

【表紙】

| | |
|---|---------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成22年12月27日 |
| 【発行者名】 | 大和住銀投信投資顧問株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 横井 正道 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区霞が関三丁目2番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | ディスクロージャー部 宮崎 洋行 |
| 【電話番号】 | 03-6205-0200 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | グローバル資産分散オープン |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 2兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当ありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成22年6月29日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、下記の箇所につき修正すべき事項がありますので、訂正を行うものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

下線部が訂正部分です。

< 訂正前 >

(2) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成22年6月29日現在）

(以下略)

・大株主の状況

| 名称 | 住所 | 所有株式数 (株) | 比率 (%) |
|-----------------------------|---|--------------|-----------|
| 株式会社大和証券グループ 本社 | 東京都千代田区丸の内1-9-1 グラントウキョウ ノースタワー | 1,692,500 | 44.0 |
| 株式会社三井住友フィナン シャルグループ | <u>東京都千代田区有楽町1-1-2</u> | 1,692,500 | 44.0 |
| ティー・アール・ピー・ エイチ・コーポレーション | アメリカ合衆国21202,メリーランド州 ボルチモア イースト プラットスト リート100 | 385,000 | 10.0 |

< 訂正後 >

(2) ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成22年10月末現在）

(以下略)

・大株主の状況

| 名称 | 住所 | 所有株式数 (株) | 比率 (%) |
|-----------------------------|---|--------------|-----------|
| 株式会社大和証券グループ 本社 | 東京都千代田区丸の内1-9-1 グラントウキョウ ノースタワー | 1,692,500 | 44.0 |
| 株式会社三井住友フィナン シャルグループ | <u>東京都千代田区丸の内1-1-2</u> | 1,692,500 | 44.0 |
| ティー・アール・ピー・ エイチ・コーポレーション | アメリカ合衆国21202,メリーランド州 ボルチモア イースト プラットスト リート100 | 385,000 | 10.0 |

2 投資方針

下線部が訂正部分です。

<訂正前>

(2)投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要は以下の通りです。

指定投資信託証券の概要は、平成22年6月29日現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。

運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

(以下略)

T・ロウ・プライス・グループ

T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド

(T.Rowe Price Global Investment Services Limited 所在地：英国ロンドン)

T・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク

(T. Rowe Price Associates, Inc. 所在地：米国メリーランド州ボルチモア)

T・ロウ・プライス・インターナショナル・インク

(T. Rowe Price International, Inc. 所在地：米国メリーランド州ボルチモア)

T・ロウ・プライス・グループの代表的な会社であるT・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。T・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、T・ロウ・プライス・インターナショナル・インクの親会社であり、T・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドの親会社であるT・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。

シービー・リチャードエリス・グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ

・エルエルシー

（CBRE Global Real Estate Securities,LLC 所在地：米国メリーランド州ボルチモア）

（以下略）

8 . T.Rowe Price Funds SICAV – Global Emerging Markets Equity Fund

< 指定投資信託証券の概要 >

| | |
|--------|---|
| 運用会社 | T . ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド |
| 投資顧問会社 | T . ロウ・プライス・インターナショナル・インク |
| 事務代行会社 | J P モルガン・バンク・ルクセンブルグ・エス・エイ |

（以下略）

| | |
|-----|---|
| その他 | - |
|-----|---|

< 運用プロセス >

（以下略）

(3) 運用体制

（以下略）

* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成22年4月末現在で約100名です。

（以下略）

< 訂正後 >

(2) 投資対象

（以下略）

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要は以下の通りです。

指定投資信託証券の概要は、平成22年10月末現在で委託会社が知り得る情報を基に作成しています。今後、指定投資信託証券の各運用会社の都合等により、記載内容が変更になることがあります。また、今後繰上償還などにより指定投資信託証券から除外される場合や、以下に記載した投資信託証券以外の投資信託証券が新たに指定投資信託証券に追加される場合があります。

運用プロセスは、実質的に運用を行う会社のものであり、将来運用プロセスは見直される場合があります。

（以下略）

T . ロウ・プライス・グループ

T . ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド^(注1)

(T.Rowe Price Global Investment Services Limited 所在地：英国ロンドン)

T . ロウ・プライス・アソシエイツ・インク

(T. Rowe Price Associates, Inc. 所在地：米国メリーランド州ボルチモア)

T . ロウ・プライス・インターナショナル・インク

(T. Rowe Price International, Inc. 所在地：米国メリーランド州ボルチモア)

T . ロウ・プライス・グループの代表的な会社であるT . ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。T . ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、T . ロウ・プライス・インターナショナル・インクの親会社であり、T . ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびT . ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド^(注1)の親会社であるT . ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。

(注1)「T . ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド」は、2010年12月31日付けで、商号を「T . ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド」に変更する予定です。なお、運用哲学、運用プロセスおよび運用体制に変更はありません。本書において、以下同じです。

シービー・リチャードエリス・グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ
・エルエルシー

(CBRE Global Real Estate Securities, LLC 所在地：米国メリーランド州ボルチモア)

（以下略）

8 . T.Rowe Price Funds SICAV – Global Emerging Markets Equity Fund

< 指定投資信託証券の概要 >

| | |
|--------|---------------------------------------|
| 運用会社 | T.ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド |
| 投資顧問会社 | T.ロウ・プライス・インターナショナル・インク [*] |
| 事務代行会社 | J Pモルガン・バンク・ルクセンブルグ・エス・エイ |

(以下略)

| | |
|-----|---|
| その他 | - |
|-----|---|

* 「T.ロウ・プライス・インターナショナル・インク」は、2010年12月31日付けで、当投資顧問業務を運用会社であるT.ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドに譲渡する予定です。

<運用プロセス>

(以下略)

(3)運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成22年10月末現在で約100名です。

(以下略)

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 投資状況

（平成22年10月末現在）

グローバル資産分散オープン

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|-----------------------------------|---------|----------------|--------|
| 親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド） | 日本 | 5,228,010,309 | 14.81% |
| 親投資信託受益証券 （グローバル好配当株マザーファンド） | 日本 | 5,201,117,005 | 14.74% |
| 親投資信託受益証券 （アジア・オセアニア債券マザーファンド） | 日本 | 3,651,593,381 | 10.35% |
| 親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド） | 日本 | 3,519,830,635 | 9.97% |
| 親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド） | 日本 | 3,468,069,052 | 9.83% |
| 親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド） | 日本 | 3,464,161,480 | 9.81% |
| 親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド） | 日本 | 1,717,271,686 | 4.87% |
| 投資証券 | ルクセンブルグ | 8,725,955,060 | 24.72% |
| 純資産総額 | | 35,296,571,980 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの投資状況>

（平成22年10月末現在）

日本好配当株マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|-------|----------------|--------|
| 株式 | 日本 | 40,941,790,800 | 94.56% |
| 純資産総額 | | 43,298,099,734 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

世界REITマザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|----------|---------------|--------|
| 投資証券 | アメリカ | 1,463,695,681 | 27.66% |
| | オーストラリア | 1,011,093,304 | 19.11% |
| | イギリス | 714,018,545 | 13.49% |
| | フランス | 527,659,789 | 9.97% |
| | シンガポール | 386,333,903 | 7.30% |
| | カナダ | 342,361,864 | 6.47% |
| | オランダ | 271,711,540 | 5.13% |
| | 日本 | 245,092,900 | 4.63% |
| | ベルギー | 150,756,678 | 2.85% |
| | ニュージーランド | 49,931,933 | 0.94% |
| | ドイツ | 25,264,751 | 0.48% |
| 純資産総額 | | 5,291,601,278 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

グローバル好配当株マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|---------|-----------------|--------|
| 株式 | アメリカ | 112,404,506,506 | 27.70% |
| | 香港 | 39,095,770,905 | 9.63% |
| | オーストラリア | 35,599,735,808 | 8.77% |
| | イギリス | 34,568,425,443 | 8.52% |
| | フランス | 23,060,739,865 | 5.68% |
| | 台湾 | 21,718,500,626 | 5.35% |
| | ドイツ | 17,867,618,851 | 4.40% |
| | シンガポール | 15,408,290,184 | 3.80% |
| | ノルウェー | 14,169,385,881 | 3.49% |
| | 韓国 | 12,160,703,240 | 3.00% |
| | フィンランド | 7,801,336,347 | 1.92% |
| | スウェーデン | 6,962,212,012 | 1.72% |
| | イタリア | 6,698,627,031 | 1.65% |
| | カナダ | 5,909,085,828 | 1.46% |
| | アイルランド | 5,403,882,334 | 1.33% |
| | ベルギー | 4,280,369,161 | 1.05% |
| | スペイン | 3,872,861,194 | 0.95% |
| | スイス | 3,728,710,249 | 0.92% |
| | ポルトガル | 3,303,987,478 | 0.81% |
| | ジャージー | 3,068,577,296 | 0.76% |
| 純資産総額 | | 405,846,656,133 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

新興国債券マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 | |
|---------|------------|---------------|-------------|-------|
| 国債証券 | ロシア | 2,648,417,541 | 10.03% | |
| | メキシコ | 2,178,655,902 | 8.25% | |
| | ブラジル | 1,891,217,858 | 7.17% | |
| | トルコ | 1,847,521,897 | 7.00% | |
| | アルゼンチン | 1,116,262,462 | 4.23% | |
| | イラク | 802,403,995 | 3.04% | |
| | インドネシア | 755,301,072 | 2.86% | |
| | ウクライナ | 752,762,340 | 2.85% | |
| | リトアニア | 692,739,355 | 2.62% | |
| | レバノン | 659,206,583 | 2.50% | |
| | ヴェネズエラ | 576,128,404 | 2.18% | |
| | ペルー | 451,514,390 | 1.71% | |
| | セルビア | 383,685,807 | 1.45% | |
| | フィリピン | 362,629,870 | 1.37% | |
| | ジャマイカ | 273,129,635 | 1.03% | |
| | ガボン | 272,922,860 | 1.03% | |
| | ハンガリー | 221,527,376 | 0.84% | |
| | コロンビア | 213,630,490 | 0.81% | |
| | エジプト | 187,765,103 | 0.71% | |
| | ウルグアイ | 174,538,941 | 0.66% | |
| | 南アフリカ | 153,104,861 | 0.58% | |
| | スリランカ | 149,768,037 | 0.57% | |
| | グレナダ | 144,145,980 | 0.55% | |
| | ガーナ | 112,113,540 | 0.42% | |
| | パキスタン | 67,495,991 | 0.26% | |
| | ドミニカ共和国 | 64,904,113 | 0.25% | |
| | ベトナム | 44,288,245 | 0.17% | |
| | 地方債証券 | アルゼンチン | 118,000,095 | 0.45% |
| | 特殊債券 | メキシコ | 306,471,987 | 1.16% |
| | | 国際機関 | 264,973,799 | 1.00% |
| ジャマイカ | | 207,280,625 | 0.79% | |
| ロシア | | 175,733,525 | 0.67% | |
| ルクセンブルグ | | 95,384,476 | 0.36% | |
| レバノン | 32,419,498 | 0.12% | | |

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|------------|----------------|-------|
| 社債券 | オランダ | 1,718,945,624 | 6.51% |
| | フィリピン | 967,412,788 | 3.67% |
| | ルクセンブルグ | 724,355,025 | 2.74% |
| | ケイマン諸島 | 683,816,152 | 2.59% |
| | アメリカ | 614,469,906 | 2.33% |
| | アイルランド | 338,429,806 | 1.28% |
| | ヴェネズエラ | 330,678,320 | 1.25% |
| | バミューダ | 271,702,432 | 1.03% |
| | アルゼンチン | 257,345,973 | 0.98% |
| | メキシコ | 242,916,714 | 0.92% |
| | トルコ | 206,047,052 | 0.78% |
| | ブラジル | 204,395,278 | 0.77% |
| | インド | 120,888,487 | 0.46% |
| | トリニダードトバゴ | 101,314,725 | 0.38% |
| | コロンビア | 65,666,502 | 0.25% |
| | インドネシア | 58,576,493 | 0.22% |
| ペルー | 41,607,793 | 0.16% | |
| 純資産総額 | | 26,392,873,814 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|-----------|---------------|------------|
| 国債証券 | イタリア | 526,515,525 | 15.20% |
| | ドイツ | 487,796,199 | 14.08% |
| | フランス | 406,827,187 | 11.74% |
| | イギリス | 336,021,018 | 9.70% |
| | スペイン | 271,434,857 | 7.84% |
| | ポーランド | 149,882,654 | 4.33% |
| | ベルギー | 105,099,960 | 3.03% |
| | アイルランド | 67,917,958 | 1.96% |
| | オーストリア | 62,025,401 | 1.79% |
| | オランダ | 58,541,749 | 1.69% |
| | スウェーデン | 49,758,739 | 1.44% |
| | ブラジル | 20,145,343 | 0.58% |
| | 特殊債券 | 国際機関 | 45,261,460 |
| ルクセンブルグ | | 29,875,872 | 0.86% |
| スウェーデン | | 26,100,858 | 0.75% |
| 社債券 | アメリカ | 174,405,959 | 5.03% |
| | イギリス | 91,686,074 | 2.65% |
| | イタリア | 67,400,012 | 1.95% |
| | フランス | 58,689,922 | 1.69% |
| | オランダ | 50,903,481 | 1.47% |
| | アイルランド | 34,974,413 | 1.01% |
| | ドイツ | 34,056,647 | 0.98% |
| | ルクセンブルグ | 24,846,805 | 0.72% |
| | スペイン | 23,233,132 | 0.67% |
| | オーストラリア | 17,902,737 | 0.52% |
| | スウェーデン | 16,729,060 | 0.48% |
| | スイス | 12,712,261 | 0.37% |
| | ケイマン諸島 | 10,315,582 | 0.30% |
| | ガンジー | 6,176,376 | 0.18% |
| | 韓国 | 6,014,669 | 0.17% |
| | カナダ | 5,921,596 | 0.17% |
| デンマーク | 5,520,986 | 0.16% | |
| 純資産総額 | | 3,464,256,055 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

コモディティ・マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|-------|---------------|--------|
| 社債券 | イギリス | 1,716,513,140 | 99.96% |
| 純資産総額 | | 1,717,241,957 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

| 投資資産の種類 | 国・地域名 | 時価合計（円） | 投資比率 |
|---------|----------|---------------|--------|
| 国債証券 | ニュージーランド | 1,164,227,637 | 31.88% |
| | 韓国 | 590,873,920 | 16.18% |
| | 香港 | 149,232,606 | 4.09% |
| | マレーシア | 112,467,378 | 3.08% |
| | シンガポール | 109,184,737 | 2.99% |
| 特殊債券 | 国際機関 | 1,151,827,002 | 31.54% |
| 純資産総額 | | 3,651,641,430 | - |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成22年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

グローバル資産分散オープン

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|---|---|----------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|---------------|----------|
| 1 | 世界REITマザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 10,397,792,978 | 0.4993 5,192,657,813 | 0.5028 5,228,010,309 | - - | 14.81% |
| 2 | グローバル好配当株マザー ファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 5,520,769,563 | 0.9532 5,262,397,548 | 0.9421 5,201,117,005 | - - | 14.74% |
| 3 | アジア・オセアニア債券マ ザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 4,176,113,199 | 0.8911 3,721,752,082 | 0.8744 3,651,593,381 | - - | 10.35% |
| 4 | 新興国債券マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 3,146,076,721 | 1.1390 3,583,695,992 | 1.1188 3,519,830,635 | - - | 9.97% |
| 5 | 日本好配当株マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 5,150,087,693 | 0.6952 3,580,855,972 | 0.6734 3,468,069,052 | - - | 9.83% |
| 6 | 欧州債券マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 - | 4,284,147,268 | 0.8225 3,524,139,542 | 0.8086 3,464,161,480 | - - | 9.81% |
| 7 | TRP FUNDS SICAV-GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND ルクセンブルグ | 投資証券 - | 4,332,578 | 775 3,357,854,367 | 795 3,448,548,449 | - - | 9.77% |

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|--|--------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|---------------|----------|
| 8 | TRP FUNDS SICAV-US AGGREGATE BOND FUND ルクセンブルグ | 投資証券 - | 3,897,340 | 875 3,411,125,856 | 876 3,417,373,575 | - - | 9.68% |
| 9 | TRP FUNDS SICAV-GLB EMERGING MARKETS EQUITY FUND JD ルクセンブルグ | 投資証券 - | 3,029,591 | 588 1,781,612,670 | 613 1,860,033,035 | - - | 5.27% |
| 10 | コモディティ・マザーファン ド 日本 | 親投資信託受 益証券 - | 2,757,783,341 | 0.6234 1,719,202,251 | 0.6227 1,717,271,686 | - - | 4.87% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの主要銘柄の明細>

日本好配当株マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|---|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|---------------|----------|
| 1 | キヤノン 日本 | 株式 電気機器 | 408,300 | 3,830 1,563,789,000 | 3,720 1,518,876,000 | - - | 3.51% |
| 2 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本 | 株式 情報・通信業 | 10,388 | 138,000 1,433,544,000 | 135,500 1,407,574,000 | - - | 3.25% |
| 3 | 三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本 | 株式 銀行業 | 3,689,700 | 406 1,498,018,200 | 375 1,383,637,500 | - - | 3.20% |
| 4 | トヨタ自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 455,800 | 2,891 1,318,006,400 | 2,859 1,303,132,200 | - - | 3.01% |
| 5 | JXホールディングス 日本 | 株式 石油・石炭製 品 | 2,650,000 | 490 1,298,500,000 | 473 1,253,450,000 | - - | 2.89% |
| 6 | 日立製作所 日本 | 株式 電気機器 | 3,430,000 | 352 1,207,360,000 | 364 1,248,520,000 | - - | 2.88% |
| 7 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 416,900 | 2,986 1,245,187,506 | 2,937 1,224,435,300 | - - | 2.83% |
| 8 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通信業 | 319,900 | 3,700 1,183,630,000 | 3,655 1,169,234,500 | - - | 2.70% |
| 9 | 住友信託銀行 日本 | 株式 銀行業 | 2,259,000 | 466 1,052,694,000 | 441 996,219,000 | - - | 2.30% |
| 10 | M S & A Dインシュアランス グループホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 441,100 | 2,024 892,786,400 | 1,933 852,646,300 | - - | 1.97% |
| 11 | リコー 日本 | 株式 電気機器 | 741,000 | 1,227 909,207,000 | 1,126 834,366,000 | - - | 1.93% |
| 12 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 389,800 | 2,036 793,632,800 | 1,935 754,263,000 | - - | 1.74% |
| 13 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 320,000 | 2,353 752,960,000 | 2,268 725,760,000 | - - | 1.68% |
| 14 | 山武 日本 | 株式 電気機器 | 369,800 | 2,051 758,459,800 | 1,959 724,438,200 | - - | 1.67% |
| 15 | アステラス製薬 日本 | 株式 医薬品 | 241,900 | 3,150 761,985,000 | 2,994 724,248,600 | - - | 1.67% |
| 16 | H O Y A 日本 | 株式 精密機器 | 383,600 | 2,031 779,091,600 | 1,882 721,935,200 | - - | 1.67% |
| 17 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 149,000 | 4,490 669,106,765 | 4,525 674,225,000 | - - | 1.56% |
| 18 | 東京瓦斯 日本 | 株式 電気・ガス業 | 1,750,000 | 362 633,500,000 | 379 663,250,000 | - - | 1.53% |
| 19 | 東日本旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 131,500 | 5,050 664,075,000 | 4,975 654,212,500 | - - | 1.51% |

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|--------------------------|--------------|-----------------|----------------------|----------------------|---------------|----------|
| 20 | イオン 日本 | 株式 小売業 | 660,000 | 982 648,120,000 | 948 625,680,000 | - - | 1.45% |
| 21 | 住友商事 日本 | 株式 卸売業 | 602,400 | 1,125 677,700,000 | 1,020 614,448,000 | - - | 1.42% |
| 22 | 東急不動産 日本 | 株式 不動産業 | 1,595,000 | 382 609,290,000 | 367 585,365,000 | - - | 1.35% |
| 23 | 横浜銀行 日本 | 株式 銀行業 | 1,472,000 | 410 603,520,000 | 396 582,912,000 | - - | 1.35% |
| 24 | 千葉銀行 日本 | 株式 銀行業 | 1,122,000 | 517 580,074,000 | 497 557,634,000 | - - | 1.29% |
| 25 | 日揮 日本 | 株式 建設業 | 355,000 | 1,615 573,325,000 | 1,540 546,700,000 | - - | 1.26% |
| 26 | みずほフィナンシャルグルー プ 日本 | 株式 銀行業 | 4,488,600 | 127 570,052,200 | 117 525,166,200 | - - | 1.21% |
| 27 | ローソン 日本 | 株式 小売業 | 141,600 | 3,860 546,576,000 | 3,660 518,256,000 | - - | 1.20% |
| 28 | 関西電力 日本 | 株式 電気・ガス業 | 238,400 | 1,995 475,685,214 | 2,038 485,859,200 | - - | 1.12% |
| 29 | ニフコ 日本 | 株式 化学 | 237,800 | 1,972 468,941,600 | 2,027 482,020,600 | - - | 1.11% |
| 30 | 参天製薬 日本 | 株式 医薬品 | 162,300 | 2,939 476,999,700 | 2,778 450,869,400 | - - | 1.04% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

