

【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23年4月11日

【計算期間】 第4期（自 平成22年1月13日 至 平成23年1月11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 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【電話番号】 03-3287-3110

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

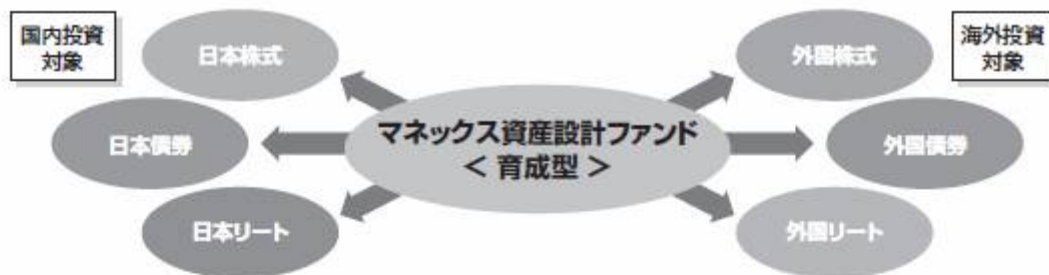
当ファンドは、契約型の追加型株式投資信託に属します。

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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



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

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

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

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに追随することをめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

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

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

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

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

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の一つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

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

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

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

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

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

4 「育成型」（自動けいぞく投資専用）のファンドです。

分配方針

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

※決算は原則として毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日。）です。

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

・商品分類表

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

・属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行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。

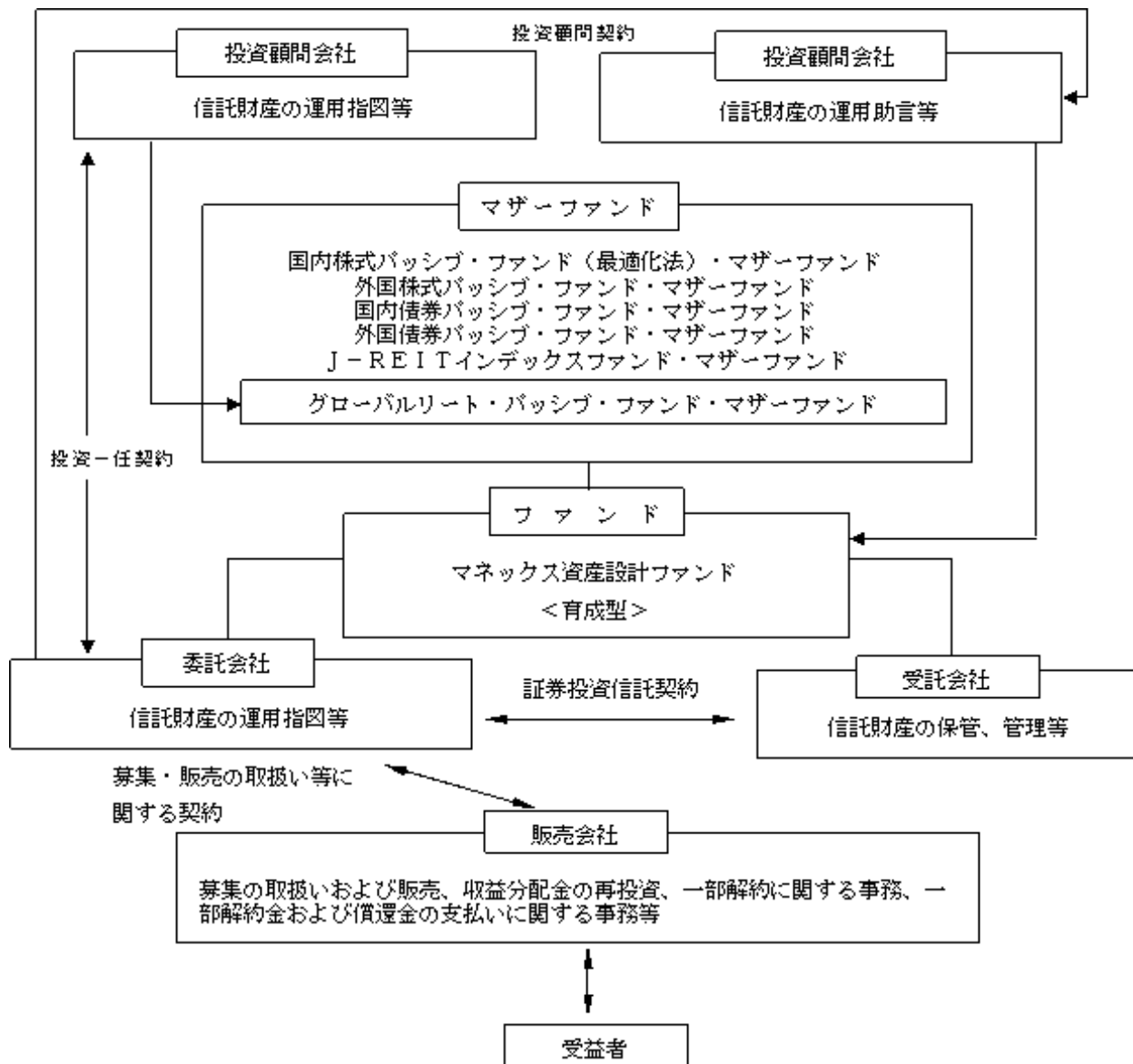
・投資信託協会への照会

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成19年1月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

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

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

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

販売会社

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

投資顧問会社：

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

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

DIAM International Ltd

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

・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

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

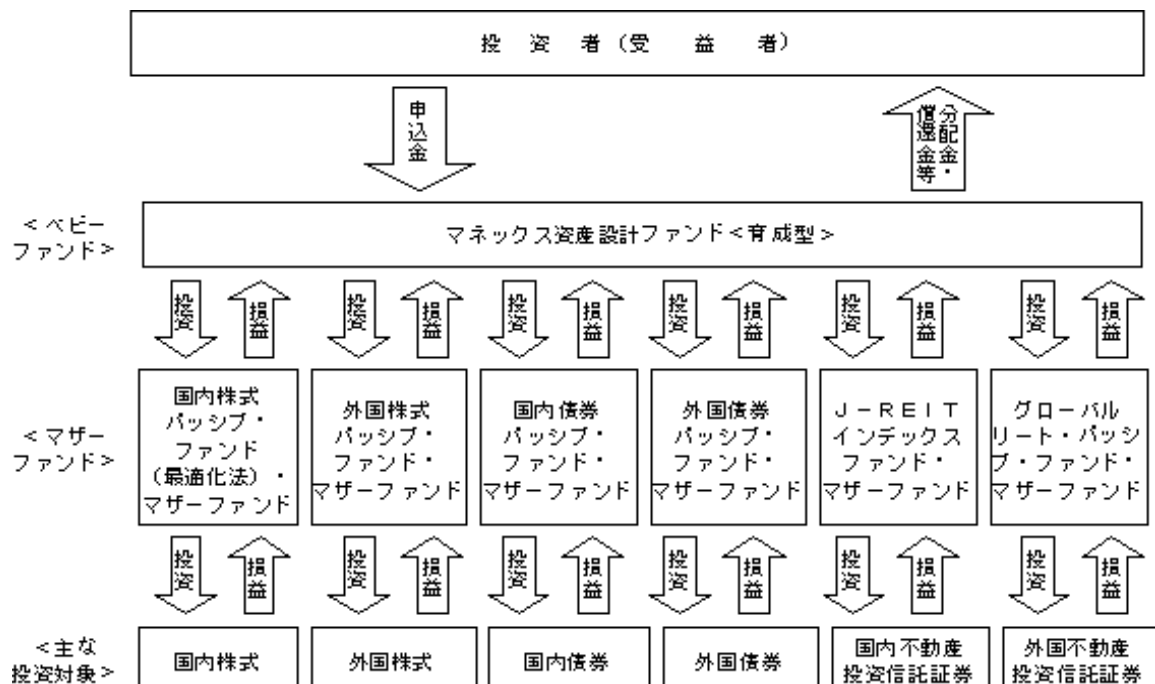
・「投資一任契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成23年1月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月 1日	会社設立
平成10年3月 31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月 1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成23年1月31日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資態度>

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

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

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

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

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

リート（REIT）とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

(2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

(1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) J-REIT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上記(27)の有価証券の性質を有するもの

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

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

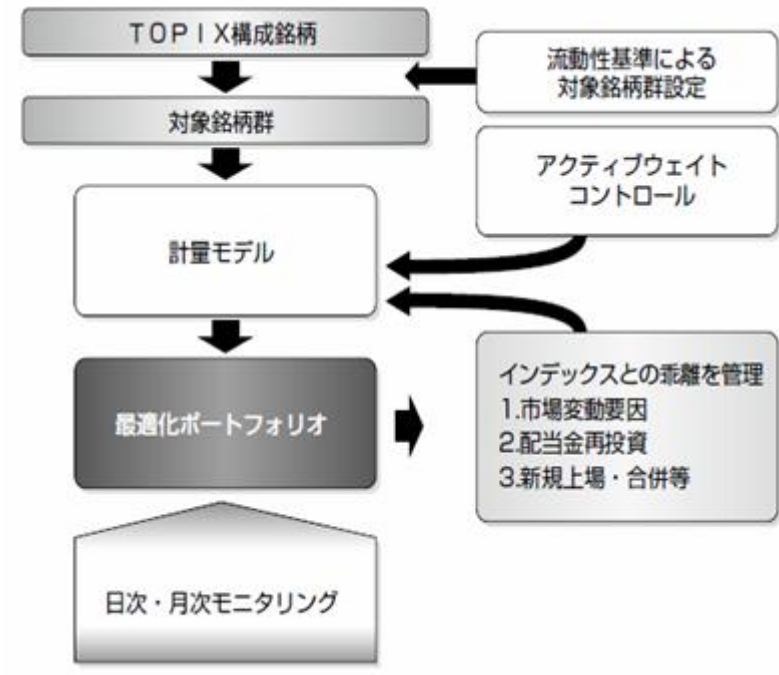
委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

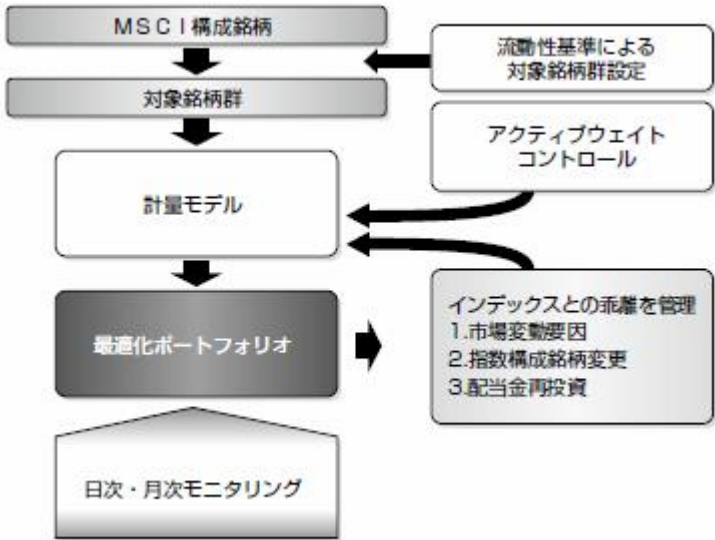
- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注）TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東東京証券取引所」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東東京証券取引所が有しています。</p> <p>東東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>東東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>東東京証券取引所は、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。また東東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、東東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>東東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>東東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、東東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。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。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。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。</p> <p><運用プロセス></p>  <pre> graph TD A[TOPIX構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C H[インデックスとの乖離を管理 1.市場変動要因 2.配当金再投資 3.新規上場・合併等] --> D </pre> <p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p>

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注)MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p><運用プロセス></p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C H[インデックスとの乖離を管理 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> D </pre> <p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

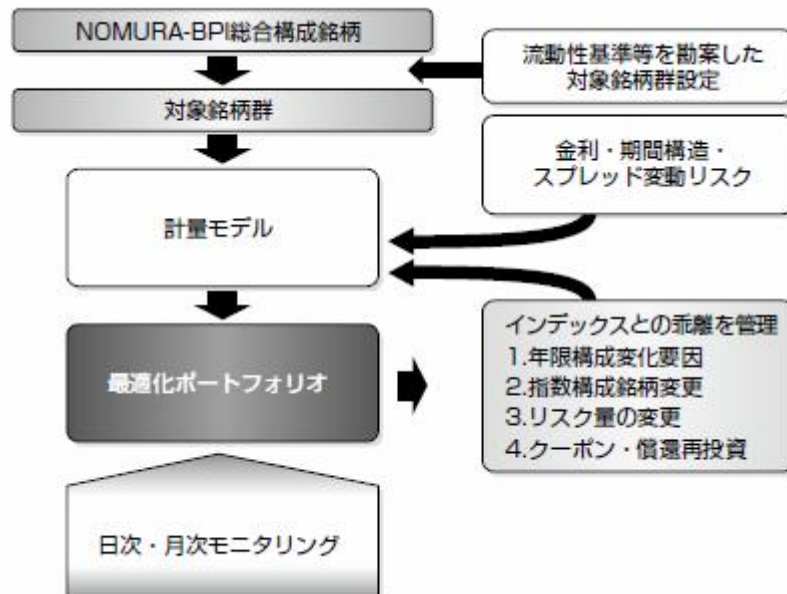
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div data-bbox="335 725 1404 904" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注)NOMURA - B P I 総合は、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p> </div>
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

<運用プロセス>



1) 流動性基準による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2) 最適化法によるポートフォリオの構築

1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1.、2. が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3) インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

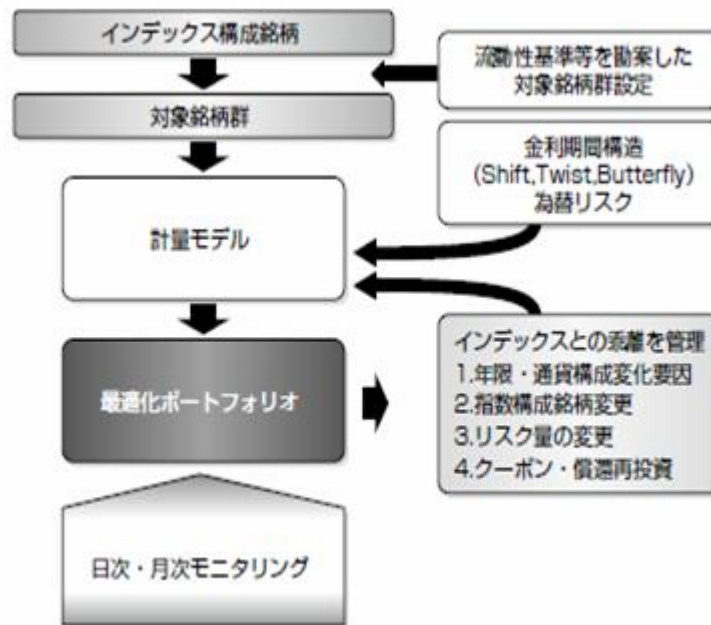
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>
--------	--

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）^(注)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="303 1131 1380 1377" style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>(注)シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。</p> <p>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。</p> </div> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>

<運用プロセス>



1)流動性基準による対象銘柄群設定

シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

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

3)インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

主な
投資
制限

株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。

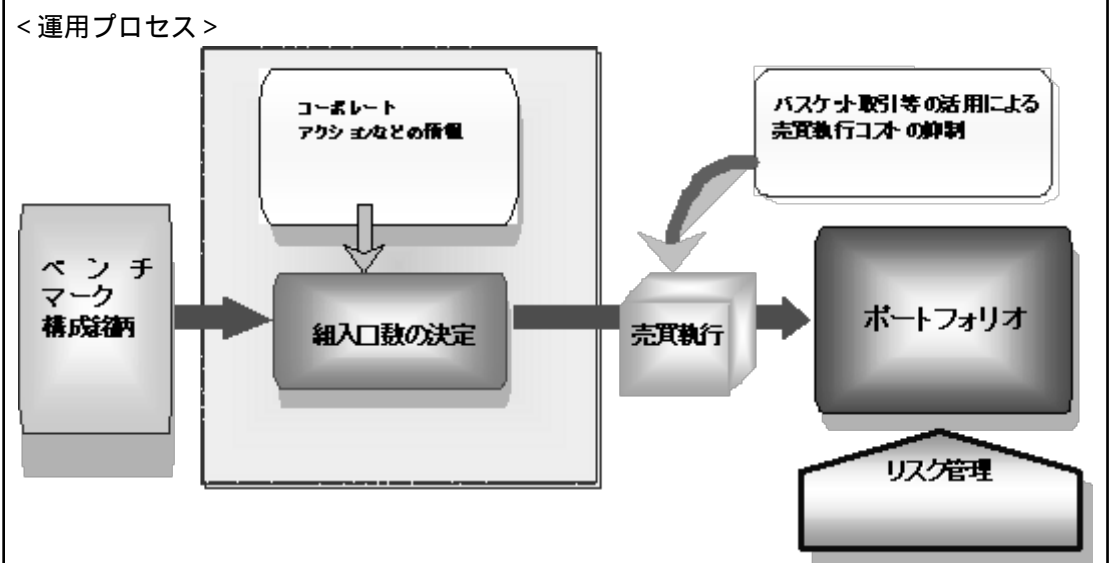
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

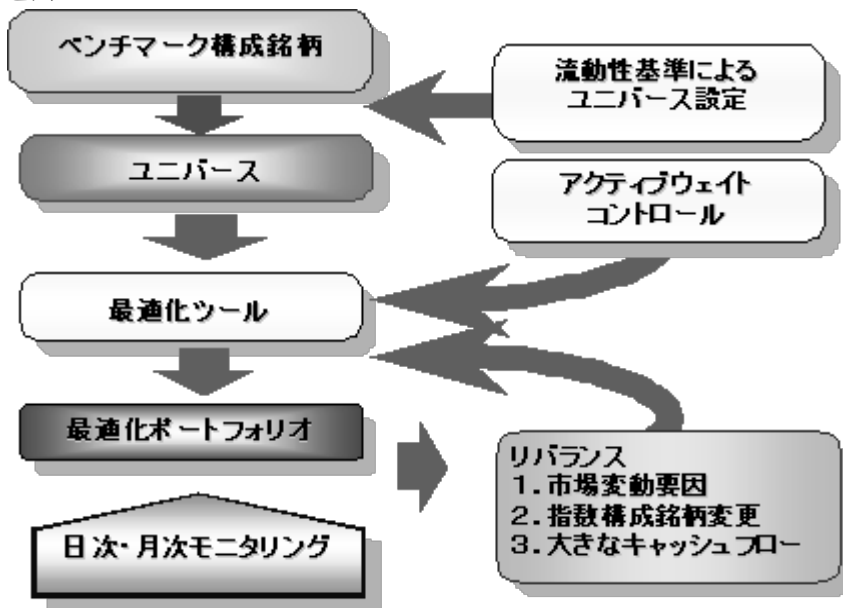
同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

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

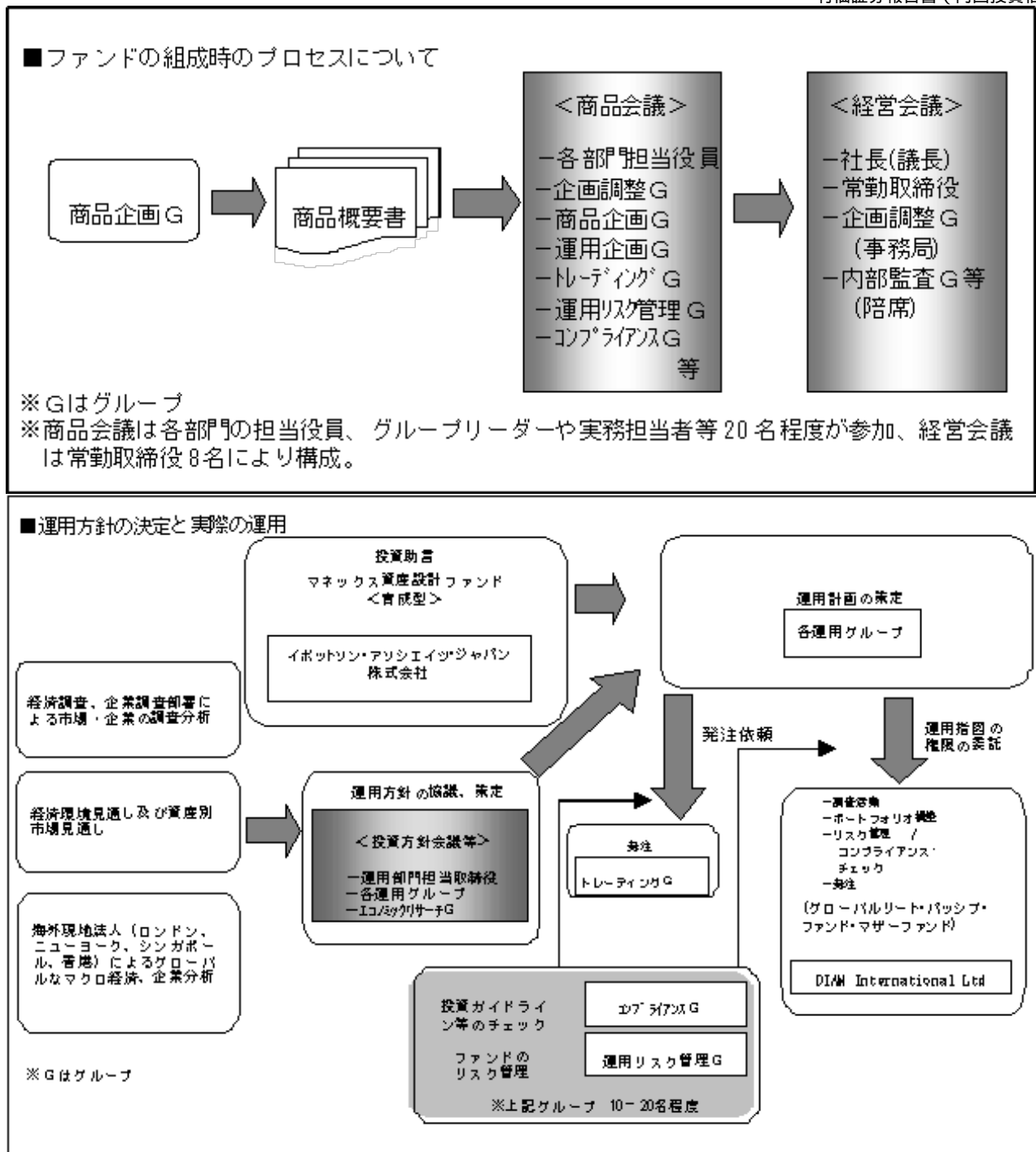
<p>投資態度</p>	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p><運用プロセス></p>  <p>1) 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>2) 新規上場、公募増資、第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。</p> <p>3) 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。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>

ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、S & P先進国REITインデックス（除く日本・円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注)「Standard & Poor's」、「S&P」は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、D I A Mアセットマネジメント株式会社の使用のためにライセンスされているものです。当マザーファンドは、Standard & Poor'sによって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではなく、また、Standard & Poor'sは、当マザーファンドの投資の妥当性を表明するものではありません。</p> <p>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。</p> <p>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、欠陥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。</p>
主な投資対象	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</p> <p>不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。</p> <p><運用プロセス></p>  <p>1)流動性基準によるユニバース設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低かつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)リバランス 日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。 リバランス要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの ・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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

されます。

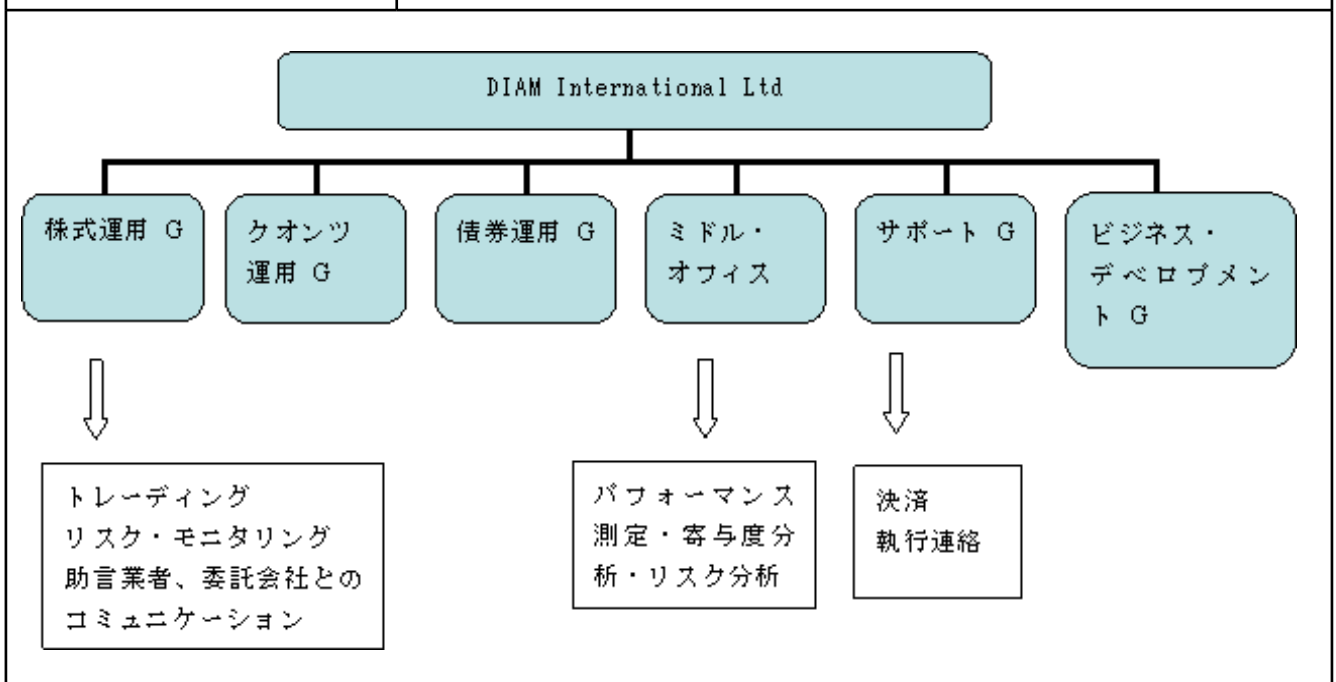
個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

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

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

2)グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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



上記運用体制は、平成23年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（毎年1月11日、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

原則として、経費控除後の利子配当等収益の範囲内で、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

- a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
- 1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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）

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

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

信用取引の指図および範囲（約款第22条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をす

ることができるものとします。

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

先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

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

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の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) 上記1)各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当す

る契約の一部の解約を指図するものとします。

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) 上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れ（約款第28条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第37条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入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

各資産毎（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）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リーートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリーートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

リーートの価格変動リスク

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

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

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

為替リスク

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

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

信用リスク

公社債、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、当該公社債等の価格は下落し（価格がゼロになることもあります。）、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

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

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

流動性リスク

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

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

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。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

当ファンド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。

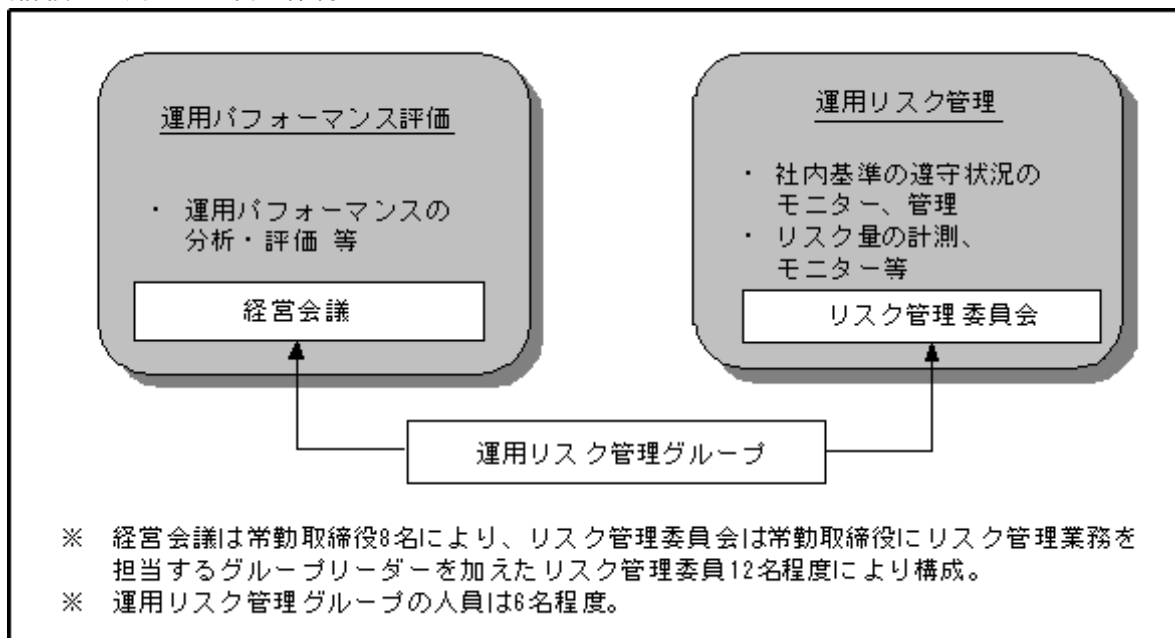
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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、リートなど値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。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。

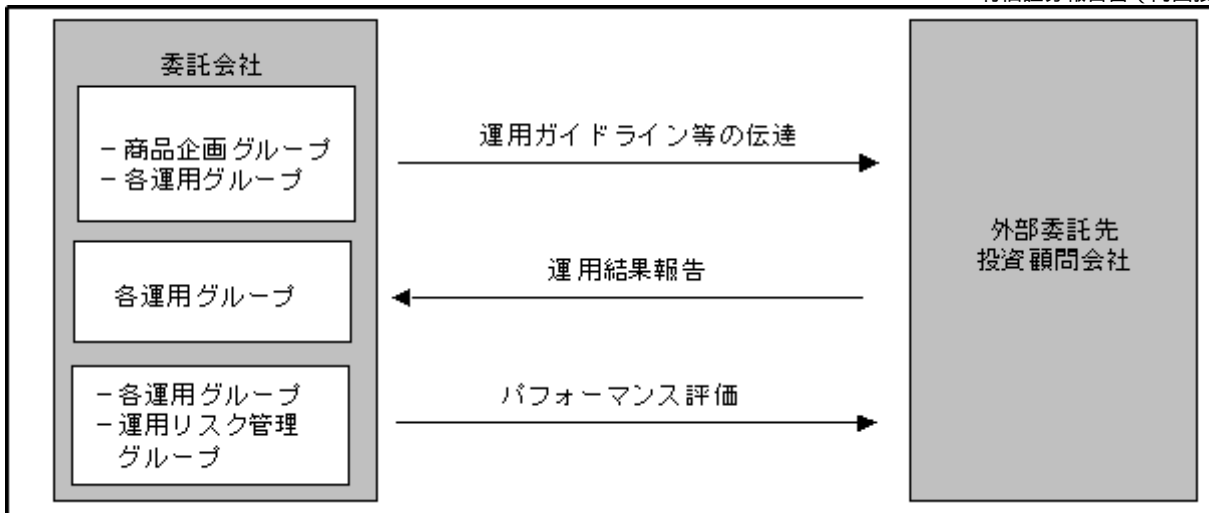
< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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。

< 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用グループが連携し、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23年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

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

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で、原則として源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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

一部解約時および償還時

平成23年12月31日までの間は、一部解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率により源泉徴収が行われ、原則として申告は不要です。上記10%の税率は平成24年1月1日からは、20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

一部解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

平成23年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7%の税率は平成24年1月1日からは、15%（所得税15%）となる予定です。買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、益金不算入制度の適用はありません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,643,263,804	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		93,909,657	1.21
合 計 (純資産総額)		7,737,173,461	100.00

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

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	264,450,759,192	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,201,245,182	0.83
合 計 (純資産総額)		266,652,004,374	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

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

株式	米国	143,975,448,956	50.79
	英国	28,193,171,159	9.95
	カナダ	16,123,509,497	5.69
	スイス	12,783,972,840	4.51
	スウェーデン	4,475,137,975	1.58
	デンマーク	1,408,691,230	0.50
	ノルウェー	1,017,184,131	0.36
	アイルランド	1,662,660,795	0.59
	オランダ	3,618,339,796	1.28
	ベルギー	1,255,401,630	0.44
	ルクセンブルク	821,040,088	0.29
	フランス	13,115,486,526	4.63
	ドイツ	11,731,228,400	4.14
	ポルトガル	359,843,782	0.13
	スペイン	5,075,765,581	1.79
	イタリア	3,800,066,332	1.34
	フィンランド	1,598,869,908	0.56
	オーストリア	464,649,761	0.16
	キプロス	48,573,118	0.02
	ギリシャ	363,535,148	0.13
	香港	3,694,122,726	1.30
	中国	24,995,610	0.01
	シンガポール	2,283,622,875	0.81
	イスラエル	1,056,841,254	0.37
	オーストラリア	11,007,767,830	3.88
	ニュージーランド	118,063,106	0.04
	パナマ	257,258,736	0.09
	バミューダ諸島	775,846,884	0.27
	オランダ領アンティル	1,486,687,380	0.52
	ケイマン諸島	179,666,505	0.06
	ガーンジー・チャンネル諸島	70,867,724	0.03
	ジャージー・チャンネル諸島	675,107,344	0.24
	マン島	122,987,842	0.04
リベリア	83,712,838	0.03	
モーリシャス	55,738,041	0.02	
小計	273,785,863,350	96.59	
投資信託受益証券	シンガポール	60,710,361	0.02
	オーストラリア	821,084,453	0.29
	小計	881,794,814	0.31
投資証券	米国	2,607,490,804	0.92
	英国	340,900,388	0.12
	カナダ	59,264,473	0.02
	オランダ	50,128,991	0.02
	フランス	369,959,595	0.13
	香港	95,932,445	0.03
小計	3,523,676,697	1.24	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,258,279,543	1.86
合 計（純資産総額）		283,449,614,404	100.00

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	327,844,890,300	75.77
地方債証券	日本	28,773,443,766	6.65
特殊債券	日本	40,225,939,203	9.30
社債券	日本	33,875,745,060	7.83

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,977,507,226	0.46
合 計 (純資産総額)	432,697,525,555	100.00

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	米国	156,801,980,846	39.55
	英国	30,344,020,665	7.65
	カナダ	11,092,106,199	2.80
	スウェーデン	2,604,694,935	0.66
	デンマーク	3,278,261,737	0.83
	ノルウェー	993,906,180	0.25
	アイルランド	2,566,778,878	0.65
	オランダ	9,876,657,970	2.49
	ベルギー	10,337,108,931	2.61
	フランス	37,205,158,901	9.38
	ドイツ	37,171,829,923	9.37
	ポルトガル	3,253,904,726	0.82
	スペイン	16,070,987,858	4.05
	イタリア	39,904,491,395	10.06
	フィンランド	2,362,095,066	0.60
	ポーランド	3,659,566,592	0.92
	オーストリア	6,816,907,767	1.72
	シンガポール	1,437,370,252	0.36
	マレーシア	1,909,139,540	0.48
	オーストラリア	4,126,184,890	1.04
メキシコ	3,342,679,402	0.84	
小計	385,155,832,653	97.14	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,345,165,695	2.86
合 計 (純資産総額)		396,500,998,348	100.00

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	4,964,311,430	98.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		72,348,902	1.44
合 計 (純資産総額)		5,036,660,332	100.00

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

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	シンガポール	106,030,907	2.80
	オーストラリア	491,568,381	13.00
	小計	597,599,287	15.81

投資証券	米国	2,302,084,767	60.89
	英国	248,635,594	6.58
	カナダ	101,258,199	2.68
	オランダ	88,304,716	2.34
	ベルギー	28,073,877	0.74
	フランス	223,118,606	5.90
	香港	84,623,341	2.24
	ニュージーランド	18,677,642	0.49
	小計	3,094,776,741	81.86
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		88,044,612	2.33
合 計（純資産総額）		3,780,420,640	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2,026,772,821	11,155.80	2,261,026,371	11,140.00	2,257,824,922	29.18
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	1,609,706,230	11,238.70	1,809,100,916	11,363.00	1,829,109,189	23.64
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1,333,870,261	12,080.13	1,611,333,191	11,860.00	1,581,970,129	20.45
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	760,200,300	12,940.24	983,717,560	13,117.00	997,154,733	12.89
5	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	662,250,431	8,860.13	586,762,724	8,700.00	576,157,874	7.45
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	530,064,707	7,439.40	394,336,343	7,566.00	401,046,957	5.18

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

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は6銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.79
合計	98.79

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,785,800	3,266.07	9,098,618,936	3,400.00	9,471,720,000	3.55
2	三菱UFJフィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	16,196,600	450.82	7,301,816,100	426.00	6,899,751,600	2.59
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	1,829,400	3,012.81	5,511,642,625	3,475.00	6,357,165,000	2.38
4	キャノン	株式	日本	電気機 器	1,347,000	3,525.20	4,748,448,304	4,025.00	5,421,675,000	2.03
5	三井住友フィ ナンシャルG	株式	日本	銀行業	1,618,500	2,756.24	4,460,974,630	2,792.00	4,518,852,000	1.69
6	みずほフィナン シャルG	株式	日本	銀行業	26,125,700	159.26	4,160,712,267	158.00	4,127,860,600	1.55
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,713,800	2,079.03	3,563,034,715	2,285.00	3,916,033,000	1.47
8	ソニー	株式	日本	電気機 器	1,217,400	2,925.64	3,561,668,558	2,829.00	3,444,024,600	1.29
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	850,700	3,978.86	3,384,815,033	3,950.00	3,360,265,000	1.26
10	東京電力	株式	日本	電気・ ガス業	1,596,000	2,345.68	3,743,702,357	1,995.00	3,184,020,000	1.19
11	日本電信電話	株式	日本	情報・ 通信業	803,600	3,909.99	3,142,068,204	3,810.00	3,061,716,000	1.15
12	ファナック	株式	日本	電気機 器	225,800	8,878.45	2,004,754,150	12,960.00	2,926,368,000	1.10
13	任天堂	株式	日本	その他 製品	124,000	24,270.93	3,009,594,808	22,180.00	2,750,320,000	1.03
14	ソフトバンク	株式	日本	情報・ 通信業	947,500	2,267.45	2,148,413,530	2,823.00	2,674,792,500	1.00
15	小松製作所	株式	日本	機械	1,075,900	1,743.72	1,876,067,935	2,444.00	2,629,499,600	0.99
16	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ	株式	日本	情報・ 通信業	17,690	138,852.12	2,456,294,008	146,500.00	2,591,585,000	0.97
17	三井物産	株式	日本	卸売業	1,847,300	1,273.27	2,352,108,900	1,380.00	2,549,274,000	0.96
18	パナソニック	株式	日本	電気機 器	2,146,900	1,298.18	2,787,054,317	1,124.00	2,413,115,600	0.90
19	三菱地所	株式	日本	不動産 業	1,498,000	1,382.48	2,070,962,190	1,550.00	2,321,900,000	0.87
20	日産自動車	株式	日本	輸送用 機器	2,739,100	710.84	1,947,055,633	830.00	2,273,453,000	0.85
21	野村ホールディ ングス	株式	日本	証券、 商品先 物取引 業	4,506,700	618.35	2,786,734,417	499.00	2,248,843,300	0.84

22	日立	株式	日本	電気機器	4,867,000	312.04	1,518,674,820	448.00	2,180,416,000	0.82
23	東芝	株式	日本	電気機器	4,279,000	424.29	1,815,549,080	485.00	2,075,315,000	0.78
24	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	377,000	5,951.45	2,243,696,885	5,420.00	2,043,340,000	0.77
25	東京海上HD	株式	日本	保険業	812,400	2,397.09	1,947,392,952	2,446.00	1,987,130,400	0.75
26	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,168,000	730.56	1,583,852,210	905.00	1,962,040,000	0.74
27	セブン&アイ・HLDGS	株式	日本	小売業	895,100	1,969.81	1,763,177,245	2,124.00	1,901,192,400	0.71
28	関西電力	株式	日本	電気・ガス業	884,900	2,098.44	1,856,913,519	2,030.00	1,796,347,000	0.67
29	信越化学	株式	日本	化学	378,200	4,719.25	1,784,819,612	4,620.00	1,747,284,000	0.66
30	三井不動産	株式	日本	不動産業	1,009,000	1,467.41	1,480,621,730	1,668.00	1,683,012,000	0.63

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

種類別業種別投資比率

種類	業種	平成23年1月31日現在
		投資比率（％）
株式	電気機器	14.81
	輸送用機器	10.24
	銀行業	9.25
	化学	5.94
	情報・通信業	5.38
	卸売業	5.37
	機械	5.01
	電気・ガス業	4.66
	医薬品	4.35
	陸運業	3.50
	小売業	3.46
	食料品	2.88
	不動産業	2.49
	保険業	2.43
	鉄鋼	2.26
	その他製品	2.06
	建設業	2.01
	サービス業	1.66
	証券、商品先物取引業	1.50
	精密機器	1.37
	非鉄金属	1.33
	ガラス・土石製品	1.28
	繊維製品	0.91
	石油・石炭製品	0.87
	その他金融業	0.76
	金属製品	0.66
	ゴム製品	0.59
	海運業	0.58
	鉱業	0.57
	パルプ・紙	0.36
空運業	0.33	
倉庫・運輸関連業	0.23	
水産・農林業	0.09	
合計		99.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
投資有価証券の主要銘柄

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	EXXON MOBIL CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	773,567	5,267.99	4,075,142,381	6,487.45	5,018,476,229	1.77
2	APPLE INC	株式	米国	コン ピュー タ・周 辺機器	138,786	16,977.53	2,356,244,040	27,599.79	3,830,463,969	1.35
3	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,181,071	2,266.87	2,677,334,705	2,279.93	2,692,757,788	0.95
4	GENERAL ELECTRIC CO	株式	米国	コング ロマ リット	1,622,365	1,273.81	2,066,586,434	1,659.03	2,691,545,716	0.95
5	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	191,208	10,192.33	1,948,854,596	13,075.92	2,500,219,995	0.88
6	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀 行	2,668,964	841.89	2,246,967,229	890.86	2,377,663,447	0.84
7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイ ス	食品	524,320	4,410.68	2,312,606,883	4,479.77	2,348,835,104	0.83
8	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	304,885	5,841.17	1,780,885,308	7,668.48	2,338,003,946	0.82
9	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用 品	429,958	5,061.40	2,176,190,733	5,272.75	2,267,059,325	0.80
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金 融サー ビス	601,484	3,184.03	1,915,143,674	3,658.07	2,200,270,696	0.78
11	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	417,387	5,115.06	2,134,958,104	4,928.62	2,057,142,459	0.73
12	AT&T INC	株式	米国	各種電 気通信 サービ ス	895,080	2,059.74	1,843,631,651	2,257.75	2,020,870,182	0.71
13	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀 行	754,934	2,202.25	1,662,553,598	2,615.02	1,974,166,905	0.70
14	BHP BILLITON LTD	株式	オー スト ラリ ア	金属・ 鉱業	509,374	3,286.77	1,674,196,576	3,632.40	1,850,251,748	0.65
15	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通 信サー ビス	7,979,139	181.25	1,446,213,549	231.69	1,848,689,028	0.65

