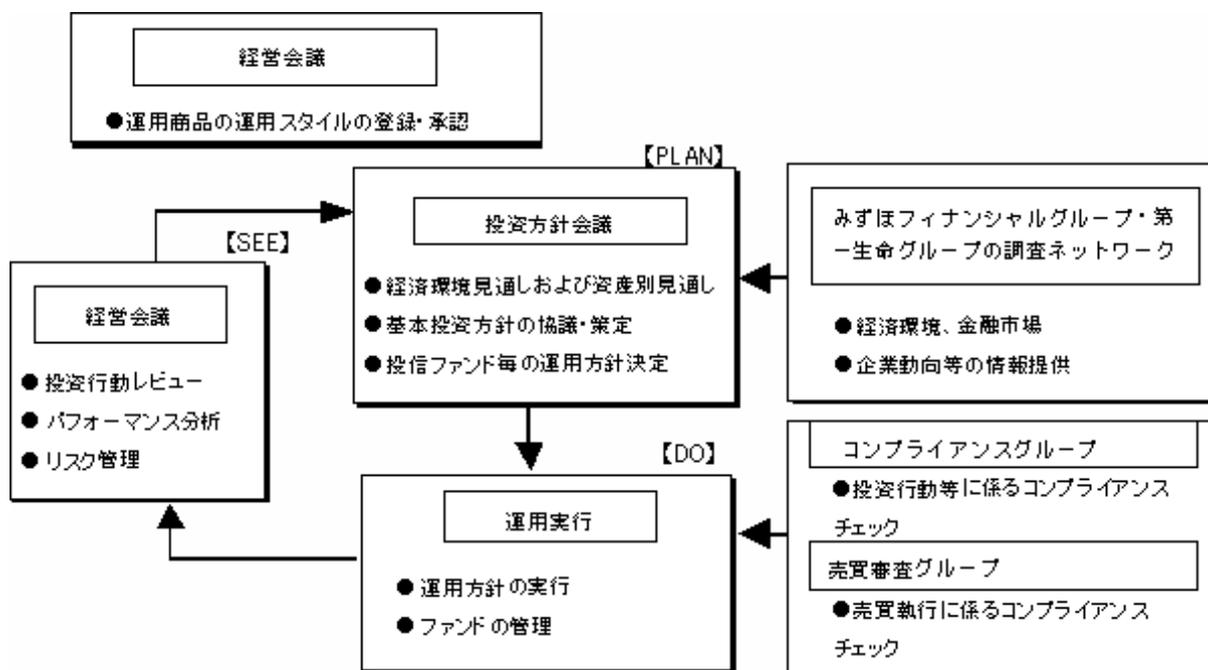
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成21年1月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年1月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は250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	18	72,411,517,258
追加型株式投資信託	219	2,693,492,663,589
単位型公社債投資信託	13	103,437,958,654
追加型公社債投資信託	0	0
合計	250	2,869,342,139,501

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、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）または「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

なお、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20年9月30日）は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成20年8月7日内閣府令第50号）附則第4条により改正前の中間財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

3．委託会社は、証券取引法第193条の2の規定に基づき第22期事業年度（自平成18年4月1日至平成19年3月31日）の財務諸表について、また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第23期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）の財務諸表について、新日本監査法人の監査を受け、第24期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20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。

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

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
(資産の部)							
流動資産							
現金・預金			-		13,267,152		
現金			1,087		-		
預金			11,618,410		-		
支払委託金			5,262		-		
収益分配金		2,122			-		
償還金		3,139			-		
前払費用			52,870			64,301	
未収委託者報酬			3,305,752			3,423,783	
未収収益	2		1,989,832			1,933,135	
繰延税金資産			463,175			553,910	
その他			27,610			43,115	
流動資産計			17,464,001	81.0		19,285,400	73.5
固定資産							
有形固定資産			566,274	2.6		488,486	1.9
建物	1	385,746			335,163		
器具備品	1	180,528			153,323		
無形固定資産			621,524	2.9		616,621	2.3
商標権	1	2,872			2,104		
ソフトウェア	1	610,731			606,677		
電話加入権		7,148			7,148		
電話施設利用権	1	771			691		
投資その他の資産			2,897,263	13.5		5,842,772	22.3
投資有価証券		127,525			3,097,362		
関係会社株式		1,410,844			1,261,144		
繰延税金資産		144,409			233,849		
長期差入保証金		1,143,241			1,194,310		
預託金		1,000			-		
その他		97,471			83,032		
貸倒引当金		27,228			26,925		
固定資産計			4,085,063	19.0		6,947,880	26.5
資産合計			21,549,064	100.0		26,233,280	100.0