世界REITマザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|-------------------------------------|-----------|-----------------|-----------------------|-----------------------|---------------|----------|
| 1 | WESTFIELD GROUP オーストラリア | 投資証券 - | 431,092 | 954 411,352,898 | 987 425,865,009 | - - | 8.05% |
| 2 | SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ | 投資証券 - | 39,152 | 7,017 274,758,279 | 7,797 305,299,308 | - - | 5.77% |
| 3 | UNIBAIL-RODAMCO SE フランス | 投資証券 - | 17,560 | 13,295 233,467,487 | 17,015 298,789,914 | - - | 5.65% |
| 4 | BRITISH LAND CO PLC イギリス | 投資証券 - | 394,715 | 615 242,772,241 | 658 260,078,640 | - - | 4.91% |
| 5 | STOCKLAND オーストラリア | 投資証券 - | 858,504 | 316 271,969,704 | 302 259,856,197 | - - | 4.91% |
| 6 | HEALTH CARE REIT INC アメリカ | 投資証券 - | 41,731 | 3,755 156,716,429 | 4,113 171,650,307 | - - | 3.24% |
| 7 | LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス | 投資証券 - | 165,086 | 874 144,381,788 | 874 144,359,328 | - - | 2.73% |
| 8 | EUROCOMMERCIAL オランダ | 投資証券 - | 30,555 | 3,239 98,981,492 | 4,080 124,677,334 | - - | 2.36% |
| 9 | DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア | 投資証券 - | 1,899,000 | 63 120,663,962 | 65 124,564,715 | - - | 2.35% |
| 10 | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ | 投資証券 - | 65,341 | 1,588 103,773,717 | 1,801 117,701,683 | - - | 2.22% |
| 11 | VORNADO REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 - | 16,233 | 6,119 99,340,803 | 7,102 115,289,071 | - - | 2.18% |
| 12 | DERWENT LONDON PLC イギリス | 投資証券 - | 54,778 | 1,815 99,456,544 | 1,959 107,325,582 | - - | 2.03% |
| 13 | CORIO NV オランダ | 投資証券 - | 17,850 | 4,797 85,632,330 | 6,008 107,258,322 | - - | 2.03% |
| 14 | ING INDUSTRIAL FUND オーストラリア | 投資証券 - | 2,474,000 | 32 81,322,252 | 41 103,625,716 | - - | 1.96% |

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|--|-----------|-----------------|-----------------------|-----------------------|---------------|----------|
| 15 | SEGRO PLC イギリス | 投資証券 - | 267,398 | 408 109,279,754 | 383 102,641,839 | - - | 1.94% |
| 16 | ICADE フランス | 投資証券 - | 11,400 | 8,667 98,810,476 | 8,988 102,469,244 | - - | 1.94% |
| 17 | CAPITACOMMERCIAL TRUST シンガポール | 投資証券 - | 1,105,000 | 69 76,614,160 | 92 101,885,420 | - - | 1.93% |
| 18 | HAMMERSON PLC イギリス | 投資証券 - | 183,800 | 531 97,706,801 | 541 99,613,154 | - - | 1.88% |
| 19 | ING OFFICE FUND オーストラリア | 投資証券 - | 2,015,870 | 46 94,321,428 | 48 97,181,665 | - - | 1.84% |
| 20 | CAPITAMALL TRUST シンガポール | 投資証券 - | 777,356 | 114 89,345,010 | 122 94,921,386 | - - | 1.79% |
| 21 | ENTERTAINMENT PROPERTIES TR アメリカ | 投資証券 - | 23,000 | 3,261 75,023,711 | 3,750 86,269,993 | - - | 1.63% |
| 22 | GLIMCHER REALTY TRUST - G アメリカ | 投資証券 - | 43,758 | 1,832 80,206,987 | 1,940 84,914,635 | - - | 1.60% |
| 23 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 - | 411 | 203,393 83,594,582 | 199,900 82,158,900 | - - | 1.55% |
| 24 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール | 投資証券 - | 641,205 | 121 77,896,789 | 125 80,693,084 | - - | 1.52% |
| 25 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 - | 15,900 | 4,424 70,344,265 | 4,828 76,770,353 | - - | 1.45% |
| 26 | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR カナダ | 投資証券 - | 42,063 | 1,519 63,935,422 | 1,807 76,036,418 | - - | 1.44% |
| 27 | KLEPIERRE フランス | 投資証券 - | 23,433 | 3,098 72,605,570 | 3,216 75,377,039 | - - | 1.42% |
| 28 | DUKE REALTY CORP アメリカ | 投資証券 - | 75,300 | 1,020 76,808,532 | 998 75,163,149 | - - | 1.42% |
| 29 | 森トラスト総合リート投資法人 日本 | 投資証券 - | 94 | 686,603 64,540,693 | 731,000 68,714,000 | - - | 1.30% |
| 30 | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST アメリカ | 投資証券 - | 36,200 | 1,887 68,344,685 | 1,862 67,407,578 | - - | 1.27% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

グローバル好配当株マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|---|----------------------------------|-------------------|-----------------|------------------------|------------------------|---------------|----------|
| 1 | VODAFONE GROUP PLC イギリス | 株式 電気通信サービス | 29,442,700 | 195 5,752,368,630 | 220 6,486,888,976 | - - | 1.60% |
| 2 | VERIZON COMM アメリカ | 株式 電気通信サービス | 2,162,900 | 2,220 4,802,060,530 | 2,621 5,670,355,754 | - - | 1.40% |
| 3 | CONSOLIDATED EDISON INC アメリカ | 株式 公益事業 | 1,396,800 | 3,712 5,185,105,632 | 4,032 5,632,409,527 | - - | 1.39% |
| 4 | OLAM INTERNATIONAL LTD シンガポール | 株式 食品・生活必需品小売り | 28,927,000 | 162 4,707,492,420 | 191 5,532,606,947 | - - | 1.36% |
| 5 | CBS CORP-CL B アメリカ | 株式 メディア | 4,046,900 | 1,162 4,704,822,076 | 1,363 5,519,184,073 | - - | 1.36% |
| 6 | AT&T INC アメリカ | 株式 電気通信サービス | 2,392,900 | 2,065 4,941,658,836 | 2,305 5,516,507,908 | - - | 1.36% |
| 7 | FOSTER'S GROUP LTD | 株式 | 11,458,000 | 454 | 472 | - | 1.33% |

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|----------------------------------|--|-----------------|------------------------|-------------------------|---------------|----------|
| | オーストラリア | 食品・飲料・ タバコ | | 5,203,689,660 | 5,415,043,925 | - | |
| 8 | XL GROUP PLC アイルランド | 株式 保険 | 3,136,400 | 1,631 5,117,215,835 | 1,722 5,403,882,334 | - | 1.33% |
| 9 | YARA INTERNATIONAL ASA ノルウェー | 株式 素材 | 1,317,900 | 3,631 4,786,407,358 | 4,088 5,388,621,612 | - | 1.33% |
| 10 | PPG INDUSTRIES INC アメリカ | 株式 素材 | 846,600 | 5,703 4,829,005,004 | 6,196 5,245,680,908 | - | 1.29% |
| 11 | TELENOR ASA ノルウェー | 株式 電気通信サー ビス | 3,821,900 | 1,297 4,958,960,841 | 1,281 4,898,512,031 | - | 1.21% |
| 12 | SAMPO OYJ-A SHS フィンランド | 株式 保険 | 2,100,200 | 2,025 4,254,143,869 | 2,302 4,836,497,024 | - | 1.19% |
| 13 | J.C. PENNEY CO INC アメリカ | 株式 小売 | 1,826,700 | 2,112 3,859,680,491 | 2,563 4,682,570,269 | - | 1.15% |
| 14 | STARBUCKS CORP アメリカ | 株式 消費者サー ビス | 2,005,500 | 1,945 3,901,017,769 | 2,283 4,579,608,785 | - | 1.13% |
| 15 | WESFARMERS LIMITED オーストラリア | 株式 食品・生活必 需品小売り | 1,717,600 | 2,266 3,892,858,838 | 2,649 4,551,426,845 | - | 1.12% |
| 16 | LINDE AG ドイツ | 株式 素材 | 378,800 | 9,873 3,739,920,017 | 11,739 4,446,957,639 | - | 1.10% |
| 17 | SUN HUNG KAI PROPERTIES 香港 | 株式 不動産 | 3,190,000 | 1,105 3,526,800,200 | 1,381 4,408,500,250 | - | 1.09% |
| 18 | DELTA ELECTRONICS INC 台湾 | 株式 テクノロジー ・ハードウェ アおよび機器 | 13,056,547 | 294 3,843,325,174 | 335 4,377,599,078 | - | 1.08% |
| 19 | WOOLWORTHS LIMITED オーストラリア | 株式 食品・生活必 需品小売り | 1,937,200 | 2,108 4,084,625,718 | 2,251 4,361,731,136 | - | 1.07% |
| 20 | SNAM RETE GAS イタリア | 株式 公益事業 | 9,925,500 | 406 4,036,568,819 | 434 4,311,009,610 | - | 1.06% |
| 21 | SCHNEIDER ELECTRIC フランス | 株式 資本財 | 375,700 | 9,320 3,501,798,148 | 11,446 4,300,565,202 | - | 1.06% |
| 22 | BELGACOM SA ベルギー | 株式 電気通信サー ビス | 1,338,400 | 3,007 4,025,332,822 | 3,198 4,280,369,161 | - | 1.05% |
| 23 | HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS 香港 | 株式 公益事業 | 8,324,500 | 480 3,998,269,836 | 510 4,245,719,761 | - | 1.05% |
| 24 | CHEUNG KONG HOLDING 香港 | 株式 不動産 | 3,400,000 | 944 3,212,857,200 | 1,235 4,202,247,000 | - | 1.04% |
| 25 | PFIZER INC アメリカ | 株式 医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフ サイエンス | 2,932,300 | 1,312 3,848,689,207 | 1,421 4,167,494,134 | - | 1.03% |
| 26 | TEXAS INSTRUMENTS INC アメリカ | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 1,761,400 | 2,275 4,008,337,137 | 2,365 4,166,104,849 | - | 1.03% |
| 27 | LIMITED BRANDS INC アメリカ | 株式 小売 | 1,748,300 | 2,047 3,579,714,851 | 2,368 4,140,777,219 | - | 1.02% |
| 28 | BNP PARIBAS フランス | 株式 銀行 | 684,100 | 5,753 3,935,778,477 | 5,943 4,065,986,522 | - | 1.00% |
| 29 | FORMOSA PLASTICS CORP 台湾 | 株式 素材 | 17,000,000 | 231 3,940,836,361 | 238 4,052,664,000 | - | 1.00% |
| 30 | ALTRIA GROUP INC アメリカ | 株式 食品・飲料・ タバコ | 1,976,200 | 1,776 3,509,752,156 | 2,049 4,050,721,088 | - | 1.00% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

[次へ](#)

新興国債券マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数・口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|------------------------------------|-----------|-----------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------|----------|
| 1 | RUSSIAN FEDERATION ロシア | 国債証券 - | 27,279,600 | 8,987.68 2,451,805,307 | 9,708.41 2,648,417,541 | 7.5000 2030/03/31 | 10.03% |
| 2 | FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル | 国債証券 - | 8,785,000 | 10,431.00 916,364,067 | 11,444.64 1,005,411,690 | 8.8750 2019/10/14 | 3.81% |
| 3 | MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ | 国債証券 - | 99,000,000 | 782.61 774,790,590 | 889.52 880,631,136 | 10.0000 2036/11/20 | 3.34% |
| 4 | NATIONAL POWER CORP フィリピン | 社債券 - | 9,020,000 | 8,990.92 810,981,299 | 9,492.11 856,189,038 | 6.8750 2016/11/02 | 3.24% |
| 5 | REPUBLIC OF TURKEY トルコ | 国債証券 - | 8,547,000 | 8,707.80 744,256,392 | 9,896.89 845,887,316 | 7.0000 2020/06/05 | 3.20% |
| 6 | REPUBLIC OF IRAQ イラク | 国債証券 - | 10,611,000 | 6,562.20 696,315,174 | 7,562.00 802,403,995 | 5.8000 2028/01/15 | 3.04% |
| 7 | FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル | 国債証券 - | 7,000,000 | 9,195.57 643,690,264 | 10,687.59 748,131,387 | 7.1250 2037/01/20 | 2.83% |
| 8 | REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン | 国債証券 - | 8,711,945 | 6,047.41 526,847,667 | 7,723.86 672,898,654 | 7.0000 2015/10/03 | 2.55% |
| 9 | TURKEY REP OF トルコ | 国債証券 - | 5,750,000 | 9,087.18 522,512,999 | 10,924.19 628,141,183 | 8.0000 2034/02/14 | 2.38% |
| 10 | UNITED MEXICAN STATES メキシコ | 国債証券 - | 5,950,000 | 8,564.22 509,571,610 | 9,585.46 570,335,167 | 5.9500 2019/03/19 | 2.16% |
| 11 | LEBANESE REPUBLIC レバノン | 国債証券 - | 6,000,000 | 9,322.57 559,354,350 | 9,403.46 564,207,750 | 8.5000 2015/08/06 | 2.14% |
| 12 | KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB オランダ | 社債券 - | 5,500,000 | 9,970.90 548,399,821 | 10,059.88 553,293,666 | 11.7500 2015/01/23 | 2.10% |
| 13 | MEXICAN BONOS メキシコ | 国債証券 - | 75,580,000 | 680.58 514,388,372 | 724.13 547,304,898 | 8.0000 2015/12/17 | 2.07% |
| 14 | REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア | 国債証券 - | 5,500,000 | 8,233.71 452,854,171 | 9,741.34 535,773,701 | 6.6250 2037/02/17 | 2.03% |
| 15 | INTERGAS FINANCE BV オランダ | 社債券 - | 5,350,000 | 8,372.11 447,908,152 | 8,813.77 471,536,930 | 6.3750 2017/05/14 | 1.79% |
| 16 | REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン | 国債証券 - | 5,781,720 | 6,393.06 369,629,000 | 7,668.37 443,363,808 | 8.2800 2033/12/31 | 1.68% |
| 17 | REPUBLIC OF SERBIA セルビア | 国債証券 - | 4,767,139 | 7,927.21 377,901,173 | 8,048.55 383,685,807 | 6.7500 2024/11/01 | 1.45% |
| 18 | REPUBLIC OF LITHUANIA リトアニア | 国債証券 - | 3,904,000 | 9,032.99 352,648,044 | 9,447.14 368,816,466 | 7.3750 2020/02/11 | 1.40% |
| 19 | REPUBLIC OF VENEZUELA ヴェネズエラ | 国債証券 - | 4,766,000 | 6,744.68 321,451,882 | 6,810.53 324,590,028 | 8.5000 2014/10/08 | 1.23% |
| 20 | REPUBLIC OF LITHUANIA リトアニア | 国債証券 - | 3,586,000 | 8,564.22 307,113,242 | 9,032.98 323,922,888 | 6.7500 2015/01/15 | 1.23% |
| 21 | PETROLEOS MEXICANOS メキシコ | 特殊債券 - | 3,500,000 | 8,308.21 290,787,416 | 8,756.34 306,471,987 | 4.8750 2015/03/15 | 1.16% |
| 22 | REPUBLIC OF PERU ペルー | 国債証券 - | 2,863,000 | 8,539.15 244,475,946 | 9,929.24 284,274,355 | 6.5500 2037/03/14 | 1.08% |
| 23 | GABONESE REPUBLIC ガボン | 国債証券 - | 2,800,000 | 8,914.88 249,616,833 | 9,747.24 272,922,860 | 8.2000 2017/12/12 | 1.03% |
| 24 | DIGICEL GROUP LTD バミューダ | 社債券 - | 3,285,000 | 8,149.66 267,716,577 | 8,271.00 271,702,432 | 8.8750 2015/01/15 | 1.03% |
| 25 | REPUBLIC OF TURKEY トルコ | 国債証券 - | 3,000,000 | 8,118.05 243,541,751 | 9,039.45 271,183,725 | 5.6250 2021/03/30 | 1.03% |
| 26 | PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ | 社債券 - | 5,650,000 | 4,893.84 276,502,242 | 4,711.84 266,219,101 | 5.2500 2017/04/12 | 1.01% |
| 27 | CENTRAL AMERICAN BANK 国際機関 | 特殊債券 - | 3,000,000 | 8,463.52 253,905,621 | 8,832.45 264,973,799 | 5.3750 2014/09/24 | 1.00% |
| 28 | PEMEX PROJ FDG MASTER TR アメリカ | 社債券 - | 2,882,000 | 8,271.48 238,384,279 | 9,096.40 262,158,365 | 5.7500 2018/03/01 | 0.99% |
| 29 | TRANSCAPIT (TRANSNEFT) アイルランド | 社債券 - | 2,550,000 | 9,332.27 237,973,122 | 10,209.12 260,332,735 | 8.7000 2018/08/07 | 0.99% |
| 30 | REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン | 国債証券 - | 2,700,000 | 7,976.90 215,376,520 | 9,423.68 254,439,495 | 6.3750 2034/10/23 | 0.96% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|----|----------------------------------|-----------|-----------------|--------------------------|--------------------------|----------------------|----------|
| 1 | BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア | 国債証券 - | 1,285,000 | 12,771.39 164,112,408 | 12,617.95 162,140,663 | 5.2500 2017/08/01 | 4.68% |
| 2 | FRANCE OAT. フランス | 国債証券 - | 1,324,000 | 12,080.80 159,949,802 | 12,007.60 158,980,680 | 4.0000 2013/04/25 | 4.59% |
| 3 | BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア | 国債証券 - | 843,000 | 13,874.67 116,963,536 | 13,791.34 116,261,052 | 6.5000 2027/11/01 | 3.36% |
| 4 | UK GILT イギリス | 国債証券 - | 883,000 | 12,380.01 109,315,513 | 12,967.66 114,504,463 | 4.2500 2046/12/07 | 3.31% |
| 5 | FRANCE O.A.T. フランス | 国債証券 - | 728,000 | 14,164.19 103,115,337 | 15,397.95 112,097,101 | 5.7500 2032/10/25 | 3.24% |
| 6 | BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア | 国債証券 - | 900,000 | 12,144.98 109,304,896 | 12,083.05 108,747,477 | 4.5000 2018/02/01 | 3.14% |
| 7 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 869,000 | 12,291.41 106,812,431 | 12,247.46 106,430,458 | 3.7500 2015/01/04 | 3.07% |
| 8 | BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア | 国債証券 - | 1,026,000 | 10,102.24 103,649,014 | 10,186.70 104,515,548 | 4.0000 2037/02/01 | 3.02% |
| 9 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 890,000 | 11,373.61 101,225,129 | 11,351.08 101,024,683 | 5.2500 2011/01/04 | 2.92% |
| 10 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン | 国債証券 - | 728,000 | 12,150.84 88,458,145 | 11,859.85 86,339,780 | 5.0000 2012/07/30 | 2.49% |
| 11 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 603,000 | 11,898.00 71,744,968 | 13,042.49 78,646,215 | 4.0000 2037/01/04 | 2.27% |
| 12 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 667,000 | 11,904.74 79,404,681 | 11,683.28 77,927,527 | 3.0000 2020/07/04 | 2.25% |
| 13 | POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド | 国債証券 - | 2,714,000 | 2,821.50 76,575,705 | 2,825.87 76,694,208 | 5.0000 2013/10/24 | 2.21% |
| 14 | UK GILT イギリス | 国債証券 - | 474,000 | 14,063.97 66,663,240 | 14,375.81 68,141,370 | 4.5000 2019/03/07 | 1.97% |
| 15 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン | 国債証券 - | 516,000 | 13,027.99 67,224,449 | 12,524.14 64,624,595 | 5.7500 2032/07/30 | 1.87% |
| 16 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 社債券 - | 550,000 | 11,709.18 64,400,532 | 11,561.10 63,586,081 | 3.6250 2011/12/12 | 1.84% |
| 17 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン | 国債証券 - | 500,000 | 12,110.52 60,552,649 | 11,950.17 59,750,866 | 4.4000 2015/01/31 | 1.72% |
| 18 | FRANCE OAT. フランス | 国債証券 - | 449,000 | 12,859.15 57,737,613 | 12,992.94 58,338,308 | 5.0000 2016/10/25 | 1.68% |
| 19 | IRISH GOVT TREASURY アイルランド | 国債証券 - | 468,000 | 12,447.33 58,253,535 | 10,749.52 50,307,778 | 5.9000 2019/10/18 | 1.45% |
| 20 | FRANCE O.A.T. フランス | 国債証券 - | 408,000 | 12,166.77 49,640,456 | 12,251.96 49,988,029 | 4.0000 2014/10/25 | 1.44% |
| 21 | UK GILT イギリス | 国債証券 - | 321,000 | 14,102.18 45,268,024 | 14,635.24 46,979,143 | 4.7500 2015/09/07 | 1.36% |
| 22 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関 | 特殊債券 - | 305,000 | 14,628.79 44,617,821 | 14,839.82 45,261,460 | 6.2500 2014/04/15 | 1.31% |
| 23 | POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド | 国債証券 - | 1,577,000 | 2,860.38 45,108,220 | 2,849.76 44,940,742 | 5.5000 2015/04/25 | 1.30% |
| 24 | BELGIUM KINGDOM ベルギー | 国債証券 - | 331,000 | 12,560.85 41,576,437 | 13,486.17 44,639,234 | 5.0000 2035/03/28 | 1.29% |
| 25 | NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ | 国債証券 - | 297,000 | 13,586.39 40,351,597 | 14,805.96 43,973,709 | 5.5000 2028/01/15 | 1.27% |
| 26 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 325,000 | 12,302.20 39,982,150 | 12,088.68 39,288,221 | 4.5000 2013/01/04 | 1.13% |
| 27 | REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア | 国債証券 - | 249,000 | 14,686.25 36,568,783 | 15,423.74 38,405,115 | 6.2500 2027/07/15 | 1.11% |
| 28 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン | 国債証券 - | 326,000 | 11,537.32 37,611,681 | 11,401.19 37,167,910 | 3.8000 2017/01/31 | 1.07% |
| 29 | UK GILT イギリス | 国債証券 - | 286,000 | 12,385.09 35,421,357 | 12,977.98 37,117,047 | 4.2500 2039/09/07 | 1.07% |
| 30 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ | 国債証券 - | 257,000 | 13,476.56 34,634,759 | 14,278.94 36,696,896 | 4.7500 2034/07/04 | 1.06% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