16	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	37,362	43,093.19	1,610,047,907	49,359.31	1,844,162,492	0.65
17	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,217,546	1,435.26	1,747,494,242	1,490.66	1,814,946,512	0.64
18	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,849,052	718.42	2,046,822,756	633.28	1,804,242,294	0.64
19	CITIGROUP INC	株式	米国	各種金融サービス	4,411,156	285.53	1,259,525,452	387.65	1,710,000,504	0.60
20	BANK OF AMERICA CORP	株式	米国	各種金融サービス	1,522,007	1,206.31	1,836,009,497	1,116.97	1,700,033,115	0.60
21	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	317,459	4,420.20	1,403,232,176	5,109.31	1,621,995,586	0.57
22	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	609,018	1,912.87	1,164,971,547	2,628.16	1,600,596,747	0.56
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	539,947	2,249.50	1,214,612,190	2,865.23	1,547,073,557	0.55
24	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	319,216	4,590.30	1,465,297,022	4,723.89	1,507,942,308	0.53
25	SCHLUMBERGER LTD	株式	オランダ	エネルギー設備・サービス	208,857	5,039.24	1,052,480,562	7,118.21	1,486,687,380	0.52
26	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	864,629	1,935.13	1,673,166,522	1,718.98	1,486,280,737	0.52
27	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	842,577	1,672.74	1,409,413,768	1,762.51	1,485,050,220	0.52
28	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	319,033	4,974.56	1,587,050,014	4,606.27	1,469,552,775	0.52
29	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	308,187	4,324.12	1,332,639,078	4,656.77	1,435,156,284	0.51

30	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株 式	ス イ ス	医薬品	106,130	15,266.03	1,620,183,591	12,571.28	1,334,190,371	0.47
----	---------------------------------	--------	-------------	-----	---------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

(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。

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.29
	商業銀行	8.17
	医薬品	5.65
	金属・鉱業	4.40
	保険	4.22
	各種電気通信サービス	3.07
	各種金融サービス	2.82
	化学	2.71
	メディア	2.50
	食品	2.49
	ソフトウェア	2.44
	資本市場	2.42
	コンピュータ・周辺機器	2.35
	食品・生活必需品小売り	2.32
	コングロマリット	2.23
	機械	2.08
	飲料	2.03
	情報技術サービス	1.91
	電力	1.89
	エネルギー設備・サービス	1.78
	航空宇宙・防衛	1.74
	半導体・半導体製造装置	1.70
	通信機器	1.65
	総合公益事業	1.47
	ホテル・レストラン・レジャー	1.44
	家庭用品	1.39
	専門小売り	1.33
	タバコ	1.26
	ヘルスケア機器・用品	1.23
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.22
	自動車	1.06
	無線通信サービス	1.04
	インターネットソフトウェア・サービス	0.98
	電気設備	0.87
バイオテクノロジー	0.86	
繊維・アパレル・贅沢品	0.83	
不動産管理・開発	0.72	
陸運・鉄道	0.72	
航空貨物・物流サービス	0.58	
複合小売り	0.57	
建設・土木	0.53	

インターネット販売・カタログ販売	0.48
商業サービス・用品	0.42
消費者金融	0.39
電子装置・機器・部品	0.38
自動車部品	0.36
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.35
専門サービス	0.34
建設資材	0.34
家庭用耐久財	0.28
パーソナル用品	0.24
紙製品・林産品	0.22
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.20
建設関連製品	0.20
商社・流通業	0.18
ガス	0.16
運送インフラ	0.16
容器・包装	0.15
旅客航空輸送業	0.14
海運業	0.13
販売	0.12
事務用電子機器	0.08
貯蓄・抵当・不動産金融	0.07
レジャー用品	0.06
各種消費者サービス	0.06
不動産投資信託	0.05
水道	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.03
株式計	96.59
投資信託受益証券	0.31
投資証券	1.24
合計	98.14

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	63回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	7,500,000,000	102.17	7,662,600,000	101.18	7,588,275,000	1.20	2012/ 3/20	1.75
2	64回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	7,200,000,000	103.05	7,419,576,000	101.83	7,331,832,000	1.50	2012/ 6/20	1.69
3	310回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	7,000,000,000	98.93	6,925,190,000	98.40	6,888,070,000	1.00	2020/ 9/20	1.59
4	306回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	101.84	6,314,214,000	102.53	6,356,798,000	1.40	2020/ 3/20	1.47
5	81回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,200,000,000	101.65	6,302,270,000	101.55	6,295,914,000	0.80	2014/ 3/20	1.46
6	285回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,600,000,000	105.94	5,932,878,000	106.40	5,958,512,000	1.70	2017/ 3/20	1.38
7	92回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	6,000,000,000	99.47	5,968,320,000	99.25	5,955,120,000	0.30	2015/ 9/20	1.38
8	66回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,700,000,000	102.30	5,831,244,000	101.50	5,785,557,000	1.10	2012/ 9/20	1.34
9	305回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	99.63	5,479,720,000	101.91	5,604,775,000	1.30	2019/ 12/20	1.30
10	88回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	100.44	5,524,435,000	100.32	5,517,820,000	0.50	2015/ 3/20	1.28
11	89回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,500,000,000	100.62	5,533,885,000	99.81	5,489,330,000	0.40	2015/ 6/20	1.27
12	75回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,300,000,000	102.74	5,445,142,000	102.25	5,418,985,000	1.10	2013/ 9/20	1.25
13	293回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.87	5,293,450,000	106.89	5,344,450,000	1.80	2018/ 6/20	1.24
14	85回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,200,000,000	101.01	5,252,468,000	101.20	5,262,348,000	0.70	2014/ 9/20	1.22
15	72回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	103.92	5,092,149,000	103.02	5,048,176,000	1.50	2013/ 6/20	1.17
16	87回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	5,000,000,000	99.98	4,998,860,000	100.40	5,020,000,000	0.50	2014/ 12/20	1.16
17	70回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.58	4,977,395,000	101.26	4,961,593,000	0.80	2013/ 3/20	1.15
18	299回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,800,000,000	100.90	4,843,241,000	102.68	4,928,544,000	1.30	2019/ 3/20	1.14

19	286回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,500,000,000	106.54	4,794,208,000	107.04	4,816,755,000	1.80	2017/6/20	1.11
20	289回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,400,000,000	104.04	4,577,917,000	105.01	4,620,308,000	1.50	2017/12/20	1.07
21	288回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,300,000,000	105.57	4,539,424,000	106.40	4,575,200,000	1.70	2017/9/20	1.06
22	83回利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	4,400,000,000	101.99	4,487,417,000	101.89	4,482,940,000	0.90	2014/6/20	1.04
23	290回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,200,000,000	102.95	4,323,984,000	104.22	4,377,198,000	1.40	2018/3/20	1.01
24	297回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,200,000,000	102.09	4,287,654,000	103.64	4,352,838,000	1.40	2018/12/20	1.01
25	301回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,100,000,000	102.30	4,194,423,000	104.02	4,264,984,000	1.50	2019/6/20	0.99
26	303回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,100,000,000	101.11	4,145,510,000	103.01	4,223,533,000	1.40	2019/9/20	0.98
27	296回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	4,000,000,000	103.71	4,148,380,000	104.54	4,181,720,000	1.50	2018/9/20	0.97
28	78回利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	4,000,000,000	102.10	4,084,080,000	101.81	4,072,480,000	0.90	2013/12/20	0.94
29	69回利付国庫債券（5年）	国債証券	日本	3,800,000,000	101.86	3,870,604,000	101.33	3,850,426,000	0.90	2012/12/20	0.89
30	266回利付国庫債券（10年）	国債証券	日本	3,700,000,000	104.25	3,857,213,000	103.86	3,842,709,000	1.40	2014/12/20	0.89

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

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	75.77
地方債証券	6.65
特殊債券	9.30
社債券	7.83
合計	99.54

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債 証券	米国	3,613,720,000	107.17	3,872,859,861	106.32	3,842,107,104	4.00	2012/ 11/15	0.97
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,285,200,000	108.72	3,571,603,736	109.62	3,601,137,684	4.25	2013/ 11/15	0.91
3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,285,200,000	107.86	3,543,383,868	109.21	3,587,766,920	4.00	2014/ 2/15	0.90
4	US T N/B 4.5 04/30/12	国債 証券	米国	3,285,200,000	107.37	3,527,418,699	105.29	3,458,822,820	4.50	2012/ 4/30	0.87
5	US T N/B 0.875 02/29/12	国債 証券	米国	3,285,200,000	100.14	3,289,882,428	100.62	3,305,469,684	0.88	2012/ 2/29	0.83
6	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,874,550,000	110.77	3,183,995,308	111.98	3,219,036,072	4.75	2014/ 5/15	0.81
7	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,874,550,000	108.59	3,121,330,118	108.95	3,131,678,498	4.25	2013/ 8/15	0.79
8	US T N/B 4.375 08/15/12	国債 証券	米国	2,874,550,000	107.88	3,101,122,031	106.17	3,051,938,481	4.38	2012/ 8/15	0.77
9	US T N/B 1.5 07/15/12	国債 証券	米国	2,956,680,000	101.87	3,012,029,496	101.67	3,006,086,123	1.50	2012/ 7/15	0.76
10	US T N/B 1.875 06/15/12	国債 証券	米国	2,874,550,000	101.95	2,930,693,600	102.12	2,935,404,224	1.88	2012/ 6/15	0.74
11	US T N/B 1.125 12/15/12	国債 証券	米国	2,874,550,000	99.22	2,852,071,019	101.13	2,906,974,924	1.13	2012/ 12/15	0.73
12	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,628,160,000	107.06	2,813,760,659	106.83	2,807,610,765	3.88	2013/ 2/15	0.71
13	US T N/B 4.5 03/31/12	国債 証券	米国	2,628,160,000	107.30	2,820,120,806	104.92	2,757,491,754	4.50	2012/ 3/31	0.70
14	US T N/B 1.375 09/15/12	国債 証券	米国	2,710,290,000	100.24	2,716,848,902	101.53	2,751,784,540	1.38	2012/ 9/15	0.69
15	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,463,900,000	108.66	2,677,372,296	111.01	2,735,101,473	4.25	2014/ 11/15	0.69
16	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,463,900,000	101.81	2,508,447,312	105.10	2,589,583,539	2.63	2014/ 6/30	0.65
17	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,299,640,000	108.88	2,503,894,025	110.87	2,549,541,879	4.25	2014/ 8/15	0.64

18	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,381,770,000	106.41	2,534,346,186	106.98	2,547,922,275	3.63	2013/ 5/15	0.64
19	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,463,900,000	98.64	2,430,316,059	99.13	2,442,414,792	0.50	2013/ 10/15	0.62
20	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,299,640,000	100.30	2,306,538,920	104.09	2,393,672,280	2.38	2014/ 9/30	0.60
21	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,299,640,000	99.48	2,287,763,006	101.63	2,337,009,150	1.38	2013/ 3/15	0.59
22	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	2,120,590,000	108.87	2,308,580,304	107.69	2,283,663,371	4.25	2014/ 7/4	0.58
23	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	2,120,590,000	106.81	2,264,982,982	106.20	2,251,960,551	3.75	2015/ 1/4	0.57
24	US T N/B 3.625 02/15/20	国債 証券	米国	2,135,380,000	99.62	2,127,181,833	103.84	2,217,442,653	3.63	2020/ 2/15	0.56
25	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタリア	2,120,590,000	106.48	2,257,988,607	102.71	2,178,057,989	4.25	2014/ 8/1	0.55
26	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,008,980,000	108.85	2,186,699,951	107.11	2,151,718,029	4.25	2014/ 1/4	0.54
27	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	国債 証券	フランス	2,008,980,000	108.66	2,182,957,668	105.56	2,120,679,288	4.75	2012/ 10/25	0.53
28	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	2,053,250,000	98.83	2,029,268,040	103.00	2,114,909,098	2.13	2014/ 11/30	0.53
29	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	国債 証券	ドイツ	2,008,980,000	106.62	2,141,974,476	105.19	2,113,246,062	3.75	2013/ 7/4	0.53
30	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	国債 証券	フランス	2,008,980,000	107.23	2,154,235,839	105.07	2,110,835,286	4.00	2013/ 4/25	0.53

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

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.14
合計	97.14

(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。

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23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	777	790,094.73	613,903,607	860,000.00	668,220,000	13.27
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	660	795,365.13	524,940,987	821,000.00	541,860,000	10.76
3	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	2,276	128,011.09	291,353,239	150,700.00	342,993,200	6.81
4	森トラスト総合リート投資法人	投資証券	日本	326	742,317.60	241,995,537	855,000.00	278,730,000	5.53
5	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	411	509,102.69	209,241,206	583,000.00	239,613,000	4.76
6	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	日本	1,321	144,378.32	190,723,766	172,300.00	227,608,300	4.52
7	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	1,957	94,832.32	185,586,859	112,000.00	219,184,000	4.35
8	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	日本	964	214,991.75	207,252,048	219,900.00	211,983,600	4.21
9	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	262	690,603.23	180,938,046	758,000.00	198,596,000	3.94
10	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	339	441,574.07	149,693,611	508,000.00	172,212,000	3.42
11	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	200	719,379.53	143,875,905	784,000.00	156,800,000	3.11
12	大和証券オフィス投資法人	投資証券	日本	534	240,553.79	128,455,724	283,700.00	151,495,800	3.01
13	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	228	508,956.87	116,042,166	570,000.00	129,960,000	2.58
14	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	211	520,025.49	109,725,378	614,000.00	129,554,000	2.57
15	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	315	316,305.33	99,636,178	378,500.00	119,227,500	2.37
16	トップリート投資法人	投資証券	日本	209	468,499.00	97,916,292	518,000.00	108,262,000	2.15
17	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	209	461,740.44	96,503,752	501,000.00	104,709,000	2.08
18	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	131	660,591.09	86,537,433	765,000.00	100,215,000	1.99
19	ビ・ライフ投資法人	投資証券	日本	160	493,711.49	78,993,839	606,000.00	96,960,000	1.93
20	福岡リート投資法人	投資証券	日本	144	564,338.47	81,264,740	617,000.00	88,848,000	1.76
21	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	312	235,540.69	73,488,695	281,000.00	87,672,000	1.74
22	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	169	393,716.43	66,538,076	477,000.00	80,613,000	1.60
23	プレミアム投資法人	投資証券	日本	189	381,397.43	72,084,114	391,000.00	73,899,000	1.47
24	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	日本	1,794	31,451.36	56,423,738	35,600.00	63,866,400	1.27
25	積水ハウス・S I投資法人	投資証券	日本	155	297,827.30	46,163,231	378,000.00	58,590,000	1.16
26	M I Dリート投資法人	投資証券	日本	248	202,354.19	50,183,840	216,700.00	53,741,600	1.07
27	平和不動産リート投資法人	投資証券	日本	938	43,376.40	40,687,064	53,500.00	50,183,000	1.00

28	阪急リート投資法人	投資証券	日本	115	388,832.33	44,715,718	415,000.00	47,725,000	0.95
29	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	107	361,212.69	38,649,758	394,000.00	42,158,000	0.84
30	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	投資証券	日本	143	213,419.18	30,518,943	255,500.00	36,536,500	0.73

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

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.56
合計	98.56

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成23年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	25,524	8,686.89	221,724,183	8,210.54	209,565,723	5.54
2	WESTFIELD GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	191,200	808.30	154,546,612	798.98	152,765,435	4.04
3	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	7,450	16,797.31	125,139,922	15,569.60	115,993,483	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	25,300	4,175.49	105,639,877	4,343.86	109,899,549	2.91
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	12,508	8,602.30	107,597,521	8,744.38	109,374,719	2.89
6	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	14,549	7,379.38	107,362,607	7,160.09	104,172,199	2.76
7	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	63,568	1,406.07	89,380,778	1,468.48	93,348,616	2.47
8	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	11,850	7,404.02	87,737,631	7,614.27	90,229,127	2.39
9	HCP INC	投資証券	米国	28,200	2,988.71	84,281,642	3,001.85	84,652,212	2.24
10	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	投資証券	米国	59,000	1,271.62	75,025,691	1,196.63	70,601,412	1.87
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	7,528	9,307.79	70,069,065	9,344.75	70,347,289	1.86
12	PROLOGIS	投資証券	米国	51,900	1,196.63	62,105,310	1,249.20	64,833,340	1.71
13	VENTAS INC	投資証券	米国	13,530	4,525.36	61,228,161	4,464.59	60,405,859	1.60

14	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資 証券	英国	68,100	898.92	61,216,581	882.66	60,109,190	1.59
15	LINK REIT/THE	投資 証券	香港	232,000	262.97	61,009,736	258.23	59,909,360	1.58
16	STOCKLAND	投資 信託 受益 証券	オース トラリア	197,140	297.48	58,646,153	294.23	58,005,212	1.53
17	BRITISH LAND CO PLC	投資 証券	英国	78,200	673.87	52,696,337	677.12	52,950,663	1.40
18	KIMCO REALTY	投資 証券	米国	33,999	1,484.91	50,485,469	1,464.38	49,787,384	1.32
19	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資 信託 受益 証券	オース トラリア	219,200	223.96	49,092,950	217.83	47,748,424	1.26
20	CORIO NV	投資 証券	オランダ	8,500	5,660.86	48,117,303	5,353.37	45,503,676	1.20
21	AMB PROPERTY CORP	投資 証券	米国	14,700	2,476.22	36,400,427	2,704.54	39,756,751	1.05
22	NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	投資 証券	米国	13,100	3,339.41	43,746,216	3,027.31	39,657,785	1.05
23	HEALTH CARE REIT INC	投資 証券	米国	9,701	4,129.50	40,060,245	3,983.31	38,642,042	1.02
24	THE MACERICH COMPANY	投資 証券	米国	9,820	4,057.22	39,841,920	3,934.85	38,640,210	1.02
25	CFS RETAIL PROPERTY	投資 信託 受益 証券	オース トラリア	243,300	147.52	35,892,395	148.74	36,189,026	0.96
26	SL GREEN	投資 証券	米国	5,625	5,771.28	32,463,422	5,901.04	33,193,353	0.88
27	GPT GROUP	投資 信託 受益 証券	オース トラリア	137,000	228.40	31,290,362	240.59	32,960,666	0.87
28	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資 証券	米国	7,210	4,660.06	33,599,005	4,415.31	31,834,376	0.84
29	SEGRO PLC	投資 証券	英国	78,090	395.08	30,852,057	391.18	30,547,295	0.81
30	DUKE REALTY TRUST	投資 証券	米国	26,800	1,061.94	28,460,016	1,118.61	29,978,764	0.79

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

種類別業種別投資比率

平成23年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	15.81
投資証券	81.86
合計	97.67

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

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

	純資産総額 （百万円）		1口当たり純資産額 （円）	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成20年1月11日現在）	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2期末（平成21年1月13日現在）	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3期末（平成22年1月12日現在）	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4期末（平成23年1月11日現在）	7,727	7,727	0.7224	0.7224
平成22年1月末	7,197	-	0.7060	-
2月末	7,200	-	0.7033	-
3月末	7,615	-	0.7419	-
4月末	7,738	-	0.7529	-
5月末	7,275	-	0.7039	-
6月末	7,172	-	0.6863	-
7月末	7,365	-	0.7005	-
8月末	7,249	-	0.6845	-
9月末	7,491	-	0.7049	-
10月末	7,430	-	0.6969	-
11月末	7,565	-	0.7069	-
12月末	7,659	-	0.7157	-
平成23年1月末	7,737	-	0.7217	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-
第3期	-
第4期	-

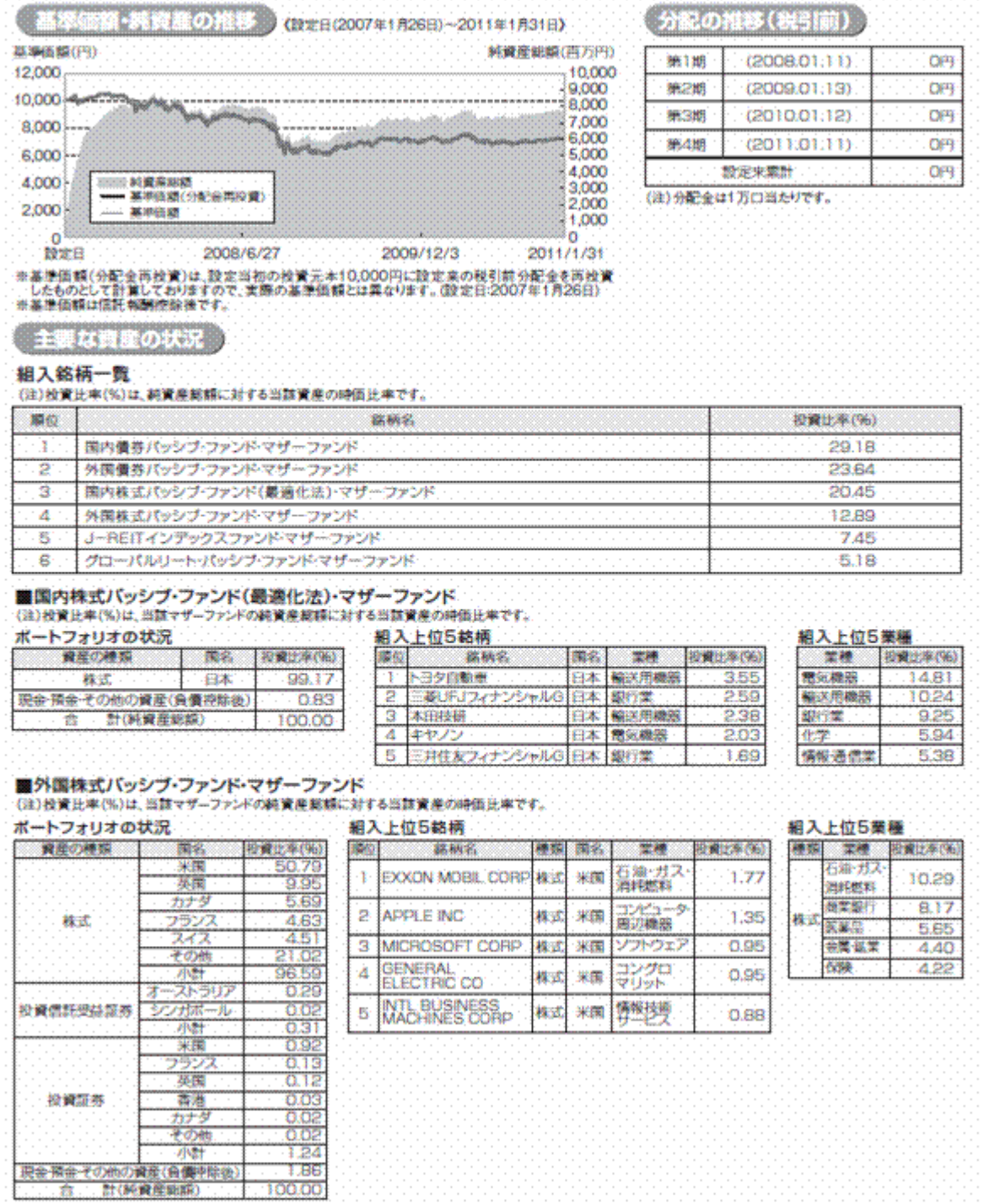
【収益率の推移】

	収益率（％）
第1期	8.75
第2期	30.05
第3期	15.32
第4期	1.86

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

<< 参考情報 >>

データの基準日：2011年1月31日



○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2011年1月31日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	日本	75.77
特殊債券	日本	9.30
社債券	日本	7.83
地方債証券	日本	6.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.46
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	63回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	1.20	2012/3/20	1.75
2	64回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	1.50	2012/6/20	1.69
3	310回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.00	2020/9/20	1.59
4	306回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.40	2020/3/20	1.47
5	81回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.80	2014/3/20	1.46

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債証券	米国	39.55
	イタリア	10.06
	フランス	9.38
	ドイツ	9.37
	英国	7.65
	その他	21.12
	小計	97.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.86
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 11/15/12	国債証券	米国	4.00	2012/11/15	0.97
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債証券	米国	4.25	2013/11/15	0.91
3	US T N/B 4.0 02/15/14	国債証券	米国	4.00	2014/2/15	0.90
4	US T N/B 4.5 04/30/12	国債証券	米国	4.50	2012/4/30	0.87
5	US T N/B 0.875 02/29/12	国債証券	米国	0.88	2012/2/29	0.83

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資証券	日本	98.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.44
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	13.27
2	ジャパリアルエステイト投資法人	日本	10.76
3	日本リアルファンド投資法人	日本	6.81
4	森トラスト総合リート投資法人	日本	5.53
5	野村不動産オフィスファンド投資法人	日本	4.76

■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

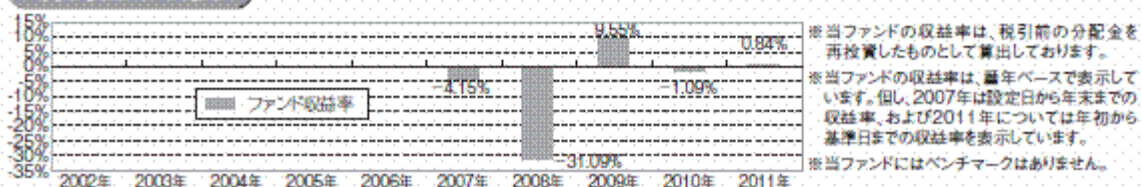
ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資信託受益証券	オーストラリア	13.00
	シンガポール	2.80
投資証券	小計	15.81
	米国	60.89
	英国	6.58
	フランス	5.90
	カナダ	2.68
	オランダ	2.34
	その他	3.48
	小計	81.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.33
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	5.54
2	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	4.04
3	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	米国	2.91
5	PUBLIC STORAGE	米国	2.89

年間収益率の推移



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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	12,252,099,717	3,511,628,988
第2期	2,271,286,181	1,714,151,191
第3期	1,780,961,356	925,938,640
第4期	1,561,559,539	1,016,414,248

(注)本邦外における設定及び解約はございません。

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、お申込日が海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

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

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

・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

海外休業日には、解約の請求の受付を行いません。

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

・解約価額

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

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令及び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（1万口あたり）は、毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
 - ・委託会社への照会
- ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>
コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(2)【保管】

該当事項はありません。

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

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。
各計算期間の終了日が休業日の場合には翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(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10億円を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更 d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信

託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

- k. 上記d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞公告または書面に付記します。

ロ．信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. からe. の規定にしたがいます。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、新聞広告または書面に付記します。
- h. 上記b. に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの計算期間末に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

ハ．関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

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

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成21年1月14日から平成22年1月12日まで）及び第4期計算期間（平成22年1月13日から平成23年1月11日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド<育成型>】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成22年1月12日現在	第4期 平成23年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,005,962	156,961,105
親投資信託受益証券	7,394,681,412	7,630,985,734
未収入金	5,858,000	429,000
流動資産合計	7,530,545,374	7,788,375,839
資産合計		
	7,530,545,374	7,788,375,839
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,957,520	22,942,204
未払受託者報酬	2,638,492	2,757,658
未払委託者報酬	33,170,146	34,668,266
その他未払費用	188,370	196,884
流動負債合計	56,954,528	60,565,012
負債合計		
	56,954,528	60,565,012
純資産の部		
元本等		
元本	10,152,628,435	10,697,773,726
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	*3 2,679,037,589	*3 2,969,962,899
(分配準備積立金)	424,807,162	506,941,979
元本等合計	7,473,590,846	7,727,810,827
純資産合計		
	7,473,590,846	7,727,810,827
負債純資産合計		
	7,530,545,374	7,788,375,839

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第 3 期		第 4 期	
	自 平成21年 1 月14日	至 平成22年 1 月12日	自 平成22年 1 月13日	至 平成23年 1 月11日
営業収益				
受取利息		90,684		76,739
有価証券売買等損益		1,026,052,308		58,318,678
営業収益合計		1,026,142,992		58,241,939
営業費用				
受託者報酬		4,928,943		5,450,296
委託者報酬	*1	61,964,907	*1	68,519,148
その他費用		351,889		389,126
営業費用合計		67,245,739		74,358,570
営業利益又は営業損失()		958,897,253		132,600,509
経常利益又は経常損失()		958,897,253		132,600,509
当期純利益又は当期純損失()		958,897,253		132,600,509
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		40,537,557		21,801,443
期首剰余金又は期首欠損金()		3,363,053,909		2,679,037,589
剰余金増加額又は欠損金減少額		332,483,263		269,768,799
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		332,483,263		269,768,799
剰余金減少額又は欠損金増加額		566,826,639		449,895,043
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		566,826,639		449,895,043
分配金		*2 -		*2 -
期末剰余金又は期末欠損金()		2,679,037,589		2,969,962,899

(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 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、平成21年1月14日から平成22年1月12日までとなっております。	計算期間の取扱い 当ファンドの計算期間は前計算期間末日が休業日のため、平成22年1月13日から平成23年1月11日までとなっております。

(追加情報)

第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 3 期 平成22年1月12日現在	第 4 期 平成23年1月11日現在
*1 期首元本額	9,297,605,719円	10,152,628,435円
期中追加設定元本額	1,780,961,356円	1,561,559,539円
期中解約元本額	925,938,640円	1,016,414,248円
*2 計算期間末日における受益権の総数	10,152,628,435口	10,697,773,726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2,679,037,589円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,969,962,899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 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
*1 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	971,671円	862,311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(187,506,924円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(101,911,955円)及び分配準備積立金(237,300,238円)より分配対象収益は526,719,117円(1万口当たり518.80円)であります。なお、分配金については、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(121,601,309円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(171,026,607円)及び分配準備積立金(385,340,670円)より分配対象収益は677,968,586円(1万口当たり633.75円)であります。なお、分配金については、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 3 期 自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 3 期 平成22年1月12日現在	第 4 期 平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

	第 4 期 自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券	57,343,823	
合計	57,343,823	

（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 3 期 平成22年1月12日現在	第 4 期 平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.7361円	0.7224円

(1万口当たり純資産額)	(7,361円)	(7,224円)
--------------	----------	----------

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,331,163,776	1,608,045,841	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,022,475,991	2,256,274,215	
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	660,693,969	585,440,925	
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	758,783,644	981,790,156	
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	1,606,931,925	1,805,870,097	
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	529,055,653	393,564,500	
合計		6,909,104,958	7,630,985,734	

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22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,144,123,015	2,235,740,681
株式	*2	279,636,813,884	273,490,260,816
派生商品評価勘定		324,456,481	88,010,774
未収入金		660,595	1,809,821
未収配当金		215,792,550	242,914,800
差入委託証拠金		191,428,081	-
流動資産合計		286,513,274,606	276,058,736,892
資産合計		286,513,274,606	276,058,736,892
負債の部			

流動負債			
前受金		241,944,081	91,270,000
未払金		131,119,706	-
未払解約金		372,228,000	82,007,000
流動負債合計		745,291,787	173,277,000
負債合計		745,291,787	173,277,000
純資産の部			
元本等			
元本		234,321,017,334	228,379,687,941
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		51,446,965,485	47,505,771,951
元本等合計		285,767,982,819	275,885,459,892
純資産合計		285,767,982,819	275,885,459,892
負債純資産合計		286,513,274,606	276,058,736,892

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及 び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価 で評価しております。時価評価に あたっては、原則として、計算日 に知りうる直近の日の主たる金 融商品取引所等の発表する清算 値段又は最終相場によっており ます。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成21年2 月10日から平成22年2月8日まで となっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成22年2 月9日から平成23年2月7日までと なっております。

(追加情報)

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	152,215,619,455円	234,321,017,334円
同期中追加設定元本額	121,910,897,356円	45,220,534,775円
同期中解約元本額	39,805,499,477円	51,161,864,168円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,240,826,388円	1,610,616,769円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	571,853,111円	1,041,338,140円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	27,477,374,032円	30,980,898,025円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	630,990,480円	722,475,195円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,470,316,824円	2,771,259,234円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,663,298,426円	2,910,270,200円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	422,053,974円	444,286,655円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,266,901,924円	1,359,305,055円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	982,497,036円	1,035,187,638円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	165,580,049円	148,204,667円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,268,381,067円	1,331,163,776円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	- 円	9,953,804円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	276,749,160円	256,259,608円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	12,042,367,860円	10,254,954,694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)	1,953,730,647円	1,750,725,206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)	223,706,103円	203,242,674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)	832,965,196円	769,278,546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)	234,305,997円	219,367,345円

D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	308,472,435円	288,653,665円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,326,362,750円	19,349,603,643円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,986,751,720円	6,436,035,294円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,617,334,211円	5,022,227,148円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,841,880,998円	3,398,318,782円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,972,563,967円	7,952,582,764円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,294,353,059円	1,205,187,236円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	2,752,665,298円	2,530,767,385円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,867,004,337円	2,587,872,007円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	14,738,925,608円	13,926,600,072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)	243,609,429円	215,786,345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)	545,104,164円	295,865,972円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,923,564,501円	4,759,493,521円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,695,713,679円	8,845,496,943円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	460,058,065円	458,251,539円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	42,139,677,496円	39,854,696,261円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,974,018,147円	2,696,756,649円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,218,376,675円	4,823,978,728円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	25,718,772,412円	24,121,903,458円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	286,039,539円	276,688,196円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	93,642円	91,930円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	144,608円	144,867円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	18,586,676,425円	21,026,822,765円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	22,899,615円	200,129,538円

D I A M国内バランス30VA （適格機関投資家限定）	49,025,475円	77,583,539円
D I A Mバランス20VA（適 格機関投資家限定）	26,811,895円	209,143,853円
D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定）	86,893円	86,168円
D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	132,017円	132,442円
（合 計）	234,321,017,334円	228,379,687,941円
*2 差入代用有価証券		株式 1,727,500,000円
*3 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	234,321,017,334口	228,379,687,941口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
----	--------------	--------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	279,636,813,884	39,678,759,158
合計	279,636,813,884	39,678,759,158

	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
株式	14,689,435,088	
合計	14,689,435,088	

(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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11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。	
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。	
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。	
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。	
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。	

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成22年1月12日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	5,793,397,000	-	6,118,425,000	324,456,481
合計		5,793,397,000	-	6,118,425,000	324,456,481

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

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2196円	1.2080円
（1万口当たり純資産額）	（12,196円）	（12,080円）

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

平成23年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	101,000	182	18,382,000	
日本水産	286,600	256	73,369,600	
マルハニチロホールディングス	493,000	141	69,513,000	
ハウスイ	20,000	109	2,180,000	
サカタのタネ	33,600	1,134	38,102,400	
ホクト	25,300	1,919	48,550,700	
ショーボンドHD	22,100	1,746	38,586,600	
ミライト・ホールディングス	65,200	603	39,315,600	
住石ホールディングス	69,900	88	6,151,200	
日鉄鉱業	63,000	408	25,704,000	
三井松島	143,000	183	26,169,000	
国際石油開発帝石	2,508	486,000	1,218,888,000	
日本海洋掘削	6,200	3,020	18,724,000	
関東天然瓦斯	26,000	451	11,726,000	
石油資源開発	39,200	3,235	126,812,000	
ダイセキ環境ソリューション	21	79,700	1,673,700	
間組	99,400	72	7,156,800	
東急建設	88,350	248	21,910,800	
コムシスホールディングス	120,700	886	106,940,200	
ミサワホーム	29,400	397	11,671,800	
高松コンストラクションGP	19,000	1,117	21,223,000	
東建コーポレーション	8,360	3,450	28,842,000	
ヤマウラ	8,500	206	1,751,000	
大成建設	1,175,000	204	239,700,000	
大林組	743,000	399	296,457,000	
清水建設	704,000	367	258,368,000	
飛鳥建設	717,000	26	18,642,000	
長谷工コーポレーション	1,546,500	77	119,080,500	
松井建設	2,000	325	650,000	
鹿島建設	1,089,000	230	250,470,000	
不動テトラ	181,800	55	9,999,000	
大末建設	92,000	41	3,772,000	
鉄建建設	152,000	91	13,832,000	
安藤建設	85,000	122	10,370,000	
太平工業	49,000	394	19,306,000	
西松建設	325,000	114	37,050,000	
三井住友建設	136,500	68	9,282,000	
大豊建設	76,000	79	6,004,000	
前田建設	153,000	284	43,452,000	
佐田建設	89,000	41	3,649,000	
ナカノフドー建設	19,500	233	4,543,500	
奥村組	236,000	322	75,992,000	
大和小田急建設	13,000	227	2,951,000	
東鉄工業	33,000	594	19,602,000	
イチケン	30,000	122	3,660,000	
浅沼組	83,000	56	4,648,000	
戸田建設	266,000	323	85,918,000	
熊谷組	189,000	64	12,096,000	
青木あすなろ建設	17,500	360	6,300,000	
北野建設	55,000	210	11,550,000	
植木組	34,000	132	4,488,000	
三井ホーム	28,000	449	12,572,000	

矢作建設	31,000	488	15,128,000
ピーエス三菱	16,900	243	4,106,700
大東建託	96,800	5,650	546,920,000
新日本建設	29,900	225	6,727,500
N I P P O	58,000	572	33,176,000
東亜道路	49,000	134	6,566,000
前田道路	72,000	663	47,736,000
日本道路	75,000	202	15,150,000
東亜建設	202,000	99	19,998,000
若築建設	139,000	46	6,394,000
東洋建設	337,000	47	15,839,000
五洋建設	271,500	131	35,566,500
大林道路	32,000	167	5,344,000
世紀東急	64,000	50	3,200,000
福 田 組	34,000	162	5,508,000
住友林業	170,700	745	127,171,500
日本基礎技術	35,200	266	9,363,200
日成ビルド工業	77,000	56	4,312,000
エス・バイ・エル	120,000	57	6,840,000
巴コーポレーション	35,300	260	9,178,000
パナホーム	81,000	550	44,550,000
大和ハウス	617,000	1,018	628,106,000
ライト工業	56,000	225	12,600,000
積水ハウス	743,000	839	623,377,000
日特建設	72,000	60	4,320,000
北陸電気工事	2,000	226	452,000
ユアテック	40,000	335	13,400,000
西部電気工業	1,000	357	357,000
四電工	6,000	351	2,106,000
中電工	36,500	1,008	36,792,000
関 電 工	114,000	542	61,788,000
きんでん	165,000	775	127,875,000
東京エネシス	28,000	537	15,036,000
トーエネック	37,000	476	17,612,000
住友電設	18,300	349	6,386,700
日本電設工業	46,000	798	36,708,000
協和エクシオ	89,600	841	75,353,600
新日本空調	18,700	512	9,574,400
日本工営	78,000	263	20,514,000
日本電話施設	40,000	264	10,560,000
九電工	46,000	523	24,058,000
三機工業	57,000	575	32,775,000
日 揮	249,000	1,904	474,096,000
中外炉工業	80,000	314	25,120,000
ヤマト	16,000	302	4,832,000
太平電業	32,000	691	22,112,000
高砂熱学	71,300	688	49,054,400
三晃金属	29,000	186	5,394,000
N E C ネットズエスアイ	21,100	1,078	22,745,800
朝日工業社	8,000	353	2,824,000
アタカ大機	17,000	244	4,148,000
大 氣 社	38,000	1,457	55,366,000
ダイダン	25,000	434	10,850,000
日比谷総合設	33,200	777	25,796,400
東芝プラントシステム	40,000	1,183	47,320,000
日本製粉	145,000	411	59,595,000
日清製粉G本社	224,500	1,050	235,725,000
日東富士製粉	8,000	311	2,488,000
昭和産業	104,000	242	25,168,000

鳥越製粉	22,200	751	16,672,200
協同飼料	90,000	103	9,270,000
中部飼料	22,200	576	12,787,200
日本配合飼料	78,000	106	8,268,000
東洋精糖	40,000	110	4,400,000
日本甜菜糖	139,000	198	27,522,000
三井製糖	98,000	313	30,674,000
ネクスト	58	99,600	5,776,800
日本M&Aセンター	50	362,000	18,100,000
アコーディア・ゴルフ	649	75,500	48,999,500
パソナグループ	200	61,100	12,220,000
リンクアンドモチベーション	51	49,950	2,547,450
テンプホールディングス	31,700	758	24,028,600
森永製菓	245,000	195	47,775,000
中村屋	58,000	398	23,084,000
江崎グリコ	90,000	953	85,770,000
名糖産業	11,300	1,104	12,475,200
不二家	142,000	167	23,714,000
山崎製パン	182,000	980	178,360,000
第一屋製パン	37,000	99	3,663,000
モロゾフ	40,000	282	11,280,000
森永乳業	210,000	344	72,240,000
ヤクルト	132,800	2,432	322,969,600
明治ホールディングス	73,400	3,705	271,947,000
雪印メグミルク	48,700	1,518	73,926,600
プリマハム	141,000	97	13,677,000
日本ハム	173,000	1,085	187,705,000
伊藤ハム	137,000	297	40,689,000
林兼産業	81,000	88	7,128,000
丸大食品	110,000	268	29,480,000
米久	22,000	675	14,850,000
S Foods	16,500	713	11,764,500
学情	8,600	305	2,623,000
スタジオアリス	9,700	783	7,595,100
シミック	440	23,060	10,146,400
システナ	217	92,500	20,072,500
NECフィールドینگ	18,700	1,051	19,653,700
新日鉄ソリューションズ	18,100	1,806	32,688,600
総合警備保障	84,100	987	83,006,700
日本駐車場開発	2,400	3,850	9,240,000
コア	8,500	695	5,907,500
カクコム	159	515,000	81,885,000
アイロムホールディングス	536	2,493	1,336,248
ルネサンス	11,500	300	3,450,000
新日本科学	14,600	400	5,840,000
エムスリー	90	424,500	38,205,000
ディー・エヌ・エー	90,000	2,957	266,130,000
博報堂DYHLDGS	31,990	4,835	154,671,650
ぐるなび	121	121,900	14,749,900
一休	164	38,350	6,289,400
ジャパンベストレスキューS	36	69,300	2,494,800
ジェイコムホールディングス	23	98,700	2,270,100
PGMホールディングス	487	54,900	26,736,300
サッポロホールディングス	352,000	387	136,224,000
アサヒビール	464,700	1,572	730,508,400
キリンHD	1,023,000	1,144	1,170,312,000
宝ホールディングス	210,000	485	101,850,000
オエノンホールディングス	70,000	206	14,420,000
養命酒	3,000	798	2,394,000