区分	注記 番号	第22期（平成19年3月31日現在）			第23期（平成20年3月31日現在）		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	構成比 (%)
（負債の部）							
流動負債							
預り金			173,471		162,809		
未払金			1,775,461		2,186,170		
未払収益分配金		8,569		8,470			
未払償還金		53,576		50,930			
未払手数料		1,464,902		1,527,000			
その他未払金		248,414		599,769			
未払費用	2		1,656,967		1,653,424		
未払法人税等			2,262,679		2,575,999		
未払消費税等			279,396		316,821		
前受収益			3,433		-		
賞与引当金			557,836		687,832		
流動負債計			6,709,246	31.1	7,583,058	28.9	
固定負債							
役員退職慰労引当金			121,274		179,237		
退職給付引当金			182,197		334,280		
固定負債計			303,471	1.4	513,518	1.9	
負債合計			7,012,717	32.5	8,096,577	30.8	
（純資産の部）							
株主資本							
資本金			2,000,000	9.3	2,000,000	7.6	
資本剰余金			2,428,478	11.3	2,428,478	9.3	
資本準備金		2,428,478		2,428,478			
利益剰余金			10,106,875	46.9	13,718,238	52.3	
利益準備金		123,293		123,293			
その他利益剰余金							
別途積立金		4,640,000		7,040,000			
研究開発積立金		300,000		300,000			
運用責任準備積立金		200,000		200,000			
繰越利益剰余金		4,843,582		6,054,944			
株主資本合計			14,535,353	67.5	18,146,716	69.2	
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金			992		10,012		
評価・換算差額等合計			992	0.0	10,012	0.0	
純資産合計			14,536,346	67.5	18,136,703	69.2	
負債・純資産合計			21,549,064	100.0	26,233,280	100.0	

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業収益			32,125,919	100.0		40,502,581	100.0
委託者報酬		25,222,520			32,833,957		
販売手数料		2,990			-		
顧問料		6,207,737			6,804,888		
その他営業収益		692,671			863,734		
営業費用							
支払手数料			11,361,954			14,748,737	
広告宣伝費			539,570			830,858	
公告費			11,612			3,293	
受益証券発行費			51,476			2,167	
調査費			4,740,502			6,268,709	
調査費		2,194,949			2,415,829		
委託調査費		2,545,553			3,852,880		
委託計算費			383,253			345,695	
営業雑経費			690,767			1,143,457	
通信費		23,506			33,290		
印刷費		600,301			1,041,499		
協会費		18,099			22,173		
諸会費		38			41		
支払販売手数料		48,822			46,452		
営業費用計			17,779,137	55.3		23,342,919	57.6
一般管理費							
給料			3,631,878			4,082,147	
役員報酬	1	205,347			223,147		
給料・手当		2,916,607			3,258,097		
賞与		509,924			600,902		
交際費			43,931			44,264	
寄付金			20			4,010	
旅費交通費			249,538			309,129	
租税公課			85,465			103,549	
不動産賃借料			702,262			754,728	
退職給付費用			73,952			88,449	
固定資産減価償却費			357,945			337,808	
福利厚生費			19,772			23,757	
修繕費			65,984			16,394	
賞与引当金繰入			557,836			687,832	
役員退職慰労引当金繰入			53,548			60,123	
役員退職金			528			528	
機器リース料			9,688			1,207	
事務委託費			188,274			279,797	
消耗品費			46,333			76,448	
器具備品費			63,518			10,563	
諸経費			200,560			204,099	
一般管理費計			6,351,042	19.8		7,084,837	17.5
営業利益			7,995,739	24.9		10,074,823	24.9