コモディティ・マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|---|---------------------------------|----------|-----------------|---------------------------|---------------------------|----------------------|----------|
| 1 | DJUBS/BARCLAYS 10/19/11 イギリス | 社債券 - | 21,300,000 | 8,091.71 1,723,535,363 | 8,058.74 1,716,513,140 | 0.5000 2011/10/19 | 99.96% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

| | 銘柄名 国・地域 | 種類 業種 | 株数、口数 又は額面金額 | 簿価単価(円) 簿価(円) | 評価単価(円) 時価(円) | 利率(%) 償還期限 | 投資 比率 |
|---|------------------------------------|-----------|-----------------|-------------------------|-------------------------|----------------------|----------|
| 1 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関 | 特殊債券 - | 12,600,000 | 7,720.59 972,795,443 | 7,865.77 991,087,885 | 5.3750 2014/05/20 | 27.14% |
| 2 | NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド | 国債証券 - | 9,700,000 | 6,419.89 622,730,020 | 6,451.90 625,834,917 | 6.5000 2013/04/15 | 17.14% |
| 3 | KOREA TREASURY BOND 韓国 | 国債証券 - | 8,000,000,000 | 7.37 590,170,224 | 7.38 590,873,920 | 4.7500 2012/03/10 | 16.18% |
| 4 | NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド | 国債証券 - | 8,300,000 | 6,398.98 531,115,706 | 6,486.65 538,392,719 | 6.0000 2017/12/15 | 14.74% |
| 5 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関 | 特殊債券 - | 2,000,000 | 8,034.74 160,694,860 | 8,036.95 160,739,117 | 6.0000 2013/08/14 | 4.40% |
| 6 | HONG KONG GOVERNMENT 香港 | 国債証券 - | 13,600,000 | 1,111.83 151,209,968 | 1,097.29 149,232,606 | 4.0600 2012/03/19 | 4.09% |
| 7 | MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア | 国債証券 - | 4,300,000 | 2,636.55 113,371,764 | 2,615.52 112,467,378 | 3.7560 2011/04/28 | 3.08% |
| 8 | SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール | 国債証券 - | 1,700,000 | 6,482.50 110,202,532 | 6,422.63 109,184,737 | 2.6250 2012/04/01 | 2.99% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

グローバル資産分散オープン

| 種類別 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 74.37% |
| 投資証券 | 24.72% |
| 合計 | 99.09% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの投資有価証券の種類別投資比率>

日本好配当株マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|-----|--------|
| 株式 | 94.56% |
| 合計 | 94.56% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

世界REITマザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|------|--------|
| 投資証券 | 98.04% |
| 合計 | 98.04% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

グローバル好配当株マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|-----|--------|
| 株式 | 92.91% |
| 合計 | 92.91% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

新興国債券マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|-------|--------|
| 国債証券 | 65.16% |
| 社債券 | 26.33% |
| 特殊債券 | 4.10% |
| 地方債証券 | 0.45% |
| 合計 | 96.04% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 73.38% |
| 社債券 | 18.52% |
| 特殊債券 | 2.92% |
| 合計 | 94.82% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

コモディティ・マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|-----|--------|
| 社債券 | 99.96% |
| 合計 | 99.96% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

| 種類別 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 58.22% |
| 特殊債券 | 31.54% |
| 合計 | 89.76% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

グローバル資産分散オープン
該当事項はありません。

<参考：マザーファンドの投資株式の業種別投資比率>

日本好配当株マザーファンド

| 業種別 | 投資比率 |
|---------|--------|
| (国内) | |
| 電気機器 | 12.13% |
| 銀行業 | 9.34% |
| 化学 | 8.83% |
| 情報・通信業 | 8.40% |
| 輸送用機器 | 7.45% |
| 医薬品 | 6.38% |
| 電気・ガス業 | 5.58% |
| 卸売業 | 4.95% |
| 建設業 | 4.37% |
| 小売業 | 3.65% |
| 保険業 | 3.65% |
| 石油・石炭製品 | 3.27% |
| 不動産業 | 2.90% |
| 精密機器 | 2.63% |
| 陸運業 | 1.74% |
| ゴム製品 | 1.57% |
| サービス業 | 1.49% |
| 食料品 | 1.29% |
| 機械 | 1.15% |
| その他製品 | 1.13% |
| その他金融業 | 0.98% |
| 鉄鋼 | 0.62% |

| 業種別 | 投資比率 |
|-------|--------|
| パルプ・紙 | 0.51% |
| 非鉄金属 | 0.36% |
| 金属製品 | 0.19% |
| 小計 | 94.56% |
| 合計 | 94.56% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

世界REITマザーファンド
該当事項はありません。

グローバル好配当株マザーファンド

| 業種別 | 投資比率 |
|------------------------|--------|
| (海外) | |
| 素材 | 14.08% |
| 電気通信サービス | 10.14% |
| 銀行 | 9.76% |
| 公益事業 | 6.80% |
| 食品・飲料・タバコ | 6.56% |
| 資本財 | 6.09% |
| 小売 | 3.94% |
| 不動産 | 3.88% |
| エネルギー | 3.84% |
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.57% |
| 食品・生活必需品小売り | 3.56% |
| 保険 | 3.12% |
| 半導体・半導体製造装置 | 3.08% |
| メディア | 2.95% |
| 消費者サービス | 2.78% |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.71% |
| 耐久消費財・アパレル | 1.45% |
| 各種金融 | 1.02% |
| 自動車・自動車部品 | 0.97% |
| ソフトウェア・サービス | 0.97% |
| 運輸 | 0.83% |
| 家庭用品・パーソナル用品 | 0.83% |
| 小計 | 92.91% |
| 合計 | 92.91% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

新興国債券マザーファンド
該当事項はありません。

欧州債券マザーファンド
該当事項はありません。

コモディティ・マザーファンド
該当事項はありません。

アジア・オセアニア債券マザーファンド
該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成22年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

該当事項はありません。

<参考：マザーファンドの投資不動産物件>

日本好配当株マザーファンド

該当事項はありません。

世界REITマザーファンド

該当事項はありません。

グローバル好配当株マザーファンド

該当事項はありません。

新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

欧州債券マザーファンド

該当事項はありません。

コモディティ・マザーファンド

該当事項はありません。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（平成22年10月末現在）

グローバル資産分散オープン

該当事項はありません。

<参考：マザーファンドのその他投資資産の主要なもの>

日本好配当株マザーファンド

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価(円) | 時価(円) | 投資比率 |
|--------|----|-------------------|---------|-----|---------------|---------------|-------|
| 株価指数先物 | 日本 | TOPIX 先物 2212月 | 買建 | 214 | 1,794,390,000 | 1,724,840,000 | 3.98% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

世界REITマザーファンド

該当事項はありません。

グローバル好配当株マザーファンド

該当事項はありません。

新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

欧州債券マザーファンド

該当事項はありません。

コモディティ・マザーファンド

該当事項はありません。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

グローバル資産分散オープン

| | 純資産総額（百万円） | | 1口当りの純資産額（円） | |
|-------------------------|------------|---------|--------------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 設定時 （平成19年5月22日） | 3,000 | - | 1.0000 | - |
| 第1特定期間末 （平成19年9月27日） | 136,194 | 136,891 | 0.9696 | 0.9746 |

| | 純資産総額（百万円） | | 1口当りの純資産額（円） | |
|-------------------------|------------|---------|--------------|--------|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第2特定期間末 （平成20年3月27日） | 111,903 | 114,044 | 0.8028 | 0.8178 |
| 第3特定期間末 （平成20年9月29日） | 91,800 | 93,739 | 0.7555 | 0.7705 |
| 第4特定期間末 （平成21年3月27日） | 58,671 | 60,384 | 0.5357 | 0.5507 |
| 第5特定期間末 （平成21年9月28日） | 55,505 | 56,379 | 0.6138 | 0.6228 |
| 平成21年11月末日 | 51,503 | - | 0.6108 | - |
| 平成21年12月末日 | 52,796 | - | 0.6531 | - |
| 平成22年1月末日 | 48,976 | - | 0.6241 | - |
| 平成22年2月末日 | 47,131 | - | 0.6196 | - |
| 第6特定期間末 （平成22年3月29日） | 48,227 | 48,936 | 0.6584 | 0.6674 |
| 平成22年3月末日 | 48,718 | - | 0.6663 | - |
| 平成22年4月末日 | 48,142 | - | 0.6800 | - |
| 平成22年5月末日 | 42,134 | - | 0.6157 | - |
| 平成22年6月末日 | 39,720 | - | 0.5979 | - |
| 平成22年7月末日 | 39,734 | - | 0.6154 | - |
| 平成22年8月末日 | 37,163 | - | 0.5974 | - |
| 第7特定期間末 （平成22年9月27日） | 37,347 | 37,927 | 0.6243 | 0.6333 |
| 平成22年9月末日 | 37,123 | - | 0.6240 | - |
| 平成22年10月末日 | 35,296 | - | 0.6152 | - |

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

グローバル資産分散オープン

| 期間 | 1口当りの分配金（円） |
|-------------------------------|-------------|
| 第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日） | 0.0050 |
| 第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日） | 0.0150 |
| 第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日） | 0.0150 |
| 第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日） | 0.0150 |
| 第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日） | 0.0090 |
| 第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日） | 0.0090 |
| 第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日） | 0.0090 |

収益率の推移

グローバル資産分散オープン

| 期間 | 収益率 |
|-------------------------------|-------|
| 第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日） | 2.5% |
| 第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日） | 15.7% |
| 第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日） | 4.0% |
| 第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日） | 27.1% |
| 第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日） | 16.3% |
| 第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日） | 8.7% |
| 第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日） | 3.8% |

（注）収益率 = (当特定期末分配付基準価額 - 前特定期末分配落基準価額) ÷ 前特定期末分配落基準価額 × 100

[前へ](#)

第2【財務ハイライト情報】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

以下の情報は、「ファンドの詳細情報」に記載されている財務諸表の内容の一部を抜粋したものです。当該財務諸表については、有限責任あずさ監査法人による監査を受けており、当該監査証明にかかる監査報告書は、当該財務諸表に添付されております。なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任あずさ監査法人となりました。

グローバル資産分散オープン

1 貸借対照表

| 区 分 | 前 期 平成22年3月29日現在 金 額（円） | 当 期 平成22年9月27日現在 金 額（円） |
|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,529,630 | 1,394,001 |
| コール・ローン | 1,034,472,095 | 584,608,957 |
| 投資証券 | 11,811,808,953 | 9,172,954,953 |
| 親投資信託受益証券 | 35,742,256,276 | 27,863,014,007 |
| 未収入金 | 300,136,308 | 300,000,000 |
| 流動資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |
| 資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 103,853 | - |
| 未払収益分配金 | 219,750,957 | 179,475,322 |
| 未払解約金 | 319,876,595 | 295,486,815 |
| 未払受託者報酬 | 3,377,421 | 2,730,165 |
| 未払委託者報酬 | 118,210,300 | 95,556,366 |
| その他未払費用 | 900,493 | 844,749 |
| 流動負債合計 | 662,219,619 | 574,093,417 |
| 負債合計 | 662,219,619 | 574,093,417 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 73,250,319,029 | 59,825,107,440 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 25,022,335,386 | 22,477,228,939 |
| （分配準備積立金） | 932,316,883 | 886,506,854 |
| 元本等合計 | 48,227,983,643 | 37,347,878,501 |
| 純資産合計 | 48,227,983,643 | 37,347,878,501 |

| | | |
|---------|----------------|----------------|
| 負債純資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |
|---------|----------------|----------------|

2 損益及び剰余金計算書

| 区 分 | 前 期 | 当 期 |
|---|--|--|
| | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 金 額（円） | 自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日 金 額（円） |
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 349,928,823 | 273,493,410 |
| 受取利息 | 353,013 | 278,732 |
| 有価証券売買等損益 | 3,910,770,484 | 931,838,150 |
| 為替差損益 | 494,749,724 | 897,141,684 |
| 営業収益合計 | 4,755,802,044 | 1,555,207,692 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 10,892,633 | 8,795,472 |
| 委託者報酬 | 381,243,747 | 307,842,953 |
| その他費用 | 1,073,939 | 1,007,784 |
| 営業費用合計 | 393,210,319 | 317,646,209 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 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（ ） | 356,820,101 | 32,626,232 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 34,917,442,669 | 25,022,335,386 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 6,757,957,146 | 5,156,624,913 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金 減少額 | 6,757,957,146 | 5,156,624,913 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 159,896,809 | 126,481,928 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金 増加額 | 159,896,809 | 126,481,928 |
| 分配金 | 708,724,678 | 579,556,405 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 25,022,335,386 | 22,477,228,939 |

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目 | 前期 | 当期 |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 | 自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券 移動平均法に基づき、当該投資証券の時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（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の提示する気配相場に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p> <p>同左</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p> <p>(2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> | <p>(1)受取配当金 同左</p> <p>(2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1)外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p> <p>(2)当ファンドの特定期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成21年 9月29日から平成22年 3月29日までとなっております。</p> | <p>(1)外貨建資産等の会計処理 同左</p> <p>(2)当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成22年 3月30日から平成22年 9月27日までとなっております。</p> |

第三部【ファンドの詳細情報】

第3【管理及び運営】

1 資産管理等の概要

下線部が訂正部分です。

< 訂正前 >

(5) その他

(以下略)

委託会社と関係法人との契約の変更

(以下略)

□ 運用委託契約

運用委託契約は、当事者間の合意等により変更することができます。なお、当ファンドの投資顧問会社に異動があれば、委託会社は、有価証券届出書の訂正届出書を提出します。

(イ) 委託会社とT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドとの間の運用委託契約には期限の定めがありません。

(ロ) 委託会社とシービー・リチャードエリス・グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・エルエルシーとの間の運用委託契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。

< 訂正後 >

(5) その他

(以下略)

委託会社と関係法人との契約の変更

(以下略)

□ 運用委託契約

運用委託契約は、当事者間の合意等により変更することができます。なお、当ファンドの投資顧問会社に異動があれば、委託会社は、有価証券届出書の訂正届出書を提出します。

(イ) 委託会社とT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドとの間の運用委託契約には期限の定めがありません。

「T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッド」は、2010年12月31日付けで、商号を「T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド」に変更する予定です。なお、運用哲学、運用プロセスおよび運用体制に変更はありません。

(ロ) 委託会社とシービー・リチャードエリス・グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・エルエルシーとの間の運用委託契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。

第4【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

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。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
ただし、前特定期間（平成21年9月29日から平成22年3月29日まで）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産の計算に関する規則に基づき、当特定期間（平成22年3月30日から平成22年9月27日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産の計算に関する規則に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前特定期間（平成21年9月29日から平成22年3月29日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人による監査を受け、当特定期間（平成22年3月30日から平成22年9月27日まで）の財務諸表については、有限責任あずさ監査法人による監査を受けております。
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任あずさ監査法人となりました。

[次へ](#)

1 財務諸表

グローバル資産分散オープン

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 前 期 平成22年3月29日現在 金 額（円） | 当 期 平成22年9月27日現在 金 額（円） |
|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,529,630 | 1,394,001 |
| コール・ローン | 1,034,472,095 | 584,608,957 |
| 投資証券 | 11,811,808,953 | 9,172,954,953 |
| 親投資信託受益証券 | 35,742,256,276 | 27,863,014,007 |
| 未収入金 | 300,136,308 | 300,000,000 |
| 流動資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |
| 資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 103,853 | - |
| 未払収益分配金 | 219,750,957 | 179,475,322 |
| 未払解約金 | 319,876,595 | 295,486,815 |
| 未払受託者報酬 | 3,377,421 | 2,730,165 |
| 未払委託者報酬 | 118,210,300 | 95,556,366 |
| その他未払費用 | 900,493 | 844,749 |
| 流動負債合計 | 662,219,619 | 574,093,417 |
| 負債合計 | 662,219,619 | 574,093,417 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 73,250,319,029 | 59,825,107,440 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 25,022,335,386 | 22,477,228,939 |
| （分配準備積立金） | 932,316,883 | 886,506,854 |
| 元本等合計 | 48,227,983,643 | 37,347,878,501 |
| 純資産合計 | 48,227,983,643 | 37,347,878,501 |
| 負債純資産合計 | 48,890,203,262 | 37,921,971,918 |

(2) 損益及び剰余金計算書

| 区 分 | 前 期 | 当 期 |
|--|---|---|
| | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 金 額 (円) | 自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日 金 額 (円) |
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 349,928,823 | 273,493,410 |
| 受取利息 | 353,013 | 278,732 |
| 有価証券売買等損益 | 3,910,770,484 | 931,838,150 |
| 為替差損益 | 494,749,724 | 897,141,684 |
| 営業収益合計 | 4,755,802,044 | 1,555,207,692 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 10,892,633 | 8,795,472 |
| 委託者報酬 | 381,243,747 | 307,842,953 |
| その他費用 | 1,073,939 | 1,007,784 |
| 営業費用合計 | 393,210,319 | 317,646,209 |
| 営業利益又は営業損失 () | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 経常利益又は経常損失 () | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 当期純利益又は当期純損失 () | 4,362,591,725 | 1,872,853,901 |
| 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 () | 356,820,101 | 32,626,232 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 () | 34,917,442,669 | 25,022,335,386 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 6,757,957,146 | 5,156,624,913 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金 減少額 | 6,757,957,146 | 5,156,624,913 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 159,896,809 | 126,481,928 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金 増加額 | 159,896,809 | 126,481,928 |
| 分配金 | 708,724,678 | 579,556,405 |
| 期末剰余金又は期末欠損金 () | 25,022,335,386 | 22,477,228,939 |