三国コカ・コ・ラ	30,400	741	22,526,400
コカ・コーラウエスト	76,400	1,504	114,905,600
コカコーラセントラルジャパン	28,300	1,081	30,592,300
ダイドードリンコ	10,400	3,140	32,656,000
伊藤園	62,900	1,380	86,802,000
キーコーヒー	22,100	1,460	32,266,000
ユニカフェ	6,400	406	2,598,400
ジャパンフーズ	4,000	819	3,276,000
日清オイリオグループ	108,000	406	43,848,000
不二製油	60,300	1,165	70,249,500
J-オイルミルズ	93,000	255	23,715,000
ローソン	75,700	4,030	305,071,000
インターニックス	9,600	395	3,792,000
サンエー	7,400	3,325	24,605,000
キリン堂	9,800	418	4,096,400
ダイユーエイト	1,900	555	1,054,500
カワチ薬品	15,200	1,725	26,220,000
エービーシー・マート	25,800	2,975	76,755,000
ハードオフコーポレーション	11,300	447	5,051,100
高千穂交易	9,500	942	8,949,000
アスクル	15,700	1,627	25,543,900
ゲオ	361	98,800	35,666,800
ポイント	18,400	3,600	66,240,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	5,000	124	620,000
伊藤忠食品	5,500	2,914	16,027,000
くらコーポレーション	11,400	1,267	14,443,800
キャンドゥ	92	72,200	6,642,400
エレマテック	17,500	1,206	21,105,000
バル	6,350	2,925	18,573,750
JALUX	6,800	697	4,739,600
エディオン	79,500	748	59,466,000
サーラコーポレーション	21,500	462	9,933,000
トーマンデバイス	2,800	2,045	5,726,000
バルス	103	83,000	8,549,000
あみやき亭	38	271,500	10,317,000
ひらまつ	43	97,900	4,209,700
双日	1,460,500	191	278,955,500
アルフレッサホールディングス	57,000	3,685	210,045,000
ハニーズ	19,110	998	19,071,780
キッコーマン	202,000	927	187,254,000
味の素	673,000	870	585,510,000
キュービー	128,500	1,042	133,897,000
ハウス食品	91,500	1,326	121,329,000
カゴメ	89,200	1,506	134,335,200
焼津水産化工	12,100	862	10,430,200
アリアケジャパン	20,700	1,415	29,290,500
ニチレイ	279,000	377	105,183,000
横浜冷凍	47,800	563	26,911,400
東洋水産	107,000	1,816	194,312,000
日清食品HD	88,700	2,926	259,536,200
永谷園	2,000	868	1,736,000
フジッコ	27,000	1,014	27,378,000
ロックフィールド	12,300	1,299	15,977,700
日本たばこ産業	5,145	308,000	1,584,660,000
わらべや日洋	14,000	1,019	14,266,000
なとり	12,900	828	10,681,200
片倉工業	26,700	806	21,520,200
ゲンゼ	158,000	365	57,670,000
昭栄	39,900	756	30,164,400

神 栄	29,000	167	4,843,000
川島織物セルコン	84,000	71	5,964,000
山下医科器械	1,900	1,119	2,126,100
ラサ商事	11,100	351	3,896,100
アルペン	16,600	1,460	24,236,000
ビックカメラ	531	33,900	18,000,900
DCMホールディングス	103,900	503	52,261,700
MonotaRO	4,300	810	3,483,000
あい ホールディングス	46,500	318	14,787,000
ユニバース	3,300	1,252	4,131,600
J. フロント リテイリング	515,000	445	229,175,000
ドトール・日レスHD	38,300	1,114	42,666,200
マツモトキヨシHLDGS	40,400	1,764	71,265,600
ココカラファイン	21,000	1,740	36,540,000
三越伊勢丹HD	433,100	947	410,145,700
東洋紡績	824,000	156	128,544,000
ユニチカ	522,000	77	40,194,000
富士紡ホールディングス	103,000	149	15,347,000
日清紡ホールディングス	147,000	935	137,445,000
倉敷紡績	220,000	157	34,540,000
ダイワボウHD	201,000	224	45,024,000
シキボウ	141,000	121	17,061,000
日東紡績	188,000	213	40,044,000
トヨタ紡織	77,200	1,509	116,494,800
クリエイトSDH	7,600	1,828	13,892,800
バイタルKSKHD	41,100	706	29,016,600
UKCホールディングス	12,900	1,040	13,416,000
CHIグループ	12,400	315	3,906,000
日本毛織	79,000	692	54,668,000
大東紡織	36,000	76	2,736,000
トーア紡コーポレーション	80,000	75	6,000,000
ダイドーリミテッド	29,000	731	21,199,000
東京建物不動産販	6,600	271	1,788,600
野村不動産HLDGS	91,400	1,595	145,783,000
ヒューリック	61,900	683	42,277,700
帝国繊維	25,000	518	12,950,000
ブックオフコーポレーション	13,500	680	9,180,000
日本コークス工業	185,500	170	31,535,000
ミタチ産業	3,800	465	1,767,000
JFE商事HLDGS	146,000	417	60,882,000
あさひ	9,000	1,246	11,214,000
サークルKサンクス	47,300	1,361	64,375,300
日本調剤	2,750	3,295	9,061,250
コスモス薬品	9,600	3,275	31,440,000
シップヘルスケアHD	28,300	1,071	30,309,300
セブン&アイ・HLDGS	912,000	2,155	1,965,360,000
ツルハホールディングス	16,300	3,915	63,814,500
サンマルクホールディングス	7,000	3,420	23,940,000
フェリシモ	6,200	1,025	6,355,000
トリドール	80	119,300	9,544,000
帝 人	878,000	378	331,884,000
東 レ	1,790,000	515	921,850,000
ク ラ レ	341,500	1,208	412,532,000
旭 化 成	1,347,000	548	738,156,000
サカイ オーベックス	65,000	132	8,580,000
稲葉製作所	11,300	890	10,057,000
宮地エンジニアリングG	74,000	88	6,512,000
三協・立山HLDGS	268,000	109	29,212,000
トーカロ	12,000	1,601	19,212,000

アルファCO	7,300	942	6,876,600
SUMCO	141,400	1,211	171,235,400
川田テクノロジーズ	5,300	1,577	8,358,100
住江織物	58,000	184	10,672,000
日本フェルト	14,000	421	5,894,000
イチカワ	14,000	171	2,394,000
日本バイリン	25,000	430	10,750,000
エコナックホールディングス	73,000	35	2,555,000
日東製網	28,000	98	2,744,000
芦森工業	57,000	136	7,752,000
アツギ	200,000	110	22,000,000
ダイニック	45,000	170	7,650,000
共和レザー	14,600	328	4,788,800
セーレン	57,700	668	38,543,600
東海染工	33,000	86	2,838,000
小松精練	39,000	353	13,767,000
ワコールホールディングス	138,000	1,158	159,804,000
ホギメディカル	12,400	4,040	50,096,000
サンエー・インターナショナル	9,700	1,065	10,330,500
レナウン	44,300	214	9,480,200
クラウドディア	2,400	1,313	3,151,200
ITホールディングス	72,100	1,102	79,454,200
グリー	35,100	1,092	38,329,200
コーエーテクモHD	43,200	627	27,086,400
三菱総合研究所	8,400	1,915	16,086,000
特種東海製紙	146,000	200	29,200,000
ダウンゴ	109	180,200	19,641,800
ベリサーブ	13	133,000	1,729,000
マクロミル	21,200	946	20,055,200
ティーガイア	176	142,200	25,027,200
GMOペイメントゲートウェイ	48	229,700	11,025,600
ザッパラス	120	123,200	14,784,000
インターネットイニシアティブ	127	249,500	31,686,500
ソネットエンタテインメント	123	253,400	31,168,200
SRAホールディングス	11,400	919	10,476,600
JBI Sホールディングス	22,900	335	7,671,500
朝日ネット	18,000	320	5,760,000
王子製紙	1,022,000	393	401,646,000
三菱製紙	330,000	99	32,670,000
北越紀州製紙	143,500	478	68,593,000
中越パルプ	90,000	153	13,770,000
巴川製紙	40,000	287	11,480,000
大王製紙	97,000	591	57,327,000
日本製紙G本社	111,600	2,150	239,940,000
レンゴー	186,000	557	103,602,000
トーモク	73,000	247	18,031,000
ザ・パック	16,400	1,461	23,960,400
コ-プケミカル	37,000	110	4,070,000
昭和電工	1,540,000	193	297,220,000
住友化学	1,590,000	424	674,160,000
日本化成	44,000	205	9,020,000
住友精化	49,000	382	18,718,000
日産化学	167,300	1,079	180,516,700
ラサ工業	88,000	107	9,416,000
クレハ	150,000	496	74,400,000
テイカ	40,000	334	13,360,000
石原産業	389,000	92	35,788,000
片倉チツカリン	13,000	256	3,328,000
日本曹達	138,000	400	55,200,000

東ソー	578,000	269	155,482,000
トクヤマ	360,000	440	158,400,000
セントラル硝子	222,000	403	89,466,000
東亜合成	236,000	397	93,692,000
ダイソー	94,000	254	23,876,000
関東電化	51,000	693	35,343,000
電気化学	486,000	392	190,512,000
イビデン	134,500	2,775	373,237,500
信越化学	385,300	4,700	1,810,910,000
日本カ-パイド	55,000	253	13,915,000
堺化学	72,000	439	31,608,000
エア・ウォーター	187,000	1,069	199,903,000
大陽日酸	304,000	726	220,704,000
日本化学工業	87,000	229	19,923,000
日本パ-カラijing	55,000	1,252	68,860,000
高压ガス	35,000	512	17,920,000
チタン工業	28,000	410	11,480,000
四国化成	34,000	492	16,728,000
戸田工業	33,000	892	29,436,000
ステラケミファ	10,100	3,905	39,440,500
保土谷化学	52,000	364	18,928,000
日本触媒	189,000	866	163,674,000
大日精化	83,000	464	38,512,000
カネカ	288,000	582	167,616,000
協和発酵キリン	277,000	845	234,065,000
三菱瓦斯化学	365,000	576	210,240,000
三井化学	1,052,000	304	319,808,000
J S R	193,100	1,650	318,615,000
東京応化工業	41,500	1,835	76,152,500
三菱ケミカルH L D G S	1,343,000	588	789,684,000
日本合成化学	54,000	567	30,618,000
ダイセル化学	300,000	626	187,800,000
住友ベ-クライト	217,000	511	110,887,000
積水化学	481,000	617	296,777,000
日本ゼオン	216,000	723	156,168,000
アイカ工業	67,600	984	66,518,400
宇部興産	970,000	242	234,740,000
積水樹脂	33,000	841	27,753,000
タキロン	55,000	295	16,225,000
旭有機材	84,000	223	18,732,000
日立化成	100,000	1,764	176,400,000
ニチバン	23,000	312	7,176,000
リケンテクノス	42,000	295	12,390,000
大倉工業	55,000	250	13,750,000
積水化成成品	53,000	372	19,716,000
群栄化学	64,000	238	15,232,000
タイガースポリマー	11,800	388	4,578,400
日本カ-リット	18,900	493	9,317,700
日本化薬	163,000	890	145,070,000
イーピーエス	125	199,300	24,912,500
パナソニック電工I S	4,400	2,220	9,768,000
フェイス	740	10,100	7,474,000
アミューズ	6,900	971	6,699,900
野村総合研究所	123,300	1,883	232,173,900
ドリームインキュベータ	68	67,500	4,590,000
サイバネットシステム	185	24,060	4,451,100
T A C	14,200	341	4,842,200
ケネディクス	2,601	23,820	61,955,820
電通	209,900	2,578	541,122,200

インテージ	6,500	1,728	11,232,000
テイクアンドギヴニーズ	1,151	7,600	8,747,600
ぴあ	6,900	839	5,789,100
シンプレクスホールディング	364	38,300	13,941,200
イオンファンタジー	7,600	998	7,584,800
ソースネクスト	43	22,940	986,420
ネクシィーズ	1,007	2,936	2,956,552
メディカルシステムネットワーク	3,100	659	2,042,900
日本精化	19,600	561	10,995,600
A D E K A	92,700	925	85,747,500
日油	203,000	423	85,869,000
ミヨシ油脂	81,000	134	10,854,000
ハリマ化成	9,000	566	5,094,000
花王	629,900	2,197	1,383,890,300
第一工業製薬	39,000	328	12,792,000
三洋化成	65,000	712	46,280,000
武田薬品	866,700	3,975	3,445,132,500
アステラス製薬	513,700	3,125	1,605,312,500
大日本住友製薬	164,000	753	123,492,000
塩野義製薬	337,200	1,597	538,508,400
田辺三菱製薬	192,600	1,379	265,595,400
わかもと製薬	4,000	249	996,000
あすか製薬	28,000	609	17,052,000
日本新薬	53,000	1,147	60,791,000
中外製薬	230,400	1,496	344,678,400
科研製薬	98,000	1,004	98,392,000
エーザイ	284,900	2,938	837,036,200
ロート製薬	105,000	959	100,695,000
小野薬品	116,100	3,870	449,307,000
久光製薬	65,300	3,370	220,061,000
有機合成薬品	17,000	245	4,165,000
持田製薬	93,000	880	81,840,000
大正製薬	186,000	1,818	338,148,000
参天製薬	71,700	2,924	209,650,800
扶桑薬品	78,000	253	19,734,000
日本ケミファ	36,000	289	10,404,000
ツムラ	63,100	2,611	164,754,100
テルモ	173,600	4,610	800,296,000
みらかホールディングス	56,100	3,260	182,886,000
キッセイ薬品工業	46,900	1,607	75,368,300
生化学工業	44,600	898	40,050,800
栄研化学	18,300	1,006	18,409,800
日水製薬	10,400	700	7,280,000
鳥居薬品	15,900	1,786	28,397,400
東和薬品	11,800	4,475	52,805,000
沢井製薬	15,200	6,700	101,840,000
ゼリア新薬工業	34,000	996	33,864,000
第一三共	778,300	1,782	1,386,930,600
キョーリン製薬HD	62,000	1,433	88,846,000
大幸薬品	7,900	1,138	8,990,200
大日本塗料	135,000	119	16,065,000
日本ペイント	200,000	650	130,000,000
関西ペイント	262,000	828	216,936,000
トウパ	22,000	88	1,936,000
中国塗料	62,000	713	44,206,000
日本特殊塗料	18,500	369	6,826,500
藤倉化成	29,500	576	16,992,000
太陽ホールディングス	17,100	2,692	46,033,200
D I C	883,000	182	160,706,000

サカタインクス	48,000	430	20,640,000
東洋インキ	208,000	432	89,856,000
アルプス技研	10,400	691	7,186,400
サニックス	33,900	197	6,678,300
ダイオーズ	1,400	478	669,200
日本空調サービス	6,700	733	4,911,100
オリエンタルランド	62,400	7,600	474,240,000
ダスキン	64,800	1,542	99,921,600
パーク24	102,300	849	86,852,700
明光ネットワークジャパン	19,500	693	13,513,500
ファルコSDホールディングス	11,800	818	9,652,400
クレスコ	5,400	571	3,083,400
フジ・メディア・HD	2,270	129,400	293,738,000
秀英予備校	4,100	375	1,537,500
田谷	900	695	625,500
ラウンドワン	58,800	529	31,105,200
リゾートトラスト	35,600	1,386	49,341,600
オービック	7,500	17,770	133,275,000
ティーディーシーソフトウェア	4,900	765	3,748,500
ヤフー	15,953	30,450	485,768,850
ビー・エム・エル	13,600	2,311	31,429,600
ワタベウェディング	7,000	903	6,321,000
トレンドマイクロ	96,200	2,718	261,471,600
もしもしホットライン	14,400	2,072	29,836,800
東急コミュニティー	6,000	2,427	14,562,000
リソー教育	2,378	4,750	11,295,500
日本オラクル	34,900	3,995	139,425,500
アルファシステムズ	6,000	1,503	9,018,000
フューチャーアーキテクト	264	35,950	9,490,800
ウェアハウス	5,900	292	1,722,800
シーエーシー	13,400	656	8,790,400
ソフトバンク・テクノ	5,500	686	3,773,000
トーセ	4,100	573	2,349,300
ユー・エス・エス	30,100	6,620	199,262,000
オービックビジネスC	5,550	4,760	26,418,000
日立ビジネスソリューション	7,400	783	5,794,200
伊藤忠テクノソリューション	30,900	3,125	96,562,500
アイティフォー	24,500	290	7,105,000
東京個別指導学院	17,000	245	4,165,000
東計電算	4,200	1,152	4,838,400
カルチュア・コンビニエンス	119,800	480	57,504,000
エクスネット	18	138,400	2,491,200
テー・オー・ダブリュー	6,700	490	3,283,000
大塚商会	17,300	5,600	96,880,000
総合メディカル	4,800	2,371	11,380,800
サイボウズ	288	24,800	7,142,400
ソフトブレーン	335	5,950	1,993,250
アグレックス	5,800	831	4,819,800
セントラルスポーツ	7,600	906	6,885,600
電通国際情報S	13,700	580	7,946,000
ウェザーニューズ	5,000	1,625	8,125,000
C I J	21,300	282	6,006,600
フルキャストホールディングス	215	20,260	4,355,900
富士フイルムHLDGS	494,200	3,030	1,497,426,000
コニカミノルタHLDGS	583,500	870	507,645,000
資生堂	384,100	1,767	678,704,700
ライオン	267,000	444	118,548,000
高砂香料	76,000	530	40,280,000
マンダム	23,200	2,191	50,831,200

ミルボン	12,300	2,163	26,604,900
ファンケル	44,700	1,204	53,818,800
コーセー	41,600	2,070	86,112,000
ドクターシーラボ	154	316,500	48,741,000
エステー	14,400	967	13,924,800
コニシ	18,300	995	18,208,500
長谷川香料	29,500	1,390	41,005,000
小林製薬	32,100	3,810	122,301,000
荒川化学工業	18,200	882	16,052,400
メック	15,600	429	6,692,400
日本高純度化学	66	269,700	17,800,200
荏原ユージライト	3,500	1,788	6,258,000
アース製薬	16,700	2,798	46,726,600
イハラケミカル	44,000	279	12,276,000
北興化学	11,000	256	2,816,000
大成ラミック	6,700	2,298	15,396,600
クミアイ化学	48,000	281	13,488,000
日本農薬	48,000	437	20,976,000
昭和シエル石油	207,100	773	160,088,300
コスモ石油	639,000	280	178,920,000
富士興産	84,000	80	6,720,000
ニチレキ	30,000	350	10,500,000
東燃ゼネラル石油	349,000	933	325,617,000
ユシロ化学	11,600	1,245	14,442,000
ビービー・カストロール	11,300	336	3,796,800
AOCホールディングス	58,900	525	30,922,500
出光興産	27,400	9,000	246,600,000
JXホールディングス	2,567,100	576	1,478,649,600
横浜ゴム	259,000	443	114,737,000
東洋ゴム	192,000	210	40,320,000
ブリヂストン	725,100	1,673	1,213,092,300
住友ゴム	162,300	885	143,635,500
藤倉ゴム	15,000	380	5,700,000
オカモト	89,000	340	30,260,000
アキレス	189,000	125	23,625,000
フコク	9,700	850	8,245,000
ニッタ	20,700	1,672	34,610,400
クリエートメディック	7,600	858	6,520,800
東海ゴム工業	35,600	1,176	41,865,600
三ツ星ベルト	60,000	494	29,640,000
バンドー化学	83,000	351	29,133,000
鬼怒川ゴム	55,000	455	25,025,000
旭硝子	1,140,000	964	1,098,960,000
日本板硝子	993,000	226	224,418,000
石塚硝子	31,000	170	5,270,000
有沢製作所	36,000	510	18,360,000
日本山村硝子	101,000	230	23,230,000
日本電気硝子	478,000	1,154	551,612,000
オハラ	8,800	1,173	10,322,400
住友大阪セメント	441,000	192	84,672,000
太平洋セメント	979,000	111	108,669,000
デイ・シイ	25,900	168	4,351,200
リゾートソリューション	22,000	162	3,564,000
日本ヒユ-ム	20,000	279	5,580,000
日本コンクリ-ト	40,000	151	6,040,000
東海カーボン	217,000	530	115,010,000
日本カーボン	114,000	270	30,780,000
東洋炭素	11,400	4,990	56,886,000
ノリタケ	120,000	299	35,880,000

TOTO	332,000	592	196,544,000
日本碍子	278,000	1,426	396,428,000
日本特殊陶業	205,000	1,325	271,625,000
ダントーホールディングス	37,000	85	3,145,000
MARUWA	5,300	2,506	13,281,800
品川リフラクトリーズ	59,000	261	15,399,000
黒崎播磨	50,000	356	17,800,000
東京窯業	13,000	217	2,821,000
ニッカトー	9,200	412	3,790,400
フジインコーポレーテッド	21,200	1,311	27,793,200
エーアンドエーマテリアル	52,000	60	3,120,000
ニチアス	112,000	470	52,640,000
新日本製鐵	6,070,000	303	1,839,210,000
住友金属工業	4,285,000	201	861,285,000
神戸製鋼所	3,205,000	216	692,280,000
日新製鋼	887,000	181	160,547,000
中山製鋼所	118,000	121	14,278,000
合同製鐵	130,000	198	25,740,000
JFEホールディングス	547,900	2,907	1,592,745,300
東京製鐵	127,600	971	123,899,600
共英製鋼	24,600	1,409	34,661,400
大和工業	52,800	2,568	135,590,400
東京鐵鋼	48,000	234	11,232,000
大阪製鐵	14,600	1,442	21,053,200
淀川製鋼所	177,000	387	68,499,000
東洋鋼鈹	55,000	523	28,765,000
住友鋼管	15,900	609	9,683,100
丸一鋼管	77,500	1,785	138,337,500
モリ工業	38,000	366	13,908,000
大同特殊鋼	387,000	512	198,144,000
日本高周波	91,000	105	9,555,000
日本金属工業	171,000	116	19,836,000
日本冶金工	119,000	260	30,940,000
山陽特殊鋼	115,000	521	59,915,000
愛知製鋼	123,000	633	77,859,000
日立金属	151,000	1,005	151,755,000
日本金属	60,000	167	10,020,000
大平洋金属	161,000	699	112,539,000
日本電工	91,000	664	60,424,000
栗本鉄工所	120,000	115	13,800,000
旭テック	160,000	37	5,920,000
日本鑄鉄管	26,000	132	3,432,000
日本製鋼所	357,000	904	322,728,000
三菱製鋼	139,000	265	36,835,000
日亜鋼業	33,000	230	7,590,000
日本精線	18,000	463	8,334,000
日本軽金属	523,000	161	84,203,000
大紀アルミニウム	36,000	260	9,360,000
三井金属	668,000	274	183,032,000
東邦亜鉛	130,000	442	57,460,000
三菱マテリアル	1,443,000	271	391,053,000
住友鋳山	638,000	1,410	899,580,000
DOWAホールディングス	276,000	545	150,420,000
古河機金	391,000	105	41,055,000
大阪チタニウム	25,300	3,935	99,555,500
東邦チタニウム	37,500	1,986	74,475,000
住友軽金属	385,000	103	39,655,000
古河スカイ	93,000	251	23,343,000
古河電工	727,000	381	276,987,000

住友電工	817,000	1,190	972,230,000
フジクラ	347,000	437	151,639,000
昭和電線HLDGS	278,000	102	28,356,000
東京特殊電線	35,000	89	3,115,000
タツタ電線	46,000	275	12,650,000
日立電線	181,000	236	42,716,000
沖電線	26,000	160	4,160,000
カナレ電気	2,800	1,192	3,337,600
平河ヒューテック	4,700	724	3,402,800
リョービ	129,000	365	47,085,000
アサヒHD	32,300	1,715	55,394,500
東洋製罐	163,400	1,597	260,949,800
ホッカンホールディングス	56,000	256	14,336,000
コロナ	10,800	818	8,834,400
横河ブリッジHLDGS	41,000	551	22,591,000
日本橋梁	9,150	181	1,656,150
駒井ハルテック	46,000	202	9,292,000
サクラダ	214,000	18	3,852,000
高田機工	23,000	176	4,048,000
三和ホールディングス	232,000	273	63,336,000
文化シャッター-	60,000	228	13,680,000
東洋シャッター-	5,200	369	1,918,800
住生活グループ	279,300	1,783	497,991,900
日本フィルコン	17,000	404	6,868,000
ノーリツ	41,900	1,439	60,294,100
長府製作所	22,300	1,893	42,213,900
リンナイ	37,200	5,110	190,092,000
ユニプレス	28,100	1,670	46,927,000
ダイニチ工業	12,100	589	7,126,900
日東精工	33,000	273	9,009,000

[次へ](#)

平成23年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
三洋工業	31,000	119	3,689,000	
岡 部	49,900	373	18,612,700	
日立ツール	13,400	946	12,676,400	
中国工業	37,000	97	3,589,000	
東 プ レ	44,600	652	29,079,200	
高周波熱錬	30,900	711	21,969,900	
東京製綱	158,000	291	45,978,000	
バイオラックス	9,900	1,860	18,414,000	
日本発条	167,000	927	154,809,000	
中央発條	30,000	346	10,380,000	
アドバネクス	44,000	106	4,664,000	
三浦工業	37,300	2,251	83,962,300	
タ ク マ	84,000	287	24,108,000	
ツ ガ ミ	65,000	632	41,080,000	
オークマ	150,000	672	100,800,000	
東芝機械	137,000	438	60,006,000	
ア マ ダ	326,000	690	224,940,000	
アイダエンジニア	60,100	409	24,580,900	
牧野フライス	107,000	712	76,184,000	
オーエスジー	101,900	978	99,658,200	
ダイジェット	22,000	114	2,508,000	
旭ダイヤモンド	49,000	1,608	78,792,000	
森精機製作所	121,900	996	121,412,400	
ディスコ	23,300	5,070	118,131,000	
日東工器	13,500	2,138	28,863,000	
豊田自動織機	201,100	2,696	542,165,600	
豊和工業	120,000	82	9,840,000	
大阪機工	78,000	141	10,998,000	
石川製作所	50,000	82	4,100,000	
東洋機械金属	19,100	268	5,118,800	
オ - エム製作所	21,000	347	7,287,000	
津田駒工業	56,000	174	9,744,000	
エンシュウ	53,000	103	5,459,000	
島精機製作所	30,100	2,196	66,099,600	
日阪製作所	29,000	1,135	32,915,000	
やまびこ	9,200	945	8,694,000	
ペガサスミシン製造	23,300	273	6,360,900	
ナプテスコ	87,200	1,831	159,663,200	
三井海洋開発	19,100	1,550	29,605,000	
レオン自動機	23,000	205	4,715,000	
S M C	69,000	14,750	1,017,750,000	
新川	16,500	971	16,021,500	
ホソカワミクロン	39,000	350	13,650,000	
ユニオンツール	14,300	2,398	34,291,400	
オイレス工業	23,400	1,608	37,627,200	
サトー	22,000	1,113	24,486,000	
日本エアーテック	7,500	413	3,097,500	
日精樹脂工業	18,800	285	5,358,000	
ワイエイシイ	9,900	676	6,692,400	
小松製作所	1,096,200	2,583	2,831,484,600	
住友重機械	590,000	549	323,910,000	
日立建機	103,300	2,071	213,934,300	
日 工	18,000	296	5,328,000	
巴工業	8,800	1,190	10,472,000	
井関農機	237,000	230	54,510,000	

T O W A	22,200	678	15,051,600
丸山製作所	53,000	177	9,381,000
北川鉄工所	106,000	166	17,596,000
シンニッタン	22,200	428	9,501,600
クボタ	970,000	815	790,550,000
荏原実業	5,900	1,234	7,280,600
東洋エンジニア	145,000	320	46,400,000
三菱化工機	71,000	193	13,703,000
月島機械	38,000	605	22,990,000
帝国電機製作所	7,900	1,889	14,923,100
東京機械	70,000	82	5,740,000
新東工業	46,600	812	37,839,200
渋谷工業	13,300	849	11,291,700
アイチ コーポレーション	38,600	356	13,741,600
小森コーポレーション	60,900	1,012	61,630,800
鶴見製作所	14,000	587	8,218,000
住友精密	41,000	435	17,835,000
酒井重工業	46,000	170	7,820,000
荏原製作所	406,000	408	165,648,000
石井鉄工所	35,000	175	6,125,000
西島製作所	26,700	1,753	46,805,100
千代田化工建	161,000	772	124,292,000
ダイキン工業	241,300	2,958	713,765,400
オルガノ	40,000	635	25,400,000
ト - ヨ - カネツ	125,000	157	19,625,000
栗田工業	127,500	2,621	334,177,500
椿本チエイン	118,000	453	53,454,000
大同工業	47,000	198	9,306,000
日本コンベヤ	75,000	85	6,375,000
日 機 装	77,000	695	53,515,000
木村化工機	21,300	690	14,697,000
新興プランテック	47,600	802	38,175,200
アネスト岩田	41,000	366	15,006,000
ダイフク	93,500	605	56,567,500
加藤製作所	53,000	204	10,812,000
油研工業	41,000	187	7,667,000
タダノ	98,000	471	46,158,000
フジテック	65,000	421	27,365,000
シーケーディ	61,800	783	48,389,400
キトー	67	80,000	5,360,000
平和	47,900	1,221	58,485,900
理想科学工業	17,200	1,467	25,232,400
S A N K Y O	66,900	4,615	308,743,500
日本金銭機械	20,600	680	14,008,000
マースエンジニアリング	11,000	1,510	16,610,000
福島工業	6,900	948	6,541,200
オーイズミ	8,400	324	2,721,600
ダイコク電機	9,300	1,051	9,774,300
ア マ ノ	61,400	819	50,286,600
J U K I	133,000	177	23,541,000
サンデン	125,000	362	45,250,000
蛇の目ミシン	213,000	81	17,253,000
ブラザー工業	285,400	1,253	357,606,200
シルバー精工	213,000	1	213,000
マックス	38,000	997	37,886,000
モリタホールディングス	39,000	514	20,046,000
グローリー	61,200	2,015	123,318,000
大和冷機工業	32,000	425	13,600,000
セガサミーホールディングス	233,000	1,635	380,955,000

日本ピストンリング	86,000	259	22,274,000
リケン	88,000	387	34,056,000
帝国ピストン	26,800	928	24,870,400
ホシザキ電機	44,500	1,575	70,087,500
大豊工業	15,600	887	13,837,200
日本精工	492,000	772	379,824,000
N T N	511,000	458	234,038,000
ジェイテクト	234,600	1,062	249,145,200
不二越	222,000	301	66,822,000
ミネベア	328,000	532	174,496,000
日本トムソン	76,000	687	52,212,000
T H K	146,800	2,086	306,224,800
ユーシン精機	11,000	1,656	18,216,000
前澤給装工業	8,700	1,013	8,813,100
イーグル工業	27,000	923	24,921,000
前澤工業	15,200	167	2,538,400
日本ピラ - 工業	24,000	663	15,912,000
キッツ	90,800	412	37,409,600
日立	4,958,000	457	2,265,806,000
東芝	4,360,000	480	2,092,800,000
三菱電機	2,209,000	897	1,981,473,000
富士電機H L D G S	665,000	266	176,890,000
東洋電機製造	35,000	485	16,975,000
安川電機	242,000	816	197,472,000
シンフォニアテクノロジー	133,000	311	41,363,000
明電舎	219,000	421	92,199,000
オリジン電気	30,000	459	13,770,000
デンヨー	21,000	712	14,952,000
日立工機	59,100	781	46,157,100
三桜工業	25,600	792	20,275,200
マキタ	144,000	3,385	487,440,000
東芝テック	138,000	421	58,098,000
芝浦メカトロニクス	39,000	348	13,572,000
マブチモーター	31,600	4,285	135,406,000
日本電産	109,400	8,720	953,968,000
高岳製作所	88,000	510	44,880,000
ダイヘン	121,000	392	47,432,000
J V CケンウッドH D	82,100	472	38,751,200
日新電機	37,000	545	20,165,000
大崎電気	32,000	789	25,248,000
オムロン	246,000	2,240	551,040,000
日東工業	33,300	1,021	33,999,300
I D E C	26,400	797	21,040,800
エルピーダメモリ	194,800	1,001	194,994,800
ジーエス・ユアサコーポ	426,000	591	251,766,000
サクサホールディングス	56,000	170	9,520,000
メルコホールディングス	12,200	2,945	35,929,000
テクノメディカ	13	292,600	3,803,800
日本電気	2,858,000	254	725,932,000
富士通	2,129,000	552	1,175,208,000
沖電気	804,000	73	58,692,000
岩崎通信機	101,000	72	7,272,000
電気興業	68,000	415	28,220,000
サンケン電気	129,000	406	52,374,000
ナカヨ通信機	18,000	210	3,780,000
アイホン	14,300	1,347	19,262,100
ルネサスエレクトロニクス	57,100	957	54,644,700
セイコーエプソン	150,700	1,528	230,269,600
ワコム	434	141,400	61,367,600

アルバック	40,600	2,264	91,918,400
アクセル	7,700	2,254	17,355,800
ピクセラ	9,400	274	2,575,600
ナナオ	18,800	1,918	36,058,400
日本信号	51,500	674	34,711,000
京三製作所	48,000	396	19,008,000
能美防災	30,000	549	16,470,000
ホーチキ	20,000	426	8,520,000
マスプロ電工	15,600	761	11,871,600
日本無線	85,000	263	22,355,000
パナソニック	2,187,400	1,182	2,585,506,800
シャープ	990,000	888	879,120,000
アンリツ	97,000	694	67,318,000
富士通ゼネラル	52,000	526	27,352,000
日立国際電気	50,000	836	41,800,000
ソニー	1,240,400	3,010	3,733,604,000
T D K	124,400	6,080	756,352,000
帝国通信工業	56,000	204	11,424,000
三洋電機	1,690,000	134	226,460,000
宮越商事	6,600	356	2,349,600
ミツミ電機	78,000	1,556	121,368,000
タムラ製作所	67,000	259	17,353,000
アルプス電気	174,200	1,001	174,374,200
池上通信機	73,000	68	4,964,000
バイオニア	313,000	382	119,566,000
日本電波工業	17,100	1,678	28,693,800
日本トリム	2,600	1,821	4,734,600
ローランド ディー・ジー	9,900	1,375	13,612,500
日本コロムビア	178,000	49	8,722,000
山水電気	1,456,000	3	4,368,000
フォスタ - 電機	20,900	2,600	54,340,000
クラリオン	116,000	169	19,604,000
S M K	65,000	497	32,305,000
ヨコオ	18,800	649	12,201,200
東光	94,000	213	20,022,000
ティアック	120,000	47	5,640,000
ホシデン	54,900	1,000	54,900,000
ヒロセ電機	35,700	9,410	335,937,000
日本航空電子	51,000	673	34,323,000
T O A	28,000	470	13,160,000
ユニデン	65,000	286	18,590,000
アルパイン	43,000	1,255	53,965,000
スミダコーポレーション	13,600	1,020	13,872,000
アイコム	12,300	2,236	27,502,800
船井電機	19,800	3,050	60,390,000
横河電機	221,300	674	149,156,200
新電元工業	78,000	436	34,008,000
山武	61,900	2,016	124,790,400
日本光電工業	40,900	1,759	71,943,100
チノー	44,000	231	10,164,000
共和電業	3,000	275	825,000
日本電子材料	9,600	616	5,913,600
堀場製作所	38,000	2,382	90,516,000
アドバンテスト	150,500	1,878	282,639,000
小野測器	23,000	278	6,394,000
エスベック	23,000	709	16,307,000
パナソニック電工SUNX	19,600	518	10,152,800
キーエンス	49,300	23,800	1,173,340,000
日置電機	10,700	1,714	18,339,800

シスメックス	38,800	5,680	220,384,000
メガチップス	20,100	1,736	34,893,600
O B A R A	15,700	919	14,428,300
日本電産コパル電子	23,000	697	16,031,000
ミヤチテクノス	11,700	711	8,318,700
東京電波	6,800	762	5,181,600
澤藤電機	14,000	309	4,326,000
デンソー	485,100	3,000	1,455,300,000
コーセル	29,500	1,245	36,727,500
日立メディコ	16,000	773	12,368,000
新日本無線	16,000	282	4,512,000
オプテックス	15,200	1,209	18,376,800
千代田インテグレ	8,800	1,229	10,815,200
東光電気	14,000	508	7,112,000
スタンレー電気	149,200	1,587	236,780,400
岩崎電気	81,000	180	14,580,000
ウシオ電機	134,100	1,664	223,142,400
岡谷電機	13,100	390	5,109,000
ヘリオステクノH	20,400	239	4,875,600
日本セラミック	14,500	1,490	21,605,000
新神戸電機	17,000	1,032	17,544,000
日本デジタル研究所	18,700	931	17,409,700
古河電池	15,000	586	8,790,000
双信電機	11,200	560	6,272,000
山一電機	22,300	464	10,347,200
図研	15,500	705	10,927,500
日本電子	82,000	316	25,912,000
カシオ	210,600	711	149,736,600
ファナック	230,000	12,980	2,985,400,000
日本シイエムケイ	43,200	490	21,168,000
エンプラス	11,100	1,295	14,374,500
ローム	110,700	5,550	614,385,000
浜松ホトニクス	86,200	3,070	264,634,000
三井ハイテック	26,300	504	13,255,200
新光電気工業	55,500	950	52,725,000
京セラ	183,700	8,590	1,577,983,000
協栄産業	25,000	185	4,625,000
太陽誘電	99,000	1,365	135,135,000
村田製作所	231,700	6,140	1,422,638,000
ユーシン	26,300	775	20,382,500
双葉電子工業	37,800	1,702	64,335,600
日東電工	190,600	4,180	796,708,000
北陸電気工業	90,000	176	15,840,000
パナソニック電工	206,000	1,083	223,098,000
東海理化電機	51,700	1,662	85,925,400
ニチコン	69,600	1,233	85,816,800
日本ケミコン	137,000	435	59,595,000
K O A	27,800	1,015	28,217,000
三井造船	856,000	235	201,160,000
日立造船	930,000	127	118,110,000
佐世保重工業	145,000	186	26,970,000
三菱重工業	3,703,000	320	1,184,960,000
川崎重工業	1,719,000	291	500,229,000
I H I	1,509,000	188	283,692,000
日本車輛	81,000	458	37,098,000
日本輸送機	27,000	230	6,210,000
近畿車輛	33,000	465	15,345,000
日産自動車	2,790,800	855	2,386,134,000
いすゞ自動車	1,280,000	409	523,520,000

トヨタ自動車	2,838,300	3,455	9,806,326,500	*
日野自動車	276,000	480	132,480,000	
三菱自動車工業	4,559,000	121	551,639,000	
エフテック	7,600	1,605	12,198,000	
武蔵精密工業	21,400	2,140	45,796,000	
トヨタ車体	40,100	1,583	63,478,300	
日産車体	86,000	730	62,780,000	
関東自動車	33,500	766	25,661,000	
新明和工業	99,000	367	36,333,000	
極東開発工業	41,600	357	14,851,200	
日信工業	44,900	1,578	70,852,200	
トピー工業	182,000	236	42,952,000	
ティラド	72,000	361	25,992,000	
曙ブレーキ	102,700	545	55,971,500	
タチエス	28,800	1,453	41,846,400	
N O K	106,800	1,805	192,774,000	
フタバ産業	62,400	646	40,310,400	
カヤバ工業	138,000	666	91,908,000	
シロキ工業	49,000	325	15,925,000	
市光工業	53,000	250	13,250,000	
大同メタル工業	34,000	677	23,018,000	
プレス工業	102,000	431	43,962,000	
カルソニックカンセイ	112,000	364	40,768,000	
太平洋工業	45,000	481	21,645,000	
ケーヒン	45,600	1,945	88,692,000	
河西工業	27,000	514	13,878,000	
アイシン精機	181,900	3,060	556,614,000	
富士機工	25,000	307	7,675,000	
マ ッ ダ	1,709,000	255	435,795,000	
ダイハツ	234,000	1,287	301,158,000	
愛知機械	50,000	368	18,400,000	
今仙電機製作所	14,900	1,270	18,923,000	
本田技研	1,863,900	3,265	6,085,633,500	
スズキ	461,800	2,121	979,477,800	
富士重工業	698,000	695	485,110,000	
ヤマハ発動機	335,900	1,396	468,916,400	
ショーワ	47,000	637	29,939,000	
小糸製作所	110,000	1,399	153,890,000	
T B K	22,000	477	10,494,000	
エクセディ	26,700	2,822	75,347,400	
ミツバ	41,000	752	30,832,000	
豊田合成	62,400	2,070	129,168,000	
愛三工業	26,700	822	21,947,400	
ヨロズ	13,300	1,523	20,255,900	
エフ・シー・シー	32,500	2,070	67,275,000	
新家工業	53,000	143	7,579,000	
シマノ	91,100	4,140	377,154,000	
タカタ	34,200	2,635	90,117,000	
テイ・エス テック	42,000	1,751	73,542,000	
小野建	19,100	758	14,477,800	
はるやま商事	10,700	437	4,675,900	
佐鳥電機	14,800	639	9,457,200	
カップクリエイト	16,050	1,987	31,891,350	
エコートレーディング	5,800	845	4,901,000	
伯東	13,400	869	11,644,600	
中山福	13,500	602	8,127,000	
ライトオン	16,400	483	7,921,200	
ナガイレーベン	11,900	2,115	25,168,500	
ジーンズメイト	6,800	344	2,339,200	