区分	注記 番号	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)			第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		
		内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)	内訳 (千円)	金額 (千円)	百分比 (%)
営業外収益							
受取配当金		6,575			92,575		
受取利息		16,790			59,127		
時効成立分配金		306			298		
投資信託解約益		138,631			-		
為替差益		-			14,223		
雑収入		3,092			7,064		
営業外収益計			165,395	0.5		173,289	0.4
営業外費用							
為替差損		36,555			-		
時効成立後支払分配金		672			557		
投資信託解約損		-			109,677		
営業外費用計			37,227	0.1		110,234	0.3
経常利益			8,123,907	25.3		10,137,878	25.0
特別利益							
関係会社株式売却益		-			39,215		
貸倒引当金戻入益		-			123		
特別利益計			-	-		39,338	0.1
特別損失							
固定資産除却損	2	11,778			10,466		
貯蔵品処分損		84,277			-		
ゴルフ会員権売却損		-			5,200		
退職給付費用		-			106,395		
特別損失計			96,055	0.3		122,062	0.3
税引前当期純利益			8,027,852	25.0		10,055,154	24.8
法人税、住民税及び事業税					4,252,414		
法人税等	3	3,397,409			-		
法人税等調整額		115,869	3,281,540	10.2	172,622	4,079,792	10.0
当期純利益			4,746,311	14.8		5,975,362	14.8

（３）【株主資本等変動計算書】

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 準備金		その他利益剰余金				
				別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立金	繰越利益 剰余金	
平成18年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	3,240,000	300,000	200,000	3,297,270	11,589,042
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							1,800,000	1,800,000
別途積立金の 積立（千円）				1,400,000			1,400,000	-
当期純利益 （千円）							4,746,311	4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	1,400,000	-	-	1,546,311	2,946,311
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成18年3月31日 残高（千円）	-	11,589,042
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		1,800,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		4,746,311
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	992	992
事業年度中の 変動額合計（千円）	992	2,947,304
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本 剰余金	利益 準備金	利益剰余金				
		資本 準備金		その他利益剰余金				
				別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立金	繰越利益 剰余金	
平成19年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	4,640,000	300,000	200,000	4,843,582	14,535,353
事業年度中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							2,364,000	2,364,000
別途積立金の 積立（千円）				2,400,000			2,400,000	-
当期純利益 （千円）							5,975,362	5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）								
事業年度中の 変動額合計（千円）	-	-	-	2,400,000	-	-	1,211,362	3,611,362
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成19年3月31日 残高（千円）	992	14,536,346
事業年度中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		2,364,000
別途積立金の 積立（千円）		-
当期純利益 （千円）		5,975,362
株主資本以外の 項目の事業年度中 の変動額（純額） （千円）	11,004	11,004
事業年度中の 変動額合計（千円）	11,004	3,600,357
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703

[次へ](#)

重要な会計方針

第22期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)
<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>5. 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しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準および評価方法 (1) 子会社株式および関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 時価のあるもの：同左 時価のないもの：同左</p> <p>2. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>3. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 同左</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度より、法人税法の改正(「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」)に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正法人税法に規定する方法により減価償却費を計上してしております。 なお、この変更による営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(追加情報) 当事業年度より、法人税法の改正(「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号」および「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」)に伴い、平成19年3月31日以前に取得した有形固定資産については、償却可能限度額まで償却が終了した翌事業年度から、残存簿価を5年間で均等償却してしております。 なお、これにより営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 同左</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>5. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左</p>