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 前期 | 当期 |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 | 自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券 移動平均法に基づき、当該投資証券の時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（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の提示する気配相場に基づいて評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p> <p>同左</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p> <p>(2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> | <p>(1)受取配当金 同左</p> <p>(2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1)外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p> <p>(2)当ファンドの特定期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成21年9月29日から平成22年3月29日までとなっております。</p> | <p>(1)外貨建資産等の会計処理 同左</p> <p>(2)当ファンドの特定期間は、前計算期末が休日のため、平成22年3月30日から平成22年9月27日までとなっております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 前期 | 当期 |
|-----------|-----------------|-----------------|
| | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
| 1. 元本状況 | | |
| 期首元本額 | 90,423,333,118円 | 73,250,319,029円 |
| 期中追加設定元本額 | 420,700,426円 | 337,246,711円 |
| 期中一部解約元本額 | 17,593,714,515円 | 13,762,458,300円 |
| 2. 受益権の総数 | 73,250,319,029口 | 59,825,107,440口 |
| 3. 元本の欠損 | 25,022,335,386円 | 22,477,228,939円 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 前期 | 当期 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--------------------------------|--------------|-----------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|------------------|--------------|-------------------------------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|------------------|--------------|-------------------------------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|--|------------------|--------------|-----------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|------------------|--------------|-------------------------------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|------------------|--------------|-------------------------------|----|-------|--------------|---------|--------------|-------|----------------|---------------|-----------|-------|--------------|---------------|-------|
| 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 | 自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>1. 親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">34,519,033円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第15期計算期間末（平成21年11月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,324,744,905円（1万口当たり156.94円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1253,233,885円（1万口当たり30円）を分配しております。なお、収益分配金には、外国所得税39,695円を含めております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">220,147,333円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">263,060,755円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">841,536,817円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,324,744,905円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(156.94円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">253,233,885円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> <p>第16期計算期間末（平成22年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,311,508,435円（1万口当たり166.87円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1235,779,531円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">313,766,599円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">246,192,900円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">751,548,936円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,311,508,435円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(166.87円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">235,779,531円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> <p>第17期計算期間末（平成22年3月29日）に、投資信託約款に基づき計算した1,382,889,065円（1万口当たり188.79円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1219,750,957円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">380,229,399円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">230,821,225円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">771,838,441円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,382,889,065円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(188.79円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">219,750,957円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> | 配当等収益 （費用控除後） | 220,147,333円 | 有価証券売買等損益 | 0円 | 収益調整金 | 263,060,755円 | 分配準備積立金 | 841,536,817円 | 分配可能額 | 1,324,744,905円 | （1万口当たり分配可能額） | (156.94円) | 収益分配金 | 253,233,885円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) | 配当等収益 （費用控除後） | 313,766,599円 | 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | 収益調整金 | 246,192,900円 | 分配準備積立金 | 751,548,936円 | 分配可能額 | 1,311,508,435円 | （1万口当たり分配可能額） | (166.87円) | 収益分配金 | 235,779,531円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) | 配当等収益 （費用控除後） | 380,229,399円 | 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | 収益調整金 | 230,821,225円 | 分配準備積立金 | 771,838,441円 | 分配可能額 | 1,382,889,065円 | （1万口当たり分配可能額） | (188.79円) | 収益分配金 | 219,750,957円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) | <p>1. 親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額</p> <p style="text-align: right;">27,774,451円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第18期計算期間末（平成22年5月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,319,286,260円（1万口当たり192.46円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1205,646,375円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">230,747,274円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">217,480,513円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">871,058,473円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,319,286,260円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(192.46円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">205,646,375円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> <p>第19期計算期間末（平成22年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,295,341,297円（1万口当たり199.86円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1194,434,708円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">242,384,574円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">207,055,993円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">845,900,730円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,295,341,297円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(199.86円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">194,434,708円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> <p>第20期計算期間末（平成22年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,258,507,748円（1万口当たり210.36円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1179,475,322円（1万口当たり30円）を分配しております。</p> <table border="1"> <tr><td>配当等収益 （費用控除後）</td><td style="text-align: right;">242,259,972円</td></tr> <tr><td>有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後）</td><td style="text-align: right;">0円</td></tr> <tr><td>収益調整金</td><td style="text-align: right;">192,525,572円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">823,722,204円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,258,507,748円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(210.36円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">179,475,322円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり収益分配金）</td><td style="text-align: right;">(30円)</td></tr> </table> | 配当等収益 （費用控除後） | 230,747,274円 | 有価証券売買等損益 | 0円 | 収益調整金 | 217,480,513円 | 分配準備積立金 | 871,058,473円 | 分配可能額 | 1,319,286,260円 | （1万口当たり分配可能額） | (192.46円) | 収益分配金 | 205,646,375円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) | 配当等収益 （費用控除後） | 242,384,574円 | 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | 収益調整金 | 207,055,993円 | 分配準備積立金 | 845,900,730円 | 分配可能額 | 1,295,341,297円 | （1万口当たり分配可能額） | (199.86円) | 収益分配金 | 194,434,708円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) | 配当等収益 （費用控除後） | 242,259,972円 | 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | 収益調整金 | 192,525,572円 | 分配準備積立金 | 823,722,204円 | 分配可能額 | 1,258,507,748円 | （1万口当たり分配可能額） | (210.36円) | 収益分配金 | 179,475,322円 | （1万口当たり収益分配金） | (30円) |
| 配当等収益 （費用控除後） | 220,147,333円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 263,060,755円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 841,536,817円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,324,744,905円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (156.94円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 253,233,885円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益 （費用控除後） | 313,766,599円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 246,192,900円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 751,548,936円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,311,508,435円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (166.87円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 235,779,531円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益 （費用控除後） | 380,229,399円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 230,821,225円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 771,838,441円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,382,889,065円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (188.79円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 219,750,957円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益 （費用控除後） | 230,747,274円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 217,480,513円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 871,058,473円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,319,286,260円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (192.46円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 205,646,375円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益 （費用控除後） | 242,384,574円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 207,055,993円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 845,900,730円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,295,341,297円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (199.86円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 194,434,708円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 配当等収益 （費用控除後） | 242,259,972円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 有価証券売買等損益 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金 | 192,525,572円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金 | 823,722,204円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配可能額 | 1,258,507,748円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり分配可能額） | (210.36円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金 | 179,475,322円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （1万口当たり収益分配金） | (30円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 当期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 平成22年3月30日 | |
| | 至 平成22年9月27日 | |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 | |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券、投資証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 | |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 | |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 | |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 当期 | |
|--------------------------|---|--|
| | 平成22年9月27日現在 | |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 | |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 最終の計算期間の損益に |
|-----------|----------------|---------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 35,742,256,276 | 1,891,247,239 |
| 投資証券 | 11,811,808,953 | 208,757,859 |
| 合計 | 47,554,065,229 | 2,100,005,098 |

当期（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|-----------|------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 732,849,224 |
| 投資証券 | 244,034,092 |
| 合計 | 976,883,316 |

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前期（自平成21年9月29日 至平成22年3月29日）

取引の状況に関する事項

| 項目 | 前期 自平成21年9月29日 至平成22年3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

| 区分 | 種類 | 前期 平成22年3月29日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|--------------------|------------------|-------------|---------|
| | | 契約額等 (円) | うち 1年超 (円) | 時価(円) | 評価損益(円) |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル | 300,000,000 | - | 300,103,853 | 103,853 |
| 合計 | | - | - | 300,103,853 | 103,853 |

(注) 時価の算定方法

A. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。

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

特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B. 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

当期（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
前期（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
該当事項はありません。

当期（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 前期 平成22年 3月29日現在 | 当期 平成22年 9月27日現在 |
|--|--|
| 1口当たり純資産額 0.6584円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 6,584円) 」 | 1口当たり純資産額 0.6243円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 6,243円) 」 |

(4) 附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|-----------|--------------------|---|----------------|-------------------|-----------------|
| 円 | 親投資信託 | 日本好配当株マザーファンド | 5,150,087,693 | 3,580,855,972 | |
| | 受益証券 | | | | |
| | 親投資信託 | 世界REITマザーファンド | 11,196,993,778 | 5,591,778,692 | |
| | 受益証券 | | | | |
| | 親投資信託 | グローバル好配当株マザーファンド | 5,837,025,098 | 5,563,852,323 | |
| | 受益証券 | | | | |
| | 親投資信託 | 新興国債券マザーファンド | 3,146,076,721 | 3,583,695,992 | |
| | 受益証券 | | | | |
| | 親投資信託 | 欧州債券マザーファンド | 4,646,334,882 | 3,822,075,073 | |
| 受益証券 | | | | | |
| 親投資信託 | アジア・オセアニア債券マザーファンド | 4,176,113,199 | 3,721,752,082 | | |
| 受益証券 | | | | | |
| 親投資信託 | コモディティ・マザーファンド | 3,206,615,133 | 1,999,003,873 | | |
| 受益証券 | | | | | |
| 小計（日本）7銘柄 | | | 37,359,246,504 | 27,863,014,007 | |
| アメリカ・ドル | 投資証券 | TRP FUNDS SICAV-GLB EMERGING MARKETS EQUITY FUND JD | 3,029,591.310 | 22,025,128.820 | |
| | 投資証券 | TRP FUNDS SICAV-GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND | 4,676,226.740 | 44,798,252.160 | |
| | 投資証券 | TRP FUNDS SICAV-US AGGREGATE BOND FUND | 3,883,148.510 | 42,015,666.870 | |
| | 小計（アメリカ・ドル）3銘柄 | | | 11,588,966.560 | 108,839,047.850 |
| | | | | (9,172,954,953) | |
| 合計 | | | | 37,035,968,960 | |
| | | | | (9,172,954,953) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 時価比率 | 有価証券の合計 金額に対する比率 |
|---------|-------------|----------------|---------------------|
| アメリカ・ドル | 投資証券 3銘柄 | 24.56% | 24.77% |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前](#) [次](#)

< 参考 >

当ファンドは、指定投資信託証券である、「日本好配当株マザーファンド」、「世界REITマザーファンド」、「グローバル好配当株マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「欧州債券マザーファンド」、「コモディティ・マザーファンド」、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」及び「グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」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」及び「投資証券」は指定投資信託証券に属するものを指します。

指定投資信託証券の状況は以下のとおりです。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年 3月29日現在 金 額 (円) | 平成22年 9月27日現在 金 額 (円) |
|----------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 2,382,841,326 | 1,778,137,197 |
| 株式 | 57,031,463,000 | 43,860,796,000 |
| 派生商品評価勘定 | 122,344,613 | 57,267,955 |
| 未収入金 | 1,342,867,910 | 1,547,047,388 |
| 未収配当金 | 691,801,950 | 40,612,000 |
| 差入委託証拠金 | 68,400,000 | 67,410,000 |
| 流動資産合計 | 61,639,718,799 | 47,351,270,540 |
| 資産合計 | 61,639,718,799 | 47,351,270,540 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | 103,170,000 | 25,359,000 |
| 未払金 | 977,030,614 | 425,534,184 |
| 未払解約金 | 54,091,581 | 453,467,807 |
| 流動負債合計 | 1,134,292,195 | 904,360,991 |
| 負債合計 | 1,134,292,195 | 904,360,991 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 元本 | 76,767,109,692 | 66,796,500,910 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 16,261,683,088 | 20,349,591,361 |
| 元本等合計 | 60,505,426,604 | 46,446,909,549 |
| 純資産合計 | 60,505,426,604 | 46,446,909,549 |
| 負債純資産合計 | 61,639,718,799 | 47,351,270,540 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------|---|---|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（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の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 株式 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 | (1)受取配当金 同左 (2)有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 92,097,612,064円 | 76,767,109,692円 |
| 期中追加設定元本額 | 665,520,465円 | 664,357,900円 |
| 期中一部解約元本額 | 15,996,022,837円 | 10,634,966,682円 |
| 元本の内訳 | | |
| 日本好配当株オープン | 70,772,612,082円 | 61,646,413,217円 |
| グローバル資産分散オープン | 5,994,497,610円 | 5,150,087,693円 |
| 合計 | 76,767,109,692円 | 66,796,500,910円 |
| 2. 受益権の総数 | 76,767,109,692口 | 66,796,500,910口 |
| 3. 元本の欠損 | 16,261,683,088円 | 20,349,591,361円 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|-----|----------------|---------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 株 式 | 57,031,463,000 | 5,039,166,296 |
| 合計 | 57,031,463,000 | 5,039,166,296 |

「計算期間」とは、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年10月9日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|-----|----------------------|
| 株 式 | 4,684,249,366 |
| 合計 | 4,684,249,366 |

「計算期間」とは、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成

22年4月9日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは株価指数先物取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 株価指数先物取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 株価指数先物取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、株価指数先物取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 3月29日現在 | | | |
|------|-----------------------------|---------------|------------------|---------------|-------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 T O P I X | 2,090,395,387 | - | 2,212,740,000 | 122,344,613 |
| 合計 | | - | - | 2,212,740,000 | 122,344,613 |

評価損益は、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

- 1) 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 2) 期末の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段等を用いております。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（株式関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年9月27日現在 | | | |
|------|-------------------------|---------------|------------------|---------------|------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 TOPIX | 1,748,892,045 | - | 1,806,160,000 | 57,267,955 |
| | 合計 | - | - | 1,806,160,000 | 57,267,955 |

評価損益は、「日本好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

- 1) 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 2) 期末の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段等を用いております。

（関連当事者との取引に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 0.7882円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,882円）」 | 1口当たり純資産額 0.6953円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,953円）」 |

（3）附属明細表
有価証券明細表
<株式>

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 (株) | 評価額 | | 備考 |
|----|--------------------|------------|-------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 円 | 大東建託 | 73,000 | 5,120 | 373,760,000 | |
| | パナホーム | 514,000 | 493 | 253,402,000 | |
| | 積水ハウス | 225,000 | 755 | 169,875,000 | |
| | 関電工 | 937,000 | 500 | 468,500,000 | |
| | 日揮 | 295,000 | 1,503 | 443,385,000 | |
| | NECネットエスアイ | 216,000 | 1,055 | 227,880,000 | |
| | 味の素 | 412,000 | 826 | 340,312,000 | |
| | 王子製紙 | 240,000 | 377 | 90,480,000 | |
| | 日本製紙グループ本社 | 77,600 | 2,160 | 167,616,000 | |
| | クラレ | 383,000 | 1,073 | 410,959,000 | |
| | 旭化成 | 905,000 | 457 | 413,585,000 | |
| | 日産化学工業 | 14,000 | 969 | 13,566,000 | |
| | 電気化学工業 | 140,000 | 370 | 51,800,000 | |
| | エア・ウォーター | 306,000 | 1,005 | 307,530,000 | |
| | 保土谷化学工業 | 464,000 | 264 | 122,496,000 | |
| | 日本触媒 | 63,000 | 736 | 46,368,000 | |
| | 東京応化工業 | 120,000 | 1,497 | 179,640,000 | |
| | 住友ベークライト | 453,000 | 441 | 199,773,000 | |
| | ADEKA | 316,000 | 870 | 274,920,000 | |
| | 花王 | 211,000 | 2,070 | 436,770,000 | |
| | 太陽インキ製造 | 169,800 | 2,420 | 410,916,000 | |
| | 東洋インキ製造 | 736,000 | 341 | 250,976,000 | |
| | ニフコ | 237,800 | 2,026 | 481,782,800 | |
| | 日本バルカー工業 | 685,000 | 243 | 166,455,000 | |
| | 武田薬品工業 | 45,800 | 4,030 | 184,574,000 | |
| | アステラス製薬 | 319,900 | 3,105 | 993,289,500 | |
| | 塩野義製薬 | 79,000 | 1,578 | 124,662,000 | |
| | 田辺三菱製薬 | 444,000 | 1,350 | 599,400,000 | |
| | 日本新薬 | 303,000 | 1,104 | 334,512,000 | |
| | エーザイ | 114,300 | 3,105 | 354,901,500 | |
| | 参天製薬 | 177,300 | 3,050 | 540,765,000 | |
| | キッセイ薬品工業 | 134,000 | 1,662 | 222,708,000 | |
| | 第一三共 | 105,000 | 1,743 | 183,015,000 | |
| | 東燃ゼネラル石油 | 228,000 | 784 | 178,752,000 | |
| | JXホールディングス | 2,650,000 | 481 | 1,274,650,000 | |
| | 横浜ゴム | 920,000 | 430 | 395,600,000 | |
| | 住友ゴム工業 | 355,500 | 836 | 297,198,000 | |
| | 住友金属工業 | 1,983,000 | 213 | 422,379,000 | |
| | ジェイ エフ イー ホールディングス | 25,000 | 2,636 | 65,900,000 | |
| | アサヒホールディングス | 88,000 | 1,838 | 161,744,000 | |
| | 住生活グループ | 205,000 | 1,672 | 342,760,000 | |
| | クボタ | 446,000 | 761 | 339,406,000 | |
| | マックス | 201,000 | 972 | 195,372,000 | |
| | 日立製作所 | 3,430,000 | 374 | 1,282,820,000 | |
| | マプチモーター | 24,000 | 4,310 | 103,440,000 | |
| | 山武 | 369,800 | 2,172 | 803,205,600 | |

| | | | | |
|-------------------------------|------------|---------|----------------|--|
| ローム | 29,500 | 5,290 | 156,055,000 | |
| 村田製作所 | 139,000 | 4,350 | 604,650,000 | |
| キヤノン | 408,300 | 3,890 | 1,588,287,000 | |
| リコー | 1,012,000 | 1,191 | 1,205,292,000 | |
| 東海理化電機製作所 | 155,000 | 1,478 | 229,090,000 | |
| トヨタ自動車 | 291,800 | 3,095 | 903,121,000 | |
| 本田技研工業 | 401,900 | 3,015 | 1,211,728,500 | |
| エクセディ | 107,000 | 2,585 | 276,595,000 | |
| エフ・シー・シー | 203,000 | 1,850 | 375,550,000 | |
| HOYA | 594,600 | 2,098 | 1,247,470,800 | |
| ニプロ | 59,000 | 1,745 | 102,955,000 | |
| 大日本印刷 | 57,000 | 1,059 | 60,363,000 | |
| 任天堂 | 20,700 | 23,800 | 492,660,000 | |
| 東京電力 | 136,000 | 2,334 | 317,424,000 | |
| 関西電力 | 196,400 | 2,169 | 425,991,600 | |
| 東北電力 | 116,000 | 1,940 | 225,040,000 | |
| 電源開発 | 49,000 | 2,712 | 132,888,000 | |
| 東京瓦斯 | 1,750,000 | 384 | 672,000,000 | |
| 大阪瓦斯 | 1,220,000 | 312 | 380,640,000 | |
| 東日本旅客鉄道 | 131,500 | 5,140 | 675,910,000 | |
| 日本通運 | 170,000 | 327 | 55,590,000 | |
| 山九 | 153,000 | 333 | 50,949,000 | |
| 新日鉄ソリューションズ | 93,000 | 1,607 | 149,451,000 | |
| コーエーテクモホールディングス | 248,000 | 549 | 136,152,000 | |
| ティーガイア | 1,430 | 127,700 | 182,611,000 | |
| 野村総合研究所 | 34,000 | 1,626 | 55,284,000 | |
| オービック | 24,100 | 16,480 | 397,168,000 | |
| トレンドマイクロ | 26,000 | 2,670 | 69,420,000 | |
| 日本オラクル | 82,600 | 4,015 | 331,639,000 | |
| 日本電信電話 | 319,900 | 3,845 | 1,230,015,500 | |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 10,388 | 145,800 | 1,514,570,400 | |
| コナミ | 41,000 | 1,505 | 61,705,000 | |
| 黒田電気 | 164,000 | 997 | 163,508,000 | |
| 伊藤忠商事 | 706,000 | 742 | 523,852,000 | |
| 三井物産 | 248,000 | 1,247 | 309,256,000 | |
| 住友商事 | 602,400 | 1,098 | 661,435,200 | |
| 三菱商事 | 481,800 | 1,977 | 952,518,600 | |
| ローソン | 141,600 | 3,810 | 539,496,000 | |
| カワチ薬品 | 92,900 | 1,483 | 137,770,700 | |
| ポイント | 77,000 | 3,895 | 299,915,000 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 163,000 | 1,974 | 321,762,000 | |
| イオン | 660,000 | 899 | 593,340,000 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 3,689,700 | 407 | 1,501,707,900 | |
| 千葉銀行 | 1,122,000 | 512 | 574,464,000 | |
| 横浜銀行 | 1,472,000 | 387 | 569,664,000 | |
| 住友信託銀行 | 2,259,000 | 428 | 966,852,000 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 4,530,600 | 122 | 552,733,200 | |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 441,100 | 1,977 | 872,054,700 | |
| 東京海上ホールディングス | 320,000 | 2,321 | 742,720,000 | |
| 日立キャピタル | 394,000 | 1,194 | 470,436,000 | |
| 野村不動産ホールディングス | 204,500 | 1,190 | 243,355,000 | |
| 東京建物 | 890,000 | 329 | 292,810,000 | |
| 東急不動産 | 1,595,000 | 343 | 547,085,000 | |
| NECフィールディング | 204,000 | 948 | 193,392,000 | |
| もしもしホットライン | 114,000 | 2,055 | 234,270,000 | |
| セコム | 21,000 | 3,830 | 80,430,000 | |
| ベネッセホールディングス | 74,500 | 3,945 | 293,902,500 | |
| 合計（日本）103銘柄 | 49,790,018 | - | 43,860,796,000 | |

デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

世界REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年3月29日現在 金額(円) | 平成22年9月27日現在 金額(円) |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 86,725,377 | 107,474,900 |
| コール・ローン | 62,379,252 | 14,191,116 |
| 投資証券 | 7,030,277,520 | 5,520,568,876 |
| 未収入金 | 160,178,296 | - |
| 未収配当金 | 17,541,372 | 13,659,040 |
| 流動資産合計 | 7,357,101,817 | 5,655,893,932 |
| 資産合計 | 7,357,101,817 | 5,655,893,932 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 5,407 | - |
| 未払金 | 77,062,548 | - |
| 流動負債合計 | 77,067,955 | - |
| 負債合計 | 77,067,955 | - |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 14,787,321,751 | 11,324,671,189 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 7,507,287,889 | 5,668,777,257 |
| 元本等合計 | 7,280,033,862 | 5,655,893,932 |
| 純資産合計 | 7,280,033,862 | 5,655,893,932 |
| 負債純資産合計 | 7,357,101,817 | 5,655,893,932 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|---|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（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の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 投資証券 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 国内投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | (1)受取配当金及び配当株式 国内投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 外国投資証券についての受取配当金及び配当株式は、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 18,571,983,621円 | 14,787,321,751円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,147,916円 | 14,806,984円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,791,809,786円 | 3,477,457,546円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル資産分散オープン | 14,654,592,931円 | 11,196,993,778円 |
| グローバル・リート・インカム・ファンド | 132,728,820円 | 127,677,411円 |
| 合計 | 14,787,321,751円 | 11,324,671,189円 |
| 2. 受益権の総数 | 14,787,321,751口 | 11,324,671,189口 |
| 3. 元本の欠損 | 7,507,287,889円 | 5,668,777,257円 |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成22年3月29日現在)

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|------|---------------|---------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 7,030,277,520 | 1,899,160,130 |
| 合計 | 7,030,277,520 | 1,899,160,130 |

「計算期間」とは、「世界REITマザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月28日から平成22年3月29日まで）を指しております。

(平成22年9月27日現在)

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|------|----------------------|
| 投資証券 | 278,552,714 |
| 合計 | 278,552,714 |

「計算期間」とは、「世界REITマザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年3月30日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 3月29日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|------------------|------------|-------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル | 50,000,000 | - | 49,994,593 | 5,407 |
| 合計 | | - | - | 49,994,593 | 5,407 |

評価損益は、「世界REITマザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）

該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 平成22年3月29日現在 | 平成22年9月27日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 0.4923円 「1口 = 1円（10,000口 = 4,923円）」 | 1口当たり純資産額 0.4994円 「1口 = 1円（10,000口 = 4,994円）」 |

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|-----------------|---------------|--------------------------------------|---------------|-----------------------------------|--------------------------------|
| 円 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 411 | 74,843,100 | |
| | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人 | 94 | 66,646,000 | |
| | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 90 | 60,390,000 | |
| | 投資証券 | 福岡リート投資法人 | 22 | 11,572,000 | |
| | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 | 80 | 33,280,000 | |
| | 小計（日本）5銘柄 | | | 697 | 246,731,100 |
| アメリカ・ドル | 投資証券 | APARTMENT INVT & MGMT CO-U | 13,778.000 | 356,850.200 | |
| | 投資証券 | ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D | 19,625.000 | 451,375.000 | |
| | 投資証券 | BRE PROPERTIES-C | 26,903.000 | 670,960.820 | |
| | 投資証券 | COUSINS PROPERTIES INC-A | 20,775.000 | 518,959.500 | |
| | 投資証券 | COUSINS PROPERTIES INC-B | 25,829.000 | 640,042.620 | |
| | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 15,900.000 | 963,540.000 | |
| | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 84,400.000 | 1,006,892.000 | |
| | 投資証券 | ENTERTAINMENT PROPERTIES TR | 26,000.000 | 1,159,080.000 | |
| | 投資証券 | FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 25,900.000 | 396,529.000 | |
| | 投資証券 | GLIMCHER REALTY TRUST - G | 43,758.000 | 1,072,508.580 | |
| | 投資証券 | HCP INC | 19,614.000 | 719,049.240 | |
| | 投資証券 | HEALTH CARE REIT INC | 37,231.000 | 1,763,632.470 | |
| | 投資証券 | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 42,400.000 | 934,072.000 | |
| | 投資証券 | KITE REALTY GROUP TRUST | 140,000.000 | 658,000.000 | |
| | 投資証券 | L A S A L L E H O T E L PROPERTIES-D | 25,200.000 | 621,180.000 | |
| | 投資証券 | LTC PROPERTIES INC | 16,400.000 | 424,432.000 | |
| | 投資証券 | PUBLIC STORAGE-N | 14,946.000 | 392,332.500 | |
| | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 35,452.000 | 3,376,448.480 | |
| | 投資証券 | U-STORE-IT TRUST | 48,456.000 | 417,690.720 | |
| | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST | 17,233.000 | 1,499,271.000 | |
| 小計（アメリカ・ドル）20銘柄 | | | 699,800.000 | 18,042,846.130 (1,520,651,072) | |
| カナダ・ドル | 投資証券 | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 65,341.000 | 1,419,859.930 | |
| | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 38,605.000 | 653,196.600 | |
| | 投資証券 | CHARTWELL SENIORS HOUSING RE | 36,600.000 | 324,642.000 | |
| | 投資証券 | DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN | 15,054.000 | 409,468.800 | |
| | 投資証券 | INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 46,305.000 | 331,080.750 | |
| | 投資証券 | PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE | 20,100.000 | 396,975.000 | |
| | 投資証券 | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 42,063.000 | 949,782.540 | |
| | 小計（カナダ・ドル）7銘柄 | | | 264,068.000 | 4,485,005.620 (368,846,862) |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 438,000.000 | 854,100.000 | |
| | 投資証券 | DEXUS PROPERTY GROUP | 1,899,000.000 | 1,576,170.000 | |
| | 投資証券 | ING INDUSTRIAL FUND | 2,474,000.000 | 1,175,150.000 | |

| | | | | | |
|-------------|----------------------|------------------------------|---------------|-----------------|--|
| | 投資証券 | ING OFFICE FUND | 1,948,870.000 | 1,169,322.000 | |
| | 投資証券 | STOCKLAND | 832,504.000 | 3,238,440.560 | |
| | 投資証券 | WESTFIELD GROUP | 459,092.000 | 5,651,422.520 | |
| | 小計(オーストラリア・ドル) 6 銘柄 | | 8,051,466.000 | 13,664,605.080 | |
| | | | | (1,106,013,135) | |
| シンガポール・ドル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 661,205.000 | 1,434,814.850 | |
| | 投資証券 | CAPITACOMMERCIAL TRUST | 1,330,000.000 | 1,955,100.000 | |
| | 投資証券 | CAPITAMALL TRUST | 886,356.000 | 1,817,029.800 | |
| | 投資証券 | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 809,000.000 | 711,920.000 | |
| | 投資証券 | SUNTEC REIT | 695,000.000 | 1,063,350.000 | |
| | 小計(シンガポール・ドル) 5 銘柄 | | 4,381,561.000 | 6,982,214.650 | |
| | | | | (445,116,183) | |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 | KIWI INCOME PROPERTY TRUST | 779,961.000 | 779,961.000 | |
| | 小計(ニュージーランド・ドル) 1 銘柄 | | 779,961.000 | 779,961.000 | |
| | | | | (48,365,381) | |
| イギリス・ポンド | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC | 425,615.000 | 2,010,179.640 | |
| | 投資証券 | DERWENT LONDON PLC | 48,378.000 | 745,021.200 | |
| | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC | 198,386.000 | 1,266,694.610 | |
| | 投資証券 | SEGRO PLC | 448,698.000 | 1,198,023.660 | |
| | 小計(イギリス・ポンド) 4 銘柄 | | 1,121,077.000 | 5,219,919.110 | |
| | | | | (695,971,814) | |
| ユーロ | 投資証券 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 22,324.000 | 205,827.280 | |
| | 投資証券 | BEFIMMO S.C.A. | 6,447.000 | 396,554.970 | |
| | 投資証券 | COFINIMMO | 4,495.000 | 436,015.000 | |
| | 投資証券 | CORIO NV | 19,850.000 | 993,889.500 | |
| | 投資証券 | EUROCOMMERCIAL | 37,155.000 | 1,236,518.400 | |
| | 投資証券 | ICADE | 12,500.000 | 950,000.000 | |
| | 投資証券 | KLEPIERRE | 26,533.000 | 733,902.780 | |
| | 投資証券 | SILIC | 5,600.000 | 520,184.000 | |
| | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO SE | 18,560.000 | 3,045,696.000 | |
| | 投資証券 | VASTNED RETAIL NV | 8,884.000 | 437,359.320 | |
| | 投資証券 | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 17,842.000 | 630,893.120 | |
| | 小計(ユーロ) 11 銘柄 | | 180,190.000 | 9,586,840.370 | |
| | | | | (1,088,873,329) | |
| 合計 | | | | 5,520,568,876 | |
| | | | | (5,273,837,776) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 | | 有価証券の合計 |
|------------|------------|--------|--------|----------|
| | | | 時価比率 | 金額に対する比率 |
| アメリカ・ドル | 投資証券 20 銘柄 | | 26.89% | 27.55% |
| カナダ・ドル | 投資証券 7 銘柄 | | 6.52% | 6.68% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 6 銘柄 | | 19.55% | 20.03% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 5 銘柄 | | 7.87% | 8.06% |

| | | | | |
|-------------|------|-------|--------|--------|
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 | 1 銘柄 | 0.85% | 0.88% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 | 4 銘柄 | 12.31% | 12.61% |
| ユーロ | 投資証券 | 11 銘柄 | 19.25% | 19.72% |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

グローバル好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年 3月29日現在 金 額 (円) | 平成22年 9月27日現在 金 額 (円) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 4,540,671,185 | 13,818,663,243 |
| コール・ローン | 10,081,729,929 | 6,807,853,072 |
| 株式 | 427,322,881,565 | 397,502,608,487 |
| 未収配当金 | 1,575,942,273 | 1,349,540,224 |
| 流動資産合計 | 443,521,224,952 | 419,478,665,026 |
| 資産合計 | 443,521,224,952 | 419,478,665,026 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 399,238,622 | 600,673,631 |
| 流動負債合計 | 399,238,622 | 600,673,631 |
| 負債合計 | 399,238,622 | 600,673,631 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 444,350,489,035 | 439,448,659,766 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 1,228,502,705 | 20,570,668,371 |
| 元本等合計 | 443,121,986,330 | 418,877,991,395 |
| 純資産合計 | 443,121,986,330 | 418,877,991,395 |
| 負債純資産合計 | 443,521,224,952 | 419,478,665,026 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|---|--|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（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の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 株式 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 外国株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | (1)受取配当金 同左 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|------------------|------------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 404,114,860,505円 | 444,350,489,035円 |
| 期中追加設定元本額 | 93,283,151,315円 | 64,936,329,301円 |
| 期中一部解約元本額 | 53,047,522,785円 | 69,838,158,570円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル好配当株オープン | 437,240,768,632円 | 433,611,634,668円 |
| グローバル資産分散オープン | 7,109,720,403円 | 5,837,025,098円 |
| 合計 | 444,350,489,035円 | 439,448,659,766円 |
| 2. 受益権の総数 | 444,350,489,035口 | 439,448,659,766口 |
| 3. 元本の欠損 | 1,228,502,705円 | 20,570,668,371円 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|-----|-----------------|----------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 株 式 | 427,322,881,565 | 15,550,615,126 |
| 合計 | 427,322,881,565 | 15,550,615,126 |

「計算期間」とは、「グローバル好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年1月9日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|-----|----------------------|
| 株 式 | 34,597,858,758 |
| 合計 | 34,597,858,758 |

「計算期間」とは、「グローバル好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間

（平成22年7月9日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成22年 3月29日現在）

該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 9月27日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|------------------|---------------|---------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル | 8,427,000,000 | - | 8,427,000,000 | 0 |
| | 合計 | - | - | 8,427,000,000 | 0 |

評価損益は、「グローバル好配当株マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B . 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）

該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|--|--|
| 1口当たり純資産額 0.9972円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 9,972円) 」 | 1口当たり純資産額 0.9532円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 9,532円) 」 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

< 株式 >

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 (株) | 評価額 | | 備考 |
|-----------------------|------------------------------|------------|----------------|--|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | ABBOTT LABORATORIES | 989,100 | 51.940 | 51,373,854.000 | |
| | AGRIUM INC | 578,400 | 77.180 | 44,640,912.000 | |
| | ALTRIA GROUP INC | 2,847,600 | 24.000 | 68,342,400.000 | |
| | AT&T INC | 2,392,900 | 28.580 | 68,389,082.000 | |
| | BRISTOL MYERS-SQUIBB | 1,099,000 | 27.620 | 30,354,380.000 | |
| | BUCYRUS INTERNATIONAL INC | 669,500 | 70.970 | 47,514,415.000 | |
| | BUNGE LIMITED | 739,900 | 60.740 | 44,941,526.000 | |
| | CBS CORP-CL B | 3,237,700 | 16.170 | 52,353,609.000 | |
| | CHEVRON CORP | 367,100 | 80.120 | 29,412,052.000 | |
| | COCA-COLA CO/THE | 746,100 | 58.620 | 43,736,382.000 | |
| | CONSOLIDATED EDISON INC | 1,024,600 | 48.790 | 49,990,234.000 | |
| | DEERE & CO | 878,000 | 72.640 | 63,777,920.000 | |
| | DU PONT (E.I.)DE NEMOURS | 709,500 | 45.580 | 32,339,010.000 | |
| | EATON CORP | 676,400 | 82.420 | 55,748,888.000 | |
| | ELI LILLY & CO | 1,387,700 | 36.100 | 50,095,970.000 | |
| | JOY GLOBAL INC | 693,600 | 70.460 | 48,871,056.000 | |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 771,600 | 39.770 | 30,686,532.000 | |
| | KIMBERLY CLARK CORP | 861,800 | 66.050 | 56,921,890.000 | |
| | LIMITED BRANDS INC | 1,011,100 | 27.180 | 27,481,698.000 | |
| | MCDONALDS CORP | 630,200 | 75.100 | 47,328,020.000 | |
| | MERCK & CO INC | 786,100 | 37.340 | 29,352,974.000 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 1,558,100 | 30.640 | 47,740,184.000 | |
| | P G & E CORP | 999,500 | 45.820 | 45,797,090.000 | |
| | PFIZER INC | 2,932,300 | 17.410 | 51,051,343.000 | |
| | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 543,500 | 53.080 | 28,848,980.000 | |
| | PPG INDUSTRIES INC | 470,700 | 72.920 | 34,323,444.000 | |
| STARBUCKS CORP | 2,005,500 | 26.150 | 52,443,825.000 | | |
| SUNTRUST BANKS INC | 1,246,300 | 26.040 | 32,453,652.000 | | |
| US BANCORP | 1,304,500 | 22.410 | 29,233,845.000 | | |
| VERIZON COMM | 2,162,900 | 32.640 | 70,597,056.000 | | |
| VF CORP | 383,500 | 79.020 | 30,304,170.000 | | |
| WELLS FARGO & COMPNAY | 1,177,200 | 25.590 | 30,124,548.000 | | |
| XL GROUP PLC | 2,433,200 | 21.220 | 51,632,504.000 | | |
| YUM! BRANDS INC | 879,500 | 46.500 | 40,896,750.000 | | |
| | 小計 (アメリカ・ドル) 34銘柄 | 41,194,600 | - | 1,519,100,195.000 (128,029,764,435) | |
| カナダ・ドル | ROYAL BANK OF CANADA | 439,000 | 53.490 | 23,482,110.000 | |
| | 小計 (カナダ・ドル) 1銘柄 | 439,000 | - | 23,482,110.000 (1,931,168,726) | |
| オーストラリア・ドル | AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 1,620,000 | 23.600 | 38,232,000.000 | |
| | COCA-COLA AMATIL LIMITED | 4,351,900 | 12.140 | 52,832,066.000 | |
| | COMMONWEALTH BK | 841,800 | 51.820 | 43,622,076.000 | |
| | FOSTER'S GROUP LTD | 11,458,000 | 6.240 | 71,497,920.000 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 1,464,000 | 25.550 | 37,405,200.000 | |
| | ORICA LTD | 1,718,800 | 25.600 | 44,001,280.000 | |
| | SANTOS LTD | 3,042,700 | 12.830 | 39,037,841.000 | |
| | TELSTRA CORP | 17,753,600 | 2.670 | 47,402,112.000 | |
| | WESFARMERS LIMITED | 1,717,600 | 33.750 | 57,969,000.000 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 2,168,600 | 23.490 | 50,940,414.000 | |
| WOOLWORTHS LIMITED | 1,937,200 | 28.910 | 56,004,452.000 | | |

| | | | | | |
|-------------|------------------------------|--------------------|------------|---|---------------------------------------|
| | 小計（オーストラリア・ドル）11銘柄 | 48,074,200 | - | 538,944,361.000 (43,622,156,580) | |
| 香港・ドル | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 11,110,000 | 23.450 | 260,529,500.000 | |
| | CHEUNG KONG HOLDING | 3,400,000 | 113.100 | 384,540,000.000 | |
| | CHINA MERCHANTS HLDGS INT | 12,020,000 | 28.550 | 343,171,000.000 | |
| | CHINA MOBILE LTD | 4,180,000 | 80.100 | 334,818,000.000 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 18,640,000 | 17.160 | 319,862,400.000 | |
| | CNOOC LTD | 22,340,000 | 14.560 | 325,270,400.000 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 2,307,900 | 113.900 | 262,869,810.000 | |
| | HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS | 8,324,500 | 47.650 | 396,662,425.000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 3,190,000 | 126.800 | 404,492,000.000 | |
| | 小計（香港・ドル）9銘柄 | 85,512,400 | - | 3,032,215,535.000 (32,929,860,710) | |
| シンガポール・ドル | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 5,050,000 | 14.080 | 71,104,000.000 | |
| | OLAM INTERNATIONAL LTD | 31,427,000 | 3.150 | 98,995,050.000 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 13,339,000 | 4.160 | 55,490,240.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 19,665,000 | 3.140 | 61,748,100.000 | |
| | | 小計（シンガポール・ドル）4銘柄 | 69,481,000 | - | 287,337,390.000 (18,317,758,613) |
| 台湾・ドル | COMPAL ELECTRONICS | 5,368,224 | 37.500 | 201,308,400.000 | |
| | DELTA ELECTRONICS INC | 13,056,547 | 130.000 | 1,697,351,110.000 | |
| | HTC CORP | 3,675,000 | 724.000 | 2,660,700,000.000 | |
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 1,700,000 | 620.000 | 1,054,000,000.000 | |
| | MEDIATEK INC | 2,929,117 | 446.000 | 1,306,386,182.000 | |
| | TAIWAN FERTILIZER CO LTD | 10,000,000 | 99.300 | 993,000,000.000 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE | 18,813,131 | 60.100 | 1,130,669,173.100 | |
| | 小計（台湾・ドル）7銘柄 | 55,542,019 | - | 9,043,414,865.100 (24,236,351,838) | |
| イギリス・ポンド | ARM HOLDINGS PLC | 7,483,200 | 4.146 | 31,025,347.200 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,327,500 | 24.305 | 32,264,887.500 | |
| | CENTRICA | 7,904,400 | 3.333 | 26,345,365.200 | |
| | DIAGEO PLC | 2,512,000 | 10.980 | 27,581,760.000 | |
| | GLAXOSMITHKLINE PLC | 2,528,300 | 12.645 | 31,970,353.500 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 18,665,400 | 1.030 | 19,225,362.000 | |
| | MARKS & SPENCER GROUP PLC | 8,148,600 | 3.805 | 31,005,423.000 | |
| | PEARSON PLC | 2,773,300 | 9.925 | 27,525,002.500 | |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 302,800 | 64.850 | 19,636,580.000 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 1,790,400 | 18.450 | 33,032,880.000 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 25,067,900 | 1.609 | 40,334,251.100 | |
| | 小計（イギリス・ポンド）11銘柄 | 78,503,800 | - | 319,947,212.000 (42,658,561,775) | |
| スイス・フラン | SYNGENTA AG-REG | 163,900 | 254.900 | 41,778,110.000 | |
| | | 小計（スイス・フラン）1銘柄 | 163,900 | - | 41,778,110.000 (3,575,370,653) |
| ノルウェー・クローネ | DNB NOR ASA | 3,458,800 | 78.800 | 272,553,440.000 | |
| | TELENOR ASA | 3,821,900 | 94.050 | 359,449,695.000 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 790,000 | 271.600 | 214,564,000.000 | |
| | | 小計（ノルウェー・クローネ）3銘柄 | 8,070,700 | - | 846,567,135.000 (12,131,307,044) |
| スウェーデン・クローナ | ALFA LAVAL AB | 3,261,000 | 119.600 | 390,015,600.000 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B | 1,379,000 | 260.000 | 358,540,000.000 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 2,060,100 | 121.400 | 250,096,140.000 | |
| | | 小計（スウェーデン・クローナ）3銘柄 | 6,700,100 | - | 998,651,740.000 (12,373,295,058) |
| 韓国・ウォ | KT&G CORP | 717,000 | 66,900.000 | 47,967,300,000.000 | |