菱食	21,200	1,818	38,541,600
良品計画	25,000	3,790	94,750,000
三城ホールディングス	27,100	815	22,086,500
松田産業	16,000	1,440	23,040,000
メディバルHD	201,200	916	184,299,200
アドヴァン	13,500	650	8,775,000
S P K	5,000	1,256	6,280,000
アズワン	14,300	1,731	24,753,300
スズデン	7,700	539	4,150,300
尾家産業	6,800	845	5,746,000
シモジマ	15,100	1,084	16,368,400
ドウシシャ	10,400	1,989	20,685,600
コナカ	25,400	414	10,515,600
高速	13,300	731	9,722,300
ハウス ローゼ	2,000	1,259	2,518,000
G - 7ホールディングス	5,900	537	3,168,300
イオン北海道	17,100	306	5,232,600
コジマ	26,400	522	13,780,800
コーナン商事	21,200	1,062	22,514,400
黒田電気	29,100	1,196	34,803,600
ネットワンシステムズ	530	126,200	66,886,000
エコス	7,500	445	3,337,500
ワタミ	25,800	1,688	43,550,400
マルシェ	6,500	698	4,537,000
ドン・キホーテ	35,300	2,568	90,650,400
丸文	17,400	517	8,995,800
メガネトップ	22,800	823	18,764,400
西松屋チェーン	47,700	792	37,778,400
ゼンショー	83,000	834	69,222,000
ハピネット	5,900	1,110	6,549,000
幸楽苑	13,800	1,229	16,960,200
トーマンエレクトロニクス	9,000	1,294	11,646,000
ハークスレイ	6,300	505	3,181,500
サイゼリヤ	28,700	1,686	48,388,200
エクセル	10,600	1,095	11,607,000
マルカキカイ	7,400	609	4,506,600
アルゴグラフィックス	8,200	1,070	8,774,000
ガリバーインターナショナル	5,870	3,950	23,186,500
日本エム・ディ・エム	19,700	204	4,018,800
ポプラ	6,600	520	3,432,000
ユナイテッドアローズ	20,600	1,333	27,459,800
進和	12,000	1,012	12,144,000
エスケイジャパン	6,000	295	1,770,000
ダイトエレクトロン	9,300	658	6,119,400
ハイデイ日高	9,600	1,357	13,027,200
シークス	13,800	1,084	14,959,200
京都きもの友禅	14,300	933	13,341,900
コロワイド	72,500	469	34,002,500
田中商事	7,500	329	2,467,500
オーハシテクニカ	13,000	640	8,320,000
壱番屋	7,800	2,353	18,353,400
マクニカ	9,900	2,053	20,324,700
白銅	7,300	920	6,716,000
トップカルチャー	8,300	377	3,129,100
スギホールディングス	34,800	1,965	68,382,000
島津製作所	264,000	651	171,864,000
J M S	34,000	298	10,132,000
クボテック	50	31,500	1,575,000
モリテックス	4,800	500	2,400,000

長野計器	14,800	759	11,233,200
スター精密	42,200	871	36,756,200
東京計器	79,000	131	10,349,000
愛知時計	7,000	235	1,645,000
日本電産トソー	13,300	960	12,768,000
東京精密	42,400	1,364	57,833,600
ニコン	384,900	1,829	703,982,100
トプコン	50,900	506	25,755,400
オリンパス	260,600	2,519	656,451,400
理研計器	18,200	692	12,594,400
大日本スクリーン	244,000	636	155,184,000
キヤノン電子	20,300	2,297	46,629,100
タムロン	21,300	1,761	37,509,300
HOYA	507,300	2,035	1,032,355,500
ノーリツ鋼機	20,000	523	10,460,000
エー・アンド・デイ	22,000	385	8,470,000
キヤノン	1,372,400	4,155	5,702,322,000
リコー	664,000	1,178	782,192,000
日本電産コバル	17,400	1,460	25,404,000
日本電産サンヨー	52,000	742	38,584,000
シチズンホールディングス	240,200	579	139,075,800
リズム時計	110,000	141	15,510,000
SRIスポーツ	143	94,300	13,484,900
バンダイナムコHLDGS	257,300	898	231,055,400
共立印刷	21,200	137	2,904,400
フランスベッドHLDGS	149,000	119	17,731,000
パイロットコーポレーション	209	150,000	31,350,000
エイベックス・グループHD	41,200	1,217	50,140,400
トッパン・フォームズ	47,400	846	40,100,400
フジシールインターナショナル	22,700	1,894	42,993,800
タカラトミー	66,000	682	45,012,000
廣濟堂	17,900	128	2,291,200
アーケ	73,900	151	11,158,900
レック	6,200	1,598	9,907,600
アロン化成	17,000	395	6,715,000
タカノ	8,800	497	4,373,600
プロネクス	24,900	444	11,055,600
ホクシン	17,300	117	2,024,100
ウッドワン	38,000	285	10,830,000
大建工業	91,000	220	20,020,000
きもと	20,700	872	18,050,400
凸版印刷	624,000	764	476,736,000
大日本印刷	673,000	1,142	768,566,000
図書印刷	37,000	142	5,254,000
共同印刷	70,000	195	13,650,000
日本写真印刷	40,100	2,251	90,265,100
光村印刷	3,000	305	915,000
藤森工業	16,600	1,260	20,916,000
宝印刷	9,400	673	6,326,200
前澤化成工業	16,900	764	12,911,600
アシックス	206,000	1,045	215,270,000
ツツミ	9,700	2,217	21,504,900
ジェイエスピー	15,100	1,296	19,569,600
ニチハ	23,100	714	16,493,400
ローランド	21,100	1,067	22,513,700
エフピコ	11,400	4,565	52,041,000
小松ウオール工業	8,700	786	6,838,200
ヤマハ	175,900	1,064	187,157,600
河合楽器	82,000	209	17,138,000

クリナップ	22,800	582	13,269,600
ビジョン	15,300	2,719	41,600,700
天馬	20,600	922	18,993,200
パラマウントベッド	17,400	2,228	38,767,200
兼松日産農林	35,000	135	4,725,000
キングジム	17,000	572	9,724,000
リンテック	47,200	2,224	104,972,800
田崎真珠	42,000	77	3,234,000
信越ポリマー	45,400	575	26,105,000
東リ	62,000	149	9,238,000
イトーキ	47,000	233	10,951,000
任天堂	126,300	24,040	3,036,252,000
三菱鉛筆	18,800	1,384	26,019,200
タカラスタンダード	102,000	550	56,100,000
コクヨ	114,800	709	81,393,200
ナカバヤシ	48,000	182	8,736,000
ニフコ	44,200	2,250	99,450,000
グローブライド	100,000	103	10,300,000
岡村製作所	85,000	516	43,860,000
日本バルカー	96,000	265	25,440,000
MUTOHホールディングス	27,000	213	5,751,000
伊藤忠	1,522,100	882	1,342,492,200
丸紅	1,908,000	611	1,165,788,000
スクロール	30,900	363	11,216,700
高島	39,000	141	5,499,000
F & A アクアホールディングス	17,200	831	14,293,200
三陽商会	113,000	325	36,725,000
長瀬産業	124,000	1,066	132,184,000
ナイガイ	66,000	49	3,234,000
蝶理	147,000	109	16,023,000
豊田通商	243,100	1,521	369,755,100
オンワ - ドホールディングス	154,000	748	115,192,000
三共生興	37,600	300	11,280,000
兼松	495,000	84	41,580,000
美津濃	110,000	411	45,210,000
ツカモトコーポレーション	39,000	93	3,627,000
ファミリーマート	73,700	3,065	225,890,500
ルック	38,000	143	5,434,000
三井物産	1,882,100	1,430	2,691,403,000
日本紙パルプ	124,000	298	36,952,000
東京エレクトロン	173,400	5,330	924,222,000
日立ハイテクノロジーズ	66,100	1,946	128,630,600
カメイ	26,000	422	10,972,000
東都水産	37,000	137	5,069,000
スターゼン	75,000	236	17,700,000
セイコーHD	115,000	313	35,995,000
山善	84,300	442	37,260,600
椿本興業	23,000	237	5,451,000
住友商事	1,201,100	1,225	1,471,347,500
日本ユニシス	59,900	663	39,713,700
内田洋行	47,000	311	14,617,000
三菱商事	1,746,100	2,382	4,159,210,200
第一実業	48,000	349	16,752,000
キヤノンマーケティングJPN	72,500	1,210	87,725,000
西華産業	85,000	209	17,765,000
佐藤商事	19,900	530	10,547,000
菱洋エレクトロ	28,800	966	27,820,800
東京産業	23,500	264	6,204,000
ユアサ商事	225,000	98	22,050,000

神鋼商事	56,000	211	11,816,000
阪和興業	204,000	414	84,456,000
カナデン	2,000	531	1,062,000
菱電商事	36,000	544	19,584,000
ニプロ	44,100	1,684	74,264,400
フルサト工業	13,200	554	7,312,800
岩谷産業	244,000	253	61,732,000
すてきナイスグループ	96,000	185	17,760,000
昭光通商	81,000	136	11,016,000
ニチモウ	34,000	178	6,052,000
極東貿易	31,000	159	4,929,000
イワキ	24,000	200	4,800,000
兼松エレクトロニクス	14,400	849	12,225,600
三愛石油	52,000	412	21,424,000
稲畑産業	58,700	532	31,228,400
G S Iクレオス	58,000	125	7,250,000
明和産業	18,100	266	4,814,600
ゴ-ルドウイン	52,000	229	11,908,000

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東京スタイル	84,000	655	55,020,000	
ユニ・チャーム	127,700	3,270	417,579,000	
デサント	58,000	451	26,158,000	
ヤマトインタ - ナショナル	14,200	395	5,609,000	
東邦ホールディングス	66,500	1,167	77,605,500	
サンゲツ	38,700	1,939	75,039,300	
ミツウロコ	35,400	513	18,160,200	
シナネン	48,000	382	18,336,000	
伊藤忠エネクス	48,500	458	22,213,000	
ザ・トーカイ	52,000	342	17,784,000	
サンリオ	61,000	1,958	119,438,000	
サンワ テクノス	10,800	699	7,549,200	
リョーサン	35,600	2,214	78,818,400	
新光商事	20,500	694	14,227,000	
トーホー	47,000	317	14,899,000	
三信電気	27,100	701	18,997,100	
東陽テクニカ	29,800	879	26,194,200	
モスフード サービス	28,700	1,519	43,595,300	
加賀電子	21,800	1,080	23,544,000	
三益半導体	17,100	972	16,621,200	
ソーダニツカ	2,000	364	728,000	
立花エレテック	13,500	741	10,003,500	
木曽路	25,000	1,717	42,925,000	
千趣会	39,400	501	19,739,400	
タカキュー	17,500	165	2,887,500	
ケーヨー	41,100	422	17,344,200	
ユニヘアー	25,000	1,068	26,700,000	
上新電機	47,000	802	37,694,000	
日本瓦斯	20,900	1,145	23,930,500	
ベスト電器	68,000	275	18,700,000	
マルエツ	44,000	327	14,388,000	
ロイヤルホールディングス	33,700	852	28,712,400	
東天紅	14,000	142	1,988,000	
いなげや	25,000	919	22,975,000	
島忠	42,300	1,901	80,412,300	
チヨダ	28,700	1,150	33,005,000	
鈴丹	5,500	174	957,000	
ライフコーポレーション	13,700	1,303	17,851,100	
カスミ	45,000	458	20,610,000	
リンガーハット	16,800	1,066	17,908,800	
さが美	18,000	123	2,214,000	
MR MAX	22,000	293	6,446,000	
テンアライド	13,800	293	4,043,400	
AOKIホールディングス	20,200	1,391	28,098,200	
オークワ	31,000	860	26,660,000	
コメリ	29,800	1,955	58,259,000	
青山商事	55,400	1,469	81,382,600	
しまむら	22,800	7,600	173,280,000	
CFSコーポレーション	21,500	454	9,761,000	
高島屋	295,000	702	207,090,000	
松屋	40,200	589	23,677,800	
エイチ・ツー・オーリテイリング	128,000	604	77,312,000	
丸栄	37,000	117	4,329,000	
ニッセンHD	43,500	410	17,835,000	
パルコ	56,500	749	42,318,500	

丸井グループ	284,200	696	197,803,200
クレディセゾン	165,300	1,433	236,874,900
原信ナルスHLDGS	13,100	1,190	15,589,000
セディナ	222,600	164	36,506,400
井筒屋	118,000	65	7,670,000
ダイエー	100,800	320	32,256,000
イズミヤ	76,000	343	26,068,000
イオン	768,500	1,051	807,693,500
ユニー	177,100	851	150,712,100
イズミ	59,700	1,265	75,520,500
東武ストア	31,000	258	7,998,000
平和堂	44,200	1,081	47,780,200
フジ	24,300	1,689	41,042,700
ヤオコー	9,600	2,525	24,240,000
ゼビオ	26,300	1,786	46,971,800
ケースホールディングス	50,200	2,238	112,347,600
Paltaac	13,400	1,485	19,899,000
OLYMPIC	14,800	609	9,013,200
東日カーライフグループ	32,000	105	3,360,000
新生銀行	1,131,000	100	113,100,000
あおぞら銀行	792,000	170	134,640,000
三菱UFJフィナンシャルG	16,501,900	442	7,293,839,800
りそなホールディングス	666,400	485	323,204,000
中央三井トラストHD	1,252,000	337	421,924,000
三井住友フィナンシャルG	1,649,000	2,922	4,818,378,000
第四銀行	286,000	269	76,934,000
北越銀行	246,000	171	42,066,000
西日本シティ銀行	764,000	254	194,056,000
札幌北洋ホール	328,300	404	132,633,200
千葉銀行	860,000	530	455,800,000
横浜銀行	1,494,000	429	640,926,000
常陽銀行	846,000	360	304,560,000
群馬銀行	509,000	462	235,158,000
武蔵野銀行	35,500	2,348	83,354,000
千葉興業銀行	41,500	498	20,667,000
筑波銀行	96,400	289	27,859,600
東京都民銀行	41,200	1,239	51,046,800
七十七銀行	368,000	441	162,288,000
青森銀行	175,000	230	40,250,000
秋田銀行	150,000	256	38,400,000
山形銀行	133,000	386	51,338,000
岩手銀行	14,700	3,985	58,579,500
東邦銀行	184,000	262	48,208,000
東北銀行	123,000	136	16,728,000
みちのく銀行	109,000	163	17,767,000
ふくおかフィナンシャルG	884,000	358	316,472,000
静岡銀行	677,000	749	507,073,000
十六銀行	264,000	273	72,072,000
スルガ銀行	230,000	766	176,180,000
八十二銀行	410,000	465	190,650,000
山梨中央銀行	133,000	384	51,072,000
大垣共立銀行	291,000	269	78,279,000
福井銀行	189,000	257	48,573,000
北國銀行	250,000	284	71,000,000
清水銀行	7,500	3,665	27,487,500
滋賀銀行	205,000	458	93,890,000
南都銀行	203,000	421	85,463,000
百五銀行	197,000	361	71,117,000
京都銀行	390,000	765	298,350,000

三重銀行	98,000	228	22,344,000
ほくほくフィナンシャルG	1,527,000	167	255,009,000
広島銀行	643,000	352	226,336,000
山陰合同銀行	131,000	618	80,958,000
中国銀行	180,000	1,006	181,080,000
鳥取銀行	70,000	183	12,810,000
伊予銀行	233,000	659	153,547,000
百十四銀行	256,000	308	78,848,000
四国銀行	157,000	265	41,605,000
阿波銀行	181,000	493	89,233,000
鹿児島銀行	141,000	550	77,550,000
大分銀行	141,000	308	43,428,000
宮崎銀行	145,000	223	32,335,000
肥後銀行	171,000	433	74,043,000
佐賀銀行	134,000	237	31,758,000
十八銀行	140,000	241	33,740,000
沖縄銀行	16,500	3,265	53,872,500
琉球銀行	46,000	979	45,034,000
住友信託	1,954,000	508	992,632,000
みずほ信託銀行	2,071,000	85	176,035,000
八千代銀行	11,400	2,347	26,755,800
みずほフィナンシャルG	26,602,800	163	4,336,256,400
紀陽ホールディングス	866,000	115	99,590,000
山口フィナンシャルG	217,000	836	181,412,000
フィデック	133	14,100	1,875,300
芙蓉総合リース	20,800	3,025	62,920,000
興銀リース	30,300	2,150	65,145,000
東京センチュリーリース	51,200	1,459	74,700,800
S B Iホールディングス	25,983	12,830	333,361,890
日本証券金融	90,000	658	59,220,000
大阪証券金融	25,700	174	4,471,800
アイフル	179,800	81	14,563,800
日本アジア投資	150,000	62	9,300,000
ポケットカード	21,700	260	5,642,000
長野銀行	78,000	167	13,026,000
名古屋銀行	197,000	268	52,796,000
愛知銀行	7,300	5,150	37,595,000
第三銀行	133,000	218	28,994,000
中京銀行	90,000	216	19,440,000
東日本銀行	115,000	186	21,390,000
愛媛銀行	138,000	228	31,464,000
トマト銀行	87,000	158	13,746,000
みなと銀行	226,000	144	32,544,000
京葉銀行	179,000	410	73,390,000
関西アーバン銀行	305,000	135	41,175,000
栃木銀行	109,000	398	43,382,000
北日本銀行	6,900	2,019	13,931,100
東和銀行	234,000	82	19,188,000
福島銀行	271,000	51	13,821,000
大東銀行	140,000	64	8,960,000
リコーリース	15,000	2,379	35,685,000
イオン クレジットサービス	96,900	1,242	120,349,800
N I Sグループ	161,200	10	1,612,000
アコム	43,850	1,115	48,892,750
プロミス	110,950	554	61,466,300
ジャックス	144,000	270	38,880,000
日立キャピタル	51,400	1,350	69,390,000
オリックス	113,390	8,030	910,521,700
三菱UFJリース	55,280	3,290	181,871,200

ジャフコ	29,800	2,435	72,563,000
トモニホールディングス	167,300	336	56,212,800
大和証券G本社	2,159,000	440	949,960,000
野村ホールディングス	4,591,700	536	2,461,151,200
みずほ証券	558,000	247	137,826,000
みずほインベストズ証	507,000	93	47,151,000
岡三証券グループ	186,000	358	66,588,000
丸三証券	69,800	503	35,109,400
東洋証券	83,000	152	12,616,000
東海東京HD	250,000	315	78,750,000
光世証券	54,000	93	5,022,000
水戸証券	59,000	150	8,850,000
いちよし証券	49,000	637	31,213,000
松井証券	129,400	592	76,604,800
N K S Jホールディングス	1,824,000	598	1,090,752,000
だいこう証券ビジ	13,300	322	4,282,600
マネックスG	1,285	24,190	31,084,150
カブドットコム証券	93,700	370	34,669,000
極東証券	29,600	698	20,660,800
岩井コスモホールディング	20,700	605	12,523,500
フィデアホール	125,800	217	27,298,600
池田泉州HD	612,000	122	74,664,000
M S & A D	651,600	2,033	1,324,702,800
SONY F H	1,044	315,000	328,860,000
小林洋行	5,200	231	1,201,200
第一生命	8,744	139,500	1,219,788,000
富士火災	192,000	114	21,888,000
東京海上HD	827,800	2,502	2,071,155,600
アサックス	32	91,400	2,924,800
N E Cキャピタルソリューション	6,000	1,263	7,578,000
T & Dホールディングス	397,250	2,136	848,526,000
三井不動産	1,028,000	1,681	1,728,068,000
三菱地所	1,526,000	1,505	2,296,630,000
平和不動産	165,000	265	43,725,000
東京建物	446,000	390	173,940,000
ダイビル	64,300	707	45,460,100
サンケイビル	42,400	530	22,472,000
東急不動産	439,000	418	183,502,000
京阪神不動産	26,500	421	11,156,500
住友不動産	523,000	1,973	1,031,879,000
東宝不動産	23,300	585	13,630,500
太平洋興発	75,000	75	5,625,000
大京	366,000	166	60,756,000
テーオーシー	84,900	359	30,479,100
東京楽天地	27,000	315	8,505,000
レオパレス21	131,200	164	21,516,800
フジ住宅	23,100	448	10,348,800
空港施設	23,000	359	8,257,000
明和地所	12,700	597	7,581,900
住友不動産販売	7,880	4,130	32,544,400
ゴールドクレスト	19,640	2,256	44,307,840
東栄住宅	16,600	1,438	23,870,800
日本エスリード	9,600	878	8,428,800
東急リバブル	23,100	969	22,383,900
飯田産業	16,400	920	15,088,000
日神不動産	12,900	688	8,875,200
アーネストワン	40,600	1,087	44,132,200
タカラレーベン	20,500	723	14,821,500
サンヨーハウジ 名古屋	96	85,200	8,179,200

イオンモール	99,400	2,246	223,252,400
フージャースコーポレーション	334	37,800	12,625,200
サンシティ	541	2,440	1,320,040
タクトホーム	99	105,000	10,395,000
ランド	23,600	23	542,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,581	81,700	129,167,700
サンフロンティア不動産	206	14,880	3,065,280
ランドビジネス	149	18,330	2,731,170
東武鉄道	943,000	456	430,008,000
相鉄ホールディングス	347,000	263	91,261,000
東京急行	1,214,000	374	454,036,000
京浜急行	568,000	705	400,440,000
小田急電鉄	708,000	761	538,788,000
京王電鉄	574,000	555	318,570,000
京成電鉄	355,000	570	202,350,000
富士急行	61,000	428	26,108,000
新京成電鉄	23,000	341	7,843,000
東日本旅客鉄道	384,100	5,300	2,035,730,000
西日本旅客鉄道	2,058	309,000	635,922,000
東海旅客鉄道	1,917	686,000	1,315,062,000
アートコーポレーション	4,700	1,295	6,086,500
西日本鉄道	287,000	345	99,015,000
ハマキョウレックス	6,300	2,421	15,252,300
サカイ引越センター	4,200	1,803	7,572,600
近畿鉄道	1,995,000	255	508,725,000
阪急阪神HLDGS	1,483,000	381	565,023,000
南海電鉄	461,000	331	152,591,000
京阪電鉄	496,000	336	166,656,000
名糖運輸	8,900	678	6,034,200
名古屋鉄道	771,000	221	170,391,000
日本通運	875,000	354	309,750,000
ヤマトホールディングス	449,600	1,185	532,776,000
山九	268,000	383	102,644,000
日新	84,000	220	18,480,000
丸運	13,900	222	3,085,800
丸全昭和運輸	75,000	273	20,475,000
センコー	89,000	280	24,920,000
トナミホールディングス	46,000	178	8,188,000
日本梱包運輸	66,000	986	65,076,000
日石輸送	12,000	197	2,364,000
福山通運	153,000	447	68,391,000
セイノーホールディングス	171,000	576	98,496,000
神奈川中央交通	27,000	411	11,097,000
日立物流	38,500	1,287	49,549,500
日本郵船	1,866,000	380	709,080,000
商船三井	1,075,000	580	623,500,000
川崎汽船	682,000	381	259,842,000
NSユニテッド海運	79,000	220	17,380,000
乾汽船	26,300	529	13,912,700
明治海運	19,900	344	6,845,600
飯野海運	106,900	393	42,011,700
共栄タンカー	19,000	171	3,249,000
第一中央汽船	144,000	225	32,400,000
全日本空輸	2,945,000	305	898,225,000
パスコ	25,000	237	5,925,000
国際航業HLDGS	12,000	208	2,496,000
三菱倉庫	157,000	1,090	171,130,000
三井倉庫	103,000	341	35,123,000
住友倉庫	162,000	437	70,794,000

渋沢倉庫	58,000	288	16,704,000
ヤマタネ	110,000	116	12,760,000
東陽倉庫	30,000	187	5,610,000
日本トランスシティ	47,000	291	13,677,000
ケイヒン	42,000	99	4,158,000
安田倉庫	19,500	500	9,750,000
東洋埠頭	67,000	137	9,179,000
宇徳	16,800	258	4,334,400
上組	245,000	693	169,785,000
サンリツ	1,700	600	1,020,000
キムラユニティー	4,800	704	3,379,200
キューソー流通システム	7,400	867	6,415,800
郵船ロジスティクス	17,400	1,197	20,827,800
近鉄エクスプレス	19,800	2,332	46,173,600
東海運	13,500	204	2,754,000
バンテック	103	123,400	12,710,200
東京放送HD	117,600	1,175	138,180,000
日本テレビ放送網	19,140	12,830	245,566,200
テレビ朝日	552	141,100	77,887,200
スカパーJ S A T H D	1,662	31,800	52,851,600
テレビ東京HD	9,900	1,236	12,236,400
アイ・ティー・シーネットワーク	19,300	473	9,128,900
イー・アクセス	1,203	51,900	62,435,700
NECモバイルリング	8,000	2,423	19,384,000
日本電信電話	818,900	3,715	3,042,213,500
KDDI	3,384	480,500	1,626,012,000
光通信	28,000	1,825	51,100,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,023	143,000	2,577,289,000
インボイス	12,794	1,479	18,922,326
GMOインターネット	61,800	479	29,602,200
学研ホールディングス	95,000	180	17,100,000
ゼンリン	31,600	954	30,146,400
昭文社	13,500	627	8,464,500
角川グループHLDGS	20,600	2,137	44,022,200
インプレスホールディングス	18,700	154	2,879,800
東京電力	1,626,200	1,975	3,211,745,000
中部電力	680,500	1,996	1,358,278,000
関西電力	901,600	2,013	1,814,920,800
中国電力	305,500	1,661	507,435,500
北陸電力	226,700	2,001	453,626,700
東北電力	551,900	1,820	1,004,458,000
四国電力	223,800	2,391	535,105,800
九州電力	487,900	1,830	892,857,000
北海道電力	206,800	1,665	344,322,000
沖縄電力	13,200	3,920	51,744,000
電源開発	137,000	2,558	350,446,000
東京瓦斯	2,762,000	363	1,002,606,000
大阪瓦斯	2,222,000	316	702,152,000
東邦瓦斯	569,000	407	231,583,000
北海道瓦斯	45,000	244	10,980,000
西部瓦斯	250,000	212	53,000,000
静岡瓦斯	57,500	483	27,772,500
アイネット	11,200	496	5,555,200
松竹	134,000	543	72,762,000
東宝	142,800	1,356	193,636,800
エイチ・アイ・エス	23,500	2,192	51,512,000
東映	91,000	403	36,673,000
葵プロモーション	7,500	473	3,547,500
C & I HOLDINGS	145,800	6	874,800

NTTデータ	1,539	277,400	426,918,600
共立メンテナンス	10,400	1,404	14,601,600
イチネンホールディングス	24,600	452	11,119,200
建設技術研究所	14,200	450	6,390,000
アインファーマシーズ	7,200	2,869	20,656,800
燦ホールディングス	5,000	1,350	6,750,000
スバル興業	3,000	253	759,000
東京テアトル	90,000	127	11,430,000
ホリプロ	8,500	723	6,145,500
よみうりランド	53,000	281	14,893,000
東京都競馬	160,000	131	20,960,000
常磐興産	73,000	123	8,979,000
カナモト	31,000	442	13,702,000
東京ドーム	172,000	235	40,420,000
D T S	20,800	1,028	21,382,400
スクウェア・エニックス・HD	71,200	1,471	104,735,200
シーイーシー	14,400	448	6,451,200
カプコン	46,400	1,354	62,825,600
東海観光	112,000	24	2,688,000
日本空港ビルデング	69,600	1,257	87,487,200
トランス・コスモス	30,000	808	24,240,000
乃村工藝社	45,000	304	13,680,000
ジャステック	13,400	489	6,552,600
住商情報システム	22,300	1,426	31,799,800
藤田観光	59,000	378	22,302,000
近畿日本ツーリスト	74,000	74	5,476,000
日本管財	8,600	1,406	12,091,600
白洋舎	5,000	229	1,145,000
セコム	240,100	3,855	925,585,500
C S K	77,500	396	30,690,000
日本システムウエア	8,700	395	3,436,500
セントラル警備保障	10,600	867	9,190,200
アイネス	29,600	644	19,062,400
丹青社	5,000	353	1,765,000
メイテック	33,700	1,785	60,154,500
T K C	16,600	1,752	29,083,200
アサツー ディ・ケイ	37,200	2,271	84,481,200
富士ソフト	29,400	1,435	42,189,000
応用地質	22,300	722	16,100,600
船井総合研究所	25,500	525	13,387,500
N S D	42,100	954	40,163,400
進学会	13,600	319	4,338,400
丸紅建材リース	24,000	102	2,448,000
コナミ	100,606	1,775	178,575,650
ベネッセホールディングス	73,000	3,780	275,940,000
イオンディライト	26,000	1,554	40,404,000
ナック	5,600	1,115	6,244,000
福井コンピュータ	1,500	436	654,000
ニチイ学館	40,200	743	29,868,600
ダイセキ	34,100	1,656	56,469,600
日鐵商事	48,000	271	13,008,000
元気寿司	6,900	960	6,624,000
トラスコ中山	27,500	1,391	38,252,500
ヤマダ電機	99,380	5,400	536,652,000
オートバックスセブン	28,300	3,350	94,805,000
アークランドサカモト	12,800	1,008	12,902,400
ニトリホールディングス	43,150	7,000	302,050,000
グルメ杵屋	16,000	468	7,488,000
愛眼	18,000	462	8,316,000

吉野家ホールディングス	592	106,300	62,929,600
加藤産業	31,600	1,352	42,723,200
イエローハット	20,500	814	16,687,000
富士エレクトロニクス	12,400	1,344	16,665,600
松屋フーズ	10,700	1,396	14,937,200
J B C Cホールディングス	18,900	553	10,451,700
J Kホールディングス	20,600	419	8,631,400
サガミチェーン	26,000	518	13,468,000
日伝	9,100	2,419	22,012,900
北沢産業	11,000	178	1,958,000
杉本商事	12,300	751	9,237,300
因幡電機産業	25,800	2,343	60,449,400
住金物産	102,000	204	20,808,000
プレナス	27,500	1,255	34,512,500
ミニストップ	16,300	1,442	23,504,600
イマージュホールディングス	8,900	312	2,776,800
アークス	28,000	1,290	36,120,000
バロー	43,400	716	31,074,400
ミスミグループ本社	73,600	2,079	153,014,400
江守商事	5,000	816	4,080,000
アルテック	9,400	316	2,970,400
ベルク	10,900	1,003	10,932,700
大庄	11,900	1,057	12,578,300
タキヒヨー	33,000	413	13,629,000
ファーストリテイリング	50,900	12,330	627,597,000
ソフトバンク	965,300	2,857	2,757,862,100
スズケン	90,200	2,502	225,680,400
サンドラッグ	41,500	2,362	98,023,000
ジェコス	16,700	312	5,210,400
ヤマザワ	5,900	1,175	6,932,500
やまや	3,600	748	2,692,800
ベルーナ	27,200	467	12,702,400
合計	337,461,190		273,490,260,816

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		2,572,356,182	4,879,699,361
コール・ローン		426,411,901	32,888,316
株式		290,793,652,338	272,428,796,276
投資信託受益証券		927,703,845	874,593,729
投資証券		3,121,341,919	3,408,513,729
派生商品評価勘定		176,480,770	65,505,002
未収配当金		362,375,318	334,311,908
差入委託証拠金		3,105,229,477	1,546,882,393
流動資産合計		301,485,551,750	283,571,190,714
資産合計		301,485,551,750	283,571,190,714
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,076,713	38,469,437
未払金		-	90,614,999
未払解約金		65,519,000	151,113,000
流動負債合計		68,595,713	280,197,436
負債合計		68,595,713	280,197,436
純資産の部			
元本等			
元本		225,558,619,520	218,946,599,573
剰余金			
剰余金又は欠損金()		75,858,336,517	64,344,393,705
元本等合計		301,416,956,037	283,290,993,278
純資産合計		301,416,956,037	283,290,993,278
負債純資産合計		301,485,551,750	283,571,190,714

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。	(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22年2月16日から平成23年2月15日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	197,183,673,045円	225,558,619,520円
同期中追加設定元本額	92,304,482,403円	58,766,187,799円
同期中解約元本額	63,929,535,928円	65,378,207,746円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	568,168,434円	449,309,260円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	23,213,965,594円	28,399,848,603円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	150,678,903円	176,140,694円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	913,519,550円	990,180,130円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,149,698,004円	1,235,372,366円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	193,050,523円	203,263,880円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	498,948,286円	520,238,727円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	359,110,729円	367,609,658円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	86,729,232円	84,318,046円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	652,023,646円	758,783,644円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	83,852,177円
D I A M外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	630,981,786円	618,457,817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）	7,190,773,220円	6,123,852,190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）	3,887,302,768円	- 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）	18,474,923,213円	17,296,875,235円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	105,500,784円	99,933,771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）	10,727,886,299円	9,408,940,283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）	1,740,569,365円	1,600,344,297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）	199,270,706円	185,451,338円
D I A M国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,113,268,685円	1,054,945,626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）	104,261,122円	99,908,449円
D I A M国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	182,819,516円	175,894,362円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	18,997,744,727円	17,662,021,759円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	9,337,734,130円	8,825,117,749円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	3,331,932,857円	3,049,289,705円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,993,730,662円	2,715,959,778円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	7,992,567,042円	7,271,925,509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)	5,726,725,789円	5,490,772,309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)	7,325,053,528円	6,930,556,787円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A (適格 機関投資家限定)	5,114,656,766円	4,735,244,023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)	4,370,574,948円	4,252,778,602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)	71,879,037円	68,116,711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)	486,094,615円	264,757,976円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	19,838,757,391円	19,210,077,485円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	3,579,581,887円	3,329,303,835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)	139,785,636円	138,987,345円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	25,019,554,358円	24,321,797,768円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	2,648,519,200円	2,470,487,028円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	4,649,048,270円	4,423,500,876円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	15,269,051,444円	14,650,854,548円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	166,823円	168,745円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	257,809円	264,627円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	16,521,517,152円	19,200,854,775円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	78,091円	79,229円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	156,993円	161,851円
(合 計)	225,558,619,520円	218,946,599,573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	225,558,619,520口	218,946,599,573口
--	------------------	------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	290,793,652,338	74,147,845,756
投資信託受益証券	927,703,845	175,764,065
投資証券	3,121,341,919	1,002,638,551
合計	294,842,698,102	75,326,248,372

	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	35,359,431,353
投資信託受益証券	12,764,072
投資証券	646,973,221
合計	35,993,640,502

(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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11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。	
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。	
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。	
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。	
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。	

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

平成22年1月12日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	274,255,371	-	285,261,824	11,006,453
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	415,662,544	-	423,953,942	8,291,398
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,416,138,522	-	1,455,054,656	38,916,134
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	674,129,056	-	693,205,783	19,076,727
	米ドル S&P 500 FUTURE	3,223,567,116	-	3,321,761,625	98,194,509
	合 計	6,003,752,609	-	6,179,237,830	175,485,221

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（通貨関連）

平成22年1月12日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	23,997,636	-	23,995,400	2,236
	買建				
	オーストラリアドル	17,135,000	-	17,132,000	3,000
	カナダドル	18,055,600	-	17,852,000	203,600
	ユーロ	106,940,000	-	107,000,000	60,000
	英ポンド	44,679,900	-	44,574,000	105,900
米ドル	158,723,900	-	156,893,000	1,830,900	
	合計	369,532,036	-	367,446,400	2,081,164

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

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.3363円	1.2939円
（1万口当たり純資産額）	（13,363円）	（12,939円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

平成23年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	SCHLUMBERGER LTD	208,857	80.680	16,850,582.760	
	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	1,385	344.800	477,548.000	
	EVEREST RE GROUP LTD	9,632	82.550	795,121.600	
	PARTNERRE LTD	6,610	80.910	534,815.100	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,644	35.400	695,397.600	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	62.880	534,039.840	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,949	85.930	597,127.570	
	BUNGE LTD	20,860	66.500	1,387,190.000	
	VALIDUS HOLDINGS LTD	13,905	30.540	424,658.700	
	INVESCO LTD	73,288	24.250	1,777,234.000	
	ULTRA PETROLEUM CORP	25,409	46.660	1,185,583.940	
	ACE LTD	53,858	60.460	3,256,254.680	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	75,148	43.080	3,237,375.840	
	WEATHERFORD INTL LTD	112,245	22.080	2,478,369.600	
	NOBLE CORP	39,396	35.950	1,416,286.200	
	GARMIN LTD	20,035	30.470	610,466.450	
	FOSTER WHEELER AG	21,365	34.300	732,819.500	
	TYCO ELECTRONICS LTD	67,857	35.870	2,434,030.590	
	SEAGATE TECHNOLOGY	78,988	14.320	1,131,108.160	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	25,326	59.080	1,496,260.080	
	XL GROUP PLC	53,089	22.140	1,175,390.460	
	INGERSOLL-RAND PLC	49,001	46.550	2,280,996.550	
	ACCENTURE PLC-CL A	96,596	48.110	4,647,233.560	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,253	35.180	853,220.540	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	17,625	23.750	418,593.750	
	COVIDIEN PLC	76,040	46.230	3,515,329.200	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	47.960	1,073,200.920	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	70,216	46.370	3,255,915.920	
	FLEXTRONICS INTL LTD	129,042	8.150	1,051,692.300	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,045	28.900	174,700.500	
	AMAZON.COM INC	54,807	184.680	10,121,756.760	
	ABBOTT LABORATORIES	235,311	47.940	11,280,809.340	
	AES CORP	110,231	12.970	1,429,696.070	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,529	54.240	788,052.960	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	193,079	147.640	28,506,183.560	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	9.190	857,261.580	
	ADOBE SYSTEMS INC	82,656	32.900	2,719,382.400	
	AGCO CORP	14,077	52.190	734,678.630	
	AIRGAS INC	11,689	63.590	743,303.510	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	33,816	88.510	2,993,054.160	
	ENERGEN CORP	11,608	52.700	611,741.600	
	ALLERGAN INC	46,890	69.310	3,249,945.900	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	138,226	49.030	6,777,220.780	
	POLO RALPH LAUREN CORP	9,673	107.590	1,040,718.070	
	ALLSTATE CORP	80,680	30.990	2,500,273.200	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	111,445	53.900	6,006,885.500	
	ALTERA CORPORATION	44,383	35.950	1,595,568.850	
	ALCOA INC	154,382	16.490	2,545,759.180	
	AMGEN INC	146,699	56.440	8,279,691.560	
	HESS CORP	44,922	77.990	3,503,466.780	

ALLEGHENY ENERGY INC	24,490	25.130	615,433.700
FORTUNE BRANDS INC	23,016	62.440	1,437,119.040
AMERICAN EXPRESS CO	165,252	44.460	7,347,103.920
AMERICAN ELECTRIC POWER	76,250	35.760	2,726,700.000
AFLAC INC	71,215	55.130	3,926,082.950
AMERICAN INTL GROUP	19,154	57.390	1,099,248.060
ANALOG DEVICES	50,394	37.700	1,899,853.800
ANADARKO PETROLEUM CORP	78,114	74.880	5,849,176.320
QWEST COMMUNICATIONS INTL	259,721	7.380	1,916,740.980
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,234	82.800	764,575.200
NABORS INDUSTRIES LTD	46,216	22.270	1,029,230.320
ARCH COAL INC	26,204	34.440	902,465.760
TIME WARNER	171,776	33.280	5,716,705.280
VALERO ENERGY CORP	85,331	23.730	2,024,904.630
APOLLO GROUP INC	22,209	35.910	797,525.190
APACHE CORP	60,996	124.740	7,608,641.040
APPLE INC	139,951	342.250	47,898,229.750
APPLIED MATERIALS INC	211,288	13.780	2,911,548.640
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	103,262	32.090	3,313,677.580
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	30,448	14.370	437,537.760
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,201	41.340	711,089.340
AMEREN CORP	38,817	27.980	1,086,099.660
ARROW ELECTRONICS INC	17,437	34.920	608,900.040
AUTOLIV INC	10,481	80.800	846,864.800
AUTODESK INC	36,986	40.865	1,511,432.890
AUTOMATIC DATA PROCESSING	73,579	48.130	3,541,357.270
AUTOZONE INC	4,387	252.740	1,108,770.380
AVERY DENNISON CORP	15,202	40.990	623,129.980
AVNET INC	22,835	33.230	758,807.050
AVON PRODUCTS INC	67,666	29.390	1,988,703.740
BMC SOFTWARE INC	26,711	47.300	1,263,430.300
BAKER HUGHES INC	66,664	56.020	3,734,517.280
BALL CORP	14,325	68.780	985,273.500
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,740	79.650	10,413,441.000
CONSTELLATION ENERGY GROUP	27,811	31.950	888,561.450
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	183,728	30.700	5,640,449.600
CR BARD INC	14,153	91.050	1,288,630.650
BAXTER INTERNATIONAL INC	89,280	49.210	4,393,468.800
BED BATH & BEYOND INC	39,669	48.750	1,933,863.750
BECKMAN COULTER INC	8,722	73.870	644,294.140
BECTON DICKINSON & CO	36,694	83.060	3,047,803.640
AMETEK INC	25,735	39.130	1,007,010.550
NII HOLDINGS INC	25,446	43.060	1,095,704.760
VERIZON COMM INC	430,985	35.920	15,480,981.200
WR BERKLEY CORP	18,150	26.710	484,786.500
BEST BUY CO INC	55,155	35.910	1,980,616.050
YUM! BRANDS INC	72,009	49.590	3,570,926.310
FIRSTENERGY CORP	46,180	38.250	1,766,385.000
SLM CORP	78,907	13.340	1,052,619.380
H&R BLOCK INC	44,991	12.660	569,586.060
BOEING CO	106,019	69.090	7,324,852.710
ROBERT HALF INTL INC	22,574	31.980	721,916.520
BORGWARNER INC	17,164	71.110	1,220,532.040
BOSTON SCIENTIFIC CORP	230,329	7.390	1,702,131.310
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26,552	79.580	2,113,008.160
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	262,238	25.740	6,750,006.120
ONEOK INC	16,168	55.580	898,617.440
SEMPRA ENERGY	35,385	51.550	1,824,096.750
FEDEX CORP	45,072	94.060	4,239,472.320