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職給付会計に関する実務指針（中間報告）（日本公認会計士協会会計制度委員会報告第13号）に定める簡便法（期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）により、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>6. リース取引の処理方法 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用しておりましたが、当事業年度末から原則法に変更いたしました。 この変更は、従業員数の増加に伴い、退職給付債務の数理計算に用いられる基礎率の推定について一定の有効性が確保されることによって、原則法による計算の結果に一定の高い水準の信頼性が得られたことから、退職給付費用の期間損益計算をより適正化するために行ったものであります。 この変更に伴い、当事業年度末における簡便法と原則法により計算した退職給付債務の差額106,395千円を特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法によった場合と比較して、税引前当期純利益は106,395千円減少しております。 なお、上記に記載の通り退職給付債務の算定方法の変更が当事業年度末に行われたため、当中間会計期間は従来の方法によっております。したがって、当中間会計期間は、当事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。</p> <p>(4) 同左</p> <p>6. リース取引の処理方法 同左</p> <p>7. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）
<p>(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準) 当事業年度より、貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等（「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準委員会平成17年12月9日企業会計基準第5号）および「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準委員会平成17年12月9日企業会計基準適用指針第8号））を適用しております。従来の「資本の部」の合計に相当する金額は14,536,346千円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表の純資産の部については、財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則および「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」により作成しております。</p>	

表示方法の変更

第22期（平成19年3月31日現在）	第23期（平成20年3月31日現在）

	<p>金融商品取引業等に関する内閣府令が制定されたことに伴い、以下のとおり表示方法を変更しております。</p> <p>(貸借対照表)</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「現金」および「預金」は、当事業年度から「現金・預金」として表示しております。なお、当事業年度末における「現金」および「預金」の金額はそれぞれ1,205千円、13,265,946千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において区分掲記していた「法人税等」は当事業年度から「法人税、住民税及び事業税」として表示しております。</p>
--	--

注記事項

(貸借対照表関係)

第22期 (平成19年3月31日現在)	第23期 (平成20年3月31日現在)																																
<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>建物</td><td style="text-align: right;">310,209千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td style="text-align: right;">169,451千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td style="text-align: right;">4,814千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td style="text-align: right;">677,186千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td style="text-align: right;">825千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <tr><td>流動資産</td><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">367,395千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">694,532千円</td></tr> </table>	建物	310,209千円	器具備品	169,451千円	商標権	4,814千円	ソフトウェア	677,186千円	電話施設利用権	825千円	流動資産	未収収益	367,395千円	流動負債	未払費用	694,532千円	<p>1. 固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>建物</td><td style="text-align: right;">373,021千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td style="text-align: right;">229,532千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td style="text-align: right;">5,582千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td style="text-align: right;">653,371千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td style="text-align: right;">905千円</td></tr> </table> <p>2. 関係会社項目</p> <p>関係会社に関する資産および負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。</p> <table border="1" style="width: 100%;"> <tr><td>流動資産</td><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">379,257千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">641,087千円</td></tr> </table>	建物	373,021千円	器具備品	229,532千円	商標権	5,582千円	ソフトウェア	653,371千円	電話施設利用権	905千円	流動資産	未収収益	379,257千円	流動負債	未払費用	641,087千円
建物	310,209千円																																
器具備品	169,451千円																																
商標権	4,814千円																																
ソフトウェア	677,186千円																																
電話施設利用権	825千円																																
流動資産	未収収益	367,395千円																															
流動負債	未払費用	694,532千円																															
建物	373,021千円																																
器具備品	229,532千円																																
商標権	5,582千円																																
ソフトウェア	653,371千円																																
電話施設利用権	905千円																																
流動資産	未収収益	379,257千円																															
流動負債	未払費用	641,087千円																															