| | | | | | |
|-----|-----------------------------|------------|--|---|--|
| ン | LG CHEM LTD | 97,100 | 327,500.000 | 31,800,250,000.000 | |
| | LG ELECTRONICS INC | 447,400 | 97,600.000 | 43,666,240,000.000 | |
| | SK ENERGY CO LTD | 250,200 | 148,000.000 | 37,029,600,000.000 | |
| | 小計（韓国・ウォン）4銘柄 | 1,511,700 | - | 160,463,390,000.000 (11,794,059,165) | |
| ユーロ | AIR LIQUIDE SA | 431,600 | 91.480 | 39,482,768.000 | |
| | BANCO SANTANDER | 3,759,900 | 9.540 | 35,869,446.000 | |
| | BASF SE | 647,900 | 46.915 | 30,396,228.500 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 854,200 | 50.350 | 43,008,970.000 | |
| | BELGACOM SA | 1,338,400 | 28.740 | 38,465,616.000 | |
| | BNP PARIBAS | 684,100 | 55.300 | 37,830,730.000 | |
| | E.ON AG | 662,800 | 21.700 | 14,382,760.000 | |
| | FORTUM OYJ | 1,465,600 | 19.340 | 28,344,704.000 | |
| | GDF SUEZ | 722,200 | 26.070 | 18,827,754.000 | |
| | INTESA SANPAOLO SPA | 13,672,500 | 2.440 | 33,360,900.000 | |
| | K+S AG | 713,400 | 44.425 | 31,692,795.000 | |
| | LINDE AG | 438,200 | 97.740 | 42,829,668.000 | |
| | PORTUGAL TELECOM SA-REGIS | 2,811,700 | 9.691 | 27,248,184.700 | |
| | SAMPO OYJ-A SHS | 2,100,200 | 19.720 | 41,415,944.000 | |
| | SCHNEIDER ELECTRIC | 436,400 | 93.820 | 40,943,048.000 | |
| | SNAM RETE GAS | 9,925,500 | 3.700 | 36,724,350.000 | |
| | TECHNIP SA | 437,900 | 58.160 | 25,468,264.000 | |
| | TOTAL SA | 366,500 | 38.040 | 13,941,660.000 | |
| | 小計（ユーロ）18銘柄 | 41,469,000 | - | 580,233,790.200 (65,902,953,890) | |
| 合計 | 436,662,419 | - | 397,502,608,487 (397,502,608,487) | | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 | | 有価証券の合計 |
|-------------|-----------|--------|----------|---------|
| | | 時価比率 | 金額に対する比率 | |
| アメリカ・ドル | 外国株式 34銘柄 | 30.57% | | 32.21% |
| カナダ・ドル | 外国株式 1銘柄 | 0.46% | | 0.49% |
| オーストラリア・ドル | 外国株式 11銘柄 | 10.41% | | 10.97% |
| 香港・ドル | 外国株式 9銘柄 | 7.86% | | 8.28% |
| シンガポール・ドル | 外国株式 4銘柄 | 4.37% | | 4.61% |
| 台湾・ドル | 外国株式 7銘柄 | 5.79% | | 6.10% |
| イギリス・ポンド | 外国株式 11銘柄 | 10.18% | | 10.73% |
| スイス・フラン | 外国株式 1銘柄 | 0.85% | | 0.90% |
| ノルウェー・クローネ | 外国株式 3銘柄 | 2.90% | | 3.05% |
| スウェーデン・クローナ | 外国株式 3銘柄 | 2.95% | | 3.11% |
| 韓国・ウォン | 外国株式 4銘柄 | 2.82% | | 2.97% |
| ユーロ | 外国株式 18銘柄 | 15.73% | | 16.58% |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

新興国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年 3月29日現在 金 額 (円) | 平成22年 9月27日現在 金 額 (円) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 513,278,119 | 1,286,084,540 |
| コール・ローン | 10,029,777 | 90,252 |
| 国債証券 | 20,269,793,545 | 17,986,444,527 |
| 地方債証券 | 60,517,713 | 118,529,087 |
| 特殊債券 | 2,091,189,711 | 1,120,815,051 |
| 社債券 | 9,903,872,201 | 7,011,989,098 |
| 派生商品評価勘定 | 6,424,146 | 8,723,227 |
| 未収入金 | 243,769,188 | - |
| 未収利息 | 644,748,278 | 508,518,897 |
| 前払費用 | 10,978,475 | 11,041,590 |
| 流動資産合計 | 33,754,601,153 | 28,052,236,269 |
| 資産合計 | 33,754,601,153 | 28,052,236,269 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 40,586,261 | 22,898,144 |
| 未払金 | - | 272,099,457 |
| 未払解約金 | 9,999,999 | - |
| 流動負債合計 | 50,586,260 | 294,997,601 |
| 負債合計 | 50,586,260 | 294,997,601 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 29,347,351,735 | 24,368,567,044 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 4,356,663,158 | 3,388,671,624 |
| 元本等合計 | 33,704,014,893 | 27,757,238,668 |
| 純資産合計 | 33,704,014,893 | 27,757,238,668 |
| 負債純資産合計 | 33,754,601,153 | 28,052,236,269 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|--|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左</p> <p>同左</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 35,483,716,694円 | 29,347,351,735円 |
| 期中追加設定元本額 | 579,415,373円 | 155,177,764円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,715,780,332円 | 5,133,962,455円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル資産分散オープン | 4,194,428,443円 | 3,146,076,721円 |
| 大和住銀/T・ロウ・プライスFOFs用新興国債券ファンド（適格機関投資家専用） | 21,447,154,449円 | 17,944,739,090円 |
| T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（FOFs用）（適格機関投資家専用） | 3,705,768,843円 | 3,277,751,233円 |
| 合計 | 29,347,351,735円 | 24,368,567,044円 |
| 2. 受益権の総数 | 29,347,351,735口 | 24,368,567,044口 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|-------|----------------|---------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 20,269,793,545 | 902,331,739 |
| 地方債証券 | 60,517,713 | 993,348 |
| 特殊債証券 | 2,091,189,711 | 135,121,686 |
| 社債証券 | 9,903,872,201 | 530,247,813 |
| 合計 | 32,325,373,170 | 1,568,694,586 |

「計算期間」とは、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年11月10日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|-------|----------------------|
| 国債証券 | 1,389,248,283 |
| 地方債証券 | 4,271,197 |
| 特殊債証券 | 43,423,517 |
| 社債証券 | 297,194,491 |

| | |
|----|---------------|
| 合計 | 1,734,137,488 |
|----|---------------|

「計算期間」とは、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年5月8日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 3月29日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|------------------|---------------|-------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル | 1,004,154,232 | - | 1,009,877,260 | 5,723,028 |
| | 売建 アメリカ・ドル | 232,900,000 | - | 232,911,624 | 11,624 |
| | メキシコ・ペソ | 1,004,154,232 | - | 1,044,027,751 | 39,873,519 |
| | 合計 | - | - | 2,286,816,635 | 34,162,115 |

評価損益は、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

- B. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 9月27日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|------------------|---------------|------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル | 663,021,184 | - | 641,593,040 | 21,428,144 |
| | 売建 アメリカ・ドル | 139,200,000 | - | 138,985,081 | 214,919 |
| | メキシコ・ペソ | 663,021,184 | - | 655,982,876 | 7,038,308 |
| 合計 | | - | - | 1,436,560,997 | 14,174,917 |

評価損益は、「新興国債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|--|--|
| 1口当たり純資産額 1.1485円 「1口 = 1円（10,000口 = 11,485円）」 | 1口当たり純資産額 1.1391円 「1口 = 1円（10,000口 = 11,391円）」 |

（3）附属細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------|------|-------------------|---------------|---------------|----|
| アメリカ・ドル | 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 209,308.000 | 184,770.820 | |
| | 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 954,654.000 | 842,739.910 | |
| | 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 1,905,000.000 | 1,681,676.850 | |
| | 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 647,983.000 | 572,019.950 | |
| | 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 95,000.000 | 83,863.150 | |

| | | | |
|------|-----------------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 2,900,000.000 | 2,560,033.000 |
| 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 1,238,000.000 | 1,092,869.260 |
| 国債証券 | ARGBON 7 10/03/15 | 762,000.000 | 672,670.740 |
| 国債証券 | ARGENT 8.28 12/31/33 | 2,569,653.400 | 2,100,691.650 |
| 国債証券 | ARGENT 8.28 12/31/33 | 274,829.570 | 224,673.170 |
| 国債証券 | ARGENT 8.28 12/31/33 | 367,583.780 | 300,499.740 |
| 国債証券 | ARGENT 8.28 12/31/33 | 2,569,653.400 | 2,100,691.650 |
| 国債証券 | BRAZIL 7.125 01/20/37 | 4,600,000.000 | 5,942,280.000 |
| 国債証券 | BRAZIL 7.125 01/20/37 | 2,400,000.000 | 3,100,320.000 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 250,000.000 | 362,562.500 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 80,000.000 | 116,020.000 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 340,000.000 | 493,085.000 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 170,000.000 | 246,542.500 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 310,000.000 | 449,577.500 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.875 10/14/19 | 1,885,000.000 | 2,637,171.550 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.875 10/14/19 | 1,900,000.000 | 2,658,157.000 |
| 国債証券 | BRAZIL 8.875 10/14/19 | 5,000,000.000 | 6,995,150.000 |
| 国債証券 | COLOM 7.375 09/18/37 | 1,000,000.000 | 1,287,100.000 |
| 国債証券 | COLOM 7.375 09/18/37 | 1,500,000.000 | 1,930,650.000 |
| 国債証券 | DOMREP 7.5 05/06/21 | 600,000.000 | 672,000.000 |
| 国債証券 | DOMREP 7.5 05/06/21 | 100,000.000 | 112,000.000 |
| 国債証券 | EGYPT 5.75 04/29/20 | 800,000.000 | 860,360.000 |
| 国債証券 | EGYPT 6.875 04/30/40 | 1,000,000.000 | 1,130,000.000 |
| 国債証券 | EGYPT 6.875 04/30/40 | 180,000.000 | 203,400.000 |
| 国債証券 | EGYPT 6.875 04/30/40 | 120,000.000 | 135,600.000 |
| 国債証券 | GABON 8.2 12/12/17 | 2,800,000.000 | 3,262,000.000 |
| 国債証券 | GHANA 8.5 10/04/17 | 500,000.000 | 573,250.000 |
| 国債証券 | GHANA 8.5 10/04/17 | 700,000.000 | 802,550.000 |
| 国債証券 | GRENAD FL 09/15/25 | 1,300,000.000 | 702,000.000 |
| 国債証券 | GRENAD FL 09/15/25 | 1,000,000.000 | 540,000.000 |
| 国債証券 | GRENAD FL 09/15/25 | 1,000,000.000 | 540,000.000 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 290,000.000 | 356,668.100 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 210,000.000 | 258,276.900 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 2,000,000.000 | 2,459,780.000 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 1,200,000.000 | 1,475,868.000 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 1,800,000.000 | 2,213,802.000 |
| 国債証券 | INDON 6.625 02/17/37 | 3,000,000.000 | 3,689,670.000 |
| 国債証券 | INDON 7.75 01/17/38 | 750,000.000 | 1,013,437.500 |
| 国債証券 | INDON 7.75 01/17/38 | 1,250,000.000 | 1,689,062.500 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 2,240,000.000 | 1,926,400.000 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 3,500,000.000 | 3,010,000.000 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 3,571,000.000 | 3,071,060.000 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 250,000.000 | 215,000.000 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 1,000,000.000 | 860,000.000 |
| 国債証券 | IRAQ 5.8 01/15/28 | 1,400,000.000 | 1,204,000.000 |
| 国債証券 | JAMAN 10.625 06/20/17 | 325,000.000 | 371,718.750 |
| 国債証券 | JAMAN 10.625 06/20/17 | 1,100,000.000 | 1,258,125.000 |
| 国債証券 | JAMAN 10.625 06/20/17 | 800,000.000 | 915,000.000 |
| 国債証券 | JAMAN 8.5 02/28/36 | 170,000.000 | 167,450.000 |
| 国債証券 | JAMAN 8.5 02/28/36 | 150,000.000 | 147,750.000 |
| 国債証券 | JAMAN 8.5 02/28/36 | 500,000.000 | 492,500.000 |
| 国債証券 | LEBAN 8.25 04/12/21 | 500,000.000 | 585,335.000 |
| 国債証券 | LEBAN 8.25 04/12/21 | 500,000.000 | 585,335.000 |
| 国債証券 | LEBAN 8.5 08/06/15 | 4,000,000.000 | 4,640,000.000 |
| 国債証券 | LEBAN 8.5 08/06/15 | 2,000,000.000 | 2,320,000.000 |
| 国債証券 | LITHUN 6.75 01/15/15 | 1,910,000.000 | 2,074,928.500 |
| 国債証券 | LITHUN 6.75 01/15/15 | 3,000,000.000 | 3,259,050.000 |
| 国債証券 | LITHUN 6.75 01/15/15 | 300,000.000 | 325,905.000 |
| 国債証券 | LITHUN 6.75 01/15/15 | 450,000.000 | 488,857.500 |
| 国債証券 | LITHUN 6.75 01/15/15 | 150,000.000 | 162,952.500 |
| 国債証券 | LITHUN 7.375 02/11/20 | 780,000.000 | 875,004.000 |
| 国債証券 | LITHUN 7.375 02/11/20 | 900,000.000 | 1,009,620.000 |
| 国債証券 | MEX 5.125 01/15/20 | 2,000,000.000 | 2,195,000.000 |
| 国債証券 | MEX 5.95 03/19/19 | 4,950,000.000 | 5,746,950.000 |

| | | | |
|------|-----------------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | MEX 5.95 03/19/19 | 400,000.000 | 464,400.000 |
| 国債証券 | MEX 5.95 03/19/19 | 200,000.000 | 232,200.000 |
| 国債証券 | MEX 5.95 03/19/19 | 400,000.000 | 464,400.000 |
| 国債証券 | PERU 6.55 03/14/37 | 188,000.000 | 225,167.600 |
| 国債証券 | PERU 6.55 03/14/37 | 675,000.000 | 808,447.500 |
| 国債証券 | PERU 6.55 03/14/37 | 2,000,000.000 | 2,395,400.000 |
| 国債証券 | PERU 7.125 03/30/19 | 850,000.000 | 1,058,250.000 |
| 国債証券 | PERU 8.375 05/03/16 | 775,000.000 | 975,097.250 |
| 国債証券 | PHILIP 6.375 10/23/34 | 985,000.000 | 1,126,593.750 |
| 国債証券 | PHILIP 6.375 10/23/34 | 159,000.000 | 181,856.250 |
| 国債証券 | PHILIP 6.375 10/23/34 | 1,015,000.000 | 1,160,906.250 |
| 国債証券 | PHILIP 6.375 10/23/34 | 314,000.000 | 359,137.500 |
| 国債証券 | PHILIP 6.375 10/23/34 | 227,000.000 | 259,631.250 |
| 国債証券 | PHILIP 8.375 06/17/19 | 448,000.000 | 599,200.000 |
| 国債証券 | PHILIP 8.375 06/17/19 | 552,000.000 | 738,300.000 |
| 国債証券 | PKSTAN 6.875 06/01/17 | 100,000.000 | 91,250.000 |
| 国債証券 | PKSTAN 7.125 03/31/16 | 550,000.000 | 517,506.000 |
| 国債証券 | REPHUN 6.25 01/29/20 | 2,000,000.000 | 2,091,300.000 |
| 国債証券 | REPHUN 6.25 01/29/20 | 500,000.000 | 522,825.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 1,798,600.000 | 2,144,650.640 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 4,600,000.000 | 5,485,040.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 851,000.000 | 1,014,732.400 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 920,000.000 | 1,097,008.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 4,140,000.000 | 4,936,536.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 920,000.000 | 1,097,008.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 1,840,000.000 | 2,194,016.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 4,600,000.000 | 5,485,040.000 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 4,692,000.000 | 5,594,740.800 |
| 国債証券 | RUSSIA FL 03/31/30 | 3,680,000.000 | 4,388,032.000 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 468,833.350 | 466,489.180 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 966,666.700 | 961,833.360 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 290,000.010 | 288,550.000 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 808,638.930 | 804,595.730 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 299,666.680 | 298,168.340 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 1,208,333.380 | 1,202,291.710 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 1,208,333.380 | 1,202,291.710 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 966,666.700 | 961,833.360 |
| 国債証券 | SERBIA FL 11/01/24 | 1,063,333.370 | 1,058,016.700 |
| 国債証券 | TURKEY 5.625 03/30/21 | 900,000.000 | 957,375.000 |
| 国債証券 | TURKEY 5.625 03/30/21 | 335,000.000 | 356,356.250 |
| 国債証券 | TURKEY 5.625 03/30/21 | 648,000.000 | 689,310.000 |
| 国債証券 | TURKEY 5.625 03/30/21 | 558,000.000 | 593,572.500 |
| 国債証券 | TURKEY 5.625 03/30/21 | 559,000.000 | 594,636.250 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 307,000.000 | 359,067.200 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 2,600,000.000 | 3,040,960.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 230,000.000 | 269,008.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 210,000.000 | 245,616.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 1,750,000.000 | 2,046,800.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 1,000,000.000 | 1,169,600.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 400,000.000 | 467,840.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 300,000.000 | 350,880.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 250,000.000 | 292,400.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7 06/05/20 | 1,500,000.000 | 1,754,400.000 |
| 国債証券 | TURKEY 7.5 11/07/19 | 1,000,000.000 | 1,212,400.000 |
| 国債証券 | TURKEY 8 02/14/34 | 400,000.000 | 507,060.000 |
| 国債証券 | TURKEY 8 02/14/34 | 4,100,000.000 | 5,197,365.000 |
| 国債証券 | TURKEY 8 02/14/34 | 1,250,000.000 | 1,584,562.500 |
| 国債証券 | UKRAIN 6.385 06/26/12 | 2,400,000.000 | 2,421,600.000 |
| 国債証券 | UKRAIN 6.58 11/21/16 | 2,800,000.000 | 2,744,840.000 |
| 国債証券 | UKRAIN 7.65 06/11/13 | 2,000,000.000 | 2,090,200.000 |
| 国債証券 | UKRAIN 7.65 06/11/13 | 1,000,000.000 | 1,045,100.000 |
| 国債証券 | URUGUA 9.25 05/17/17 | 1,200,000.000 | 1,575,888.000 |
| 国債証券 | VENZ 12.75 08/23/22 | 300,000.000 | 250,119.000 |
| 国債証券 | VENZ 12.75 08/23/22 | 343,000.000 | 285,969.390 |