VERISIGN INC	26,815	32.910	882,481.650
AMPHENOL CORP	26,334	51.910	1,366,997.940
BROWN-FORMAN CORP	11,945	67.930	811,423.850
QUANTA SERVICES INC	33,320	21.420	713,714.400
CSX CORP	57,647	67.980	3,918,843.060
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	34.050	1,273,776.450
CABOT OIL & GAS CORP	19,209	37.600	722,258.400
CAMPBELL SOUP CO	30,602	34.600	1,058,829.200
CONSTELLATION BRANDS INC	31,178	19.520	608,594.560
CARDINAL HEALTH INC	55,176	39.240	2,165,106.240
CATERPILLAR INC	96,377	93.390	9,000,648.030
CELGENE CORP	71,771	56.440	4,050,755.240
CITRIX SYSTEMS INC	28,958	69.700	2,018,372.600
CHESAPEAKE ENERGY CORP	106,856	26.960	2,880,837.760
CENTURYLINK INC	49,397	44.960	2,220,889.120
CEPHALON INC	13,313	59.580	793,188.540
CERNER CORP	10,714	95.290	1,020,937.060
JPMORGAN CHASE & CO	606,505	43.400	26,322,317.000
CHUBB CORP	49,171	57.840	2,844,050.640
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,222	69.150	706,851.300
CIGNA CORP	42,100	39.280	1,653,688.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,440	31.870	651,422.800
CINTAS CORP	18,563	28.060	520,877.780
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	146,854	9.510	1,396,581.540
CISCO SYSTEMS INC	872,783	20.780	18,136,430.740
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	20,415	82.500	1,684,237.500
CLOROX COMPANY	21,099	62.510	1,318,898.490
COCA-COLA CO/THE	317,459	63.060	20,018,964.540
COCA-COLA ENTERPRISES INC	50,168	24.650	1,236,641.200
COLGATE-PALMOLIVE CO	73,646	77.890	5,736,286.940
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	48,129	40.530	1,950,668.370
AON CORP	45,575	44.010	2,005,755.750
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	118,400	21.510	2,546,784.000
COMERICA INC	26,181	40.940	1,071,850.140
NRG ENERGY, INC.	36,050	19.770	712,708.500
COMCAST CORP-CL A	309,630	22.710	7,031,697.300
CA INC	66,524	24.510	1,630,503.240
COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	51.910	1,197,252.240
CONAGRA FOODS INC	66,889	22.670	1,516,373.630
CONSOLIDATED EDISON INC	44,922	49.230	2,211,510.060
SARA LEE CORP	105,850	18.210	1,927,528.500
CAMERON INTERNATIONAL CORP	36,887	48.680	1,795,659.160
MOLSON COORS BREWING CO	24,259	47.130	1,143,326.670
CORNING INC	237,425	19.500	4,629,787.500
DIRECTV	132,935	41.700	5,543,389.500
COVANCE INC	9,828	50.310	494,446.680
CREE INC	17,229	67.450	1,162,096.050
COVENTRY HEALTH CARE INC	21,115	29.210	616,769.150
SEALED AIR CORP	23,230	25.910	601,889.300
BROADCOM CORP-CL A	68,999	45.710	3,153,944.290
CUMMINS INC	28,983	111.040	3,218,272.320
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	17,834	75.540	1,347,180.360
DR HORTON INC	51,100	12.660	646,926.000
DANAHER CORP	86,696	46.280	4,012,290.880
MOODY'S CORP	32,725	28.730	940,189.250
AMERICAN TOWER CORP	63,853	50.410	3,218,829.730
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,353	75.335	3,567,338.250
TARGET CORP	104,076	55.220	5,747,076.720

	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	9,740	69.330	675,274.200
	DEERE & CO	65,045	84.580	5,501,506.100
	DELL INC	271,964	14.020	3,812,935.280
	MORGAN STANLEY	191,220	28.050	5,363,721.000
	REPUBLIC SERVICES INC	59,838	29.260	1,750,859.880
	DEVRY INC	10,352	42.810	443,169.120
	THE WALT DISNEY CO	277,511	39.500	10,961,684.500
	DOLLAR TREE INC	21,583	52.440	1,131,812.520
	RR DONNELLEY & SONS CO	27,250	17.700	482,325.000
	DOVER CORP	28,398	57.440	1,631,181.120
	DOW CHEMICAL	176,990	35.500	6,283,145.000
	OMNICOM GROUP	47,303	46.260	2,188,236.780
	DTE ENERGY CO	28,485	46.140	1,314,297.900
	DUKE ENERGY CORP	195,968	17.580	3,445,117.440
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	45,302	42.570	1,928,506.140
	FLOWSERVE CORP	8,844	117.190	1,036,428.360
	DARDEN RESTAURANTS INC	20,389	46.260	943,195.140
	EBAY INC	181,062	28.250	5,115,001.500
	EMC CORP/MASS	312,798	23.720	7,419,568.560
	BANK OF AMERICA CORP	1,533,884	14.400	22,087,929.600
	EL PASO CORP	106,896	13.500	1,443,096.000
	CITIGROUP INC	4,446,851	4.910	21,834,038.410
	EASTMAN CHEMICAL CO	11,841	88.270	1,045,205.070
	EATON CORP	24,287	102.680	2,493,789.160
	EATON VANCE CORP	19,507	29.940	584,039.580
	DISH NETWORK CORP	37,614	20.990	789,517.860
	ECOLAB INC	36,135	49.500	1,788,682.500
	ELECTRONIC ARTS INC	47,221	16.010	756,008.210
	SALESFORCE.COM INC	18,078	142.640	2,578,645.920
	EMERSON ELECTRIC CO	113,124	57.180	6,468,430.320
	ENTERGY CORP	27,589	72.630	2,003,789.070
	EOG RESOURCES INC	39,874	94.950	3,786,036.300
	EQUIFAX INC	16,637	35.970	598,432.890
	EQT CORP	24,370	45.950	1,119,801.500
	ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,406	81.320	1,415,455.920
	EXPEDITORS INTERNATIONAL	32,178	54.080	1,740,186.240
	EXPRESS SCRIPTS INC	78,719	56.330	4,434,241.270
	EXXON MOBIL CORP	779,741	75.150	58,597,536.150
	FMC CORP	11,028	76.630	845,075.640
	NEXTERA ENERGY INC	55,491	52.920	2,936,583.720
	FAMILY DOLLAR STORES	20,902	43.940	918,433.880
	ASSURANT INC	15,460	38.240	591,190.400
	FASTENAL CO	19,624	59.220	1,162,133.280
	FIFTH THIRD BANCORP	124,201	14.430	1,792,220.430
	M&T BANK CORP	12,227	86.100	1,052,744.700
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	14,749	58.730	866,208.770
	FISERV INC	22,936	59.175	1,357,237.800
	FLIR SYSTEMS INC	25,251	28.875	729,122.620
	MACY'S INC	64,505	23.480	1,514,577.400
	FORD MOTOR CO	464,033	18.310	8,496,444.230
	FOREST LABORATORIES INC	46,687	31.330	1,462,703.710
	FRANKLIN RESOURCES INC	23,779	112.930	2,685,362.470
	FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	71,316	118.960	8,483,751.360
	GAP INC/THE	68,800	20.530	1,412,464.000
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	19,533	35.110	685,803.630
	GENERAL DYNAMICS CORP	50,450	71.180	3,591,031.000
	GENERAL MILLS INC	96,103	35.840	3,444,331.520
	GENUINE PARTS CO	23,798	51.760	1,231,784.480

GENZYME CORP-GENL DIVISION	40,700	72.400	2,946,680.000
GILEAD SCIENCES INC	127,731	36.660	4,682,618.460
STARWOOD HOTELS&RESORTS	31,303	61.020	1,910,109.060
GOODRICH CORP	18,974	89.290	1,694,188.460
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	13.130	481,621.530
MCKESSON CORP	40,060	73.600	2,948,416.000
NVIDIA CORP	81,290	20.640	1,677,825.600
GENERAL ELECTRIC CO	1,635,699	18.510	30,276,788.490
WW GRAINGER INC	9,040	132.660	1,199,246.400
LIFE TECHNOLOGIES CORP	27,637	55.950	1,546,290.150
NUANCE COMMUNICATIONS INC	34,300	20.000	686,000.000
HALLIBURTON CO	139,312	38.170	5,317,539.040
HANSEN NATURAL CORP	12,038	53.540	644,514.520
GOLDMAN SACHS GROUP INC	74,903	169.760	12,715,533.280
HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	36.490	1,338,088.300
HARRIS CORP	20,993	47.340	993,808.620
JEFFERIES GROUP INC NPR	18,639	26.690	497,474.910
CONSOL ENERGY INC	33,779	51.040	1,724,080.160
HASBRO INC	19,502	45.980	896,701.960
HENRY SCHEIN INC	15,975	62.560	999,396.000
DENBURY RESOURCES INC	62,511	18.730	1,170,831.030
HJ HEINZ CO	49,044	48.440	2,375,691.360
HELMERICH & PAYNE INC	15,984	48.560	776,183.040
HERSHEY FOODS CORP	23,225	48.310	1,121,999.750
HEWLETT-PACKARD CO	355,179	44.860	15,933,329.940
F5 NETWORKS INC	12,462	142.690	1,778,202.780
CROWN HOLDINGS INC NPR	24,661	33.430	824,417.230
REYNOLDS AMERICAN INC	58,498	33.230	1,943,888.540
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	18,255	39.560	722,167.800
HUMAN GENOME SCIENCES INC	28,494	25.830	736,000.020
JUNIPER NETWORKS INC	79,204	37.610	2,978,862.440
HOLOGIC INC	34,989	18.760	656,393.640
UNUM GROUP	49,083	24.830	1,218,730.890
HOME DEPOT INC	255,629	34.390	8,791,081.310
HORMEL FOODS CORP	12,265	49.860	611,532.900
HUDSON CITY BANCORP INC	62,940	13.010	818,849.400
CENTERPOINT ENERGY INC	65,672	15.740	1,033,677.280
HUMANA INC	24,958	55.810	1,392,905.980
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,239	41.870	638,056.930
RED HAT INC	30,089	46.500	1,399,138.500
BIOGEN IDEC INC	37,471	66.900	2,506,809.900
ILLINOIS TOOL WORKS	64,115	54.370	3,485,932.550
INTUIT INC	45,595	47.750	2,177,161.250
INTEL CORP	851,038	20.690	17,607,976.220
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,576	55.840	590,563.840
INTL GAME TECH	44,449	18.490	821,862.010
INTERNATIONAL PAPER CO	66,964	28.120	1,883,027.680
ITT CORP	26,239	52.740	1,383,844.860
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	69,653	11.170	778,024.010
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	45.880	898,330.400
RAYONIER INC	10,481	57.380	601,399.780
JOHNSON & JOHNSON	421,411	62.160	26,194,907.760
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	68,367	27.580	1,885,561.860
JOHNSON CONTROLS INC	101,605	40.900	4,155,644.500
KLA-TENCOR CORP	24,308	38.620	938,774.960
DEVON ENERGY CORP	65,587	78.300	5,135,462.100
NSTAR	14,218	41.940	596,302.920
KELLOGG CO	41,987	51.050	2,143,436.350

KEYCORP	141,351	8.660	1,224,099.660
KIMBERLY-CLARK CORP	60,025	62.910	3,776,172.750
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,142	191.170	2,512,356.140
KOHL'S CORP	45,466	52.270	2,376,507.820
KROGER CO	94,696	21.530	2,038,804.880
LSI CORP	110,142	6.060	667,460.520
LAM RESEARCH CORP	20,796	48.740	1,013,597.040
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,255	48.790	1,329,771.450
LEGG MASON INC	22,970	35.180	808,084.600
LEGGETT & PLATT INC	19,896	22.790	453,429.840
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,481	30.190	980,601.390
ELI LILLY & CO	158,438	34.490	5,464,526.620
LIMITED BRANDS	42,413	29.130	1,235,490.690
LINCOLN NATIONAL CORP	46,505	29.190	1,357,480.950
LINEAR TECH CORP	34,661	34.570	1,198,230.770
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	109,953	72.140	7,932,009.420
AGILENT TECHNOLOGIES INC	54,135	42.220	2,285,579.700
LOCKHEED MARTIN CORP	47,617	73.590	3,504,135.030
LOEWS CORP	48,916	40.010	1,957,129.160
RANGE RESOURCES CORP	26,082	46.460	1,211,769.720
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,568	55.300	805,610.400
LOWE'S COS INC	212,394	24.310	5,163,298.140
LUBRIZOL CORP	11,172	103.410	1,155,296.520
DOMINION RESOURCES INC/VA	92,781	42.440	3,937,625.640
IRON MOUNTAIN INC	29,860	24.780	739,930.800
SCANA CORP	16,061	41.080	659,785.880
MDU RESOURCES GROUP INC	27,799	20.410	567,377.590
MGM RESORTS INTERNATIONAL	39,867	16.330	651,028.110
MCCORMICK & CO INC	16,978	45.510	772,668.780
MCDONALD'S CORPORATION	163,081	73.560	11,996,238.360
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	49,293	37.700	1,858,346.100
MCAFFEE INC	22,524	47.430	1,068,313.320
MANPOWER INC	13,462	66.200	891,184.400
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,245	78.650	1,277,669.250
MARSH & MCLENNAN COS	85,146	26.820	2,283,615.720
MARSHALL & ILSLEY CORP	82,632	7.020	580,076.640
ENERGIZER HOLDINGS INC	10,852	71.600	777,003.200
MASCO CORP	58,195	13.710	797,853.450
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,120	82.670	505,940.400
MATTEL INC	56,682	23.900	1,354,699.800
METLIFE INC	144,519	45.440	6,566,943.360
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	48,996	24.840	1,217,060.640
MEDTRONIC INC	164,774	36.500	6,014,251.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	80,546	11.980	964,941.080
CVS CAREMARK CORP	205,420	35.180	7,226,675.600
MERCK & CO. INC.	470,615	37.200	17,506,878.000
MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	33,006	11.590	382,539.540
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	89.120	1,394,817.120
MICROSOFT CORP	1,190,807	28.210	33,592,665.470
MICRON TECH INC	134,484	8.550	1,149,838.200
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,631	35.380	906,824.780
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	80,651	20.280	1,635,602.280
3M CO	102,739	87.150	8,953,703.850
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	57.350	513,741.300
PROGRESS ENERGY INC	47,954	43.990	2,109,496.460
MOTOROLA INC	48,368	38.530	1,863,619.040

MURPHY OIL CORPORATION	27,581	72.910	2,010,930.710
MYLAN LABORATORIES	52,377	22.410	1,173,768.570
ILLUMINA INC	19,512	65.950	1,286,816.400
XCEL ENERGY INC	76,825	23.560	1,809,997.000
NATIONAL OILWELL VARCO INC	66,030	65.200	4,305,156.000
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	37,397	14.060	525,801.820
NETAPP INC	54,353	58.215	3,164,159.890
SEARS HOLDINGS CORP	6,881	70.550	485,454.550
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,269	72.050	1,604,481.450
NEWELL RUBBERMAID INC	41,069	18.080	742,527.520
DUN & BRADSTREET CORP	8,370	82.940	694,207.800
NEWMONT MINING CORP	74,097	57.750	4,279,101.750
NIKE INC-CL B	57,192	84.170	4,813,850.640
NOBLE ENERGY INC	28,766	82.340	2,368,592.440
NORDSTROM INC	26,726	42.150	1,126,500.900
NORFOLK SOUTHERN CORP	55,333	65.610	3,630,398.130
NORTHEAST UTILITIES	29,133	31.560	919,437.480
NISOURCE INC	44,250	18.090	800,482.500
COACH INC	47,477	53.490	2,539,544.730
NORTHERN TRUST CORP	31,642	54.710	1,731,133.820
NORTHROP GRUMMAN CORP	42,168	66.930	2,822,304.240
WELLS FARGO & CO	760,632	31.200	23,731,718.400
NUCOR CORP	46,577	43.750	2,037,743.750
MONSANTO CO	81,606	71.370	5,824,220.220
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,538	45.570	3,305,556.660
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	124,018	95.790	11,879,684.220
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18,071	56.755	1,025,619.600
OLD REPUBLIC INTL CORP	38,339	13.160	504,541.240
OMNICARE INC	15,639	24.940	390,036.660
ORACLE CORP	615,099	31.010	19,074,219.990
OWENS-ILLINOIS INC	23,621	31.540	745,006.340
PACCAR INC	51,579	57.270	2,953,929.330
PALL CORP	16,605	50.160	832,906.800
EXELON CORP	99,073	42.230	4,183,852.790
PARKER HANNIFIN CORP	24,469	87.250	2,134,920.250
PATTERSON COS INC	17,356	31.180	541,160.080
PAYCHEX INC	49,781	32.000	1,592,992.000
JC PENNEY CO INC HOLDING CO	34,075	30.890	1,052,576.750
PPL CORPORATION	73,375	26.350	1,933,431.250
PEPSICO INC	242,140	66.050	15,993,347.000
PENTAIR INC	12,610	36.050	454,590.500
PERRIGO CO	11,741	66.260	777,958.660
PFIZER INC	1,230,369	18.250	22,454,234.250
CONOCOPHILLIPS	215,554	66.880	14,416,251.520
PETSMART INC	20,132	39.160	788,369.120
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	19,402	27.310	529,868.620
PG&E CORP	59,541	46.520	2,769,847.320
PITNEY BOWES INC	29,849	23.880	712,794.120
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,639	87.860	1,637,622.540
ALTRIA GROUP INC	318,900	24.240	7,730,136.000
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	79,775	61.620	4,915,735.500
AETNA INC	66,171	32.220	2,132,029.620
FLUOR CORP (NEW)	26,618	66.010	1,757,054.180
PPG INDUSTRIES INC	24,715	82.580	2,040,964.700
PRAXAIR INC	46,006	93.180	4,286,839.080
PRECISION CASTPARTS CORP	22,672	142.350	3,227,359.200
COSTCO WHOLESALE CORP	66,240	70.480	4,668,595.200
T ROWE PRICE GROUP INC	38,520	64.730	2,493,399.600

QUEST DIAGNOSTICS	22,395	53.630	1,201,043.850
PROCTER & GAMBLE CO	434,277	64.360	27,950,067.720
PROGRESSIVE CORP	92,643	19.300	1,788,009.900
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	80,746	31.600	2,551,573.600
PULTE GROUP INC	52,991	8.200	434,526.200
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	62,881	18.380	1,155,752.780
QUALCOMM INC	245,346	51.610	12,662,307.060
US BANCORP	291,893	26.250	7,662,191.250
RALCORP HOLDINGS INC	9,036	63.350	572,430.600
ROSS STORES INC	18,841	64.270	1,210,911.070
ROPER INDUSTRIES INC	15,510	75.070	1,164,335.700
ROWAN COS INC	17,226	33.410	575,520.660
PEABODY ENERGY CORP	41,112	61.540	2,530,032.480
ROCKWELL AUTOMATION INC	24,354	72.400	1,763,229.600
RAYTHEON COMPANY	58,666	49.640	2,912,180.240
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	8,983	65.350	587,039.050
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	71.790	610,573.950
FMC TECHNOLOGIES INC	18,402	85.960	1,581,835.920
KRAFT FOODS INC-A	266,712	31.210	8,324,081.520
SANDISK CORP	38,131	53.250	2,030,475.750
SAFEWAY INC	56,305	21.160	1,191,413.800
ROCKWELL COLLINS INC	23,208	60.200	1,397,121.600
ST JUDE MEDICAL INC	51,264	40.550	2,078,755.200
THE TRAVELERS COMPANIES INC	70,363	53.850	3,789,047.550
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	42,694	28.530	1,218,059.820
PRICELINE.COM INC	7,076	440.560	3,117,402.560
SCHWAB (CHARLES) CORP	159,440	17.950	2,861,948.000
JOY GLOBAL INC	16,273	87.260	1,419,981.980
ZIMMER HOLDINGS INC	30,008	53.000	1,590,424.000
SPX CORP	9,093	73.310	666,607.830
SEI INVESTMENTS CO	20,856	24.070	502,003.920
WELLPOINT INC	61,216	61.130	3,742,134.080
AMERISOURCEBERGEN CORP	47,577	34.730	1,652,349.210
PRIDE INTERNATIONAL INC	29,280	32.450	950,136.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	51,227	32.330	1,656,168.910
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	14,960	82.620	1,235,995.200
SIGMA-ALDRICH	19,608	64.580	1,266,284.640
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,533	59.870	4,222,810.710
ADVANCE AUTO PARTS	15,154	62.340	944,700.360
UNITED STATES STEEL CORP	23,777	55.400	1,317,245.800
SOUTHWESTERN ENERGY CO	56,146	38.090	2,138,601.140
EDISON INTERNATIONAL	46,765	38.130	1,783,149.450
SOUTHERN CO	127,152	37.760	4,801,259.520
BB&T CORP	103,595	26.440	2,739,051.800
SOUTHWEST AIRLINES	31,468	13.300	418,524.400
AT&T INC	902,567	28.340	25,578,748.780
CHEVRON CORP	307,715	90.410	27,820,513.150
MEADWESTVACO CORP	22,905	27.070	620,038.350
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,521	65.750	1,546,505.750
STAPLES INC	114,366	23.060	2,637,279.960
STATE STREET CORP	76,270	46.400	3,538,928.000
STARBUCKS CORP	113,559	32.765	3,720,760.630
STRYKER CORP	45,944	54.700	2,513,136.800
NETFLIX INC	6,637	187.880	1,246,959.560
SUNOCO INC	15,972	38.770	619,234.440
STERICYCLE INC	12,270	77.000	944,790.000
SUNTRUST BANKS INC	79,499	28.470	2,263,336.530

	SYMANTEC CORP	124,019	17.080	2,118,244.520	
	SYNOPSYS INC	27,123	26.790	726,625.170	
	SYSCO CORP	88,122	30.080	2,650,709.760	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,976	271.580	1,622,962.080	
	TELEPHONE & DATA SYSTEMS INC	7,118	36.380	258,952.840	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	183,804	33.380	6,135,377.520	
	TEXTRON INC	42,770	24.330	1,040,594.100	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	61,800	56.140	3,469,452.000	
	TIFFANY & CO	19,250	60.940	1,173,095.000	
	TOLL BROTHERS INC	17,548	20.270	355,697.960	
	TORCHMARK CORP	13,076	61.470	803,781.720	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	31,861	16.020	510,413.220	
	DAVITA INC	15,287	69.390	1,060,764.930	
	TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	10,685	51.850	554,017.250	
	TYSON FOODS INC	47,556	16.920	804,647.520	
	URS CORP	11,295	40.620	458,802.900	
	MARATHON OIL CORP	108,408	39.150	4,244,173.200	
	UNION PACIFIC CORP	76,037	97.360	7,402,962.320	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	134,497	78.460	10,552,634.620	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	172,937	38.450	6,649,427.650	
	SPRINT NEXTEL CORP	469,424	4.580	2,149,961.920	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	20,330	68.670	1,396,061.100	
	VF CORP	12,722	82.700	1,052,109.400	
	CBS CORP	95,329	19.780	1,885,607.620	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	34,970	36.290	1,269,061.300	
	VULCAN MATERIALS CO	20,011	40.370	807,844.070	
	URBAN OUTFITTERS INC	16,748	36.090	604,435.320	
	WALGREEN CO	147,747	40.950	6,050,239.650	
	WAL-MART STORES INC	311,532	53.730	16,738,614.360	
	WASTE MANAGEMENT INC	73,941	36.150	2,672,967.150	
	WATERS CORP	15,070	74.680	1,125,427.600	
	WASHINGTON POST	984	415.000	408,360.000	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	15,987	53.450	854,505.150	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	63.180	1,142,547.120	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	65,926	63.020	4,154,656.520	
	WESTERN DIGITAL CORP	34,951	32.840	1,147,790.840	
	WEYERHAEUSER CO	81,106	20.800	1,687,004.800	
	WHIRLPOOL CORP	11,190	87.900	983,601.000	
	WYNN RESORTS LTD	12,957	118.700	1,537,995.900	
	WHOLE FOODS MARKET INC	22,280	48.740	1,085,927.200	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	23,790	23.480	558,589.200	
	CME GROUP INC	10,126	314.310	3,182,703.060	
	WILLIAMS COS INC	88,360	24.750	2,186,910.000	
	PEPCO HOLDINGS INC	29,814	18.080	539,037.120	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,827	37.090	661,203.430	
	WISCONSIN ENERGY CORP	20,256	58.540	1,185,786.240	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	33.330	770,189.640	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	13,646	47.790	652,142.340	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	31,885	19.910	634,830.350	
	CARMAX INC	33,430	32.420	1,083,800.600	
	XEROX CORP	219,095	11.410	2,499,873.950	
	XILINX INC	39,758	30.190	1,200,294.020	
	YAHOO! INC	194,520	16.600	3,229,032.000	
	CIMAREX ENERGY CO	15,308	91.650	1,402,978.200	
	TJX COMPANIES INC	64,355	45.580	2,933,300.900	
	HOSPIRA INC	27,758	55.650	1,544,732.700	
	GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	13.880	1,019,180.640	
	PETROHAWK ENERGY CORP	52,018	19.280	1,002,907.040	
	BUCYRUS INTERNATIONAL INC	10,858	90.100	978,305.800	

CB RICHARD ELLIS GROUP INC	25,354	20.580	521,785.320
LIBERTY GLOBAL INC	17,272	37.410	646,145.520
REGIONS FINANCIAL CORP	183,557	7.050	1,294,076.850
GOOGLE INC	37,733	614.210	23,175,985.930
METROPCS COMMUNICATIONS INC	35,132	13.180	463,039.760
LAS VEGAS SANDS CORP	51,811	50.600	2,621,636.600
MOSAIC CO/THE	25,725	75.580	1,944,295.500
NEWS CORP CLASS B	65,216	16.350	1,066,281.600
NEWS CORP INC CLASS A	280,863	14.630	4,109,025.690
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	8,633	66.900	577,547.700
CELANESE CORP	24,956	42.850	1,069,364.600
WINDSTREAM CORP	69,270	13.260	918,520.200
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	19,351	64.630	1,250,655.130
IHS INC-CLASS A	7,410	78.930	584,871.300
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	17,045	39.820	678,731.900
EXPEDIA INC	33,017	25.510	842,263.670
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,794	135.490	1,462,479.060
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,151	60.010	2,409,461.510
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	23,006	35.530	817,403.180
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	35,921	13.140	472,001.940
GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	20.700	482,972.400
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,509	114.090	1,198,971.810
VIACOM INC-CLASS B	88,308	40.630	3,587,954.040
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,402	223.670	760,925.340
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	12,917	26.200	338,425.400
NYSE EURONEXT	38,980	30.980	1,207,600.400
VIRGIN MEDIA INC	47,938	25.820	1,237,759.160
MASTERCARD INC	15,984	230.200	3,679,516.800
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	92,389	16.050	1,482,843.450
WESTERN UNION CO	105,403	19.020	2,004,765.060
SAIC INC	57,846	16.010	926,114.460
KBR INC	27,411	29.080	797,111.880
FIRST SOLAR INC	8,706	136.430	1,187,759.580
SPECTRA ENERGY CORP	99,681	24.720	2,464,114.320
TIME WARNER CABLE INC	56,388	66.260	3,736,268.880
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	51,685	14.025	724,882.120
DELTA AIR LINES INC	29,903	12.600	376,777.800
DISCOVER FINANCIAL	85,015	19.120	1,625,486.800
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	87.320	1,300,282.120
VMWARE INC	10,126	95.700	969,058.200
TERADATA CORP	27,764	44.420	1,233,276.880
CALPINE CORP NPR	62,847	14.180	891,170.460
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	279,987	56.510	15,822,065.370
VISA INC	75,058	71.810	5,389,914.980
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	38,313	35.080	1,344,020.040
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	25.510	732,774.750
LORILLARD INC	23,877	77.860	1,859,063.220
SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	15,156	47.560	720,819.360
LENDER PROCESSING SERVICES	16,352	29.740	486,308.480
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	26,102	34.500	900,519.000
CAREFUSION CORP	34,028	25.220	858,186.160
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	42,322	32.260	1,365,307.720
VERISK ANALYTICS INC	15,668	34.290	537,255.720
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	31,156	61.060	1,902,385.360

	CIT GROUP INC	29,747	46.640	1,387,400.080	
	DOLLAR GENERAL CORP	13,004	30.000	390,120.000	
	QEP RESOURCES INC	27,559	37.190	1,024,919.210	
	GENERAL MOTORS CO	81,841	38.560	3,155,788.960	
米ドル小計	銘柄数 : 571	50,149,406		1,819,527,494.330	
	組入時価比率 : 53.25%			(150,838,829,280)	
	合計時価比率 : 54.51%				
英ポンド	XSTRATA PLC	315,220	14.850	4,681,017.000	
	AMEC PLC	45,879	12.070	553,759.530	
	ANTOFAGASTA PLC	68,045	15.050	1,024,077.250	
	SEVERN TRENT PLC	32,783	14.610	478,959.630	
	BHP BILLITON PLC	338,337	24.740	8,370,457.380	
	BARCLAYS PLC	1,748,091	2.767	4,836,967.790	
	BALFOUR BEATTY PLC	45,234	3.169	143,346.540	
	AUTONOMY CORP PLC	33,254	15.360	510,781.440	
	BRITISH AIRWAYS PLC	68,984	2.978	205,434.350	
	BT GROUP PLC	1,180,510	1.873	2,211,095.230	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	176,393	7.420	1,308,836.060	

[前へ](#) [次へ](#)

平成23年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	AGGREKO PLC	44,550	14.600	650,430.000	
	TULLOW OIL PLC	149,762	13.500	2,021,787.000	
	BUNZL PLC	45,259	7.570	342,610.630	
	CAPITA GROUP PLC	90,670	6.755	612,475.850	
	AVIVA PLC	446,847	4.060	1,814,198.820	
	DIAGEO PLC	380,900	12.070	4,597,463.000	
	SCHRODERS PLC	15,818	18.870	298,485.660	
	NATIONAL GRID PLC	520,429	5.650	2,940,423.850	
	LONMIN	24,209	18.500	447,866.500	
	KINGFISHER PLC	336,453	2.622	882,179.760	
	BAE SYSTEMS PLC	521,872	3.404	1,776,452.280	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	305,100	24.185	7,378,843.500	
	MAN GROUP PLC	271,583	3.052	828,871.310	
	COBHAM PLC	193,291	2.199	425,046.900	
	FIRSTGROUP PLC	78,089	3.997	312,121.730	
	NEXT PLC	27,896	20.650	576,052.400	
	REXAM PLC	155,173	3.500	543,105.500	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	154,361	19.580	3,022,388.380	
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,968	20.080	702,157.440	
	SABMILLER PLC	144,503	22.165	3,202,908.990	
	ANGLO AMERICAN PLC	202,213	32.265	6,524,402.440	
	COMPASS GROUP PLC	288,611	5.670	1,636,424.370	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,691,734	6.724	18,099,219.410	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.025	934,615.500	
	ARM HOLDINGS PLC	206,868	4.650	961,936.200	
	CENTRICA PLC	791,517	3.338	2,642,083.740	
	UNILEVER PLC	194,545	18.970	3,690,518.650	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	327,631	2.710	887,880.010	
	INTL POWER PLC	230,301	4.210	969,567.210	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	119,146	5.920	705,344.320	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	507,864	1.300	660,223.200	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	52,877	11.410	603,326.570	
	PEARSON PLC	128,282	9.830	1,261,012.060	
	PRUDENTIAL PLC	386,040	6.720	2,594,188.800	
	RIO TINTO PLC	222,550	43.890	9,767,719.500	
	VODAFONE GROUP PLC	8,063,863	1.768	14,256,909.780	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	94,259	34.880	3,287,753.920	
	REED ELSEVIER PLC	185,486	5.375	996,987.250	
	OLD MUTUAL PLC	846,878	1.233	1,044,200.570	
	ROLLS ROYCE GROUP	283,852	6.530	1,853,553.560	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,733,986	0.395	1,079,924.470	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	146,128	12.190	1,781,300.320	
	SERCO GROUP PLC	87,197	5.500	479,583.500	
	BP PLC	2,875,569	4.863	13,983,892.040	
	SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	2.767	609,177.180	
	INVENSYS PLC	136,685	3.509	479,627.660	
	SMITHS GROUP PLC	59,731	12.730	760,375.630	
	STANDARD CHARTERED PLC	356,660	17.150	6,116,719.000	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,240,783	0.651	4,062,749.730	
	BG GROUP PLC	517,975	13.250	6,863,168.750	
	TESCO PLC	1,224,933	4.296	5,262,312.160	
	3I GROUP PLC	173,835	3.258	566,354.430	
	SMITH & NEPHEW PLC	134,328	7.120	956,415.360	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	794,922	12.340	9,809,337.480	
	WEIR GROUP	19,104	17.510	334,511.040	

	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,822	8.625	239,964.750	
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	5.705	346,088.120	
	ASTRAZENECA PLC	219,743	29.660	6,517,577.380	
	WHITBREAD PLC	27,936	18.680	521,844.480	
	CARNIVAL PLC	26,075	30.970	807,542.750	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	242,817	3.840	932,417.280	
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	18.640	522,031.840	
	BURBERRY GROUP PLC	61,455	11.190	687,681.450	
	INVESTEC PLC	83,969	5.255	441,257.090	
	CAIRN ENERGY	224,914	4.314	970,278.990	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	41,175	13.190	543,098.250	
	VEDANTA RESOURCES PLC	16,418	23.550	386,643.900	
	ICAP PLC	87,128	5.435	473,540.680	
	ITV PLC	516,632	0.720	371,975.040	
	SAINSBURY (J) PLC	181,016	3.893	704,695.280	
	G4S PLC	243,560	2.608	635,204.480	
	ADMIRAL GROUP PLC	34,776	15.430	536,593.680	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	551,208	21.330	11,757,266.640	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	405,860	21.375	8,675,257.500	
	INMARSAT PLC	62,616	6.650	416,396.400	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	15.520	529,759.680	
	STANDARD LIFE PLC	346,532	2.138	740,885.410	
	HOME RETAIL GROUP	142,584	2.034	290,015.850	
	EXPERIAN PLC	161,474	7.740	1,249,808.760	
	THOMAS COOK GROUP PLC	129,781	1.950	253,072.950	
	TUI TRAVEL PLC	96,617	2.549	246,276.730	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	42,150	10.360	436,674.000	
	FRESNILLO PLC NPR	26,632	15.210	405,072.720	
	ESSAR ENERGY PLC	68,956	5.580	384,774.480	
	CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	429,358	0.695	298,403.810	
	RESOLUTION LTD	208,800	2.434	508,219.200	
	SHIRE PLC	85,724	15.980	1,369,869.520	
	WPP PLC	195,243	7.775	1,518,014.320	
	WOLSELEY PLC	45,294	20.570	931,697.580	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	12,861	51.400	661,055.400	
	PETROFAC LTD	40,996	16.330	669,464.680	
英債券小計	銘柄数 : 102	45,663,720		231,204,338.580	
	組入時価比率 : 10.53%			(29,823,047,633)	
	合計時価比率 : 10.78%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	28,702	71.320	2,047,026.640	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	24,232	27.300	661,533.600	
	BARRICK GOLD CORP	153,369	48.720	7,472,137.680	
	TMX GROUP INC	5,512	37.190	204,991.280	
	TALISMAN ENERGY INC	171,651	22.200	3,810,652.200	
	BANK OF MONTREAL	88,546	58.080	5,142,751.680	
	BANK OF NOVA SCOTIA	161,612	55.920	9,037,343.040	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	68.650	1,751,261.500	
	BCE INC	40,524	35.390	1,434,144.360	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	87,680	31.930	2,799,622.400	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	46,194	34.800	1,607,551.200	
	BOMBARDIER INC 'B'	215,110	5.240	1,127,176.400	
	SAPUTO INC	19,337	40.600	785,082.200	
	RESEARCH IN MOTION LTD	75,360	61.770	4,654,987.200	
	CGI GROUP INC	44,501	17.120	761,857.120	
	CAE INC	50,233	12.150	610,330.950	
	CAMECO CORP	63,356	37.890	2,400,558.840	
	ROGERS COMM-CL B	71,410	34.370	2,454,361.700	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,952	76.890	4,840,379.280
CANADIAN NATURAL RESOURCES	172,898	41.600	7,192,556.800
NEXEN INC	90,019	21.820	1,964,214.580
CANADIAN TIRE CORP-CL A	11,281	65.900	743,417.900
CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	53.650	736,346.250
CANADIAN NATL RAILWAY CO	74,525	66.840	4,981,251.000
AGRIUM INC	24,811	90.170	2,237,207.870
YAMANA GOLD INC	126,445	11.810	1,493,315.450
GILDAN ACTIVEWEAR INC	19,386	28.150	545,715.900
OPEN TEXT CORP	9,281	46.440	431,009.640
ELDORADO GOLD CORP	91,513	16.900	1,546,569.700
OSISKO MINING CORP	27,525	13.800	379,845.000
KINROSS GOLD CORP	178,560	17.210	3,073,017.600
FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	28.030	843,142.400
FORTIS INC	24,644	33.740	831,488.560
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	13,417	114.610	1,537,722.370
TELUS CORP-NON VOTE	29,878	43.500	1,299,693.000
GREAT WEST LIFECO INC	45,535	25.890	1,178,901.150
IAMGOLD CORP	48,222	17.810	858,833.820
IMPERIAL OIL LTD	44,848	39.330	1,763,871.840
ENBRIDGE INC	58,301	54.550	3,180,319.550
IGM FINANCIAL INC	19,774	43.250	855,225.500
IVANHOE MINES LTD/CA	43,340	23.780	1,030,625.200
MANULIFE FINANCIAL CORP	270,518	17.450	4,720,539.100
LOBLAW CO LTD	17,526	38.380	672,647.880
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,264	31.470	1,330,048.080
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	16,912	36.370	615,089.440
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,562	60.770	1,978,792.740
SUN LIFE FINANCIAL INC	90,261	30.360	2,740,323.960
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,141	410.000	1,287,810.000
INMET MINING CORPORATION	6,327	74.260	469,843.020
METRO INC	20,518	44.520	913,461.360
HUSKY ENERGY INC	39,604	26.130	1,034,852.520
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,354	42.380	1,837,342.520
NIKO RESOURCES LTD	8,983	94.750	851,139.250
ONEX CORP	17,569	30.450	534,976.050
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,683	37.080	729,845.640
GOLDCORP INC	123,092	42.660	5,251,104.720
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,791	164.730	7,543,151.430
POWER CORP OF CANADA	60,704	27.550	1,672,395.200
POWER FINANCIAL CORP	37,766	30.600	1,155,639.600
ROYAL BANK OF CANADA	222,880	51.690	11,520,667.200
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,493	58.660	1,495,419.380
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	26,819	65.610	1,759,594.590
SHAW COMM INC-B	56,820	20.230	1,149,468.600
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	51,741	8.590	444,455.190
SINO-FOREST CORP	38,862	22.440	872,063.280
SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	39.330	1,344,142.080
SUNCOR ENERGY INC	241,993	36.850	8,917,442.050
ENCANA CORP	122,984	28.690	3,528,410.960
TECK RESOURCES LTD-CL B	83,853	60.500	5,073,106.500
THOMSON REUTERS CORP	59,197	37.160	2,199,760.520
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,305	73.700	10,045,678.500
TRANSCANADA CORP	108,450	37.000	4,012,650.000
TRANSALTA CORP	34,014	21.300	724,498.200
WESTON (GEORGE) LTD	9,625	82.900	797,912.500

	CENTERRA GOLD INC	9,187	18.590	170,786.330	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	42,285	12.310	520,528.350	
	INTACT FINANCIAL CORP	17,942	50.830	911,991.860	
	SILVER WHEATON CORP	49,630	34.060	1,690,397.800	
	VITERRA INC NPR	63,352	10.670	675,965.840	
	PETROMINERALES LTD	9,794	35.470	347,393.180	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,995	31.350	626,843.250	
	CI FINANCIAL CORP	23,137	21.280	492,355.360	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD	11,734	21.780	255,566.520	
	TIM HORTONS INC	27,358	42.000	1,149,036.000	
	IVANHOE MINES LTD/CA RTS	43,340	1.460	63,276.400	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	38,473	14.830	570,554.590	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	121,077	31.950	3,868,410.150	
	YELLOW MEDIA INC	41,248	6.150	253,675.200	
	VERMILION ENERGY INC	19,643	46.120	905,935.160	
カナダドル小計	銘柄数 : 89	5,321,781		194,035,028.400	
	組入時価比率 : 5.71%			(16,178,640,668)	
	合計時価比率 : 5.85%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	33,938	15.150	514,160.700	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	171,912	40.080	6,890,232.960	
	SYNGENTA AG	14,689	297.200	4,365,570.800	
	LOGITECH INTL-REG	27,879	17.350	483,700.650	
	NESTLE SA-REGISTERED	530,612	53.400	28,334,680.800	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	80,420	53.900	4,334,638.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	107,454	134.100	14,409,581.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,135	105.900	755,596.500	
	SIKA INHABER	325	2,048.000	665,600.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,544.000	1,329,384.000	
	SWISS RE-REG	53,667	51.700	2,774,583.900	
	NOVARTIS AG-REG SHS	323,726	54.850	17,756,371.100	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	90.950	817,094.800	
	SWISSCOM AG-REG	3,764	412.200	1,551,520.800	
	ABB LTD	334,715	21.130	7,072,527.950	
	ADECCO SA-REG	18,303	62.900	1,151,258.700	
	GEBERIT AG	5,934	208.700	1,238,425.800	
	LONZA GROUP AG-REG	7,731	69.950	540,783.450	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	27	28,525.000	770,175.000	
	UBS AG-REGISTERED	557,069	15.680	8,734,841.920	
	GIVAUDAN-REG	1,382	974.000	1,346,068.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	22,092	245.300	5,419,167.600	
	HOLCIM LTD-REG	38,247	68.400	2,616,094.800	
	ACTELION	16,953	52.400	888,337.200	
	SONOVA HOLDING AG	7,134	115.800	826,117.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	8,495	131.600	1,117,942.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,476	207.100	305,679.600	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,604	395.300	1,819,961.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	8,522	71.350	608,044.700	
	SCHINDLER NAMEN	4,151	106.300	441,251.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,952	139.600	691,299.200	
	ARYZTA AG	13,689	42.300	579,044.700	
	JULIUS BAER GROUP LTD	33,938	43.620	1,480,375.560	
	TRANSOCEAN LTD	44,875	71.200	3,195,100.000	
	SYNTHESE INC	9,280	125.300	1,162,784.000	
スイスフラン小計	銘柄数 : 35	2,508,935		126,987,996.290	
	組入時価比率 : 3.84%			(10,867,632,722)	
	合計時価比率 : 3.93%				