(損益計算書関係)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)																
<p>1. 役員報酬の限度額</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>取締役</td><td style="text-align: right;">年額250,000千円</td></tr> <tr><td>監査役</td><td style="text-align: right;">年額 50,000千円</td></tr> </table> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>建物</td><td style="text-align: right;">4,738千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td style="text-align: right;">5,960千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td style="text-align: right;">1,079千円</td></tr> </table> <p>3. 法人税等には、法人住民税および事業税が含まれております。</p>	取締役	年額250,000千円	監査役	年額 50,000千円	建物	4,738千円	器具備品	5,960千円	ソフトウェア	1,079千円	<p>1. 役員報酬の限度額</p> <p>同左</p> <p>2. 固定資産除却損の内訳</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>建物</td><td style="text-align: right;">3,634千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td style="text-align: right;">5,271千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td style="text-align: right;">1,560千円</td></tr> </table> <p>3.</p>	建物	3,634千円	器具備品	5,271千円	ソフトウェア	1,560千円
取締役	年額250,000千円																
監査役	年額 50,000千円																
建物	4,738千円																
器具備品	5,960千円																
ソフトウェア	1,079千円																
建物	3,634千円																
器具備品	5,271千円																
ソフトウェア	1,560千円																

(株主資本等変動計算書関係)

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成18年6月28日 定時株主総会	普通 株式	1,800,000	75,000	平成18年3月31日	平成18年6月29日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成19年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,364,000	98,500	平成19年3月31日	平成19年6月29日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(リース取引関係)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)				第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)			
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	91,585千円	-	91,585千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額相当額	39,283千円	-	39,283千円	減価償却累計額相当額	29,608千円	-	29,608千円
期末残高相当額	52,301千円	-	52,301千円	期末残高相当額	60,993千円	-	60,993千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料	18,391千円			未経過リース料	22,595千円		
期末残高相当額		38,155千円	56,546千円	期末残高相当額		39,602千円	62,197千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額			
支払リース料		20,361千円		支払リース料		25,173千円	
減価償却費相当額		16,593千円		減価償却費相当額		20,191千円	
支払利息相当額		1,717千円		支払利息相当額		1,754千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2.オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。				2.オペレーティング・リース取引 同左			

（有価証券関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	60,000	61,674	1,674
小計	60,000	61,674	1,674
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	60,000	61,674	1,674

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
1,661,631	138,848	217

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 65,851千円

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

該当事項はありません。

第23期（平成20年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価（千円）	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,031,000	3,014,115	16,884
小計	3,031,000	3,014,115	16,884
合計	3,031,000	3,014,115	16,884

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
574,322	3,196	112,873

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 83,246千円

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

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1．取引の状況に関する事項

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第22期(平成19年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	59,269	-	59,231	38
合計		59,269	-	59,231	38

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

第23期（平成20年3月31日現在）

1．取引の状況に関する事項

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	
(1)取引の内容	為替予約取引を利用しております。
(2)取引に対する取組方針	実需の範囲内でのみデリバティブ取引を利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
(3)取引の利用目的	その他有価証券に含まれる為替変動リスクを低減する目的で行っております。
(4)取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。
(5)取引に係るリスク管理体制	取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。また、リスク管理については当該担当所管にて実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。
(6)取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2．取引の時価等に関する事項

区分	種類	第23期(平成20年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	523,028	-	508,267	14,760
	合計	523,028	-	508,267	14,760

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（退職給付関係）

第22期（平成19年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、簡便法（退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法）を適用しております。

(1)	退職給付債務	(平成19年3月31日現在)	(千円)
	退職給付債務	(期末自己都合要支給額)	182,197
	退職給付引当金		182,197
(2)	退職給付費用		(千円)
	勤務費用		48,032
	確定拠出年金	拠出額	25,920
	退職給付費用		73,952

第23期（平成20年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

当社は、当事業年度末から原則法を適用しております。

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

3．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第23期 (平成20年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産および繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第22期	第23期
	(平成19年3月31日現在)	(平成20年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	172,434	197,866
未払事業所税	5,303	5,714
賞与引当金	227,039	279,947
未払法定福利費	24,208	27,884
未払確定拠出年金掛金	1,506	2,610
減価償却超過額（一括償却資産）	12,020	10,139
繰延資産償却超過額（税法上）	20,071	27,940
その他（未払金等）	590	1,807
退職給付引当金	74,154	136,052
役員退職慰労引当金	49,358	72,949
ゴルフ会員権評価損	3,135	3,135
貸倒引当金繰入額	18,442	14,840
其他有価証券評価差額金	-	6,871
繰延税金資産合計	608,266	787,759
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	681	-
繰延税金負債合計	681	-
差引繰延税金資産の純額	607,584	787,759