| | | | |
|-------|-----------------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | VENZ 12.75 08/23/22 | 343,000.000 | 285,969.390 |
| 国債証券 | VENZ 12.75 08/23/22 | 514,000.000 | 428,537.220 |
| 国債証券 | VENZ 7.65 04/21/25 | 415,000.000 | 244,850.000 |
| 国債証券 | VENZ 7.65 04/21/25 | 420,000.000 | 247,800.000 |
| 国債証券 | VENZ 8.5 10/08/14 | 838,000.000 | 688,182.360 |
| 国債証券 | VENZ 8.5 10/08/14 | 2,500,000.000 | 2,053,050.000 |
| 国債証券 | VENZ 8.5 10/08/14 | 1,428,000.000 | 1,172,702.160 |
| 国債証券 | VENZ 9 05/07/23 | 400,000.000 | 264,800.000 |
| 国債証券 | VENZ 9.25 09/15/27 | 1,397,000.000 | 1,002,347.500 |
| 国債証券 | VIETNM 6.75 01/29/20 | 280,000.000 | 306,236.000 |
| 国債証券 | VIETNM 6.75 01/29/20 | 200,000.000 | 218,740.000 |
| 地方債証券 | BUEAIR 12.5 04/06/15 | 1,000,000.000 | 1,070,000.000 |
| 地方債証券 | BUEAIR 7.875 04/11/11 | 33,400.000 | 33,942.750 |
| 地方債証券 | BUEAIR 7.875 04/11/11 | 25,050.000 | 25,457.060 |
| 地方債証券 | BUEAIR 7.875 04/11/11 | 172,344.000 | 175,144.590 |
| 地方債証券 | BUEAIR 7.875 04/11/11 | 100,200.000 | 101,828.250 |
| 特殊債券 | CABEL 5.375 09/24/14 | 3,000,000.000 | 3,236,040.000 |
| 特殊債券 | CAPJAM 8.5 11/16/21 | 500,000.000 | 511,250.000 |
| 特殊債券 | CAPJAM 8.5 11/16/21 | 2,000,000.000 | 2,045,000.000 |
| 特殊債券 | GAZPRU 7.288 08/16/37 | 200,000.000 | 219,770.000 |
| 特殊債券 | GAZPRU 7.288 08/16/37 | 1,800,000.000 | 1,977,930.000 |
| 特殊債券 | GAZPRU 9.25 04/23/19 | 950,000.000 | 1,169,687.500 |
| 特殊債券 | LIBAN 10 04/25/15 | 330,000.000 | 399,979.800 |
| 特殊債券 | PEMEX 4.875 03/15/15 | 3,500,000.000 | 3,739,050.000 |
| 社債券 | ADAIND 7.625 10/22/19 | 250,000.000 | 272,500.000 |
| 社債券 | ADAIND 7.625 10/22/19 | 224,000.000 | 243,252.800 |
| 社債券 | ADAIND 7.625 10/22/19 | 176,000.000 | 191,127.200 |
| 社債券 | AGILE 10 11/14/16 | 2,000,000.000 | 2,177,100.000 |
| 社債券 | AKBNK 5.125 07/22/15 | 2,500,000.000 | 2,493,750.000 |
| 社債券 | ARCDOR 7.5 10/01/19 | 1,310,000.000 | 1,421,350.000 |
| 社債券 | ARCDOR 7.5 10/01/19 | 1,000,000.000 | 1,085,000.000 |
| 社債券 | BCP 5.375 09/16/20 | 500,000.000 | 506,875.000 |
| 社債券 | CEMEX 9.5 12/14/16 | 500,000.000 | 504,260.000 |
| 社債券 | CHMFRU 9.75 07/29/13 | 1,500,000.000 | 1,663,125.000 |
| 社債券 | DLLTD 8.875 01/15/15 | 935,000.000 | 954,868.750 |
| 社債券 | DLLTD 8.875 01/15/15 | 1,000,000.000 | 1,021,250.000 |
| 社債券 | DLLTD 8.875 01/15/15 | 1,350,000.000 | 1,378,687.500 |
| 社債券 | DPWORL 6.25 07/02/17 | 2,150,000.000 | 2,095,497.500 |
| 社債券 | DRUMCO 9 10/15/14 | 500,000.000 | 530,000.000 |
| 社債券 | ECOPET 7.625 07/23/19 | 1,000,000.000 | 1,198,750.000 |
| 社債券 | EPPME 7.625 07/29/19 | 450,000.000 | 535,635.000 |
| 社債券 | EVRAZ 8.875 04/24/13 | 200,000.000 | 211,500.000 |
| 社債券 | EVRAZ 8.875 04/24/13 | 500,000.000 | 528,750.000 |
| 社債券 | EVRAZ 8.875 04/24/13 | 500,000.000 | 528,750.000 |
| 社債券 | EVRAZ 8.875 04/24/13 | 400,000.000 | 423,000.000 |
| 社債券 | EVRAZ 8.875 04/24/13 | 500,000.000 | 528,750.000 |
| 社債券 | FIBRIA 7.5 05/04/20 | 1,196,000.000 | 1,288,690.000 |
| 社債券 | GAZPRU 10.5 03/25/14 | 1,000,000.000 | 1,197,350.000 |
| 社債券 | HALYK 7.25 05/03/17 | 400,000.000 | 407,000.000 |
| 社債券 | HALYK 7.25 05/03/17 | 350,000.000 | 356,125.000 |
| 社債券 | HALYK 7.25 05/03/17 | 650,000.000 | 661,375.000 |
| 社債券 | HALYK 9.25 10/16/13 | 300,000.000 | 330,315.000 |
| 社債券 | HALYK 9.25 10/16/13 | 900,000.000 | 990,945.000 |
| 社債券 | HSBKKZ 7.75 05/13/13 | 500,000.000 | 533,650.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 400,000.000 | 433,200.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 650,000.000 | 703,950.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 500,000.000 | 541,500.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 800,000.000 | 866,400.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 1,000,000.000 | 1,083,000.000 |
| 社債券 | INTERG 6.375 05/14/17 | 2,000,000.000 | 2,166,000.000 |
| 社債券 | KTZKZ 7 05/11/16 | 1,000,000.000 | 1,054,500.000 |
| 社債券 | KTZKZ 7 05/11/16 | 1,000,000.000 | 1,054,500.000 |
| 社債券 | KZOLKZ 11.75 01/23/15 | 3,500,000.000 | 4,408,600.000 |
| 社債券 | KZOLKZ 11.75 01/23/15 | 1,000,000.000 | 1,259,600.000 |

| | | | | |
|------------------|-----------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| 社債券 | KZOLKZ 11.75 01/23/15 | 500,000.000 | 629,800.000 | |
| 社債券 | KZOLKZ 11.75 01/23/15 | 500,000.000 | 629,800.000 | |
| 社債券 | MABEMX 7.875 10/28/19 | 250,000.000 | 275,600.000 | |
| 社債券 | MHPSA 10.25 04/29/15 | 900,000.000 | 944,352.000 | |
| 社債券 | MHPSA 10.25 04/29/15 | 100,000.000 | 104,928.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 400,000.000 | 469,444.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 400,000.000 | 469,444.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 500,000.000 | 586,805.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 150,000.000 | 176,041.500 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 500,000.000 | 586,805.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 550,000.000 | 645,485.500 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 120,000.000 | 140,833.200 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 300,000.000 | 352,083.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 600,000.000 | 704,166.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 2,500,000.000 | 2,934,025.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 600,000.000 | 704,166.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 500,000.000 | 586,805.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 1,000,000.000 | 1,173,610.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 100,000.000 | 117,361.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 200,000.000 | 234,722.000 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 250,000.000 | 293,402.500 | |
| 社債券 | NATPOW 6.875 11/02/16 | 350,000.000 | 410,763.500 | |
| 社債券 | NATPOW 9.625 05/15/28 | 1,000,000.000 | 1,366,250.000 | |
| 社債券 | NETBZ 7.5 01/27/20 | 1,300,000.000 | 1,477,125.000 | |
| 社債券 | NIHD 10 08/15/16 | 1,800,000.000 | 2,056,500.000 | |
| 社債券 | ODBR 7 04/21/20 | 500,000.000 | 532,560.000 | |
| 社債券 | PCU 7.5 07/27/35 | 500,000.000 | 570,155.000 | |
| 社債券 | PDVSA 4.9 10/28/14 | 250,000.000 | 155,625.000 | |
| 社債券 | PDVSA 4.9 10/28/14 | 250,000.000 | 155,625.000 | |
| 社債券 | PDVSA 4.9 10/28/14 | 500,000.000 | 311,250.000 | |
| 社債券 | PDVSA 4.9 10/28/14 | 250,000.000 | 155,625.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 700,000.000 | 400,750.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 800,000.000 | 458,000.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 250,000.000 | 143,125.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 1,000,000.000 | 572,500.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 500,000.000 | 286,250.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 1,200,000.000 | 687,000.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 400,000.000 | 229,000.000 | |
| 社債券 | PDVSA 5.25 04/12/17 | 800,000.000 | 458,000.000 | |
| 社債券 | PEMEX 5.75 03/01/18 | 2,882,000.000 | 3,121,465.380 | |
| 社債券 | PETMEX 9.5 08/19/14 | 2,000,000.000 | 2,212,500.000 | |
| 社債券 | PETRTT 9.75 08/14/19 | 1,000,000.000 | 1,221,900.000 | |
| 社債券 | PLNIJ 7.75 01/20/20 | 1,300,000.000 | 1,537,250.000 | |
| 社債券 | PLNIJ 8 08/07/19 | 650,000.000 | 775,840.000 | |
| 社債券 | POSADA 9.25 01/15/15 | 500,000.000 | 482,600.000 | |
| 社債券 | RSHB 9 06/11/14 | 300,000.000 | 343,020.000 | |
| 社債券 | RSHB 9 06/11/14 | 111,000.000 | 126,689.850 | |
| 社債券 | RSHB 9 06/11/14 | 389,000.000 | 443,985.150 | |
| 社債券 | TAM 7.375 04/25/17 | 880,000.000 | 897,600.000 | |
| 社債券 | TAM 7.375 04/25/17 | 400,000.000 | 408,000.000 | |
| 社債券 | TAM 7.375 04/25/17 | 1,000,000.000 | 1,020,000.000 | |
| 社債券 | TMENRU 7.25 02/02/20 | 150,000.000 | 162,562.500 | |
| 社債券 | TMENRU 7.25 02/02/20 | 250,000.000 | 270,937.500 | |
| 社債券 | TNEFT 8.7 08/07/18 | 1,500,000.000 | 1,840,650.000 | |
| 社債券 | TNEFT 8.7 08/07/18 | 800,000.000 | 981,680.000 | |
| 社債券 | TNEFT 8.7 08/07/18 | 600,000.000 | 736,260.000 | |
| 社債券 | VIP 9.125 04/30/18 | 850,000.000 | 963,687.500 | |
| 社債券 | VTB 6.875 05/29/18 | 2,125,000.000 | 2,244,956.250 | |
| 社債券 | VTB 6.875 05/29/18 | 165,000.000 | 174,314.250 | |
| 社債券 | VTB 6.875 05/29/18 | 100,000.000 | 105,645.000 | |
| 社債券 | VTB 6.875 05/29/18 | 105,000.000 | 110,927.250 | |
| 小計（アメリカ・ドル）100銘柄 | | 267,238,731.650 | 291,106,175.720 | (24,534,428,490) |

| | | | | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------------------------|-----------------------------------|
| メキシコ・ ペソ | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 3,000,000.000 | 4,223,820.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 20,000,000.000 | 28,158,800.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 50,000,000.000 | 70,397,000.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 3,815,000.000 | 5,371,291.100 | |
| | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 4,185,000.000 | 5,892,228.900 | |
| | 国債証券 | MBONO 10 11/20/36 | 18,000,000.000 | 25,342,920.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 8 12/17/15 | 8,780,000.000 | 9,650,537.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 8 12/17/15 | 24,800,000.000 | 27,258,920.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 8 12/17/15 | 20,000,000.000 | 21,983,000.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 8 12/17/15 | 17,000,000.000 | 18,685,550.000 | |
| | 国債証券 | MBONO 8 12/17/15 | 5,000,000.000 | 5,495,750.000 | |
| 国債証券 | MBONO 8.5 11/18/38 | 7,600,000.000 | 8,869,732.000 | | |
| 小計（メキシコ・ペソ）3 銘柄 | | | 182,180,000.000 | 231,329,549.000 (1,552,221,274) | |
| 南アフリ カ・ランド | 国債証券 | SAGB 13.5 09/15/15 | 5,000,000.000 | 6,297,000.000 | |
| | 国債証券 | SAGB 13.5 09/15/15 | 5,000,000.000 | 6,297,000.000 | |
| | 小計（南アフリカ・ランド）1 銘柄 | | | 10,000,000.000 | 12,594,000.000 (151,128,000) |
| 合計 | | | | 26,237,777,764 (26,237,777,764) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 | 有価証券の合計 | |
|-----------|-------|--------|----------|-------|
| | | 時価比率 | 金額に対する比率 | |
| アメリカ・ドル | 国債証券 | 47銘柄 | 88.39% | |
| | 地方債証券 | 2銘柄 | | |
| | 特殊債券 | 6銘柄 | | |
| | 社債券 | 45銘柄 | | |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 3銘柄 | 5.59% | 5.91% |
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 | 1銘柄 | 0.54% | 0.58% |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年3月29日現在 金額(円) | 平成22年9月27日現在 金額(円) |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 153,832,450 | 171,190,533 |
| コール・ローン | 549,220 | 552,757 |
| 国債証券 | 3,543,812,807 | 2,767,217,878 |
| 特殊債券 | 114,237,801 | 108,594,419 |
| 社債券 | 815,921,103 | 711,623,803 |
| 派生商品評価勘定 | 6,332,887 | 14,006,493 |
| 未収入金 | 79,407,005 | 1,596,571 |
| 未収利息 | 82,741,405 | 61,366,528 |
| 前払費用 | 16,466,883 | 13,477,892 |
| 流動資産合計 | 4,813,301,561 | 3,849,626,874 |
| 資産合計 | 4,813,301,561 | 3,849,626,874 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 10,650,211 | 16,180,615 |
| 未払金 | 13,109,500 | 11,315,578 |
| 流動負債合計 | 23,759,711 | 27,496,193 |
| 負債合計 | 23,759,711 | 27,496,193 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,524,073,684 | 4,646,334,882 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 734,531,834 | 824,204,201 |
| 元本等合計 | 4,789,541,850 | 3,822,130,681 |
| 純資産合計 | 4,789,541,850 | 3,822,130,681 |
| 負債純資産合計 | 4,813,301,561 | 3,849,626,874 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|---|------------------------------------|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 国債証券、特殊債券及び社債券 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 6,311,052,005円 | 5,524,073,684円 |
| 期中追加設定元本額 | - | - |
| 期中一部解約元本額 | 786,978,321円 | 877,738,802円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル資産分散オープン | 5,524,073,684円 | 4,646,334,882円 |
| 合計 | 5,524,073,684円 | 4,646,334,882円 |
| 2. 受益権の総数 | 5,524,073,684口 | 4,646,334,882口 |
| 3. 元本の欠損 | | |
| | 734,531,834円 | 824,204,201円 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|------|---------------|-------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 3,543,812,807 | 47,025,747 |
| 特殊債券 | 114,237,801 | 14,643,932 |
| 社債券 | 815,921,103 | 86,178,286 |
| 合計 | 4,473,971,711 | 147,847,965 |

「計算期間」とは、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月28日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|------|----------------------|
| 国債証券 | 50,037,771 |
| 特殊債券 | 1,665,554 |
| 社債券 | 4,942,570 |
| 合計 | 56,645,895 |

「計算期間」とは、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年3月30日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 3月29日現在 | | | |
|---------------|--------------|---------------|------------------|---------------|-------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | イギリス・ポンド | 178,865,618 | - | 174,963,513 | 3,902,105 |
| | スイス・フラン | 70,276,909 | - | 72,531,802 | 2,254,893 |
| | ノルウェー・クローネ | 99,335,653 | - | 100,461,858 | 1,126,205 |
| | スウェーデン・クローナ | 46,417,608 | - | 47,865,972 | 1,448,364 |
| | ポーランド・ズロチ | 2,466,800 | - | 2,480,120 | 13,320 |
| | ユーロ | 115,265,037 | - | 116,356,290 | 1,091,253 |
| | 売建 | | | | |
| | イギリス・ポンド | 76,227,764 | - | 76,412,215 | 184,451 |
| | スイス・フラン | 23,531,380 | - | 24,191,529 | 660,149 |
| | スウェーデン・クローナ | 3,679,920 | - | 3,703,453 | 23,533 |
| | ポーランド・ズロチ | 11,825,973 | - | 12,308,825 | 482,852 |
| | ユーロ | 397,362,588 | - | 402,360,857 | 4,998,269 |
| | 合計 | - | - | 1,033,636,434 | 4,317,324 |

評価損益は、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 9月27日現在 | | | |
|---------------|--------------|---------------|------------------|-------------|-------------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | イギリス・ポンド | 107,453,470 | - | 108,089,727 | 636,257 |
| | スイス・フラン | 89,629,988 | - | 94,080,157 | 4,450,169 |
| | デンマーク・クローネ | 62,432,629 | - | 64,585,952 | 2,153,323 |
| | ノルウェー・クローネ | 54,123,036 | - | 56,133,456 | 2,010,420 |
| | スウェーデン・クローナ | 23,082,357 | - | 24,608,267 | 1,525,910 |
| | ユーロ | 95,428,697 | - | 98,453,055 | 3,024,358 |
| | 売建 | | | | |
| | スイス・フラン | 19,328,860 | - | 19,426,481 | 97,621 |
| | スウェーデン・クローナ | 20,113,653 | - | 20,048,770 | 64,883 |
| | ポーランド・ズロチ | 55,986,184 | - | 59,102,207 | 3,116,023 |
| | ユーロ | 336,721,480 | - | 349,547,278 | 12,825,798 |
| | 合計 | - | - | 894,075,350 | 2,174,122 |

評価損益は、「欧州債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 0.8670円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,670円）」 | 1口当たり純資産額 0.8226円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,226円）」 |

（3）附属明細表
有価証券明細表
<株式以外の有価証券>

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------------|----------------------|--------------------|---------------|----------------------------------|----|
| イギリス・ ポンド | 国債証券 | UKT 2.25 03/07/14 | 12,000.000 | 12,391.200 | |
| | 国債証券 | UKT 2.75 01/22/15 | 124,000.000 | 129,406.400 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 24,000.000 | 25,096.800 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 30,000.000 | 31,371.000 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 16,000.000 | 16,731.200 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 21,000.000 | 21,959.700 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 130,000.000 | 135,941.000 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 95,000.000 | 99,341.500 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 22,000.000 | 23,005.400 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 06/07/32 | 33,000.000 | 34,508.100 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 09/07/39 | 207,000.000 | 214,928.100 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 09/07/39 | 60,000.000 | 62,298.000 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 09/07/39 | 19,000.000 | 19,727.700 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 5,000.000 | 5,209.500 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 54,000.000 | 56,262.600 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 74,000.000 | 77,100.600 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 267,000.000 | 278,187.300 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 190,000.000 | 197,961.000 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 75,000.000 | 78,142.500 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 15,000.000 | 15,628.500 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 28,000.000 | 29,173.200 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 28,000.000 | 29,173.200 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 65,000.000 | 67,723.500 | |
| | 国債証券 | UKT 4.25 12/07/46 | 54,000.000 | 56,262.600 | |
| | 国債証券 | UKT 4.5 03/07/19 | 399,000.000 | 447,638.100 | |
| | 国債証券 | UKT 4.5 03/07/19 | 58,000.000 | 65,070.200 | |
| | 国債証券 | UKT 4.75 09/07/15 | 209,000.000 | 237,821.100 | |
| | 国債証券 | UKT 4.75 09/07/15 | 112,000.000 | 127,444.800 | |
| | 国債証券 | UKT 8.75 08/25/17 | 121,000.000 | 170,150.200 | |
| | 特殊債券 | EIB 6.25 04/15/14 | 305,000.000 | 352,183.500 | |
| 社債券 | MANUTD 8.75 02/01/17 | 50,000.000 | 48,325.000 | | |
| 小計（イギリス・ポンド）10銘柄 | | | 2,930,000.000 | 3,195,336.700 (426,034,242) | |
| スウェーデン・ クローナ | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 45,000.000 | 54,765.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 230,000.000 | 279,910.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 205,000.000 | 249,485.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 200,000.000 | 243,400.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 140,000.000 | 170,380.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 540,000.000 | 657,180.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 170,000.000 | 206,890.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 555,000.000 | 675,435.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 270,000.000 | 328,590.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 60,000.000 | 73,020.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 35,000.000 | 42,595.000 | |
| | 国債証券 | SGB 5 12/01/20 | 130,000.000 | 158,210.000 | |
| 国債証券 | SGB 5.25 3/15/11 | 1,630,000.000 | 1,663,757.300 | | |
| 小計（スウェーデン・クローナ）2銘柄 | | | 4,210,000.000 | 4,803,617.300 (59,516,818) | |
| ポーランド・ ズロチ | 国債証券 | POLGB 5 10/24/13 | 950,000.000 | 955,700.000 | |
| | 国債証券 | POLGB 5 10/24/13 | 1,250,000.000 | 1,257,500.000 | |
| | 国債証券 | POLGB 5 10/24/13 | 514,000.000 | 517,084.000 | |
| | 国債証券 | POLGB 5.5 04/25/15 | 1,577,000.000 | 1,600,891.550 | |
| | 国債証券 | POLGB 5.5 10/25/19 | 105,000.000 | 105,630.000 | |
| | 国債証券 | POLGB 5.5 10/25/19 | 903,000.000 | 908,418.000 | |
| 小計（ポーランド・ズロチ）3銘柄 | | | 5,299,000.000 | 5,345,223.550 (152,659,585) | |
| ユーロ | 国債証券 | BGB 3.25 09/28/16 | 264,000.000 | 273,688.800 | |
| | 国債証券 | BGB 4 03/28/18 | 204,000.000 | 219,565.200 | |
| | 国債証券 | BGB 4 03/28/18 | 45,000.000 | 48,433.500 | |