スウェーデンク ローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	11,938	661.500	7,896,987.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	95,060	164.400	15,627,864.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	69,569	148.800	10,351,867.200	
	ERICSSON LM-B SHS	472,629	76.000	35,919,804.000	
	GETINGE AB-B SHS	27,977	149.300	4,176,966.100	
	SKF AB-B SHS	57,192	186.800	10,683,465.600	
	SANDVIK AB	158,062	129.300	20,437,416.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	56.950	12,191,514.300	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	134.000	7,839,938.000	
	SWEDBANK AB	110,549	95.350	10,540,847.150	
	SSAB AB-A	26,362	111.100	2,928,818.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	87,453	109.500	9,576,103.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	65,642	221.400	14,533,138.800	
	VOLVO AB-B SHS	191,074	117.800	22,508,517.200	
	HOLMEN AB-B SHS	840	231.500	194,460.000	
	SCANIA AB	55,960	154.600	8,651,416.000	
	SWEDISH MATCH AB	37,451	199.100	7,456,494.100	
	TELE2 AB-B SHS	55,285	142.000	7,850,470.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,708	471.600	3,635,092.800	
	NORDEA AB	508,358	72.000	36,601,776.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	183.500	7,080,164.000	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	78.500	4,164,817.500	
	INVESTOR AB-B SHS	69,415	145.500	10,099,882.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	156,138	223.700	34,928,070.600	
	ASSA ABLOY AB-B	48,208	188.100	9,067,924.800	
	TELIASONERA AB	340,061	53.750	18,278,278.750	
	BOLIDEN AB	44,557	136.400	6,077,574.800	
	ALFA LAVAL AB	55,244	139.400	7,701,013.600	
	KINNEVIK INVESTMENT B	38,973	140.900	5,491,295.700	
	HUSQVARNA AB-B SHS	66,807	56.600	3,781,276.200	
	RATOS AB	16,902	263.200	4,448,606.400	
	HEXAGON AB	46,285	138.000	6,387,330.000	
スウェーデンク ローネ小計	銘柄数 : 32	3,285,919		367,109,191.400	
	組入時価比率 : 1.56%			(4,419,994,664)	
	合計時価比率 : 1.60%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	51,397	10.040	516,025.880	
	OMV AG	23,460	30.350	712,011.000	
	VERBUND AG	10,151	26.900	273,061.900	
	VOEST-ALPINE AG	17,613	35.260	621,034.380	
	ERSTE GROUP BANK AG	31,044	33.430	1,037,800.920	
	IMMOFINANZ AG	152,609	3.188	486,517.490	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	40.770	370,966.230	
	UMICORE	18,212	37.955	691,236.460	
	DELHAIZE GROUP	15,041	56.040	842,897.640	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	25,919	22.725	589,009.270	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	113,101	43.590	4,930,072.590	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.004	157.630	
	SOLVAY SA	8,874	76.580	679,570.920	
	AGEAS	329,447	1.760	579,826.720	
	UCB SA	17,301	26.010	449,999.010	
	COLRUYT NV	14,070	38.570	542,679.900	
	BEKAERT NV	2,702	79.720	215,403.440	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	63.980	820,863.400	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.008	4.120	
	DEXIA	82,352	2.573	211,891.690	
	BELGACOM SA	27,540	25.620	705,574.800	

BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD NPR	138,160	2.270	313,623.200
ADIDAS AG	32,657	47.265	1,543,533.100
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	50,066	58.470	2,927,359.020
COMMERZBANK AG	113,034	5.412	611,740.000
FRESENIUS AG	5,041	61.450	309,769.450
UNITED INTERNET	16,729	11.765	196,816.680
MAN SE	16,343	88.200	1,441,452.600
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	9,936	39.465	392,124.240
GEA GROUP AG	28,135	21.000	590,835.000
FRESENIUS SE	11,678	61.860	722,401.080
CONTINENTAL AG	7,740	58.490	452,712.600
DEUTSCHE POST AG-REG	140,485	12.870	1,808,041.950
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,421	69.520	1,002,547.920
MERCK KGAA	11,319	60.530	685,139.070
RWE AG	63,555	50.270	3,194,909.850
RWE AG-N VTG PFD	6,189	48.000	297,072.000
SAP AG	131,575	37.445	4,926,825.870
E.ON AG	275,380	22.350	6,154,743.000
HENKEL AG & CO KGAA	23,200	38.280	888,096.000
METRO AG	18,581	52.640	978,103.840
SIEMENS AG-REG	126,367	88.800	11,221,389.600
PUMA AG	1,129	230.200	259,895.800
BAYER AG	127,097	54.300	6,901,367.100
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,692	45.280	1,163,333.760
DAIMLER AG	138,109	53.910	7,445,456.190
BASF SE	141,020	56.780	8,007,115.600
CELESIO AG	13,447	18.380	247,155.860
BEIERSDORF AG	16,464	41.655	685,807.920
HOCHTIEF AG	6,942	60.400	419,296.800
HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	45.530	980,670.670
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	32,338	43.120	1,394,414.560
ALLIANZ SE	69,535	90.040	6,260,931.400
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,098	16.970	629,553.060
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28,784	111.200	3,200,780.800
SALZGITTER	6,090	54.850	334,036.500
VOLKSWAGEN AG	4,930	114.500	564,485.000
VOLKSWAGEN AG PFD	26,709	126.850	3,388,036.650
THYSSENKRUPP AG	54,891	30.405	1,668,960.850
TUI AG	18,532	10.685	198,014.420
LINDE AG	26,170	107.850	2,822,434.500
DEUTSCHE BANK AG-REG	142,863	40.290	5,755,950.270

[前](#) [次](#)

平成23年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	BMW VORZUG	9,751	38.505	375,462.250	
	K & S	20,562	55.470	1,140,574.140	
	SUEDZUCKER AG	13,153	19.620	258,061.860	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	424,754	9.677	4,110,344.450	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	172,852	6.813	1,177,640.670	
	DEUTSCHE BOERSE AG	30,778	52.300	1,609,689.400	
	FRAPORT AG	5,722	47.900	274,083.800	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	7,732	53.110	410,646.520	
	WACKER-CHEMIE GMBH	2,443	127.500	311,482.500	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,438	33.840	116,341.920	
	BRENNTAG AG	1,842	69.300	127,650.600	
	IBERIA	96,529	3.630	350,400.270	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	45,024	13.435	604,897.440	
	IBERDROLA SA	622,136	5.452	3,391,885.470	
	INDRA SISTEMAS SA	14,163	12.410	175,762.830	
	REPSOL YPF SA	114,767	20.420	2,343,542.140	
	TELEFONICA S.A	628,807	16.580	10,425,620.060	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	27,041	32.640	882,618.240	
	BANKINTER S.A.	41,581	3.741	155,554.520	
	ACERINOX SA	17,369	12.430	215,896.670	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	652,635	6.920	4,516,234.200	
	ACCIONA S.A.	3,982	51.430	204,794.260	
	GAS NATURAL SDG SA	37,078	10.340	383,386.520	
	BANCO SANTANDER SA	1,260,781	7.396	9,324,736.270	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	12,298	33.405	410,814.690	
	ZARDOYA OTIS	22,909	10.730	245,813.570	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	10,230	17.615	180,201.450	
	BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	3.542	519,317.410	
	BANCO SABADELL	145,368	2.804	407,611.870	
	INDITEX	35,155	56.600	1,989,773.000	
	MAPFRE SA	115,526	2.033	234,864.350	
	ENAGAS	28,703	14.435	414,327.800	
	GESTEVISION TELECINCO SA	20,321	8.153	165,677.110	
	FERROVIAL SA	73,959	7.577	560,387.340	
	CRITERIA CAIXACORP SA	149,185	3.897	581,373.940	
	IBERDROLA RENOVABLES	171,507	2.550	437,342.850	
	EDP RENOVAVEIS SA	38,800	4.199	162,921.200	
	AMADEUS IT HOLDING SA	11,909	14.520	172,918.680	
	KESKO OYJ-B	11,627	34.580	402,061.660	
	WARTSILA OYJ	13,218	55.750	736,903.500	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	17,124	27.290	467,313.960	
	OUTOKUMPU OYJ	22,458	13.720	308,123.760	
	RAUTARUUKKI OYJ	5,312	16.970	90,144.640	
	UPM-KYMMENE OYJ	79,405	13.100	1,040,205.500	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	88,398	7.835	692,598.330	
	SAMPO OYJ-A SHS	69,068	19.970	1,379,287.960	
	FORTUM OYJ	70,526	22.210	1,566,382.460	
	NOKIA OYJ	571,314	7.980	4,559,085.720	
	POHJOLA BANK PLC	23,199	9.000	208,791.000	
	ELISA CORP	26,610	15.930	423,897.300	
	METSO OYJ	21,261	40.420	859,369.620	

	NESTE OIL OYJ	23,509	12.650	297,388.850
	KONE OYJ	27,580	41.100	1,133,538.000
	AIR LIQUIDE	42,224	90.980	3,841,539.520
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	62,093	19.160	1,189,701.880
	ERAMET	959	250.000	239,750.000
	AXA	258,522	12.755	3,297,448.110
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,269	21.640	1,109,461.160
	DANONE	88,108	45.935	4,047,240.980
	SAFRAN SA	29,066	28.000	813,848.000
	ACCOR SA	23,704	33.845	802,261.880
	BOUYGUES	27,508	31.960	879,155.680
	BNP PARIBAS	146,442	47.320	6,929,635.440
	THALES SA	14,934	26.010	388,433.340
	CAP GEMINI SA	23,487	34.525	810,888.670
	CASINO GUICHARD PERRACHON	7,870	72.230	568,450.100
	CHRISTIAN DIOR	10,461	104.800	1,096,312.800
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	22.480	529,224.160
	ALCATEL-LUCENT	374,010	2.250	841,522.500
	NATIXIS	130,004	3.554	462,034.210
	EIFFAGE	6,803	33.675	229,091.020
	PUBLICIS GROUPE	20,487	37.380	765,804.060
	IMERYS SA	5,944	50.250	298,686.000
	LAFARGE SA	29,460	45.040	1,326,878.400
	L'OREAL	36,537	82.600	3,017,956.200
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	37,576	118.950	4,469,665.200
	LAGARDERE S.C.A.	17,950	34.130	612,633.500
	MICHELIN(CGDE)-B	26,638	53.100	1,414,477.800
	PERNOD-RICARD	31,253	69.340	2,167,083.020
	PEUGEOT SA	22,742	30.695	698,065.690
	RENAULT SA	31,419	47.500	1,492,402.500
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	60,122	37.610	2,261,188.420
	SOCIETE GENERALE-A	96,697	39.330	3,803,093.010
	VINCI S.A.	66,410	39.640	2,632,492.400
	SODEXO	14,377	52.580	755,942.660
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	37,222	113.550	4,226,558.100
	VIVENDI SA	189,125	20.220	3,824,107.500
	TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,748	72.620	1,143,619.760
	TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	21,519	13.575	292,120.420
	TOTAL SA	322,961	40.690	13,141,283.090
	AIR FRANCE	24,369	14.625	356,396.620
	VALLOUREC	18,366	81.000	1,487,646.000
	FRANCE TELECOM SA	285,037	15.675	4,467,954.970
	HERMES INTL	1,647	159.500	262,696.500
	BIC	3,183	67.270	214,120.410
	DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	56.640	558,583.680
	PPR	11,844	115.000	1,362,060.000
	CNP ASSURANCES	22,436	13.855	310,850.780
	NEOPOST SA	4,207	67.770	285,108.390
	CARREFOUR SA	91,171	32.060	2,922,942.260
	ATOS ORIGIN	6,851	38.880	266,366.880
	SANOFI-AVENTIS	160,360	48.905	7,842,405.800
	STMICROELECTRONICS NV	97,120	8.271	803,279.520
	M6-METROPOLE TELEVISION	9,651	17.870	172,463.370
	EURAZEO	4,851	55.500	269,230.500
	JC DECAUX INTERNATIONAL	12,248	22.775	278,948.200
	ESSILOR INTL	28,810	48.275	1,390,802.750
	CREDIT AGRICOLE SA	147,617	9.399	1,387,452.180

	ILIAD SA	2,768	79.070	218,865.760
	BIOMERIEUX	2,655	74.890	198,832.950
	PAGESJAUNES GROUPE SA	24,382	6.718	163,798.270
	GDF SUEZ	188,334	26.615	5,012,509.410
	ALSTOM	31,638	35.000	1,107,330.000
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	28.080	489,996.000
	ELECTRICITE DE FRANCE	40,711	30.830	1,255,120.130
	LEGRAND SA	21,721	30.600	664,662.600
	ADP	5,321	58.500	311,278.500
	SCOR SE	26,944	19.705	530,931.520
	BUREAU VERITAS SA	7,690	56.190	432,101.100
	GROUPE EUROTUNNEL SA	74,636	6.654	496,627.940
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,144	14.925	643,924.200
	GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310
	EDENRED	23,704	18.975	449,783.400
	ALPHA BANK A.E.	71,683	3.300	236,553.900
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	31,803	20.000	636,060.000
	NATIONAL BANK OF GREECE	149,407	5.640	842,655.480
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	33,942	6.850	232,502.700
	EFG EUROBANK ERGASIAS	54,995	3.250	178,733.750
	OPAP SA	37,174	12.680	471,366.320
	PUBLIC POWER CORP	15,123	10.350	156,523.050
	CRH PLC	114,679	14.490	1,661,698.710
	KERRY GROUP PLC-A	24,173	26.140	631,882.220
	ELAN CORPORATION PLC	79,484	5.250	417,291.000
	ANGLO IRISH BANK CORP	91,316	0.160	14,610.560
	ASSICURAZIONI GENERALI	171,461	13.810	2,367,876.410
	INTESA SANPAOLO	1,159,601	1.891	2,192,805.490
	INTESA SANPAOLO-RNC	137,310	1.695	232,740.450
	UNICREDIT SPA	2,039,486	1.474	3,006,202.360
	ENI SPA	399,340	16.920	6,756,832.800
	MEDIOBANCA SPA	67,179	6.555	440,358.340
	PIRELLI & C	43,558	5.905	257,209.990
	SAIPEM	40,273	36.830	1,483,254.590
	LUXOTTICA GROUP SPA	20,352	22.880	465,653.760
	MEDIASET SPA	120,446	4.340	522,735.640
	AUTOGRILL SPA	17,657	10.720	189,283.040
	A2A SPA	207,015	1.001	207,222.010
	FIAT SPA	119,079	7.550	899,046.450
	ENEL SPA	1,068,714	3.692	3,945,692.080
	FINMECCANICA SPA	67,914	8.530	579,306.420
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	336,391	0.793	266,758.060
	SNAM RETE GAS	242,930	3.675	892,767.750
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	89,526	6.275	561,775.650
	TELECOM ITALIA SPA	1,567,073	1.014	1,589,012.020
	TELECOM ITALIA-RNC	897,290	0.838	751,929.020
	ATLANTIA SPA	43,519	15.290	665,405.510
	TERNA SPA	229,678	3.137	720,499.880
	EXOR SPA	8,976	24.850	223,053.600
	PARMALAT SPA	248,777	2.037	506,758.740
	PRYSMIAN SPA	22,204	14.010	311,078.040
	BANCO POPOLARE SPA	102,590	3.180	326,236.200
	ENEL GREEN POWER SPA	67,602	1.564	105,729.520
	FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	9.640	1,147,921.560
	ARCELOR MITTAL (NL)	129,793	26.550	3,446,004.150
	TENARIS SA	79,782	18.070	1,441,660.740

	SES FDR	46,853	18.130	849,444.890	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	12,092	34.000	411,128.000	
	REED ELSEVIER NV	112,017	9.524	1,066,849.900	
	KONINKLIJKE DSM NV	26,176	43.770	1,145,723.520	
	SBM OFFSHORE NV	23,374	17.475	408,460.650	
	ING GROEP NV-CVA	587,141	7.216	4,236,809.450	
	RANDSTAD HOLDINGS	17,460	40.205	701,979.300	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	175,097	9.790	1,714,199.630	
	HEINEKEN NV	41,205	36.445	1,501,716.220	
	AKZO NOBEL	35,469	44.980	1,595,395.620	
	ASML HOLDING NV	66,823	27.345	1,827,274.930	
	AEGON NV	248,023	4.850	1,202,911.550	
	TNT NV	57,215	19.055	1,090,231.820	
	UNILEVER NV-CVA	246,923	23.025	5,685,402.070	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	149,945	23.800	3,568,691.000	
	WOLTERS KLUWER-CVA	53,577	16.465	882,145.300	
	QIAGEN N.V.	38,295	14.800	566,766.000	
	VOPAK (KON.)	11,504	35.825	412,130.800	
	KONINKLIJKE KPN NV	237,161	11.295	2,678,733.490	
	HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	32.695	613,685.150	
	FUGRO CERT	11,788	61.050	719,657.400	
	DELTA LLOYD NV	5,056	16.650	84,182.400	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	83,470	2.497	208,424.590	
	JERONIMO MARTINS	40,183	11.300	454,067.900	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	95,721	8.198	784,720.750	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,762	2.473	677,013.420	
	BRISA	33,394	5.012	167,370.720	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	310,491	0.523	162,386.790	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	42,296	14.140	598,065.440	
ユーロ小計	銘柄数 : 255	27,019,566		362,832,671.430	
	組入時価比率 : 13.74%			(38,910,175,684)	
	合計時価比率 : 14.06%				
デンマーククローネ	CARLSBERG AS-B	16,764	555.500	9,312,402.000	
	A P MOLLER A/S	175	51,000.000	8,925,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	114	49,730.000	5,669,220.000	
	DANSKE BANK A/S	76,248	139.700	10,651,845.600	
	NOVOZYMES-B SHS	8,172	801.000	6,545,772.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,770	653.000	42,294,810.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,950	178.200	5,337,090.000	
	COLOPLAST-B	1,211	816.000	988,176.000	
	DSV A/S	29,112	118.500	3,449,772.000	
	WILLIAM DEMANT	3,754	446.400	1,675,785.600	
	TRYG A/S	4,588	274.300	1,258,488.400	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 11	234,858		96,108,361.600	
	組入時価比率 : 0.49%			(1,383,960,407)	
	合計時価比率 : 0.50%				
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	48,523	198.300	9,622,110.900	
	ACERGY SA	43,150	150.000	6,472,500.000	
	DNB HOLDING ASA	154,436	80.500	12,432,098.000	
	NORSK HYDRO ASA	129,248	43.680	5,645,552.640	
	TELENOR ASA	124,650	91.700	11,430,405.000	
	ORKLA ASA	114,066	57.400	6,547,388.400	
	STATOIL ASA	172,086	138.700	23,868,328.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,265	338.700	9,573,355.500	
	AKER SOLUTIONS ASA	25,474	100.400	2,557,589.600	

	RENEWABLE ENERGY CORP AS	83,784	18.420	1,543,301.280	
ノルウェーク ローネ小計	銘柄数 : 10	923,682		89,692,629.520	
	組入時価比率 : 0.44%			(1,244,036,771)	
	合計時価比率 : 0.45%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	46,000	27.600	1,269,600.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	40,500	80.600	3,264,300.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	604,000	2.440	1,473,760.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	425,000	5.800	2,465,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	384,000	36.250	13,920,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	229,260	34.100	7,817,766.000	
	CLP HOLDINGS LTD	316,500	64.000	20,256,000.000	
	PCCW LTD	884,000	3.570	3,155,880.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	227,000	22.050	5,005,350.000	
	LI & FUNG LTD	360,200	47.350	17,055,470.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	215,000	129.800	27,907,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	161,800	182.200	29,479,960.000	
	MTR CORP	218,500	29.250	6,391,125.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	171,437	37.450	6,420,315.650	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	52.300	7,060,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	124,200	130.900	16,257,780.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	181,000	56.000	10,136,000.000	
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS (THE) WHARF HOLDINGS LTD	212,000	49.150	10,419,800.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	230,750	60.700	14,006,525.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	679,137	18.080	12,278,796.960	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	329,000	89.000	29,281,000.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	77,000	38.000	2,926,000.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	123,500	43.450	5,366,075.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	573,500	26.950	15,455,825.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	433,800	15.620	6,775,956.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	21.450	4,933,500.000	
	SINO LAND CO	300,000	15.680	4,704,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	215,000	136.300	29,304,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	120,500	129.400	15,592,700.000	
	WING HANG BANK LTD	36,000	113.100	4,071,600.000	
	WHEELOCK & CO LTD	169,000	32.450	5,484,050.000	
	AIA GROUP LTD	1,178,800	21.800	25,697,840.000	
	ASM PACIFIC TECH	38,300	97.750	3,743,825.000	
	WYNN MACAU LTD	250,400	20.350	5,095,640.000	
	SANDS CHINA LTD	393,600	18.600	7,320,960.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 35	10,313,684		381,794,399.610	
	組入時価比率 : 1.44%			(4,069,928,300)	
	合計時価比率 : 1.47%				
シンガポール・ ドル	GENTING SINGAPORE PLC	945,400	2.170	2,051,518.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,248,640	0.775	967,696.000	
	SINGAPORE TECH ENG	272,000	3.310	900,320.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	161,000	5.110	822,710.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.950	1,030,950.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	252,000	14.720	3,709,440.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	12.660	1,114,080.000	
	SEMBCORP MARINE	123,000	5.150	633,450.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	175,000	2.220	388,500.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	35.200	633,600.000	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	114,000	8.360	953,040.000	
	CAPITALAND LTD	390,000	3.820	1,489,800.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	169,500	6.390	1,083,105.000	
	KEPPEL CORP LTD	222,000	11.420	2,535,240.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	234,000	1.630	381,420.000	
	NEPTUNE ORIENT	127,750	2.270	289,992.500	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	491,763	2.250	1,106,466.750	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	373,200	10.160	3,791,712.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,273,867	3.050	3,885,294.350	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	82,400	15.280	1,259,072.000	
	KEPPEL LAND LTD	116,000	4.790	555,640.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	183,000	19.260	3,524,580.000	
	STARHUB LTD	86,000	2.570	221,020.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	162,800	3.210	522,588.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	296,000	5.690	1,684,240.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	278,000	1.940	539,320.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	215,000	1.890	406,350.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	2.140	541,420.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 28	8,612,320		37,022,564.600	
	組入時価比率 : 0.83%			(2,363,520,524)	
	合計時価比率 : 0.85%				
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	185,882	18.000	3,345,876.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	216,948	17.800	3,861,674.400	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	282,651	10.450	2,953,702.950	
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	37,494	18.300	686,140.200	
	DELEK GROUP LTD	639	869.500	555,610.500	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	97,736	7.890	771,137.040	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	73,734	61.750	4,553,074.500	
	NICE SYSTEMS LTD	7,624	120.300	917,167.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	144,645	193.100	27,930,949.500	
	ISRAEL CORP LTD/THE	366	4,439.000	1,624,674.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	32,132	37.570	1,207,199.240	
イスラエル・シュケル小計	銘柄数 : 11	1,079,851		48,407,205.530	
	組入時価比率 : 0.40%			(1,123,531,240)	
	合計時価比率 : 0.41%				
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	389,613	22.960	8,945,514.480	
	AMCOR LTD	178,713	6.660	1,190,228.580	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	454,012	22.070	10,020,044.840	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	203,778	6.550	1,334,745.900	
	TELSTRA CORP LTD	683,879	2.780	1,901,183.620	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	48,988	9.690	474,693.720	
	AMP LTD	340,510	5.210	1,774,057.100	
	ASX LTD	22,414	37.600	842,766.400	
	BHP BILLITON LTD	513,407	44.450	22,820,941.150	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	21,232	14.860	315,507.520	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	62,129	2.900	180,174.100	
	COMPUTERSHARE LT	80,897	10.710	866,406.870	
	CSL LIMITED	88,574	36.070	3,194,864.180	

	TRANSURBAN GROUP	192,723	5.250	1,011,795.750	
	COCA-COLA AMATIL LTD	82,960	11.450	949,892.000	
	COCHLEAR LTD	10,177	78.810	802,049.370	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,591	16.380	2,171,840.580	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	235,057	50.050	11,764,602.850	
	BORAL LIMITED	107,619	4.810	517,647.390	
	RIO TINTO LIMITED	66,770	84.360	5,632,717.200	
	CSR LIMITED	224,708	1.755	394,362.540	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	280,267	3.890	1,090,238.630	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	37,106	8.490	315,029.940	
	ONESTEEL LIMITED	224,361	2.580	578,851.380	
	FOSTER'S GROUP LTD	294,041	5.620	1,652,510.420	
	MACARTHUR COAL LTD	17,904	13.670	244,747.680	
	OZ MINERALS LTD	555,136	1.700	943,731.200	
	ORICA LTD	53,835	25.300	1,362,025.500	
	FAIRFAX MEDIA LTD	362,918	1.395	506,270.610	
	LEIGHTON HLDGS LTD	19,582	31.400	614,874.800	
	BLUESCOPE STEEL LTD	255,174	2.200	561,382.800	
	MAP GROUP	76,167	2.970	226,215.990	
	MACQUARIE GROUP LTD	56,070	37.920	2,126,174.400	
	WORLEYPARSONS LTD	27,468	27.630	758,940.840	
	SUNCORP GROUP LTD	211,446	8.500	1,797,291.000	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	168,519	6.350	1,070,095.650	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	323,429	23.790	7,694,375.910	
	NEWCREST MINING LTD	119,349	38.840	4,635,515.160	
	PALADIN ENERGY LTD	117,788	5.030	592,473.640	
	INCITEC PIVOT LTD	236,186	4.230	999,066.780	
	TOLL HOLDINGS LTD	119,945	5.720	686,085.400	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,039	2.560	458,339.840	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	162,588	18.000	2,926,584.000	
	SANTOS LTD	138,775	13.170	1,827,666.750	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	27,467	21.390	587,519.130	
	SONIC HEALTHCARE	60,146	11.550	694,686.300	
	TABCORP HOLDINGS LTD	113,618	7.140	811,232.520	
	WESFARMERS LTD	155,931	31.200	4,865,047.200	
	ALUMINA LIMITED	397,286	2.560	1,017,052.160	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	98,979	42.990	4,255,107.210	
	WOOLWORTHS LTD	185,901	26.360	4,900,350.360	
	METCASH LTD	140,050	4.110	575,605.500	
	TATTS GROUP LTD	213,596	2.570	548,941.720	
	GOODMAN FIELDER LTD	261,734	1.315	344,180.210	
	AGL ENERGY LTD	78,763	15.220	1,198,772.860	
	BRAMBLES LTD	213,914	7.290	1,559,433.060	
	ASCIANO LTD	405,076	1.585	642,045.460	
	WESFARMERS LTD-PPS	23,287	31.500	733,540.500	
	CROWN LTD	74,398	8.220	611,551.560	
	QR NATIONAL LTD	127,448	2.770	353,030.960	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	70,178	6.610	463,876.580	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 61	10,825,616		134,936,497.750	
	組入時価比率 : 3.92%			(11,091,780,115)	
	合計時価比率 : 4.01%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	130,906	7.780	1,018,448.680	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	359,253	2.180	783,171.540	

ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	490,159		1,801,620.220	
	組入時価比率 : 0.04%			(113,718,268)	
	合計時価比率 : 0.04%				
合計				272,428,796,276	
				(272,428,796,276)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	294,800.00	577,808.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	177,906.00	384,276.960	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	472,706.00	962,084.960	
	組入時価比率 : 0.02%		(61,419,504)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	MIRVAC GROUP	541,250.00	676,562.500	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	596,324.960	
	GPT GROUP	292,236.00	850,406.760	
	LEND LEASE GROUP	89,837.00	769,004.720	
	STOCKLAND	357,887.00	1,299,129.810	
	WESTFIELD GROUP	328,870.00	3,186,750.300	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	707,229.630	
	GOODMAN GROUP	994,208.00	621,380.000	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	456,093.00	1,185,841.800	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 9	4,272,325.00	9,892,630.480	
	組入時価比率 : 0.29%		(813,174,225)	
	合計時価比率 : 0.29%			
投資信託受益証券計			874,593,729	
			(874,593,729)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,290.00	1,972,197.200	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	106,230.00	1,882,395.600	
	AMB PROPERTY CORP	24,037.00	785,769.530	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,408.00	1,355,077.680	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	488,659.940	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,501.00	2,337,140.260	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	782,763.900	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,528.00	697,454.720	
	HCP INC	49,367.00	1,787,085.400	
	HEALTH CARE REIT INC	22,119.00	1,047,334.650	
	KIMCO REALTY	66,054.00	1,177,742.820	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,897.00	476,406.060	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	928,228.280	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	96,238.00	1,763,080.160	
	PLUM CREEK TIMBER CO	23,894.00	945,007.700	
	REGENCY	15,096.00	626,936.880	
	PROLOGIS	72,823.00	1,047,922.970	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,891.00	4,378,668.140	

	PUBLIC STORAGE	21,750.00	2,199,360.000	
	VENTAS INC	23,366.00	1,215,499.320	
	VORNADO REALTY TRUST	26,982.00	2,250,568.620	
米ドル小計	銘柄数 : 21	804,551.00	30,145,299.830	
	組入時価比率 : 0.88%		(2,499,045,356)	
	合計時価比率 : 0.90%			
	BRITISH LAND CO PLC	135,237.00	710,670.430	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	434,981.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	117,753.00	804,841.750	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	83,396.00	327,329.300	
	SEGRO PLC	122,102.00	349,578.020	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	559,906.00	2,627,401.300	
	組入時価比率 : 0.12%		(338,908,494)	
	合計時価比率 : 0.12%			
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	41,673.00	721,776.360	
カナダドル小計	銘柄数 : 1	41,673.00	721,776.360	
	組入時価比率 : 0.02%		(60,181,713)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	GECINA SA	3,258.00	270,967.860	
	ICADE EMGP	4,185.00	311,782.500	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	15,182.00	2,120,166.300	
	KLEPIERRE	15,724.00	413,934.300	
	FONCIERE DES REGIONS	4,045.00	290,633.250	
	CORIO NV	9,364.00	430,369.440	
ユーロ小計	銘柄数 : 6	51,758.00	3,837,853.650	
	組入時価比率 : 0.15%		(411,571,425)	
	合計時価比率 : 0.15%			
	LINK REIT/THE	371,500.00	9,268,925.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	371,500.00	9,268,925.000	
	組入時価比率 : 0.03%		(98,806,741)	
	合計時価比率 : 0.04%			
投資証券計			3,408,513,729	
			(3,408,513,729)	
合計			4,283,107,458	
			(4,283,107,458)	

(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 571銘柄	53.25%	54.51%
米ドル	投資証券 21銘柄	0.88%	0.90%
英ポンド	株式 102銘柄	10.53%	10.78%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.12%	0.12%
カナダドル	株式 89銘柄	5.71%	5.85%
カナダドル	投資証券 1銘柄	0.02%	0.02%
スイスフラン	株式 35銘柄	3.84%	3.93%
スウェーデンクローネ	株式 32銘柄	1.56%	1.60%
ユーロ	株式 255銘柄	13.74%	14.06%

ユーロ	投資証券	6銘柄	0.15%	0.15%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	0.49%	0.50%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.44%	0.45%
香港ドル	株式	35銘柄	1.44%	1.47%
香港ドル	投資証券	1銘柄	0.03%	0.04%
シンガポール・ドル	株式	28銘柄	0.83%	0.85%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	0.02%	0.02%
イスラエル・シュケル	株式	11銘柄	0.40%	0.41%
オーストラリアドル	株式	61銘柄	3.92%	4.01%
オーストラリアドル	投資信託受益証券	9銘柄	0.29%	0.29%
ニュージーランドドル	株式	2銘柄	0.04%	0.04%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,238,319,284	1,397,911,926
国債証券		324,705,205,200	322,573,919,600
地方債証券		27,958,147,835	28,262,974,448
特殊債券		41,014,304,995	40,170,595,634
社債券		34,659,908,870	33,525,809,740
未収利息		1,195,791,165	1,248,628,767
前払費用		127,553,687	61,692,067
流動資産合計		431,899,231,036	427,241,532,182
資産合計		431,899,231,036	427,241,532,182
負債の部			
流動負債			
未払解約金		85,005,000	175,433,000
流動負債合計		85,005,000	175,433,000
負債合計		85,005,000	175,433,000
純資産の部			
元本等			
元本		395,927,275,552	382,815,805,870
剰余金			
剰余金又は欠損金()		35,886,950,484	44,250,293,312
元本等合計		431,814,226,036	427,066,099,182
純資産合計		431,814,226,036	427,066,099,182
負債純資産合計		431,899,231,036	427,241,532,182

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成21年2月17日から平成22年2月15日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。

（追加情報）

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	230,660,804,354円	395,927,275,552円
同期中追加設定元本額	215,610,719,211円	64,938,202,760円
同期中解約元本額	50,344,248,013円	78,049,672,442円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	1,824,116,896円	3,206,343,130円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	6,232,955,987円	7,362,564,589円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,318,497,606円	2,527,472,340円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,790,241,056円	4,021,199,991円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,567,218,354円	1,630,226,006円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,156,985,205円	1,160,677,732円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,150,240,290円	1,144,755,923円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	143,168,911円	141,655,342円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	232,580,739円	223,569,498円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,773,116,897円	2,022,475,991円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	1,113,051円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	12,116,969,942円	17,824,993,618円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	111,008,492円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	965,093,932円	880,631,582円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	15,332,889,720円	12,866,521,066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)	828,418,092円	731,575,501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)	554,359,759円	495,928,416円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,325,437,707円	1,206,613,436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)	621,575,580円	573,513,324円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	436,227,505円	402,399,684円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	33,933,459,295円	30,348,959,090円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,117,500,057円	10,094,541,385円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	15,912,085,048円	13,990,484,377円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	6,114,571,382円	5,327,235,731円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,515,878,790円	8,316,169,080円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	2,060,661,767円	1,890,509,761円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	7,318,982,638円	6,625,226,349円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	9,139,064,178円	8,112,251,131円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	15,631,368,941円	14,562,601,859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)	783,958,661円	711,652,567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)	1,126,530,795円	595,564,015円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	15,678,200,004円	14,947,846,567円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	7,986,849,859円	7,370,232,806円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,611,800,193円	1,543,769,952円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	119,163,807,979円	111,216,690,515円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,154,090,366円	2,820,350,588円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	11,074,816,824円	10,098,797,743円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	36,398,250,474円	33,627,817,936円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	2,431,050,511円	2,329,762,532円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	248,342円	241,057円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	153,067円	150,296円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	32,877,012,542円	36,630,963,943円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	79,834,602円	689,313,902円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	121,329,487円	189,363,623円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	285,129,457円	2,199,536,122円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	325,837円	316,732円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	233,397円	230,618円
(合計)	395,927,275,552円	382,815,805,870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	395,927,275,552口	382,815,805,870口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	324,705,205,200	115,989,800
地方債証券	27,958,147,835	293,301,622
特殊債券	41,014,304,995	342,547,955
社債券	34,659,908,870	508,510,440
合計	428,337,566,900	1,028,370,217

	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,663,133,300
地方債証券	102,062,963
特殊債券	49,332,711
社債券	862,770
合計	2,815,391,744

(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22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.0906円	1.1156円
(1万口当たり純資産額)	(10,906円)	(11,156円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	2 8 9 回 利付国庫債券（2年）	3,200,000,000	3,202,080,000	
	2 9 1 回 利付国庫債券（2年）	2,500,000,000	2,502,025,000	
	2 9 2 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,580,000	
	2 9 4 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,201,804,000	
	2 9 5 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,002,340,000	
	2 9 6 回 利付国庫債券（2年）	2,500,000,000	2,497,700,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	2,997,090,000	
	2 9 8 回 利付国庫債券（2年）	1,000,000,000	998,900,000	
	6 3 回 利付国庫債券（5年）	7,500,000,000	7,593,000,000	
	6 4 回 利付国庫債券（5年）	7,200,000,000	7,339,176,000	
	6 6 回 利付国庫債券（5年）	5,700,000,000	5,789,889,000	
	6 8 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,036,000,000	
	6 9 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,853,770,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	4,966,983,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	5,054,644,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	5,300,000,000	5,425,080,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	4,000,000,000	4,078,000,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	6,200,000,000	6,305,524,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	4,400,000,000	4,491,124,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	5,200,000,000	5,270,928,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,029,050,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5年）	5,500,000,000	5,529,370,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5年）	5,500,000,000	5,501,155,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,698,436,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	6,000,000,000	5,966,880,000	
	2 回 利付国庫債券（40年）	600,000,000	609,480,000	
	3 回 利付国庫債券（40年）	700,000,000	711,221,000	
	2 3 7 回 利付国庫債券（10年）	1,540,000,000	1,564,624,600	
	2 4 0 回 利付国庫債券（10年）	300,000,000	304,944,000	
	2 4 3 回 利付国庫債券（10年）	1,400,000,000	1,422,190,000	
	2 4 6 回 利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,923,218,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	709,569,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,074,935,000	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,785,320,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,585,150,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,032,780,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,800,000,000	2,924,572,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,825,766,000	
	2 6 6 回 利付国庫債券（10年）	3,700,000,000	3,851,404,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券（10年）	2,000,000,000	2,076,520,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券（10年）	1,900,000,000	1,975,278,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券（10年）	2,800,000,000	2,928,016,000	

274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,523,384,000	
277回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,644,800,000	
280回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	3,009,608,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,300,973,000	
284回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,303,825,000	
285回	利付国庫債券(10年)	5,600,000,000	5,968,704,000	
286回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,825,350,000	
288回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,581,779,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,889,218,000	
290回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,378,458,000	
293回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,348,750,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,184,440,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,355,442,000	
299回	利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,931,184,000	
301回	利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,269,330,000	
303回	利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,227,633,000	
305回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,609,945,000	
306回	利付国庫債券(10年)	6,200,000,000	6,362,998,000	
308回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,335,305,000	
309回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,492,510,000	
310回	利付国庫債券(10年)	7,000,000,000	6,899,480,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	113,742,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	107,308,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	211,166,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	230,990,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	207,434,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	213,656,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	315,348,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	480,405,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	376,464,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	303,732,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	298,125,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	532,935,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	216,644,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	433,532,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	212,946,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	857,293,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	209,330,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	325,593,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	523,645,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	510,631,500	
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	434,812,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	652,002,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	628,050,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,280,268,000	
27回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,305,516,000	
28回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,414,439,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,601,190,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,569,780,000	
31回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,050,480,000	
32回	利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,302,498,000	

	33回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,078,891,000	
	37回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	693,690,000	
	39回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	450,096,000	
	40回 利付国庫債券(20年)	720,000,000	796,140,000	
	42回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	902,904,000	
	43回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	992,113,200	
	45回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,001,709,000	
	46回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	548,185,000	
	47回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,041,000,500	
	48回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,430,000	
	50回 利付国庫債券(20年)	780,000,000	832,189,800	
	51回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	645,702,000	
	52回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	813,922,500	
	54回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	766,535,000	
	55回 利付国庫債券(20年)	810,000,000	869,591,700	
	57回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	881,750,500	
	58回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	954,279,000	
	60回 利付国庫債券(20年)	990,000,000	995,078,700	
	61回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	957,380,000	
	62回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	931,050,000	
	64回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,053,840,000	
	65回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,367,418,000	
	67回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,363,960,000	
	70回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,605,744,500	
	72回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,550,514,000	
	73回 利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,465,018,300	
	75回 利付国庫債券(20年)	1,540,000,000	1,638,452,200	
	78回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,606,389,000	
	81回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,779,781,000	
	83回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,902,726,000	
	85回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,845,585,000	
	88回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,051,886,000	
	90回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,021,372,000	
	92回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,780,767,000	
	93回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,030,870,000	
	94回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	835,824,000	
	95回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,140,360,000	
	97回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,897,236,000	
	99回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,867,644,000	
	100回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,100,820,000	
	102回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,048,523,000	
	105回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,167,053,000	
	107回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,061,760,000	
	109回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,396,760,000	
	111回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,609,500,000	
	113回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,464,464,000	
	114回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,564,250,000	
	116回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,702,024,000	
	118回 利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,408,862,000	
	119回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,461,075,000	
	121回 利付国庫債券(20年)	3,100,000,000	3,069,217,000	

国債証券計			322,573,919,600	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	152,559,880	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	210,092,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	168,990,370	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	208,040,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,894,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	207,710,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	209,044,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	207,564,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,655,480	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	207,482,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,838,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	105,319,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	516,946,300	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,968,254	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	107,366,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,896,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	214,542,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	160,096,500	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,903,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	214,138,980	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	309,612,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	313,053,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	203,986,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	497,375,000	
	1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	206,641,820	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	100,000,000	103,044,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	203,865,480	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	107,650,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	321,471,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	206,546,000	
	1 1 8 回 神奈川県公募公債	145,090,000	147,431,752	
	1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,388,000	
	1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	185,608,032	
	1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	105,008,000	
	1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,068,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	162,224,634	
	1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	210,466,000	
	1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,837,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,492,000	
	2 5 1 回 大阪府公募公債	110,100,000	111,706,359	
	2 5 2 回 大阪府公募公債	100,000,000	100,984,000	
	2 6 1 回 大阪府公募公債	129,000,000	133,160,250	
	2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	206,448,000	
	2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	104,375,000	
	2 8 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	208,816,000	
	2 8 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	212,036,000	
	2 9 3 回 大阪府公募公債	200,000,000	215,526,000	
	3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	106,376,000	
	3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	251,378,400	

336回 大阪府公募公債	200,000,000	203,384,000	
1回 大阪府公募公債 7年	500,000,000	518,585,000	
15年度3回 京都府公募公債	219,300,000	226,962,342	
16年度2回 京都府公募公債	100,000,000	104,051,000	
18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	106,161,000	
14年度5回 兵庫県公募公債	100,000,000	101,056,000	
15年度1回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,851,000	
16年度4回 兵庫県公募公債	251,970,000	261,857,302	
16年度8回 兵庫県公募公債	111,500,000	117,279,045	
17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	207,404,000	
17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	321,104,160	
17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,844,300	
18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	127,351,200	
14年度3回 静岡県公募公債	147,610,000	150,414,590	
15年度1回 静岡県公募公債	268,500,000	269,976,750	
15年度3回 静岡県公募公債	116,130,000	119,685,900	
18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	138,837,974	
15年度1回 愛知県公募公債	303,600,000	312,896,232	
16年度2回 愛知県公募公債	200,000,000	208,964,000	
18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	172,527,684	
20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	104,818,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	199,432,000	
16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	208,656,000	
14年度2回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,651,000	
15年度3回 埼玉県公募公債	100,000,000	103,517,000	
17年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,236,000	
18年度1回 埼玉県公募公債	200,000,000	213,016,000	
21年度4回 埼玉県公募公債	440,000,000	453,750,000	
16年度3回 福岡県公募公債	131,040,000	135,627,710	
17年度1回 福岡県公募公債	100,000,000	104,185,000	
17年度5回 福岡県公募公債	100,000,000	104,864,000	
18年度1回 福岡県公募公債	104,000,000	112,622,640	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	207,548,000	
15年度4回 千葉県公募公債	100,000,000	103,246,000	
16年度3回 千葉県公募公債	100,000,000	105,446,000	
16年度8回 千葉県公募公債	200,000,000	207,006,000	
17年度2回 千葉県公募公債	200,000,000	207,332,000	
19年度5回 千葉県公募公債	300,000,000	320,994,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	205,126,000	
18年度2回 新潟県公募公債	169,000,000	180,730,290	
2回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,787,000	
3回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,548,000	
8回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	414,800,000	
9回 共同発行市場公募地方債	210,000,000	217,312,200	
11回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,042,000	
12回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,382,300	
13回 共同発行市場公募地方債	221,000,000	229,327,280	
18回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,419,000	
19回 共同発行市場公募地方債	130,000,000	135,814,900	
20回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,153,000	
21回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,430,000	