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

第22期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第23期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（持分法損益等）

第22期(平成19年3月31日現在)	第23期(平成20年3月31日現在)
関連会社に関する投資の金額 149,700千円	
持分法を適用した場合の投資の金額 329,065千円	
持分法を適用した場合の投資利益の金額 75,398千円	

(関連当事者との取引)

第22期（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
法人主要株主	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円（基金および基金償却積立金）	生命保険業	（被所有）直接50%	兼務1名，出向3名，転籍2名	資産の運用および助言、当社設定投信の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	841,610	未収収益	240,078
								販売手数料の支払	48,822	-	-
								保険料の支払	5,031	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DLIBJ Asset Management 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	875,761	未払費用	447,362
	DLIBJ Asset Management 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	461,432	未払費用	246,903

取引条件および取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含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) 上記の取引金額および期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有（被 所有） 割合	関係内容		取引の内 容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
兄弟 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投信 の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	1,987,532	未払 手 数 料	198,163
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投信 の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	576,293	未払 手 数 料	97,572
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究 等	-	-	当社預 り資産 の 運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払 業務委託 料の支払	355,655 21,239	未払 費用 -	161,101 -

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を含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）資産運用の顧問料は、一般的取引条件を含めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第23期（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の 名称	住所	資本金又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関係内容		取引の内 容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
法人 主 要 株 主	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 （基金およ び基金償却 積立金）	生命保 険業	（被所有） 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用および 助言、当社 設定投信 の販売	資産運用 の 助言の顧 問料の受 入	833,702	未収 収益	219,740
								販売手 数 料の支 払	46,452	-	-
								保険料の 支払	5,707	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

- （注1）資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注2）支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。
- （注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。
- （注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業 の内容 又は 職業	議決権 等の所 有（被 所有） 割合	関係内容		取引の内 容	取引 金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産 の運 用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運 用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	1,096,514	未払 費用	456,913
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産 の運 用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運 用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	466,450	未払 費用	184,052

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業 の内容 又は 職業	議決権 等の所 有（被 所有） 割合	関係内容		取引の内 容	取引 金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
兄 弟 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	2,104,660	未払 手数料	145,839
	株式会社 みずほコーポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行 業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売	投資信託 の販売代 行手数料	739,368	未払 手数料	137,112
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノ ロジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究 等	-	-	当社預 り資産 の 運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払 業務委託 料の支払	340,983 16,800	未払 費用 -	153,240 -

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(1株当たり情報)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 605,681円10銭 1株当たり当期純利益金額 197,762円99銭	1株当たり純資産額 755,695円99銭 1株当たり当期純利益金額 248,973円42銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債および転換社債を発行していないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,746,311千円	5,975,362千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第22期 (自平成18年4月1日 至平成19年3月31日)	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)
	平成20年3月28日開催の取締役会の決議により、平成20年4月1日付にて100%出資の子会社DIAM SINGAPORE PTE.LTD.を設立し、その後、平成20年4月14日付にて株主割当増資を実施いたしました。(出資の総額400,000千円、資本金400,000千円)