	23回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,503,000	
	25回 共同発行市場公募地方債	304,000,000	316,156,960	
	28回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,414,000	
	29回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,412,000	
	31回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,500,000	
	32回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,542,000	
	33回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,936,000	
	35回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,774,000	
	36回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,440,000	
	37回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,751,500	
	38回 共同発行市場公募地方債	170,000,000	182,899,600	
	39回 共同発行市場公募地方債	146,000,000	156,349,940	
	40回 共同発行市場公募地方債	150,000,000	162,358,500	
	47回 共同発行市場公募地方債	161,600,000	172,520,928	
	55回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,996,000	
	57回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,266,000	
	61回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,286,000	
	65回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,028,000	
	75回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	523,295,000	
	80回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	724,360,000	
	14年度3回 大阪市公募公債	146,500,000	148,663,805	
	14年度6回 大阪市公募公債	116,800,000	118,786,768	
	17年度3回 大阪市公募公債	100,000,000	103,188,000	
	17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	207,438,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	209,382,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,833,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	107,017,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	161,416,500	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	144,742,950	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,791,000	
	12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	207,400,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	374,749,990	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	104,065,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	108,989,856	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	108,245,790	
	14年度3回 横浜市公募公債	153,500,000	155,782,545	
	14年度5回 横浜市公募公債	281,100,000	284,433,846	
	15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	206,028,000	
	16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	208,006,000	
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	310,539,000	
	14年度5回 札幌市公募公債	106,000,000	107,195,680	
	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,987,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	104,328,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,761,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	102,736,000	
	14年度2回 北九州市公募公債	100,000,000	101,428,000	
	14年度1回 福岡市公募公債	200,000,000	203,692,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	106,508,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,667,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,751,000	
地方債証券計			28,262,974,448	

特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	107,256,060	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,492,450	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,901,000	
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,084,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,291,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,776,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,538,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	210,596,000	
	12回 日本道路・機構承継債	100,000,000	102,006,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	208,506,000	
	314回 政保道路債	200,000,000	203,092,000	
	315回 政保道路債	300,000,000	303,240,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	134,218,920	
	322回 政保道路債	106,000,000	109,708,940	
	323回 政保道路債	200,000,000	207,112,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	206,678,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	207,880,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	104,342,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	313,806,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	246,311,730	
	338回 政保道路債	264,000,000	275,898,480	
	339回 政保道路債	301,000,000	313,467,420	
	342回 政保道路債	100,000,000	100,855,000	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	430,612,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	319,023,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	420,112,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	733,705,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,075,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	220,595,320	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	114,044,760	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,215,000	
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	324,652,580	
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,669,720	
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,837,000	
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	400,800,000	
	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	318,996,000	
	29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,476,000	
	30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,068,000	
	33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	315,886,230	
	36回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	370,116,480	
	40回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	356,043,460	
	47回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,644,000	
	56回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,884,000	
	66回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	168,951,420	
	67回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	420,997,870	
	71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	620,154,000	
	82回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,776,000	
	89回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	305,679,000	
	16回 日本道路・機構承継債	430,000,000	436,355,400	
	26回 日本道路・機構承継債	200,000,000	207,648,000	

	4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	312,417,000	
	5 回 公営企業債券	100,000,000	101,112,000	
	8 1 8 回 政保公営企業債券	107,000,000	108,909,950	
	8 2 1 回 政保公営企業債券	405,000,000	411,804,000	
	8 2 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	202,438,000	
	8 2 4 回 政保公営企業債券	300,000,000	303,777,000	
	8 2 8 回 政保公営企業債券	210,000,000	211,306,200	
	8 2 9 回 政保公営企業債券	400,000,000	408,568,000	
	8 3 2 回 政保公営企業債券	298,000,000	307,342,300	
	8 3 4 回 政保公営企業債券	207,000,000	214,420,950	
	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	447,046,560	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	623,214,000	
	8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	270,228,400	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	104,180,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,998,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,252,000	
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	272,705,850	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	311,364,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,891,120	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	317,160,160	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,776,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	217,378,980	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	254,888,720	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	215,528,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	213,624,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,915,470	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	109,020,660	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	512,486,500	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	675,855,180	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,692,560	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,465,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,683,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,065,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,798,000	
	4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,397,000	
	6 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	201,658,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	312,252,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,076,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	311,079,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,941,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	215,448,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	322,125,000	
	1 9 1 回 政保首都高速道路債券	113,000,000	118,778,820	
	1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,910,000	
	1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	111,179,420	
	5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	104,405,000	
	1 7 6 回 政保中小企業債券	100,000,000	103,568,000	
	1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	149,223,540	
	1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	108,049,760	
	2 6 回 中小企業債券	400,000,000	416,208,000	
	1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	209,054,000	

	8回 国際協力銀行債券	300,000,000	302,346,000	
	12回 国際協力銀行債券	200,000,000	207,680,000	
	2回 都市再生債券	100,000,000	105,738,000	
	19回 都市再生機構債券	200,000,000	214,736,000	
	23回 都市再生機構債券	200,000,000	204,994,000	
	2回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	104,289,000	
	4回 政保中部国際空港債券	300,000,000	304,671,000	
	6回 政保中部国際空港債券	100,000,000	103,456,000	
	140回 政保預金保険機構債券	300,000,000	302,733,000	
	143回 政保預金保険機構債券	280,000,000	283,130,400	
	11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,272,000	
	37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,385,000	
	6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	163,881,000	171,630,932	
	8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	113,030,000	117,586,239	
	9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	170,595,000	177,833,345	
	2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	188,064,000	196,763,840	
	13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	78,066,000	81,716,366	
	14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	400,860,000	413,402,909	
	4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	110,091,000	113,207,676	
	43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,799,000	74,071,329	
	44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	281,820,000	295,124,722	
	51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	222,156,000	231,204,413	
	1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	378,645,000	394,430,710	
	29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	456,455,000	468,245,232	
	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	771,640,000	783,554,121	
	14回 政保国民生活債券	132,000,000	137,468,760	
	683号 利附商工債	100,000,000	101,433,000	
	685号 利附商工債	200,000,000	203,804,000	
	691号 利附商工債	200,000,000	204,486,000	
	692号 利附商工債	200,000,000	203,780,000	
	704号 利附商工債	200,000,000	206,052,000	
	706号 利付商工債	300,000,000	309,360,000	
	723号 利付商工債	300,000,000	299,874,000	
	684号 利附農林債	250,000,000	253,762,500	
	688号 利附農林債	200,000,000	203,692,000	
	694号 利附農林債	400,000,000	407,320,000	
	695号 利附農林債	200,000,000	203,770,000	
	698号 利附農林債	300,000,000	308,727,000	
	701号 利附農林債	200,000,000	205,984,000	
	709号 利附農林債	400,000,000	409,812,000	
	713号 利附農林債	300,000,000	303,633,000	
	717号 利附農林債	300,000,000	302,910,000	
	208回 利附信金中金債	150,000,000	151,936,500	
	210回 利附信金中金債	100,000,000	101,519,000	
	215回 利附信金中金債	200,000,000	204,416,000	
	217回 利附信金中金債	200,000,000	204,250,000	
	222回 利附信金中金債	200,000,000	205,158,000	
	226回 利附信金中金債	300,000,000	308,217,000	
	229回 利附信金中金債	400,000,000	412,296,000	
	233回 利附信金中金債	300,000,000	309,441,000	
	236回 利附信金中金債	300,000,000	305,124,000	

	241回 利附信金中金債	300,000,000	302,739,000	
	1回 政保東日本高速道路債	101,000,000	106,449,960	
	2回 政保東日本高速道路債	101,000,000	105,994,450	
	4回 政保中日本高速道路債	170,000,000	179,469,000	
	8回 政保中日本高速道路債	170,000,000	183,355,200	
	21回 政保中日本高速道路債	300,000,000	317,958,000	
	5回 中日本高速道路債	200,000,000	212,208,000	
	1回 政保西日本高速道路債	201,000,000	211,845,960	
	5回 政保西日本高速道路債	259,000,000	276,894,310	
	6回 政保西日本高速道路債	117,000,000	125,103,420	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	315,411,000	
特殊債券計			40,170,595,634	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,689,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	100,965,000	
	14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,272,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	103,315,000	
	15回 シティグループ円貨社債	100,000,000	100,284,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	204,954,000	
	3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	101,199,000	
	7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	100,000,000	101,234,000	
	2回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,424,000	
	1回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,676,000	
	5回 日本たばこ産業社債	100,000,000	102,453,000	
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	103,321,000	
	33回 住友化学社債	100,000,000	101,732,000	
	25回 三菱化学社債	100,000,000	102,941,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	105,228,000	
	2回 花王社債	100,000,000	103,757,000	
	19回 新日本石油社債	100,000,000	101,878,000	
	8回 旭硝子社債	100,000,000	100,723,000	
	48回 新日本製鐵社債	100,000,000	101,802,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,938,000	
	11回 豊田自動織機社債	100,000,000	101,581,000	
	12回 日立製作所社債	100,000,000	100,716,000	
	7回 パナソニック社債	200,000,000	206,138,000	
	24回 シャープ社債	100,000,000	101,376,000	
	16回 ソニー社債	100,000,000	101,386,000	
	17回 ソニー社債	100,000,000	104,214,000	
	19回 ソニー社債	100,000,000	102,525,000	
	4回 デンソー社債	100,000,000	101,336,000	
	15回 三菱重工業社債	100,000,000	101,393,000	
	19回 三菱重工業社債	100,000,000	107,057,000	
	6回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,412,000	
	7回 トヨタ自動車社債	300,000,000	308,148,000	
	45回 三井物産社債	100,000,000	100,850,000	
	29回 住友商事社債	100,000,000	102,218,000	
	16回 三菱商事社債	100,000,000	107,726,000	
	14回 クレディセゾン社債	100,000,000	101,129,000	
	1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	209,550,000	

6回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,108,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,597,000	
9回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,062,000	
11回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,272,000	
13回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,240,000	
14回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	103,302,000	
15回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	205,762,000	
18回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,696,000	
92回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	204,320,000	
100回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	205,286,000	
106回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	305,196,000	
112回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,506,000	
114回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,476,000	
3回2号	三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	200,000,000	204,252,000	
3回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	205,834,000	
6回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	104,434,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	104,400,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	100,000,000	108,266,000	
5回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,210,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,181,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	107,357,000	
41回	三井住友銀行社債	100,000,000	101,896,000	
45回	三井住友銀行社債	200,000,000	205,248,000	
47回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,492,000	
6回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,206,000	
7回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,632,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	105,180,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	104,922,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,906,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	104,099,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	107,490,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,876,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,194,000	
14回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,244,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	107,045,000	
23回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,863,000	
26回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	101,525,000	
115回	オリックス社債	100,000,000	101,235,000	
118回	オリックス社債	100,000,000	103,755,000	
6回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,536,000	
7回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,014,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	106,311,000	
9回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,894,000	
13回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,955,000	
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,735,000	
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	204,650,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	104,849,000	
53回	三菱地所社債	100,000,000	101,678,000	
60回	三菱地所社債	100,000,000	101,724,000	
66回	三菱地所社債	100,000,000	101,034,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	108,345,000	

	18回 京王電鉄社債	100,000,000	103,583,000	
	2回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	235,924,000	
	7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,026,000	
	19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,827,000	
	25回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	303,291,000	
	31回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,806,000	
	41回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,781,000	
	3回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,005,000	
	10回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,523,000	
	1回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,201,000	
	2回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	234,790,000	
	6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,151,000	
	10回 東海旅客鉄道社債	190,000,000	197,482,200	
	19回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	203,398,000	
	23回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,619,000	
	48回 日本電信電話社債	400,000,000	417,060,000	
	50回 日本電信電話社債	100,000,000	104,873,000	
	51回 日本電信電話社債	200,000,000	215,326,000	
	2回 KDDI社債	100,000,000	101,362,000	
	5回 KDDI社債	100,000,000	114,314,000	
	16回 NTTドコモ社債	200,000,000	205,154,000	
	18回 NTTドコモ社債	200,000,000	203,014,000	
	441回 東京電力社債	200,000,000	229,410,000	
	455回 東京電力社債	200,000,000	215,982,000	
	457回 東京電力社債	100,000,000	107,791,000	
	473回 東京電力社債	300,000,000	308,181,000	
	501回 東京電力社債	200,000,000	202,678,000	
	502回 東京電力社債	200,000,000	202,874,000	
	505回 東京電力社債	100,000,000	101,090,000	
	507回 東京電力社債	300,000,000	309,426,000	
	510回 東京電力社債	200,000,000	206,248,000	
	511回 東京電力社債	100,000,000	104,081,000	
	514回 東京電力社債	300,000,000	312,606,000	
	515回 東京電力社債	200,000,000	207,728,000	
	516回 東京電力社債	100,000,000	103,917,000	
	517回 東京電力社債	100,000,000	103,701,000	
	518回 東京電力社債	300,000,000	311,424,000	
	519回 東京電力社債	372,000,000	390,856,680	
	522回 東京電力社債	300,000,000	323,526,000	
	527回 東京電力社債	500,000,000	518,520,000	
	535回 東京電力社債	500,000,000	531,015,000	
	536回 東京電力社債	200,000,000	210,934,000	
	541回 東京電力社債	500,000,000	509,070,000	
	542回 東京電力社債	500,000,000	524,160,000	
	557回 東京電力社債	500,000,000	509,115,000	
	407回 中部電力社債	100,000,000	112,873,000	
	409回 中部電力社債	300,000,000	352,509,000	
	460回 中部電力社債	200,000,000	203,206,000	
	463回 中部電力社債	200,000,000	202,384,000	
	467回 中部電力社債	100,000,000	104,213,000	
	468回 中部電力社債	100,000,000	103,861,000	

	471回 中部電力社債	300,000,000	310,587,000	
	476回 中部電力社債	100,000,000	108,429,000	
	478回 中部電力社債	100,000,000	106,932,000	
	480回 中部電力社債	200,000,000	212,898,000	
	484回 中部電力社債	200,000,000	207,148,000	
	487回 中部電力社債	140,000,000	143,458,000	
	496回 中部電力社債	500,000,000	498,965,000	
	410回 関西電力社債	300,000,000	322,206,000	
	427回 関西電力社債	100,000,000	102,896,000	
	431回 関西電力社債	100,000,000	101,654,000	
	432回 関西電力社債	300,000,000	305,226,000	
	433回 関西電力社債	200,000,000	206,468,000	
	441回 関西電力社債	200,000,000	208,152,000	
	446回 関西電力社債	200,000,000	212,280,000	
	298回 中国電力社債	200,000,000	230,948,000	
	310回 中国電力社債	200,000,000	230,920,000	
	337回 中国電力社債	219,000,000	222,928,860	
	341回 中国電力社債	100,000,000	103,916,000	
	350回 中国電力社債	200,000,000	208,450,000	
	245回 北陸電力社債	200,000,000	228,838,000	
	260回 北陸電力社債	100,000,000	109,682,000	
	281回 北陸電力社債	200,000,000	214,838,000	
	289回 北陸電力社債	300,000,000	311,064,000	
	368回 東北電力社債	300,000,000	343,068,000	
	375回 東北電力社債	100,000,000	113,984,000	
	380回 東北電力社債	300,000,000	349,377,000	
	411回 東北電力社債	200,000,000	203,412,000	
	420回 東北電力社債	100,000,000	103,072,000	
	427回 東北電力社債	200,000,000	208,362,000	
	432回 東北電力社債	500,000,000	539,165,000	
	249回 四国電力社債	200,000,000	203,340,000	
	257回 四国電力社債	200,000,000	207,398,000	
	369回 九州電力社債	300,000,000	304,866,000	
	374回 九州電力社債	300,000,000	309,447,000	
	382回 九州電力社債	100,000,000	103,902,000	
	383回 九州電力社債	100,000,000	104,076,000	
	387回 九州電力社債	200,000,000	211,362,000	
	257回 北海道電力社債	200,000,000	233,764,000	
	282回 北海道電力社債	200,000,000	206,400,000	
	284回 北海道電力社債	500,000,000	522,900,000	
	286回 北海道電力社債	100,000,000	104,057,000	
	7回 沖縄電力社債	100,000,000	101,815,000	
	2回 電源開発社債	100,000,000	103,106,000	
	4回 電源開発社債	200,000,000	205,562,000	
	6回 電源開発社債	100,000,000	104,025,000	
	14回 電源開発社債	100,000,000	104,698,000	
	17回 電源開発社債	100,000,000	107,654,000	
	14回 東京ガス社債	100,000,000	116,337,000	
	24回 東京瓦斯社債	200,000,000	206,064,000	
	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,821,000	
	24回 大阪瓦斯社債	100,000,000	104,261,000	

	20回 NTTデータ社債	100,000,000	101,911,000	
社債券計			33,525,809,740	
合計			424,533,299,422	

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22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		8,754,854,193	8,022,524,784
コール・ローン		829,004,858	880,906,590
国債証券		414,062,710,146	384,733,019,200
派生商品評価勘定		163,614	103,677
未収利息		5,630,641,835	4,842,963,020
前払費用		590,569,720	220,292,547
流動資産合計		429,867,944,366	398,699,809,818
資産合計		429,867,944,366	398,699,809,818
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,779,825	4,736,569
未払金		-	4,283,669,735
未払解約金		104,591,000	31,598,000
流動負債合計		107,370,825	4,320,004,304
負債合計		107,370,825	4,320,004,304
純資産の部			
元本等			
元本		335,169,742,026	350,943,197,818
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		94,590,831,515	43,436,607,696
元本等合計		429,760,573,541	394,379,805,514
純資産合計		429,760,573,541	394,379,805,514
負債純資産合計		429,867,944,366	398,699,809,818

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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21年2月24日から平成22年2月22日までとなっております。	(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22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	260,422,854,222円	335,169,742,026円
同期中追加設定元本額	120,575,225,781円	53,327,268,319円
同期中解約元本額	45,828,337,977円	37,553,812,527円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	1,165,084,751円	4,574,134,629円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	2,892,804,144円	3,580,764,901円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	240,750,333円	297,183,514円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	903,680,241円	1,081,861,380円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	984,056,228円	1,177,346,407円
D I A M D C バランス30イン デックスファンド	285,812,801円	323,613,584円
D I A M D C バランス50イン デックスファンド	560,246,962円	632,799,046円
D I A M D C バランス70イン デックスファンド	360,492,481円	414,382,579円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	194,440,327円	178,030,226円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,478,983,655円	1,606,931,925円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	- 円	4,175,814円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	15,894,236,590円	9,015,830,509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)	3,614,726,895円	4,150,240,749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)	9,040,424,911円	7,629,093,022円
D I A M外国債券パッシブファ ンド2(適格機関投資家向け)	2,004,335,773円	- 円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	949,684,594円	948,036,288円
D I A Mワールドバランス25 V A(適格機関投資家限定)	252,351,204円	269,744,724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)	52,784,792,346円	51,933,106,616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)	2,845,500,184円	2,944,918,247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)	477,145,190円	498,993,629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)	758,119,594円	809,273,188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)	213,579,570円	230,874,683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)	93,883,178円	101,038,275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)	29,116,510,158円	30,549,846,148円
D I A M世界バランスファンド 50V A(適格機関投資家限 定)	6,358,949,534円	6,769,830,622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)	11,982,751,626円	12,341,497,659円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A(適格機関投資家限 定)	5,696,783,101円	5,814,032,741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)	8,179,518,861円	8,376,189,817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）	2,955,843,543円	3,179,473,611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）	8,829,018,555円	9,356,072,523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）	10,454,546,887円	10,858,768,967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）	49,089,637,827円	53,494,918,132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）	286,126,637円	229,613,168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）	984,955,979円	562,278,813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）	6,761,320,436円	7,410,654,771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）	15,870,367,238円	16,259,741,187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）	281,671,446円	285,986,643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）	25,564,335,534円	27,943,466,960円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A（適格機関投資 家限定）	31,281,753,790円	33,836,231,153円
D I A Mバランス30V A（適 格機関投資家限定）	781,876,050円	880,604,875円
D I A Mバランス50V A（適 格機関投資家限定）	213,915円	243,618円
D I A Mバランス70V A（適 格機関投資家限定）	131,359円	151,623円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A（適格機関投資 家限定）	22,603,573,775円	29,514,006,257円
D I A M世界バランス25V A （適格機関投資家限定）	20,982,089円	211,562,092円
D I A Mバランス20V A（適 格機関投資家限定）	73,422,378円	665,284,710円
D I A Mバランス40V A（適 格機関投資家限定）	199,011円	227,931円
D I A Mバランス60V A（適 格機関投資家限定）	120,345円	139,862円
（合 計）	335,169,742,026円	350,943,197,818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	335,169,742,026口	350,943,197,818口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)国債証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	
国債証券	554,332,068	
合計	554,332,068	

(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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11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。	
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。	
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。	

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。	
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。	

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成22年1月12日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	カナダドル	34,035,183	-	33,651,020	384,163
	ユーロ	295,557,636	-	295,721,250	163,614
	英ポンド	39,764,977	-	39,670,860	94,117
	米ドル	251,945,995	-	249,644,450	2,301,545
合計		621,303,791	-	618,687,580	2,616,211

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

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客

電信売買相場の仲値で評価しております。

3.換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2822円	1.1238円
(1万口当たり純資産額)	(12,822円)	(11,238円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 4.75 01/31/12	15,000,000.00	15,696,600.000	
	US T N/B 1.125 01/15/12	20,000,000.00	20,162,400.000	
	US T N/B 4.875 02/15/12	25,000,000.00	26,251,750.000	
	US T N/B 0.875 02/29/12	40,000,000.00	40,240,400.000	
	US T N/B 4.5 03/31/12	32,000,000.00	33,614,720.000	
	US T N/B 4.5 04/30/12	40,000,000.00	42,198,400.000	
	US T N/B 1.875 06/15/12	35,000,000.00	35,753,200.000	
	US T N/B 1.5 07/15/12	36,000,000.00	36,604,440.000	
	US T N/B 4.375 08/15/12	35,000,000.00	37,201,150.000	
	US T N/B 1.375 09/15/12	33,000,000.00	33,485,760.000	
	US T N/B 4.0 11/15/12	44,000,000.00	46,849,440.000	
	US T N/B 1.125 12/15/12	35,000,000.00	35,364,700.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	34,177,280.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,430,920.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,622,000.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	31,034,350.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	20,000,000.00	21,332,000.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	38,136,000.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	29,694,000.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	43,840,400.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,634,000.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	39,191,600.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,462,500.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,961,840.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	29,076,040.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	33,250,500.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	25,685,500.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	12,000,000.00	12,544,680.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	21,976,400.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	23,769,810.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	20,753,000.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	19,905,300.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,117,150.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	8,005,600.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,669,800.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	14,650,650.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	8,000,000.00	7,795,600.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,224,620.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	10,000,000.00	9,760,900.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	21,000,000.00	23,598,750.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	20,335,800.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	15,000,000.00	18,977,250.000	

	US T N/B 3.25 06/30/16	20,000,000.00	21,160,800.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	18,000,000.00	20,594,520.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	20,812,400.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	18,057,760.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	20,495,200.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	21,031,200.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	13,558,080.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	20,690,600.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	10,397,600.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,639,700.000	
	US T N/B 4.5 05/15/17	15,000,000.00	16,838,550.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	12,994,800.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	17,063,550.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	7,665,600.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	7,646,240.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	11,000,000.00	12,167,870.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	8,000,000.00	7,810,000.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	14,785,260.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	15,000,000.00	16,184,700.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	10,000,000.00	10,861,700.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	17,000,000.00	18,119,450.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	7,000,000.00	10,087,070.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	22,000,000.00	21,750,740.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	25,000,000.00	25,302,500.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	7,000,000.00	9,769,900.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	22,000,000.00	23,017,500.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	25,000,000.00	25,560,500.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	26,000,000.00	27,005,420.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	19,000,000.00	19,466,070.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,239,110.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	25,000,000.00	23,705,000.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	18,000,000.00	16,980,300.000	
	US T N/B 8.125 05/15/21	5,000,000.00	7,096,850.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	11,000,000.00	15,549,490.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,050,930.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	4,000,000.00	5,358,400.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	8,000,000.00	10,014,960.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	3,000,000.00	4,179,120.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	3,000,000.00	4,228,110.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	4,645,410.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	5,000,000.00	6,132,000.000	
	US T N/B 6.75 08/15/26	2,000,000.00	2,634,360.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	3,862,500.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,304,060.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,551,240.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	7,466,220.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	3,498,030.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	4,000,000.00	4,533,720.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	4,000,000.00	4,535,600.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	3,000,000.00	3,750,000.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	5,000,000.00	6,346,050.000	

	US T N/B 5.375 02/15/31	6,000,000.00	6,908,400.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	9,000,000.00	9,131,400.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	6,000,000.00	6,315,000.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	4,370,920.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	6,000,000.00	5,929,680.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	8,000,000.00	8,062,480.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	10,000,000.00	8,417,900.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	13,000,000.00	12,521,600.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	15,000,000.00	15,062,100.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	17,000,000.00	16,706,410.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	18,000,000.00	18,426,060.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	13,000,000.00	12,763,270.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	12,000,000.00	10,801,800.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	13,458,480.000	
米ドル小計	銘柄数 : 107	1,810,500,000.00	1,925,109,440.000	
	組入時価比率 : 40.47%		(159,591,572,576)	
	合計時価比率 : 41.48%			
	UK TREASURY 5.0 03/07/12	9,000,000.00	9,429,300.000	
	UK TREASURY 5.25 06/07/12	10,500,000.00	11,134,200.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	10,000,000.00	10,692,000.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,534,600.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,165,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	9,963,000.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,500,000.00	9,710,900.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	8,845,600.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,782,100.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	2,000,000.00	1,949,000.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	9,000,000.00	9,632,700.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,081,500.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,000,000.00	5,630,500.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,500,000.00	8,125,500.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	11,000,000.00	11,253,000.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	8,000,000.00	8,775,200.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	6,500,000.00	6,572,150.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	5,000,000.00	6,907,000.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	5,000,000.00	5,103,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,000,000.00	6,656,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	6,000,000.00	6,070,200.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,500,000.00	5,551,650.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,500,000.00	6,920,550.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,500,000.00	6,464,250.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,500,000.00	5,624,850.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,000,000.00	6,904,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,700,000.00	7,176,370.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	5,500,000.00	5,434,550.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	5,000,000.00	4,915,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	7,000,000.00	7,219,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	7,000,000.00	6,932,800.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	6,500,000.00	6,455,150.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	5,992,800.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,000,000.00	3,787,600.000	

英ポンド小計	銘柄数 : 34	223,700,000.00	237,393,520.000	
	組入時価比率 : 7.76%		(30,621,390,145)	
	合計時価比率 : 7.96%			
	CANADA 1.5 03/01/12	3,000,000.00	3,001,620.000	
	CANADA 5.25 06/01/12	9,500,000.00	9,982,505.000	
	CANADA 2.0 09/01/12	9,500,000.00	9,555,765.000	
	CANADA 5.25 06/01/13	10,000,000.00	10,797,900.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	8,000,000.00	8,120,000.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,945,600.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	6,940,360.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,722,000.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	3,000,000.00	3,074,100.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	5,000,000.00	5,357,350.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	5,000,000.00	5,361,950.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	4,500,000.00	4,898,520.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	8,000,000.00	8,393,040.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	4,500,000.00	4,617,225.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,000,000.00	997,510.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	2,300,000.00	3,369,063.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,700,000.00	2,764,829.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	2,500,000.00	3,885,700.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	5,000,000.00	6,457,700.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	5,000,000.00	6,607,150.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,500,000.00	6,735,520.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	6,000,000.00	6,433,800.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 22	124,000,000.00	137,019,207.000	
	組入時価比率 : 2.90%		(11,424,661,480)	
	合計時価比率 : 2.97%			
	SWEDEN 5.5 10/08/12	23,000,000.00	24,432,900.000	
	SWEDEN 6.75 05/05/14	30,000,000.00	34,085,700.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	24,798,600.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	18,132,660.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	19,883,120.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	33,000,000.00	35,754,510.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	33,000,000.00	38,050,320.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	15,325,120.000	
スウェーデンクローネ小計	銘柄数 : 8	195,000,000.00	210,462,930.000	
	組入時価比率 : 0.64%		(2,533,973,677)	
	合計時価比率 : 0.66%			
	AUSTRIA 5.0 07/15/12	4,000,000.00	4,243,560.000	
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,662,500.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	7,000,000.00	7,597,100.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,156,000.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	4,000,000.00	4,228,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	5,000,000.00	5,357,500.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,334,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,418,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	5,000,000.00	5,415,000.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,205,000.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	5,000,000.00	5,005,000.000	

	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.00	2,822,750.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	3,000,000.00	3,919,260.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,500,000.00	3,652,250.000	
	BELGIUM 5.0 09/28/12	9,000,000.00	9,414,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	7,000,000.00	7,223,300.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,235,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	2,000,000.00	2,063,400.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	9,000,000.00	9,360,900.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,035,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,057,500.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	2,876,400.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	4,880,500.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	4,000,000.00	4,038,800.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	4,000,000.00	4,372,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,010,400.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	4,000,000.00	3,977,200.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,253,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	4,859,000.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	6,000,000.00	6,681,600.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,300,000.00	5,649,323.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	1,800,000.00	1,691,640.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 01/04/12	14,000,000.00	14,613,900.000	
	BUNDESUBL 4.0 04/13/12	5,000,000.00	5,207,750.000	
	DEUTSCHLAND 5.0 07/04/12	16,000,000.00	16,997,600.000	
	BUNDESUBL 4.25 10/12/12	16,000,000.00	16,960,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	14,000,000.00	14,999,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	18,000,000.00	19,218,600.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	18,000,000.00	19,616,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,829,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	19,000,000.00	20,581,750.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	19,154,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	10,000,000.00	10,735,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	10,992,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	8,000,000.00	8,677,600.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	8,000,000.00	8,914,400.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	8,000,000.00	8,774,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	9,000,000.00	10,012,500.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	9,000,000.00	9,689,400.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	10,000,000.00	10,558,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	9,000,000.00	9,300,600.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	9,000,000.00	9,098,100.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	5,711,400.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	3,000,000.00	2,910,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	4,000,000.00	5,299,600.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,500,000.00	6,244,650.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,500,000.00	7,035,600.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,500,000.00	5,258,250.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	4,844,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	7,000,000.00	9,011,100.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	8,000,000.00	9,576,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	9,000,000.00	9,819,090.000	

	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,500,000.00	6,311,250.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	6,500,000.00	8,099,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.00	1,461,450.000	
	SPAIN 5.0 07/30/12	11,000,000.00	11,284,570.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	11,000,000.00	11,566,500.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	10,115,000.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	8,000,000.00	8,049,600.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	6,500,000.00	6,630,000.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,000,000.00	4,833,750.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,098,000.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	5,664,000.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	8,500,000.00	7,888,000.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	5,000,000.00	4,690,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	6,000,000.00	6,147,420.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,557,800.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	6,000,000.00	5,665,500.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	6,000,000.00	5,533,500.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	5,000,000.00	4,467,000.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	5,000,000.00	4,747,500.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	6,000,000.00	5,510,400.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,500,000.00	4,829,000.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	7,000,000.00	7,002,100.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,500,000.00	5,317,950.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	6,000,000.00	4,594,380.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	5,000,000.00	4,207,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,500,000.00	2,854,950.000	
	FINLAND 4.25 09/15/12	2,000,000.00	2,107,000.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	3,000,000.00	3,315,300.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,587,525.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,000,000.00	2,197,600.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	2,944,950.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	3,000,000.00	3,238,500.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,210,500.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	1,000,000.00	1,021,450.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	2,964,220.000	
	FRANCE OAT 5.0 04/25/12	17,000,000.00	17,902,700.000	
	FR TREASURY 4.5 07/12/12	2,000,000.00	2,101,200.000	
	FRANCE OAT 4.75 10/25/12	18,000,000.00	19,186,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	18,000,000.00	19,144,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	14,000,000.00	14,994,000.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,302,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	14,000,000.00	15,089,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	13,000,000.00	14,032,200.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	16,974,400.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,618,800.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	12,000,000.00	12,537,600.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,342,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	9,000,000.00	9,572,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,729,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	10,000,000.00	10,723,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,696,800.000	

	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	10,500,000.00	11,382,000.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,000,000.00	5,640,800.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	8,000,000.00	8,340,000.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	10,000,000.00	10,187,000.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	5,000,000.00	4,658,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,500,000.00	11,884,100.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	6,003,600.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	9,500,000.00	10,170,700.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,602,000.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	5,000,000.00	4,840,000.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,000,000.00	9,744,800.000	
	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,219,200.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,000,000.00	7,940,100.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	9,500,000.00	9,704,250.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,000,000.00	5,539,250.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	6,000,000.00	6,129,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,000,000.00	3,069,300.000	
	IRISH 3.9 03/05/12	2,000,000.00	1,980,420.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	2,907,210.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,737,140.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,567,400.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,333,070.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,259,630.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	2,497,440.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,205,690.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,503,020.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,179,590.000	
	ITALY BTPS 5.0 02/01/12	13,000,000.00	13,361,140.000	
	ITALY BTPS 4.0 04/15/12	10,000,000.00	10,185,100.000	
	ITALY BTPS 4.25 10/15/12	17,000,000.00	17,452,370.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	14,000,000.00	14,518,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	16,443,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	12,000,000.00	12,156,000.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	19,482,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	13,000,000.00	13,291,200.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	10,000,000.00	9,729,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	15,000,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	12,500,000.00	12,358,750.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	10,000,000.00	9,951,000.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	9,000,000.00	9,513,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	9,082,800.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	8,000,000.00	8,033,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,500,000.00	8,365,700.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	8,491,500.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	9,000,000.00	8,806,500.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	9,000,000.00	8,911,800.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	8,730,900.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	9,000,000.00	8,532,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	6,000,000.00	5,509,500.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	11,000,000.00	10,167,300.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.00	6,857,900.000	

	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	5,000,000.00	6,829,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	7,401,000.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,000,000.00	2,785,500.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	4,000,000.00	4,840,400.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	10,500,000.00	11,832,450.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	11,500,000.00	11,410,300.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	11,500,000.00	12,270,500.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	6,000,000.00	6,225,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,500,000.00	8,032,500.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,500,000.00	7,752,000.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	7,500,000.00	7,010,250.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	6,800,000.00	6,322,640.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/12	4,500,000.00	4,580,100.000	
	NETHERLANDS 5.0 07/15/12	7,000,000.00	7,432,600.000	
	NETHERLANDS 1.75 01/15/13	1,500,000.00	1,523,250.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,540,400.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,531,300.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,193,000.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,345,000.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,451,000.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	6,000,000.00	6,697,800.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	5,000,000.00	5,411,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	6,000,000.00	6,465,000.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,180,600.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,377,850.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	5,642,100.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	4,870,350.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,800,000.00	2,934,400.000	
	PORTUGUESE 5.0 06/15/12	3,000,000.00	3,039,000.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	3,052,200.000	
	PORTUGUESE 4.375 06/16/14	4,000,000.00	3,856,000.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,776,500.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	4,420,000.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	1,730,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	2,635,110.000	
	PORTUGUESE 4.75 06/14/19	2,000,000.00	1,752,700.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	2,317,590.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	3,000,000.00	2,506,500.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	2,124,900.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 203	1,449,500,000.00	1,509,253,498.000	
	組入時価比率 : 41.04%		(161,852,345,126)	
	合計時価比率 : 42.07%			
	DENMARK 4.0 11/15/12	24,000,000.00	25,344,000.000	
	DENMARK 5.0 11/15/13	35,000,000.00	38,556,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	32,000,000.00	34,832,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	25,000,000.00	27,303,750.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	35,689,500.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	11,000,000.00	15,510,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	38,000,000.00	45,850,800.000	
デンマーククロネ小計	銘柄数 : 7	198,000,000.00	223,086,050.000	
	組入時価比率 : 0.81%		(3,212,439,120)	

	合計時価比率： 0.83%			
	NORWAY 6.5 05/15/13	20,000,000.00	21,824,000.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	21,664,000.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	17,000,000.00	17,901,000.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	9,000,000.00	9,598,500.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数： 4	66,000,000.00	70,987,500.000	
	組入時価比率： 0.25%		(984,596,625)	
	合計時価比率： 0.26%			
	POLAND 01/25/12	8,000,000.00	7,646,000.000	
	POLAND 4.75 04/25/12	19,000,000.00	19,057,000.000	
	POLAND 10/25/12	4,000,000.00	3,666,160.000	
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,094,500.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	10,000,000.00	9,961,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	18,000,000.00	18,284,760.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	16,000,000.00	16,464,000.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,652,000.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	12,000,000.00	11,561,520.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,000,000.00	3,715,600.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	12,000,000.00	11,510,400.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	2,829,900.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数： 12	132,000,000.00	130,442,840.000	
	組入時価比率： 0.91%		(3,589,786,957)	
	合計時価比率： 0.93%			
	SINGAPORE 2.625 04/01/12	3,000,000.00	3,078,930.000	
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	2,000,000.00	2,091,380.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,428,680.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,316,380.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,777,825.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	2,928,100.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,700,000.00	1,739,100.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,042,320.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数： 8	21,000,000.00	22,402,715.000	
	組入時価比率： 0.36%		(1,430,189,326)	
	合計時価比率： 0.37%			
	MALAYSIA 3.718 06/15/12	15,000,000.00	15,166,800.000	
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	8,000,000.00	8,102,080.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,742,560.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,255,150.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,087,990.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,217,350.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	6,000,000.00	6,186,240.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,562,550.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,233,920.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数： 9	70,000,000.00	71,554,640.000	
	組入時価比率： 0.49%		(1,925,535,362)	
	合計時価比率： 0.50%			
	AUSTRALIAN 5.75 04/15/12	5,500,000.00	5,562,425.000	
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	9,000,000.00	9,294,480.000	
	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	6,000,000.00	6,210,420.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	6,000,000.00	6,239,700.000	

	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	2,500,000.00	2,436,325.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,000,000.00	6,195,540.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	5,000,000.00	4,924,600.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,000,000.00	3,708,280.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,000,000.00	4,065,080.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.00	2,027,720.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 10	50,000,000.00	50,664,570.000	
	組入時価比率 : 1.06%		(4,164,627,654)	
	合計時価比率 : 1.08%			
	MEXICAN BONDS 9.0 12/20/12	85,000,000.00	91,111,500.000	
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	120,000,000.00	134,638,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	74,109,700.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	60,000,000.00	63,868,200.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	45,000,000.00	55,295,550.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	43,000,000.00	45,644,070.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	35,000,000.00	36,348,550.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 : 7	458,000,000.00	501,016,370.000	
	組入時価比率 : 0.86%		(3,401,901,152)	
	合計時価比率 : 0.88%			
合計			384,733,019,200	
			(384,733,019,200)	

(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 107銘柄	40.47%	41.48%
英ポンド	国債証券 34銘柄	7.76%	7.96%
カナダドル	国債証券 22銘柄	2.90%	2.97%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.64%	0.66%
ユーロ	国債証券 203銘柄	41.04%	42.07%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.81%	0.83%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.25%	0.26%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.91%	0.93%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	0.36%	0.37%
マレーシアリングgit	国債証券 9銘柄	0.49%	0.50%
オーストラリアドル	国債証券 10銘柄	1.06%	1.08%
メキシコ ペソ	国債証券 7銘柄	0.86%	0.88%

(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。

「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22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,180,777	259,280,233
投資証券		3,405,110,700	4,135,148,100
未収入金		14,634,300	628,000
未収配当金		59,680,497	42,511,113
流動資産合計		3,481,606,274	4,437,567,446
資産合計		3,481,606,274	4,437,567,446
負債の部			
流動負債			
未払金		-	256,059,290
未払解約金		14,675,000	185,000
流動負債合計		14,675,000	256,244,290
負債合計		14,675,000	256,244,290
純資産の部			
元本等			
元本		5,226,243,410	4,718,941,254
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	1,759,312,136	537,618,098
元本等合計		3,466,931,274	4,181,323,156
純資産合計		3,466,931,274	4,181,323,156
負債純資産合計		3,481,606,274	4,437,567,446

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、金融商品取引所 等における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準 ずる価額）、又は金融商品取引業 者等から提示される気配相場に 基づいて評価しております。	投資証券 同左
2. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成21年6 月9日から平成22年6月7日までと なっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本 有価証券報告書における開示対 象ファンドと異なり、平成22年6 月8日から平成23年6月6日までと なっております。

（追加情報）

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,889,410,246円	5,226,243,410円
同期中追加設定元本額	1,254,925,144円	4,334,906,397円
同期中解約元本額	2,918,091,980円	4,842,208,553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>	92,615,805円	73,447,417円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	694,195,892円	660,693,969円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	1,625,990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）	1,491,628,555円	2,376,575,088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）	492,957,176円	399,241,647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）	1,924,727,594円	789,057,681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）	530,118,388円	418,299,462円
（合計）	5,226,243,410円	4,718,941,254円
*2 本有価証券報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	5,226,243,410口	4,718,941,254口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,759,312,136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537,618,098円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

種類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資証券	3,405,110,700	43,398,691
合計	3,405,110,700	43,398,691

自平成22年1月13日 至平成23年1月11日	
種類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資証券	651,763,217
合計	651,763,217

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6634円 (6,634円)	0.8861円 (8,861円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	173	107,087,000	
	M I Dリート投資法人	203	47,786,200	
	森ヒルズリート投資法人	256	82,304,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	139	67,901,500	
	産業ファンド投資法人	87	32,973,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,085	196,168,000	
	日本ビルファンド投資法人	600	495,000,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	542	468,288,000	
	日本リテールファンド投資法人	1,869	291,750,900	
	オリックス不動産投資法人	279	145,917,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	791	187,783,400	
	プレミア投資法人	155	62,620,000	
	東急リアル・エステート投資法人	187	108,086,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	107	83,995,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	338	195,702,000	

	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,607	180,626,800	
	森トラスト総合リート投資法人	268	226,460,000	
	インヴィンシブル投資法人	705	8,883,000	
	フロンティア不動産投資法人	215	171,140,000	
	平和不動産リート投資法人	770	40,194,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	164	131,692,000	
	福岡リート投資法人	118	74,222,000	
	ケネディクス不動産投資法人	259	100,103,500	
	積水ハウス・S I 投資法人	127	49,530,000	
	F C レジデンシャル投資法人	36	9,252,000	
	大和証券オフィス投資法人	438	130,918,200	
	阪急リート投資法人	95	41,040,000	
	スタートアップシード投資法人	120	15,564,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	117	34,117,200	
	トップリート投資法人	172	89,612,000	
	ジャパン・オフィス投資法人	227	24,629,500	
	ビ・ライフ投資法人	131	77,421,000	
	日本ホテルファンド投資法人	47	12,807,500	
	日本賃貸住宅投資法人	1,473	55,679,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	171	87,894,000	
合計		14,071	4,135,148,100	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		45,233,205	47,581,715
コール・ローン		12,574,001	4,902,723
新株予約権証券		287,918	-
投資信託受益証券		1,359,052,284	611,982,793
投資証券		5,843,071,641	3,103,364,098
未収配当金		38,126,574	18,345,081
流動資産合計		7,298,345,623	3,786,176,410
資産合計		7,298,345,623	3,786,176,410
負債の部			
流動負債			
未払解約金		2,161,000	89,000
流動負債合計		2,161,000	89,000
負債合計		2,161,000	89,000
純資産の部			
元本等			
元本		10,398,034,421	5,089,591,953
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	3,101,849,798	1,303,504,543
元本等合計		7,296,184,623	3,786,087,410

純資産合計		7,296,184,623	3,786,087,410
負債純資産合計		7,298,345,623	3,786,176,410

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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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21年11月7日から平成22年11月8日までとなっております。	(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22年11月9日から平成23年11月7日までとなっております。

(追加情報)

自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
	当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	15,713,809,346円	10,398,034,421円
同期中追加設定元本額	5,796,358,442円	420,369,795円
同期中解約元本額	11,112,133,367円	5,728,812,263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>	128,496,819円	58,724,937円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	977,370,647円	529,055,653円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	- 円	27,660,568円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	9,038,715,155円	4,273,962,787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）	253,451,800円	200,188,008円
（合計）	10,398,034,421円	5,089,591,953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	10,398,034,421口	5,089,591,953口
*3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,101,849,798円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,303,504,543円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	自平成21年1月14日 至平成22年1月12日	
種 類	貸借対照表 計上額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
新株予約権証券	287,918	122,896
投資信託受益証券	1,359,052,284	111,131,485
投資証券	5,843,071,641	497,017,873
合計	7,202,411,843	608,272,254

	自平成22年1月13日 至平成23年1月11日
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	15,587,123
投資証券	107,573,644
合計	123,160,767

(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21年1月14日 至平成22年1月12日	自平成22年1月13日 至平成23年1月11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。	
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。	
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。	
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。	
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。	

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22年1月12日現在	平成23年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.7017円	0.7439円

(1万口当たり純資産額)	(7,017円)	(7,439円)
--------------	----------	----------

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成23年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	FORTUNE REAL ESTATE INVESTME	218,000.00	867,640.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	218,000.00	867,640.000	
	組入時価比率 : 0.24%		(9,249,042)	
	合計時価比率 : 0.25%			
	CAPITAMALL TRUST	206,000.00	403,760.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	202,000.00	436,320.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	150,000.00	226,500.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	170,000.00	263,500.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	95,000.00	194,750.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 5	823,000.00	1,524,830.000	
	組入時価比率 : 2.57%		(97,345,147)	
	合計時価比率 : 2.62%			
	BUNNINGS WAREHOUSE	20,500.00	35,260.000	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	282,300.00	232,897.500	
	MIRVAC GROUP	356,854.00	446,067.500	
	ING OFFICE FUND	311,080.00	172,649.400	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	32,480.00	93,867.200	
	CFS RETAIL PROPERTY	243,300.00	428,208.000	
	GPT GROUP	137,000.00	398,670.000	
	ING INDUSTRIAL FUND	341,600.00	181,048.000	
	ABACUS PROPERTY GR	16,920.00	37,393.200	
	VALAD PROPERTY GROUP	18,500.00	18,870.000	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	47,840.00	140,649.600	
	STOCKLAND	197,140.00	715,618.200	
	WESTFIELD GROUP	191,200.00	1,852,728.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	517,400.00	419,094.000	
	GOODMAN GROUP	527,762.00	329,851.250	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	235,900.00	75,488.000	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	219,200.00	569,920.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 17	3,696,976.00	6,148,279.850	
	組入時価比率 : 13.35%		(505,388,604)	
	合計時価比率 : 13.60%			
投資信託受益証券計			611,982,793	
			(611,982,793)	
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,700.00	429,267.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,850.00	1,003,458.000	
	CEDAR SHOPPING CENTERS INC	5,300.00	31,641.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	7,900.00	127,348.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	11,100.00	247,863.000	

APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7,715.00	195,266.650
AGREE REALTY CORP	1,100.00	25,894.000
BRE PROPERTIES -CL A	6,700.00	285,755.000
NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC	13,100.00	475,399.000
SL GREEN	5,625.00	383,400.000
ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	4,200.00	188,664.000
AMB PROPERTY CORP	14,700.00	480,543.000
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,528.00	822,132.880
LEXINGTON REALTY TRUST	2,521.00	20,117.580
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,200.00	280,540.000
CBL & ASSOCIATES	15,382.00	266,416.240
MACK CALI	8,300.00	277,469.000
COLONIAL PROPERTIES TRUST	8,600.00	158,240.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,100.00	77,810.000
COUSINS PROPERTIES INC	12,909.00	111,404.670
LASALLE HOTEL PROPERTIES	7,600.00	215,156.000
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.00	48,620.000
DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY CO	18,982.00	253,219.880
DUKE REALTY TRUST	26,800.00	343,576.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,060.00	233,521.600
EQUITY RESIDENTIAL	25,300.00	1,271,578.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,630.00	511,504.500
FIRST INDUSTRIAL RT	12,500.00	122,250.000
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	59,000.00	884,410.000
GLIMCHER REALTY TRUST	11,800.00	97,350.000
FELCOR LODGING TR INC	4,700.00	36,848.000
HOME PROPERTIES INC	2,400.00	129,432.000
HCP INC	28,200.00	1,020,840.000
COMMONWEALTH REIT	8,025.00	207,045.000
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.00	120,640.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	8,100.00	260,091.000
STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.00	45,600.000
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	13,800.00	329,820.000
HEALTH CARE REIT INC	9,701.00	459,342.350
EAST GROUP	3,800.00	155,648.000
KIMCO REALTY	33,999.00	606,202.170
KILROY REALTY CORP	4,900.00	181,545.000
LTC PROPERTIES INC	3,500.00	97,335.000
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	14,100.00	311,469.000
LIBERTY PROPERTY TRUST	9,100.00	291,018.000
BRANDYWINE REALTY TRUST	14,800.00	172,716.000
THE MACERICH COMPANY	12,620.00	591,120.800
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	600.00	33,192.000
ACADIA REALTY TRUST	4,585.00	82,896.800
HOST HOTELS & RESORTS INC	63,568.00	1,164,565.760
MID AMERICA	3,800.00	235,068.000
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	11,500.00	102,695.000
PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	87,710.000
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600.00	76,496.000
GETTY REALTY CORP	3,500.00	103,425.000
POST PROPERTIES, INC	6,100.00	219,600.000

	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	71,568.000	
	REALTY INCOME CORP	8,100.00	273,051.000	
	REGENCY	6,400.00	265,792.000	
	UDR INC	13,779.00	311,405.400	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6,800.00	239,836.000	
	SAUL CENTERS INC	800.00	37,704.000	
	PROLOGIS	51,900.00	746,841.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,524.00	2,489,610.960	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	4,400.00	162,272.000	
	PUBLIC STORAGE	12,508.00	1,264,808.960	
	SUN COMMUNITIES INC	1,200.00	39,504.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	3,100.00	157,542.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	4,300.00	216,720.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.00	32,796.000	
	VENTAS INC	13,530.00	703,830.600	
	VORNADO REALTY TRUST	14,549.00	1,213,532.090	
	WASHINGTON REIT	6,900.00	210,726.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	11,100.00	266,178.000	
	CAPLEASE INC	7,000.00	40,950.000	
	BIOMED REALTY TRUST INC	13,100.00	242,612.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,709.00	177,949.530	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,900.00	105,433.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.00	82,650.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,340.00	105,235.200	
	U-STORE-IT TRUST	8,900.00	82,948.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,210.00	378,092.400	
	INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.00	44,051.000	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	57,720.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	15,372.00	184,156.560	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	13,000.00	140,530.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	9,900.00	170,181.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,000.00	85,120.000	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	6,800.00	147,220.000	
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	13,000.00	258,180.000	
米ドル小計	銘柄数 : 90	964,521.00	27,998,922.580	
	組入時価比率 : 61.31%		(2,321,110,682)	
	合計時価比率 : 62.47%			
	BRITISH LAND CO PLC	78,200.00	410,941.000	
	DERWENT LONDON PLC	5,800.00	87,754.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.00	33,900.000	
	HAMMERSON PLC	46,200.00	198,151.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,100.00	465,463.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,670.00	16,748.790	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	47,404.00	186,060.700	
	SHAFTESBURY PLC	16,000.00	69,824.000	
	SEGRO PLC	78,090.00	223,571.670	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	21,400.00	74,814.400	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	110,000.00	146,850.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 11	551,864.00	1,914,079.860	
	組入時価比率 : 6.52%		(246,897,161)	
	合計時価比率 : 6.65%			

	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	3,400.00	81,702.000
	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,900.00	154,059.000
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	5,900.00	85,432.000
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,200.00	180,504.000
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	17,300.00	141,860.000
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.00	84,780.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	10,000.00	221,300.000
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	1,200.00	25,260.000
	PRIMARIS RETAIL REIT	8,000.00	153,840.000
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	12,000.00	81,120.000
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800.00	117,544.000
カナダドル小計	銘柄数 : 11	81,400.00	1,327,401.000
	組入時価比率 : 2.92%		(110,678,695)
	合計時価比率 : 2.98%		
	BEFIMMO	1,104.00	66,129.600
	COFINIMMO SA	1,090.00	103,713.500
	WAREHOUSES DE PAUW	1,934.00	71,751.400
	GECINA SA	2,800.00	232,876.000
	ICADE EMGP	2,700.00	201,150.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,450.00	1,040,392.500
	KLEPIERRE	4,400.00	115,830.000
	SILIC	1,094.00	100,702.700
	FONCIERE DES REGIONS	2,000.00	143,700.000
	MERCIALYS	4,565.00	123,711.500
	EUROCOMMERCIAL	4,900.00	162,949.500
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL	6,000.00	74,910.000
	VASTNED RETAIL	700.00	35,140.000
	CORIO NV	8,500.00	390,660.000
	WERELDHAVE NV	1,500.00	105,735.000
ユーロ小計	銘柄数 : 15	50,737.00	2,969,351.700
	組入時価比率 : 8.41%		(318,433,276)
	合計時価比率 : 8.57%		
	LINK REIT/THE	232,000.00	5,788,400.000
	GZI REAL ESTATE INVESTMENT TRU	133,000.00	578,550.000
	CHAMPION REIT	370,000.00	1,842,600.000
香港ドル小計	銘柄数 : 3	735,000.00	8,209,550.000
	組入時価比率 : 2.31%		(87,513,803)
	合計時価比率 : 2.36%		
	GOODMAN PROPERTY TRUST	148,600.00	139,684.000
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.00	50,500.000
	ARGOSY PROPERTY TRUST	148,000.00	106,560.000
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 3	346,600.00	296,744.000
	組入時価比率 : 0.49%		(18,730,481)
	合計時価比率 : 0.50%		
投資証券計			3,103,364,098
			(3,103,364,098)
合計			3,715,346,891
			(3,715,346,891)

(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 90銘柄	61.31%	62.47%
英ポンド	投資証券 11銘柄	6.52%	6.65%
カナダドル	投資証券 11銘柄	2.92%	2.98%
ユーロ	投資証券 15銘柄	8.41%	8.57%
香港ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.24%	0.25%
香港ドル	投資証券 3銘柄	2.31%	2.36%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 5銘柄	2.57%	2.62%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 17銘柄	13.35%	13.60%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.49%	0.50%

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成23年1月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	7,746,979,482円
負債総額	9,806,021円
純資産総額（ - ）	7,737,173,461円
発行済数量	10,720,346,663口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7217円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	267,807,998,765円
負債総額	1,155,994,391円
純資産総額（ - ）	266,652,004,374円
発行済数量	224,841,819,494口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1860円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	283,472,071,719円
負債総額	22,457,315円
純資産総額（ - ）	283,449,614,404円
発行済数量	216,099,295,586口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3117円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	443,021,619,705円
負債総額	10,324,094,150円
純資産総額（ - ）	432,697,525,555円
発行済数量	388,415,668,291口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1140円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	396,629,957,152円
負債総額	128,958,804円
純資産総額（ - ）	396,500,998,348円
発行済数量	348,939,100,583口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1363円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	5,070,422,612円
負債総額	33,762,280円
純資産総額（ - ）	5,036,660,332円
発行済数量	5,789,254,127口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8700円

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成23年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	3,780,420,640円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	3,780,420,640円
発行済数量	4,996,422,989口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7566円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

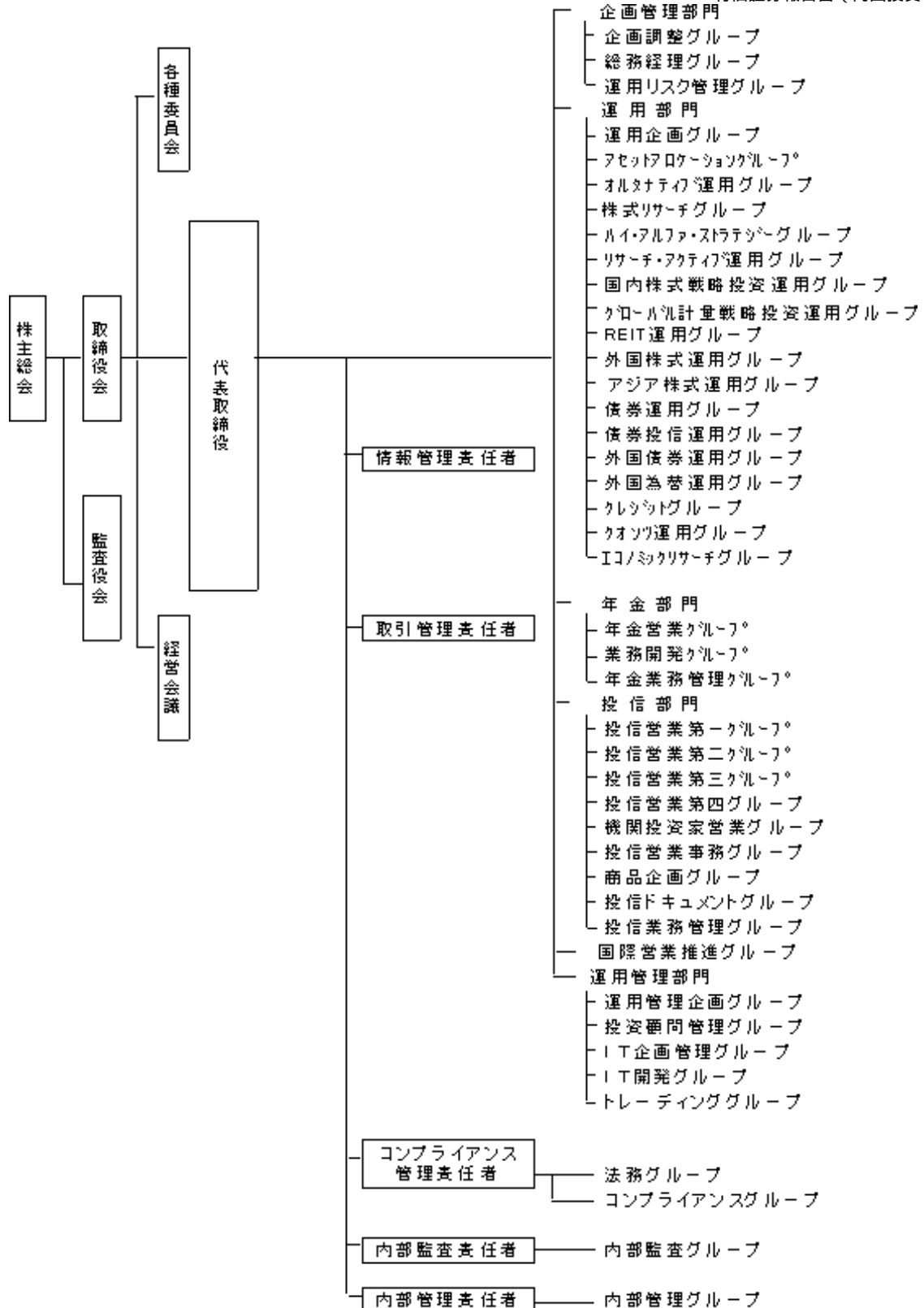
本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の組織図



上記組織は、平成23年1月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

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

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

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

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

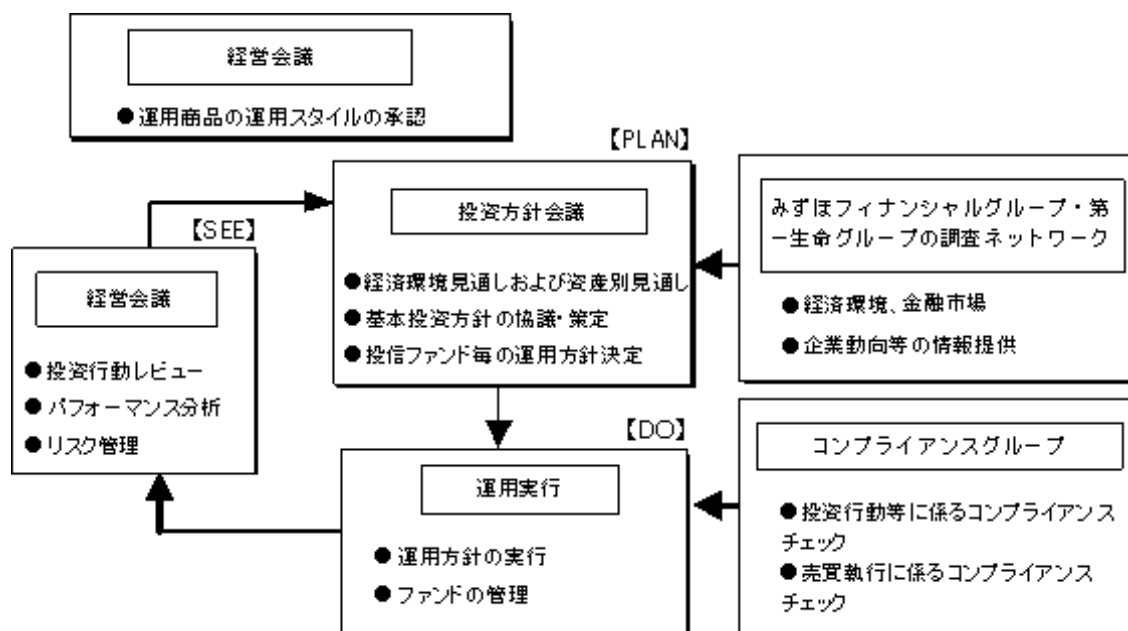
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成23年1月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成23年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は282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	77,315,067,286
追加型株式投資信託	250	4,186,873,619,098
単位型公社債投資信託	13	109,353,257,373
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	322,433,001
合計	282	4,373,864,376,758

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

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

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）および第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第26期中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,558,999	13,820,588
金銭の信託	-	399,833
前払費用	54,242	33,221
未収委託者報酬	2,254,741	3,169,323
未収運用受託報酬	1,046,291	1,000,785
未収投資助言報酬	2 252,337	2 271,577
未収収益	197,045	247,552
未収消費税等	98,402	-
繰延税金資産	369,826	383,608
その他	23,865	21,009
流動資産計	16,855,752	19,347,501
固定資産		
有形固定資産	501,481	599,421
建物	1 283,511	1 237,642
器具備品	1 201,169	1 351,237
建設仮勘定	16,799	10,541
無形固定資産	721,812	964,184
商標権	1 1,335	1 804
ソフトウェア	1 555,121	1 557,870
ソフトウェア仮勘定	157,595	397,829
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 611	1 531
投資その他の資産	4,051,090	5,247,891
投資有価証券	498,041	1,194,081
関係会社株式	1,661,144	2,161,144
繰延税金資産	442,390	403,908
長期差入保証金	1,169,961	1,187,070
その他	306,478	328,612
貸倒引当金	26,925	26,925
固定資産計	5,274,384	6,811,497
資産合計	22,130,137	26,158,999

（単位：千円）

	第24期 （平成21年3月31日現在）	第25期 （平成22年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	37,445	119,466
未払金	1,293,636	1,526,031
未払収益分配金	8,201	7,837
未払償還金	48,993	96,340
未払手数料	931,529	1,206,815
その他未払金	304,912	215,038
未払費用	2 1,040,620	2 1,522,325
未払法人税等	179,557	1,283,275
未払消費税等	-	113,923
賞与引当金	618,303	572,614
その他	20,741	38,231
流動負債計	3,190,304	5,175,867
固定負債		
退職給付引当金	404,437	488,790
役員退職慰労引当金	145,732	96,342
固定負債計	550,169	585,133
負債合計	3,740,474	5,761,000
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	13,962,732	15,737,995
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	10,040,000	11,650,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,299,438	3,464,702
株主資本計	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,547	231,525
評価・換算差額等計	1,547	231,525
純資産合計	18,389,662	20,397,999
負債・純資産合計	22,130,137	26,158,999

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬		24,552,133		26,734,588
運用受託報酬		4,509,994		4,297,349
投資助言報酬		1,228,096		1,027,153
その他営業収益		697,007		723,055
営業収益計		30,987,232		32,782,146
営業費用				
支払手数料		10,967,681		13,000,141
広告宣伝費		488,151		218,782
公告費		-		1,767
調査費		5,076,631		5,056,427
調査費		2,506,175		2,555,070
委託調査費		2,570,455		2,501,356
委託計算費		325,174		351,370
営業雑経費		812,013		679,608
通信費		35,872		32,088
印刷費		732,985		613,198
協会費		25,313		21,225
諸会費		41		41
支払販売手数料		17,800		13,054
営業費用計		17,669,652		19,308,097
一般管理費				
給料		4,587,983		4,678,614
役員報酬	1	234,353	1	244,725
給料・手当		3,647,502		3,840,052
賞与		706,127		593,836
交際費		44,085		45,342
寄付金		4,462		3,450
旅費交通費		308,237		269,516
租税公課		82,762		85,030
不動産賃借料		801,086		791,980
退職給付費用		106,223		132,513
固定資産減価償却費		330,412		397,252
福利厚生費		22,556		22,233
修繕費		6,755		5,615
賞与引当金繰入		618,303		572,614
役員退職慰労引当金繰入		42,570		45,086
役員退職金		13,175		18,129
機器リース料		973		2,191
事務委託費		247,087		285,449
消耗品費		84,099		78,753
器具備品費		6,094		2,046
諸経費		177,386		88,728
一般管理費計		7,484,253		7,524,549
営業利益		5,833,325		5,949,500

（単位：千円）

	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		4,558		5,287
受取利息		59,458		18,745
時効成立分配金		164		157
投資信託解約益		-		559,971
先物利益		180,422		-
雑収入		5,482		3,431
営業外収益計		250,086		587,592
営業外費用				
為替差損		24,553		17,771
時効成立後支払分配金		517		444
投資信託解約損		38,254		-
先物損失		-		719,577
金銭の信託運用損		-		1,116
営業外費用計		63,325		738,911
経常利益		6,020,086		5,798,181
特別損失				
固定資産除却損	2	14,476	2	21,626
固定資産売却損		-		2,464
ゴルフ会員権評価損		6,000		-
投資有価証券評価損		484,009		-
特別損失計		504,485		24,090
税引前当期純利益		5,515,600		5,774,091
法人税、住民税及び事業税		2,301,373		2,508,095
法人税等調整額		30,266		135,267
法人税等合計		2,271,106		2,372,828
当期純利益		3,244,494		3,401,263

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

		第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
株主資本			
	資本金		
	前期末残高	2,000,000	2,000,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,000,000	2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	前期末残高	2,428,478	2,428,478
	当期変動額	-	-
	当期末残高	2,428,478	2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	前期末残高	123,293	123,293
	当期変動額	-	-
	当期末残高	123,293	123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	前期末残高	7,040,000	10,040,000
	当期変動額	3,000,000	1,610,000
	当期末残高	10,040,000	11,650,000
	研究開発積立金		
	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
	運用責任準備積立金		
	前期末残高	200,000	200,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	200,000	200,000
	繰越利益剰余金		
	前期末残高	6,054,944	3,299,438
	当期変動額		
	剰余金の配当	3,000,000	1,626,000
	別途積立金の積立	3,000,000	1,610,000
	当期純利益	3,244,494	3,401,263
	当期末残高	3,299,438	3,464,702
	株主資本合計		
	前期末残高	18,146,716	18,391,210
	当期変動額	244,494	1,775,263
	当期末残高	18,391,210	20,166,473
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	前期末残高	10,012	1,547
	当期変動額（純額）	8,464	233,073
	当期末残高	1,547	231,525
純資産合計			
	前期末残高	18,136,703	18,389,662
	当期変動額	252,958	2,008,336
	当期末残高	18,389,662	20,397,999

[次へ](#)

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)</p>
<p>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（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>4. 外貨建の資産および負債の本邦通貨への換算基準 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おります。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</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. 金銭の信託の評価基準および評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準および評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産（リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左 (3) リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5. 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>6. 引当金の計上基準 (1) 同左 (2) 同左 (3) 同左 (会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正（その3）」（企業会計基準委員会 平成20年7月31日 企業会計基準第19号）を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益および税引前当期純利益に与える影響はありません。 (4) 同左</p>

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
<p>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。</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>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>

会計方針の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成5年6月17日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成6年1月18日 最終改正平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準および適用指針を適用し、通常の売買取引に係る会計処理によっております。また、所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産の減価償却の方法については、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p> <p>これによる当事業年度における貸借対照表および損益計算書に与える影響はありません。</p> <p>なお、所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p>	<p>_____</p>

表示方法の変更

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<p>（貸借対照表）</p> <p>1．前事業年度において「未収収益」に含めて表示していた投資一任契約による未収運用受託報酬および投資助言契約による未収投資助言報酬は、当事業年度から「未収運用受託報酬」および「未収投資助言報酬」として区分掲記しております。なお、前事業年度末における「未収運用受託報酬」の金額は1,299,666千円であり、「未収投資助言報酬」の金額は369,475千円であります。</p> <p>2．前事業年度において「ソフトウェア」に含めて表示していた「ソフトウェア仮勘定」は、金額的重要性が増したため、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度末における「ソフトウェア仮勘定」の金額は31,213千円であります。</p> <p>（損益計算書）</p> <p>前事業年度において「顧問料」として表示していた「運用受託報酬」および「投資助言報酬」は、当事業年度から区分掲記しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」の金額は4,929,946千円であり、「投資助言報酬」の金額は1,874,941千円であります。</p>	<hr/>

追加情報

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）
<hr/>	<p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

第24期（平成21年3月31日現在）	第25期（平成22年3月31日現在）																																
<p>1．固定資産の減価償却累計額</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>426,679千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>290,397千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,351千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>648,713千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>985千円</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"> <tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>251,392千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>345,744千円</td></tr> </table>	建物	426,679千円	器具備品	290,397千円	商標権	6,351千円	ソフトウェア	648,713千円	電話施設利用権	985千円	流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円	流動負債	未払費用	345,744千円	<p>1．固定資産の減価償却累計額</p> <table border="1"> <tr><td>建物</td><td>471,484千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>356,326千円</td></tr> <tr><td>商標権</td><td>6,882千円</td></tr> <tr><td>ソフトウェア</td><td>684,370千円</td></tr> <tr><td>電話施設利用権</td><td>1,065千円</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"> <tr><td>流動資産</td><td>未収投資助言報酬</td><td>270,492千円</td></tr> <tr><td>流動負債</td><td>未払費用</td><td>400,075千円</td></tr> </table>	建物	471,484千円	器具備品	356,326千円	商標権	6,882千円	ソフトウェア	684,370千円	電話施設利用権	1,065千円	流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動負債	未払費用	400,075千円
建物	426,679千円																																
器具備品	290,397千円																																
商標権	6,351千円																																
ソフトウェア	648,713千円																																
電話施設利用権	985千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	251,392千円																															
流動負債	未払費用	345,744千円																															
建物	471,484千円																																
器具備品	356,326千円																																
商標権	6,882千円																																
ソフトウェア	684,370千円																																
電話施設利用権	1,065千円																																
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円																															
流動負債	未払費用	400,075千円																															

(損益計算書関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 役員報酬の限度額 取締役 年額250,000千円 監査役 年額 50,000千円 2. 固定資産除却損の内訳 建物 2,251千円 器具備品 9,818千円 ソフトウェア 2,406千円	1. 役員報酬の限度額 同左 2. 固定資産除却損の内訳 建物 1,199千円 器具備品 15,159千円 ソフトウェア 5,267千円

(株主資本等変動計算書関係)

第24期(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第25期(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リース取引関係)

第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)				第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円
減価償却累計額 相当額	52,335千円	-	52,335千円	減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円
期末残高相当額	38,265千円	-	38,265千円	期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	23,251千円	16,350千円	39,602千円	未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円
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		24,096千円		支払リース料		24,096千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		22,727千円	
支払利息相当額		1,501千円		支払利息相当額		845千円	
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 オペレーティング・リース取引のうち解約不能のもの に係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,609千円	1,475千円	3,084千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）
<p>(1)金融商品に対する取組方針 資金運用については短期的な預金等に限定しております。 デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。 取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。</p>
<p>(2)金融商品の内容およびそのリスク 投資有価証券および金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託であり、為替および市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。 長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。 デリバティブ取引は、投資有価証券および金銭の信託に係る為替および市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引および株価指数先物取引等であります。</p>
<p>(3)金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理 為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理 組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて取引残高、損益およびリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理 取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。</p>
<p>(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

(注3) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

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

(注4) 社債、新株予約権付社債および長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式で時価のあるもの

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
3,021,000	20,615	58,869

7. 時価のない主な有価証券の内容

貸借対照表計上額

その他有価証券

非上場株式（店頭売買株式を除く） 82,746千円

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

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式および関連会社株式

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

4. その他有価証券

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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

（金銭の信託関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第24期（平成21年3月31日現在）

1. 取引の状況に関する事項

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
<p>(1)取引の内容 為替予約取引及び株価指数先物取引を利用しております。</p> <p>(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。</p> <p>(3)取引の利用目的 その他有価証券に含まれる為替変動リスク及び株価変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(4)取引に係るリスクの内容 為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

2. 取引の時価等に関する事項

(1) 通貨関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	24,432	-	24,960	528
	香港ドル	34,020	-	34,412	392
	豪ドル	77,510	-	78,736	1,226
	シンガポールドル	12,564	-	12,672	107
合計		148,527	-	150,782	2,255

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	第24期(平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	212,667	-	230,215	17,547
合計		212,667	-	230,215	17,547

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

第25期(平成22年3月31日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

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

(注2) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

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

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

(退職給付関係)

第24期(平成21年3月31日現在)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

当社は、原則法を適用しております。

(1) 退職給付債務 (平成21年3月31日現在) (千円)

退職給付債務	431,448
未認識数理計算上の差異	27,011
退職給付引当金	404,437

(2) 退職給付費用 (千円)

勤務費用	71,958
確定拠出年金 拠出額	34,264
退職給付費用	106,223

3. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第24期 (平成21年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第25期（平成22年3月31日現在）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

第25期
（平成22年3月31日現在）（千円）

（1）	退職給付債務	530,305
（2）	未認識数理計算上の差異	41,515
	退職給付引当金	488,790

3．退職給付費用に関する事項

第25期
（自平成21年4月1日
至平成22年3月31日）（千円）

（1）	勤務費用	82,653
（2）	利息費用	6,471
（3）	数理計算上の差異の費用処理額	5,402
（4）	確定拠出年金 拠出額	37,987
	退職給付費用	132,513

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（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24期	第25期
	(平成21年3月31日現在)	(平成22年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	19,218	108,541
未払事業所税	6,269	6,290
賞与引当金	251,649	233,054
未払法定福利費	27,146	26,912
未払確定拠出年金掛金	2,667	2,712
減価償却超過額	7,579	17,598
減価償却超過額（一括償却資産）	8,559	6,098
繰延資産償却超過額（税法上）	46,274	89,657
その他（未払金等）	461	-
退職給付引当金	164,605	198,937
役員退職慰労引当金	59,313	39,211
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	196,991	66,421
貸倒引当金繰入額	14,840	14,840
その他有価証券評価差額金	1,062	-
繰延税金資産合計	812,216	815,851
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	28,334
繰延税金負債合計	-	28,334
差引繰延税金資産の純額	812,216	787,517

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24期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

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

（関連当事者との取引）

第24期（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

（追加情報）

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

この結果、従来の開示対象範囲に対し、重要な追加はありません。

(1)親会社および法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金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	718,870	未収投資助言報酬	172,117
								販売手数料の支払	17,800	-	-
								保険料の支払	5,828	-	-

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

（注3）保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

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

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	933,784	未払費用	236,518
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	324,748	未払費用	109,093

取引条件および取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	6,500 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,531,236	未払 手数料	96,917
								預金の引出 (純額)	300,370	現金・ 預金	322,365
								受取利息	894	未収 収益	-
	株式会社 みずほコー ポレート銀行	東京都 千代田 区	10,709 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	701,162	未払 手数料	91,628
								預金の引出 (純額)	1,034,219	現金・ 預金	11,438,676
								受取利息	55,734	未収 収益	4,158
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	299,054	未払 費用	117,438
								業務委託料 の支払	17,550	未払 費用	2,677

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社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				
その他の関係会社	第一生命保険相互会社	東京都千代田区	4,200億円(基金償却積立金)	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向3名, 転籍2名	資産の運用および助言, 当社設定投資の販売	資産運用の助言の顧問料の受入	711,279	未収投資助言報酬	190,025
								販売手数料の支払	13,054	-	-
								保険料の支払	6,572	-	-

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

(2)子会社等

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

取引条件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				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払 手数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコーポ レート銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払 手数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第一 フィナンシャ ルテクノロ ジー株式会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の 運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理サー ビス信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産 管理等	-	-	当社信託 財産の 運用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
								信託報酬の 支払	130		

取引条件および取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 766,235円93銭 1株当たり当期純利益金額 135,187円25銭	1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債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24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,244,494千円	3,401,263千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<p>平成21年2月13日開催の臨時取締役会の決議により平成21年3月19日に設立した100%出資の子会社DIAM Asset Management(HK)Limitedに対して、平成21年4月9日に資本金の払込みを実施いたしました。</p> <p>当該子会社の設立は、運用・営業両面においてビジネス機会の広がる中国圏での業容拡大や、当社におけるアジア株関連商品の営業強化などを主な目的とするものです。</p> <p><子会社の概要> 商号：DIAM Asset Management(HK)Limited 主な事業内容：資産運用業務 設立年月日：平成21年3月19日 資本金：500,000千円 発行済株式総数：500,000株 出資の総額：500,000千円 出資比率：当社100%</p>	—

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,413,600
金銭の信託		2,920,386
前払費用		70,721
未収委託者報酬		2,870,054
未収運用受託報酬		1,587,601
未収投資助言報酬		258,177
未収収益		248,853
繰延税金資産		379,771
その他		27,218
	流動資産計	19,776,384
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,226
器具備品	1	275,229
無形固定資産		
商標権	1	657
ソフトウェア	1	843,268
ソフトウェア仮勘定		201,594
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	491
投資その他の資産		
投資有価証券		744,900
関係会社株式		2,161,144
繰延税金資産		501,175
長期差入保証金		1,126,064
その他		274,365
貸倒引当金		26,925
	固定資産計	6,309,341
資産合計		26,085,726

（単位：千円）

	第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	48,469
未払金	1,382,417
未払収益分配金	5,782
未払償還金	96,340
未払手数料	1,104,913
その他未払金	175,381
未払費用	1,319,766
未払法人税等	1,403,804
未払消費税等	127,640
前受収益	4,618
賞与引当金	574,949
その他	1,954
流動負債計	4,863,621
固定負債	
退職給付引当金	527,297
役員退職慰労引当金	114,975
固定負債計	642,273
負債合計	5,505,894
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	16,008,292
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	13,430,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,954,999
株主資本計	20,436,770
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	143,061
評価・換算差額等計	143,061
純資産合計	20,579,831
負債・純資産合計	26,085,726

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,201,192	
運用受託報酬	2,208,627	
投資助言報酬	507,704	
その他営業収益	389,513	
営業収益計		15,307,036
営業費用		
支払手数料	5,187,472	
広告宣伝費	138,372	
公告費	2,297	
調査費	2,474,627	
調査費	1,342,551	
委託調査費	1,132,076	
委託計算費	170,599	
営業雑経費	360,908	
通信費	15,757	
印刷費	314,154	
協会費	11,780	
諸会費	19	
支払販売手数料	19,198	
営業費用計		8,334,278
一般管理費		
給料	2,017,035	
役員報酬	114,069	
給料・手当	1,902,965	
交際費	19,811	
寄付金	3,335	
旅費交通費	125,337	
租税公課	48,553	
不動産賃借料	379,036	
退職給付費用	66,781	
固定資産減価償却費	1 243,188	
福利厚生費	11,501	
修繕費	20,312	
賞与引当金繰入	574,949	
役員退職慰労引当金繰入	26,751	
役員退職金	540	
機器リース料	1,135	
事務委託費	140,006	
消耗品費	35,920	
器具備品費	258	
諸経費	78,421	
一般管理費計		3,792,878
営業利益		3,179,879

(単位：千円)

	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
営業外収益		
受取配当金	4,651	
受取利息	5,935	
時効成立分配金	15	
為替差益	4,255	
投資信託解約益	86,546	
先物利益	26,131	
金銭信託運用益	20,662	
雑収入	7,666	
営業外収益計		155,865
経常利益		3,335,745
特別損失		
固定資産除却損	27,791	
固定資産売却損	1,440	
特別損失計		29,232
税引前中間純利益		3,306,512
法人税、住民税及び事業税		1,388,928
法人税等調整額		32,712
法人税等合計		1,356,215
中間純利益		1,950,296

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	前期末残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	前期末残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	前期末残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	前期末残高	11,650,000
	当中間期変動額	1,780,000
	当中間期末残高	13,430,000
	研究開発積立金	
	前期末残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	前期末残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	前期末残高	3,464,702
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	1,680,000
	別途積立金の積立	1,780,000
	中間純利益	1,950,296
	当中間期末残高	1,954,999
	利益剰余金合計	
	前期末残高	15,737,995
	当中間期変動額	270,296
	当中間期末残高	16,008,292
	株主資本合計	
	前期末残高	20,166,473
	当中間期変動額	270,296

	当中間期末残高	20,436,770
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	前期末残高	231,525
	当中間期変動額(純額)	88,464
	当中間期末残高	143,061
純資産合計		
	前期末残高	20,397,999
	当中間期変動額	181,832
	当中間期末残高	20,579,831

[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26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22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. 金銭の信託の評価基準および評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準および評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 …… 8～18年 器具備品 …… 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産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。
7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税および地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)

1. 固定資産の減価償却累計額	建物	...	468,310千円
	器具備品	...	423,931千円
	商標権	...	2,281千円
	ソフトウェア	...	667,311千円
	電話施設利用権	...	1,105千円

(中間損益計算書関係)

項目	第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)		
	1. 減価償却実施額	有形固定資産	...
	無形固定資産	...	142,297千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22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22年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(リース取引関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22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「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額および中間期末残高相当額

	器具備品
取得価額相当額	56,261千円
減価償却累計額相当額	50,252千円
中間期末残高相当額	6,009千円

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
6,401千円	-	6,401千円

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	10,125千円
減価償却費相当額	9,528千円
支払利息相当額	176千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

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

2. オペレーティング・リース取引

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

1年以内	1年超	合計
1,609千円	670千円	2,279千円

（金融商品関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,413,600	11,413,600	-
(2) 金銭の信託	2,920,386	2,920,386	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	662,154	662,154	-
資産計	14,996,141	14,996,141	-
(1) 未払法人税等	1,403,804	1,403,804	-
負債計	1,403,804	1,403,804	-
デリバティブ取引(*)	(195)	(195)	-

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（中間貸借対照表計上額1,126,064千円）につきましては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式および関連会社株式
関係会社株式(中間貸借対照表計上額2,161,144千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	339,574	146,101	193,472
債券	-	-	-
その他(投資信託)	299,201	244,802	54,398
小計	638,775	390,904	247,870
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	23,379	30,000	6,621
小計	23,379	30,000	6,621
合計	662,154	420,904	241,249

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

(金銭の信託関係)

第26期中間会計期間(自平成22年4月1日 至平成22年9月30日)

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

(デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間末（平成22年9月30日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	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	21,781	-	565	565
	香港ドル	24,339	-	128	128
	豪ドル	92,448	-	229	229
	シンガポールドル	13,986	-	17	17
	合計	152,556	-	481	481

(注1) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	292,423	-	676	676
	合計	292,423	-	676	676

(注2) 時価の算定方法

取引所の価格によっております。

(セグメント情報等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	12,201,192	2,716,331	389,513	15,307,036

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(追加情報)

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

(持分法損益等)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）	
1株当たり純資産額	857,492円 98銭
1株当たり中間純利益金額	81,262円 37銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期中間会計期間 （自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
中間純利益	1,950,296千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,950,296千円
期中平均株式数	24,000株

(重要な後発事象)

第26期中間会計期間（自平成22年4月1日 至平成22年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 受託会社
 - a. 名称
みずほ信託銀行株式会社
 - b. 資本金の額
平成22年3月末日現在 247,260百万円
 - 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22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	(1)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。

- (1)平成22年5月1日現在

- (3) 投資顧問会社
 - a . 名称
イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

- b．資本金の額
平成22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22年12月末日現在 400万ポンド
- c．事業の内容
イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

委託会社は、DIAM International Ltdの株式について100%保有しています。
その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【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22年4月12日
有価証券報告書	平成22年4月12日
半期報告書	平成22年10月12日
有価証券届出書の訂正届出書	平成22年10月12日

独立監査人の監査報告書

平成23年2月22日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成22年1月13日から平成23年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成23年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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

[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22年12月10日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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であり、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に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22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22年4月1日から平成22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22年2月24日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成21年1月14日から平成22年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成22年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月29日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山本禎良 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山内正彦 印

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

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

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

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

以上

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