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金			12,331,764	
前払費用			113,461	
未収委託者報酬			3,183,483	
未収運用受託報酬			1,545,690	
未収投資助言報酬			377,271	
未収収益			258,713	
繰延税金資産			502,506	
その他			55,461	
流動資産合計			18,368,353	77.6
固定資産				
有形固定資産			510,393	2.1
建物	1	310,866		
器具備品	1	146,942		
建設仮勘定		52,584		
無形固定資産			708,817	3.0
商標権	1	1,719		
ソフトウェア	1	561,075		
ソフトウェア仮勘定		138,221		
電話加入権		7,148		
電話施設利用権	1	651		
投資その他の資産			4,096,042	17.3
投資有価証券		766,642		
関係会社株式		1,661,144		
繰延税金資産		317,458		
長期差入保証金		1,169,961		
その他		207,761		
貸倒引当金		26,925		
固定資産合計			5,315,252	22.4
資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間末（平成20年9月30日現在）		
		内訳（千円）	金額（千円）	構成比（％）
（負債の部）				
流動負債				
預り金			38,403	
未払金			1,779,310	
未払収益分配金		8,311		
未払償還金		50,646		
未払手数料		1,373,667		
その他未払金		346,684		
未払費用			1,572,614	
未払法人税等			1,594,756	
未払消費税等			91,285	
前受収益			12,580	
賞与引当金			715,530	
その他			365	
流動負債合計			5,804,848	24.5
固定負債				
退職給付引当金			369,364	
役員退職慰労引当金			147,947	
固定負債合計			517,311	2.2
負債合計			6,322,159	26.7
（純資産の部）				
株主資本				
資本金			2,000,000	8.4
資本剰余金			2,428,478	10.2
資本準備金		2,428,478		
利益剰余金			13,062,550	55.2
利益準備金		123,293		
その他利益剰余金				
別途積立金		10,040,000		
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		2,399,256		
株主資本合計			17,491,028	73.8
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金			129,581	
評価・換算差額等合計			129,581	0.5
純資産合計			17,361,446	73.3
負債・純資産合計			23,683,606	100.0

区分	注記番号	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)		
		内訳(千円)	金額(千円)	百分比(%)
営業外収益				
受取配当金		1,575		
受取利息		30,350		
先物利益		97,476		
雑収入		3,796		
営業外収益合計			133,198	0.7
営業外費用				
為替差損		39,429		
時効成立後支払分配金		198		
投資信託解約損		38,254		
営業外費用合計			77,882	0.4
経常利益			3,981,874	21.9
特別損失				
固定資産除却損		2,315		
特別損失合計			2,315	0.0
税引前中間純利益			3,979,559	21.9
法人税、住民税及び事業税		1,585,387		
法人税等調整額		49,860	1,635,247	9.0
中間純利益			2,344,311	12.9

(3) 中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

	株主資本							
	資本金	資本 剰余金	利益剰余金					株主資本 合計
			資本 準備金	利益 準備金	その他利益剰余金			
		別途 積立金			研究開発 積立金	運用責任 準備積立金	繰越利益 剰余金	
平成20年3月31日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	7,040,000	300,000	200,000	6,054,944	18,146,716
中間会計期間中の 変動額								
剰余金の配当 （千円）							3,000,000	3,000,000
別途積立金の 積立（千円）				3,000,000			3,000,000	-
中間純利益（千円）							2,344,311	2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）								
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	-	-	-	3,000,000	-	-	3,655,688	655,688
平成20年9月30日 残高（千円）	2,000,000	2,428,478	123,293	10,040,000	300,000	200,000	2,399,256	17,491,028

	評価・換算差額等	純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	
平成20年3月31日 残高（千円）	10,012	18,136,703
中間会計期間中の 変動額		
剰余金の配当 （千円）		3,000,000
別途積立金の 積立（千円）		-
中間純利益（千円）		2,344,311
株主資本以外の 項目の中間会計 期間中の変動額 （純額）（千円）	119,568	119,568
中間会計期間中の 変動額合計（千円）	119,568	775,257
平成20年9月30日 残高（千円）	129,581	17,361,446

[前へ](#) [次へ](#)

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

項目	第24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
1. 有価証券の評価基準および評価方法	(1)子会社株式および関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)其他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 ... 10～15年 器具備品 ... 2～15年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
4. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 (追加情報) 従来、退職給付債務の算定については「退職給付会計に関する実務指針」に定められる簡便法を採用していましたが、前事業年度末から原則法に変更いたしました。 なお、上記の通り退職給付債務の算定方法の変更が前事業年度末に行われたため、前中間会計期間は従来の方によっております。したがって、前中間会計期間は、前事業年度末と同一の方法によった場合と比較して、税引前中間純利益は104,743千円多く計上されております。 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
5. 外貨建ての資産および負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

会計方針の変更	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当中間会計期間における中間貸借対照表および中間損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>
表示方法の変更	<p>（中間貸借対照表）</p> <p>1．前中間会計期間において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当中間会計期間から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「未収運用受託報酬」の金額は1,600,614千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は410,692千円であります。</p> <p>2．前中間会計期間において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は27,931千円であります。</p> <p>（中間損益計算書）</p> <p>前中間会計期間において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当中間会計期間から区分掲記しております。なお、前中間会計期間における「運用受託報酬」の金額は2,551,064千円であり、「投資助言報酬」の金額は735,233千円であります。</p>

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第24期中間会計期間末 （平成20年9月30日現在）	
1．固定資産の減価償却累計額	建物	... 401,730千円
	器具備品	... 261,226千円
	商標権	... 5,967千円
	ソフトウェア	... 549,824千円
	電話施設利用権	... 945千円

（中間損益計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 （自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）	
1．減価償却実施額	有形固定資産	... 62,606千円
	無形固定資産	... 103,590千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第24期中間会計期間（自平成20年4月1日 至平成20年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月27日 定時株主総会	普通株式	3,000,000	125,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

(リース取引関係)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)

1. ファイナンス・リース取引

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

リース資産の内容
該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	90,601千円
減価償却累計額相当額	40,972千円
中間期末残高相当額	49,629千円

未経過リース料中間期末残高相当額

1年以内	1年超	合計
22,920千円	28,059千円	50,980千円

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額および支払利息相当額

支払リース料	12,048千円
減価償却費相当額	11,363千円
支払利息相当額	831千円

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

(有価証券関係)

第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)

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

区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
株式	371,914	304,829	67,084
債券	-	-	-
その他(投資信託)	529,999	378,566	151,433
合計	901,914	683,396	218,518

4. 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

非上場株式(店頭売買株式を除く)

中間貸借対照表計上額

83,246千円

(デリバティブ取引関係)

デリバティブ取引の契約額等、時価および評価損益の状況

1. 通貨関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
通貨	為替予約取引 売建				
	米ドル	26,961	-	26,289	672
	香港ドル	33,800	-	34,075	275
	豪ドル	91,717	-	87,387	4,329
	シンガポールドル	16,233	-	16,323	89
	合計	168,712	-	164,076	4,636

2. 株式関連

対象物の種類	取引の種類	第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
株式	株価指数先物取引 売建	358,295	-	333,026	25,268
	合計	358,295	-	333,026	25,268

(持分法損益等)

第24期中間会計期間末(平成20年9月30日現在)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)	
1株当たり純資産額	723,393円61銭
1株当たり中間純利益金額	97,679円66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24期中間会計期間 (自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
--

中間純利益	2,344,311千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,344,311千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第24期中間会計期間(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)
該当事項はありません。

[前△](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成20年3月末日現在 247,231百万円

c. 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

(平成20年3月末日現在)

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

(3) 投資顧問会社

a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

平成20年3月末日現在 3,750万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

(4) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM International Ltd

b. 資本金の額

平成20年12月末日現在 400万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の送付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成20年4月11日
有価証券報告書	平成20年4月11日
半期報告書	平成20年10月10日
有価証券届出書の訂正届出書	平成20年10月10日

独立監査人の監査報告書

平成21年2月26日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成20年1月12日から平成21年1月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成21年1月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[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20年6月13日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以 上

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

[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20年12月12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 山本 禎良 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 山内 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成20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20年4月1日から平成20年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年2月19日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成19年1月26日から平成20年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成20年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月28日

興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士 山本 禎 良 印
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士 山内 正 彦 印

当監査法人は、証券取引法第193条の2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」に掲げられている興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成18年4月1日から平成19年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社の平成19年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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