| | | | | |
|------|-----------------------|---------------|---------------|--|
| 国債証券 | BGB 5 03/28/35 | 292,000.000 | 349,521.080 | |
| 国債証券 | BGB 5 03/28/35 | 47,000.000 | 56,258.530 | |
| 国債証券 | BGB 5 03/28/35 | 44,000.000 | 52,667.560 | |
| 国債証券 | BRAZIL 11 06/26/17 | 58,000.000 | 82,957.400 | |
| 国債証券 | BRAZIL 11 06/26/17 | 68,000.000 | 97,260.400 | |
| 国債証券 | BTF 0 11/04/10 | 200,000.000 | 199,878.000 | |
| 国債証券 | BTPS 3.75 08/01/16 | 155,000.000 | 161,649.500 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 17,000.000 | 15,334.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 125,000.000 | 112,750.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 580,000.000 | 523,160.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 87,000.000 | 78,474.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 126,000.000 | 113,652.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4 02/01/37 | 91,000.000 | 82,082.000 | |
| 国債証券 | BTPS 4.25 08/01/14 | 90,000.000 | 95,580.000 | |
| 国債証券 | BTPS 5 02/01/12 | 206,000.000 | 215,066.060 | |
| 国債証券 | BTPS 5.25 08/01/17 | 1,090,000.000 | 1,223,198.000 | |
| 国債証券 | BTPS 5.25 08/01/17 | 530,000.000 | 594,766.000 | |
| 国債証券 | BTPS 5.25 08/01/17 | 594,000.000 | 666,586.800 | |
| 国債証券 | BTPS 5.25 08/01/17 | 166,000.000 | 186,285.200 | |
| 国債証券 | DBR 3.5 07/04/19 | 58,000.000 | 63,771.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.5 07/04/19 | 30,000.000 | 32,985.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.5 07/04/19 | 60,000.000 | 65,970.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.5 07/04/19 | 87,000.000 | 95,656.500 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 40,000.000 | 44,096.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 510,000.000 | 562,224.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 30,000.000 | 33,072.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 95,000.000 | 104,728.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 133,000.000 | 146,619.200 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 45,000.000 | 49,608.000 | |
| 国債証券 | DBR 3.75 01/04/15 | 16,000.000 | 17,638.400 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 26,000.000 | 30,979.000 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 15,000.000 | 17,872.500 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 32,000.000 | 38,128.000 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 43,000.000 | 51,234.500 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 16,000.000 | 19,064.000 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 159,000.000 | 189,448.500 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 46,000.000 | 54,809.000 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 104,000.000 | 123,916.000 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 145,000.000 | 172,767.500 | |
| 国債証券 | DBR 4 01/04/37 | 17,000.000 | 20,255.500 | |
| 国債証券 | DBR 4.25 07/04/14 | 155,000.000 | 172,809.500 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.5 01/04/13 | 583,000.000 | 632,496.700 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.5 01/04/13 | 920,000.000 | 998,108.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.5 01/04/13 | 98,000.000 | 106,320.200 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.5 01/04/13 | 110,000.000 | 119,339.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 16,000.000 | 20,848.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 26,000.000 | 33,878.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 112,000.000 | 145,936.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 12,000.000 | 15,636.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 40,000.000 | 52,120.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 20,000.000 | 26,060.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 8,000.000 | 10,424.000 | |
| 国債証券 | DEUTSCH 4.75 07/04/34 | 113,000.000 | 147,239.000 | |
| 国債証券 | FRTR 3.75 04/25/21 | 526,000.000 | 570,815.200 | |
| 国債証券 | FRTR 4 04/25/13 | 13,000.000 | 13,977.600 | |
| 国債証券 | FRTR 4 04/25/13 | 1,096,000.000 | 1,178,419.200 | |
| 国債証券 | FRTR 4 04/25/13 | 215,000.000 | 231,168.000 | |
| 国債証券 | FRTR 4 10/25/14 | 121,000.000 | 133,015.300 | |
| 国債証券 | FRTR 4 10/25/14 | 148,000.000 | 162,696.400 | |
| 国債証券 | FRTR 4 10/25/14 | 79,000.000 | 86,844.700 | |
| 国債証券 | FRTR 4 10/25/14 | 60,000.000 | 65,958.000 | |
| 国債証券 | FRTR 5 10/25/16 | 311,000.000 | 363,310.200 | |
| 国債証券 | FRTR 5 10/25/16 | 138,000.000 | 161,211.600 | |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 17,000.000 | 23,449.460 | |

| | | | |
|------|-----------------------|-------------|-------------|
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 28,000.000 | 38,622.640 |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 125,000.000 | 172,422.500 |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 130,000.000 | 179,319.400 |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 250,000.000 | 344,845.000 |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 111,000.000 | 153,111.180 |
| 国債証券 | FRTR 5.75 10/25/32 | 67,000.000 | 92,418.460 |
| 国債証券 | FRTR OAT 6 10/25/25 | 72,000.000 | 97,452.000 |
| 国債証券 | IRISH 4.6 04/18/16 | 131,000.000 | 124,607.200 |
| 国債証券 | IRISH 5.4 03/13/25 | 85,000.000 | 73,902.400 |
| 国債証券 | IRISH 5.4 03/13/25 | 8,000.000 | 6,955.520 |
| 国債証券 | IRISH 5.9 10/18/19 | 378,000.000 | 363,598.200 |
| 国債証券 | IRISH 5.9 10/18/19 | 47,000.000 | 45,209.300 |
| 国債証券 | IRISH 5.9 10/18/19 | 43,000.000 | 41,361.700 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 428,000.000 | 523,144.400 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 27,000.000 | 33,002.100 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 170,000.000 | 207,791.000 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 78,000.000 | 95,339.400 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 95,000.000 | 116,118.500 |
| 国債証券 | ITALYBTSP6.5 11/1/27 | 75,000.000 | 91,672.500 |
| 国債証券 | NETHER 4.5 07/15/17 | 114,000.000 | 131,191.200 |
| 国債証券 | NETHER 5.5 01/15/28 | 285,000.000 | 381,700.500 |
| 国債証券 | NETHER 5.5 01/15/28 | 12,000.000 | 16,071.600 |
| 国債証券 | RAGB 4.65 01/15/18 | 165,000.000 | 188,953.050 |
| 国債証券 | RAGB 4.65 01/15/18 | 20,000.000 | 22,903.400 |
| 国債証券 | RAGB 6.25 07/15/27 | 249,000.000 | 345,290.790 |
| 国債証券 | SPAIN 5 07/30/12 | 728,000.000 | 767,130.000 |
| 国債証券 | SPGB 3.8 01/31/17 | 103,000.000 | 104,055.750 |
| 国債証券 | SPGB 3.8 01/31/17 | 142,000.000 | 143,455.500 |
| 国債証券 | SPGB 3.8 01/31/17 | 81,000.000 | 81,830.250 |
| 国債証券 | SPGB 4.4 01/31/15 | 500,000.000 | 529,150.000 |
| 国債証券 | SPGB 4.6 07/30/19 | 200,000.000 | 209,434.000 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 72,000.000 | 80,311.680 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 100,000.000 | 111,544.000 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 47,000.000 | 52,425.680 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 60,000.000 | 66,926.400 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 69,000.000 | 76,965.360 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 156,000.000 | 174,008.640 |
| 国債証券 | SPGB 5.75 07/30/32 | 67,000.000 | 74,734.480 |
| 特殊債券 | GAZPRU 5.875 06/01/15 | 100,000.000 | 106,375.000 |
| 特殊債券 | GAZPRU 6.605 02/13/18 | 187,000.000 | 202,754.750 |
| 特殊債券 | SEK 3.625 05/27/14 | 220,000.000 | 233,552.000 |
| 社債券 | ABIBB 4 04/26/18 | 35,000.000 | 37,101.750 |
| 社債券 | AHOLD 5.875 03/14/12 | 25,000.000 | 26,350.000 |
| 社債券 | AIB 12.5 06/25/19 | 50,000.000 | 50,125.000 |
| 社債券 | ALUFP 6.375 04/07/14 | 50,000.000 | 50,397.500 |
| 社債券 | ALVGR FL 01/13/25 | 7,000.000 | 7,871.150 |
| 社債券 | ALVGR FL 01/13/25 | 4,000.000 | 4,497.800 |
| 社債券 | ALVGR FL 01/13/25 | 3,000.000 | 3,373.350 |
| 社債券 | ALVGR FL 01/13/25 | 4,000.000 | 4,497.800 |
| 社債券 | ANZ 5.125 09/10/19 | 50,000.000 | 54,517.500 |
| 社債券 | ARGID 7.125 06/15/17 | 50,000.000 | 48,427.500 |
| 社債券 | ATLIM 5.625 05/06/16 | 50,000.000 | 55,905.000 |
| 社債券 | AVLN FL 05/22/38 | 50,000.000 | 51,757.500 |
| 社債券 | BAC 4.625 02/18/14 | 70,000.000 | 72,814.000 |
| 社債券 | BACR 5.25 05/27/14 | 50,000.000 | 54,572.500 |
| 社債券 | BACR 6 01/14/21 | 50,000.000 | 53,335.000 |
| 社債券 | BERTEL 4.75 09/26/16 | 30,000.000 | 32,400.000 |
| 社債券 | BESNN 6.25 05/17/11 | 40,000.000 | 40,402.000 |
| 社債券 | BEVPAC 9.5 06/15/17 | 50,000.000 | 47,882.500 |
| 社債券 | BNP 2.875 07/13/15 | 9,000.000 | 9,172.800 |
| 社債券 | BOGAEI 5.75 06/16/14 | 50,000.000 | 52,220.000 |
| 社債券 | BOMB 7.25 11/15/16 | 50,000.000 | 53,427.500 |
| 社債券 | C 6.4 03/27/13 | 50,000.000 | 54,277.500 |
| 社債券 | C 7.375 06/16/14 | 50,000.000 | 56,617.500 |

| | | | | |
|-----|------------------------|-------------|-------------|--|
| 社債券 | C FL 02/10/19 | 30,000.000 | 29,686.500 | |
| 社債券 | CCK 7.125 08/15/18 | 50,000.000 | 52,497.500 | |
| 社債券 | CEDC 8.875 12/01/16 | 50,000.000 | 53,747.500 | |
| 社債券 | COFP 4.875 04/10/14 | 50,000.000 | 53,399.500 | |
| 社債券 | CONGR 8.5 07/15/15 | 50,000.000 | 54,000.000 | |
| 社債券 | CS 6.125 08/05/13 | 50,000.000 | 55,522.500 | |
| 社債券 | CS 6.375 06/07/13 | 50,000.000 | 55,307.500 | |
| 社債券 | DB 5.125 01/31/13 | 40,000.000 | 42,516.000 | |
| 社債券 | DT 4.25 03/16/20 | 13,000.000 | 13,642.850 | |
| 社債券 | EBSBLD 4 02/25/15 | 50,000.000 | 45,670.000 | |
| 社債券 | EDNIM 5.125 12/10/10 | 62,000.000 | 62,480.500 | |
| 社債券 | EIBKOR 5.75 05/22/13 | 50,000.000 | 53,693.000 | |
| 社債券 | ENEL 5.25 01/14/15 | 40,000.000 | 43,912.000 | |
| 社債券 | EOAGR 5.125 10/02/12 | 25,000.000 | 26,712.500 | |
| 社債券 | EOANGR 5.5 01/19/16 | 20,000.000 | 23,016.000 | |
| 社債券 | EUROCA 9.75 08/01/17 | 50,000.000 | 54,422.500 | |
| 社債券 | F 9.375 01/17/14 | 50,000.000 | 55,687.500 | |
| 社債券 | FIAT 9 07/30/12 | 50,000.000 | 54,255.000 | |
| 社債券 | FNCIM 5.75 12/12/18 | 30,000.000 | 33,472.500 | |
| 社債券 | GE 6 01/15/19 | 50,000.000 | 57,482.500 | |
| 社債券 | GE FL 09/15/66 | 15,000.000 | 12,525.000 | |
| 社債券 | GE FL 09/15/66 | 65,000.000 | 54,275.000 | |
| 社債券 | GMAC 7.5 04/21/15 | 50,000.000 | 51,375.000 | |
| 社債券 | GS 5.125 10/16/14 | 100,000.000 | 106,075.000 | |
| 社債券 | GSZFP 5.625 01/18/16 | 40,000.000 | 46,396.000 | |
| 社債券 | HEIGR 7.5 10/31/14 | 25,000.000 | 26,605.000 | |
| 社債券 | HEIGR 7.5 10/31/14 | 15,000.000 | 15,963.000 | |
| 社債券 | HELLA 7.25 10/20/14 | 14,000.000 | 15,057.000 | |
| 社債券 | HELLA 7.25 10/20/14 | 26,000.000 | 27,963.000 | |
| 社債券 | HSBC FL 06/29/20 | 40,000.000 | 40,802.000 | |
| 社債券 | HTZ 7.875 01/01/14 | 50,000.000 | 51,125.000 | |
| 社債券 | IMPTOB 4.375 11/22/13 | 50,000.000 | 52,987.500 | |
| 社債券 | INTNED 5.5 01/04/12 | 60,000.000 | 62,070.000 | |
| 社債券 | ISPIM FL 05/28/18 | 100,000.000 | 103,805.000 | |
| 社債券 | JPM 3.625 12/12/11 | 550,000.000 | 566,830.000 | |
| 社債券 | JPM FL 11/12/19 | 100,000.000 | 102,295.000 | |
| 社債券 | KABEGR 10.75 07/01/14 | 50,000.000 | 52,557.500 | |
| 社債券 | KERLIN 10.625 02/01/17 | 50,000.000 | 52,867.500 | |
| 社債券 | KPN 7.5 02/04/19 | 50,000.000 | 64,475.000 | |
| 社債券 | LGEN FL 06/08/25 | 50,000.000 | 46,237.500 | |
| 社債券 | LGFP 5.5 12/16/19 | 50,000.000 | 50,952.500 | |
| 社債券 | LLOYDS 6.375 06/17/16 | 50,000.000 | 56,052.500 | |
| 社債券 | LR 4.25 02/24/17 | 50,000.000 | 52,365.000 | |
| 社債券 | LTOIM 5.375 12/05/16 | 50,000.000 | 53,180.000 | |
| 社債券 | LYO 8 11/01/17 | 50,000.000 | 53,873.500 | |
| 社債券 | MANAG 7.25 05/20/16 | 10,000.000 | 12,158.000 | |
| 社債券 | MDPAC 7.75 11/15/19 | 50,000.000 | 52,497.500 | |
| 社債券 | MER 6.75 05/21/13 | 50,000.000 | 54,382.500 | |
| 社債券 | MET 4.625 05/16/17 | 50,000.000 | 53,570.000 | |
| 社債券 | MICH 8.625 04/24/14 | 15,000.000 | 17,988.000 | |
| 社債券 | MONTE 4.75 04/30/14 | 50,000.000 | 52,135.000 | |
| 社債券 | MRKGR 3.375 03/24/15 | 19,000.000 | 19,757.150 | |
| 社債券 | MRKGR 4.875 09/27/13 | 8,000.000 | 8,653.600 | |
| 社債券 | MS 4 11/17/15 | 70,000.000 | 71,004.500 | |
| 社債券 | MS 6.5 04/15/11 | 50,000.000 | 51,332.500 | |
| 社債券 | MTNA 9.375 06/03/16 | 50,000.000 | 62,265.000 | |
| 社債券 | MUNRE FL PERPETUAL | 50,000.000 | 47,537.500 | |
| 社債券 | NBHSS 4.5 03/26/20 | 50,000.000 | 53,290.000 | |
| 社債券 | NGGLN 5.125 05/14/13 | 50,000.000 | 54,025.000 | |
| 社債券 | NOVASP 9.625 12/15/16 | 50,000.000 | 39,307.500 | |
| 社債券 | NWIDE 3.75 01/20/15 | 50,000.000 | 50,384.500 | |
| 社債券 | NWORLD 7.875 05/01/18 | 50,000.000 | 51,815.000 | |
| 社債券 | NYL 4.375 01/19/17 | 50,000.000 | 52,355.000 | |
| 社債券 | OBRAS 7.375 04/28/15 | 50,000.000 | 48,125.000 | |

| | | | | |
|-----|-----------------------|----------------|-------------------------------------|--|
| 社債券 | OI 6.75 09/15/20 | 50,000.000 | 51,287.500 | |
| 社債券 | PEMEX 6.25 08/05/13 | 40,000.000 | 43,460.000 | |
| 社債券 | PEMEX 6.375 08/05/16 | 90,000.000 | 99,585.000 | |
| 社債券 | PEMEX 6.375 08/05/16 | 65,000.000 | 71,922.500 | |
| 社債券 | PRTP 8.625 04/03/14 | 20,000.000 | 23,839.000 | |
| 社債券 | RBS 5.375 09/30/19 | 50,000.000 | 51,615.000 | |
| 社債券 | RENAUL 8.125 05/15/12 | 14,000.000 | 15,143.800 | |
| 社債券 | RENAUL 8.125 05/15/12 | 10,000.000 | 10,817.000 | |
| 社債券 | RENTKL 4.625 03/27/14 | 50,000.000 | 52,465.000 | |
| 社債券 | RIFP 7 01/15/15 | 50,000.000 | 55,360.000 | |
| 社債券 | ROSW 4.625 03/04/13 | 17,000.000 | 18,157.700 | |
| 社債券 | SANTAN 4.125 10/04/17 | 50,000.000 | 49,757.500 | |
| 社債券 | SFGSM 8.25 10/31/16 | 50,000.000 | 51,812.500 | |
| 社債券 | STANLN FL 02/03/17 | 20,000.000 | 20,105.000 | |
| 社債券 | STANLN FL 02/03/17 | 60,000.000 | 60,315.000 | |
| 社債券 | STENA 6.125 02/01/17 | 50,000.000 | 46,550.000 | |
| 社債券 | SUEZE 6.25 04/08/19 | 50,000.000 | 61,682.500 | |
| 社債券 | TELEFO 5.431 02/03/14 | 50,000.000 | 54,080.000 | |
| 社債券 | TITIM 8.25 03/21/16 | 50,000.000 | 60,280.000 | |
| 社債券 | TITIM 8.25 03/21/16 | 50,000.000 | 60,280.000 | |
| 社債券 | TLIASS 3.875 10/01/25 | 50,000.000 | 48,889.500 | |
| 社債券 | TPSA 6 05/22/14 | 50,000.000 | 55,707.500 | |
| 社債券 | UBS 6 04/18/18 | 50,000.000 | 58,402.500 | |
| 社債券 | UCGIM 5.75 09/26/17 | 50,000.000 | 54,332.500 | |
| 社債券 | UCGIM FL PERPETUAL | 50,000.000 | 50,681.500 | |
| 社債券 | UCIM 6.1 02/28/12 | 18,000.000 | 18,807.300 | |
| 社債券 | UNITY 9.625 12/01/19 | 50,000.000 | 53,995.000 | |
| 社債券 | VIEFP 4.875 05/28/13 | 50,000.000 | 53,752.500 | |
| 社債券 | VOTORA 5.25 04/28/17 | 50,000.000 | 51,042.500 | |
| 社債券 | VW 2.375 06/28/13 | 20,000.000 | 20,206.000 | |
| 社債券 | WESAU 3.875 07/10/15 | 50,000.000 | 52,627.500 | |
| 社債券 | WINDIM 9.75 12/01/15 | 50,000.000 | 52,712.500 | |
| 社債券 | WSTP 4.875 09/28/12 | 50,000.000 | 53,127.500 | |
| 社債券 | ZIGGO 8 05/15/18 | 50,000.000 | 52,485.000 | |
| 社債券 | ZURNVX FL 07/24/39 | 50,000.000 | 59,025.000 | |
| | 小計（ユーロ）150銘柄 | 23,631,000.000 | 25,966,063.170 (2,949,225,455) | |
| | 合計 | | 3,587,436,100 (3,587,436,100) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 | 有価証券の合計 |
|-------------|------|--------|----------|
| | | 時価比率 | 金額に対する比率 |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 8 銘柄 | 11.14% |
| | 特殊債券 | 1 銘柄 | |
| | 社債券 | 1 銘柄 | |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 2 銘柄 | 1.56% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 3 銘柄 | 3.99% |
| ユーロ | 国債証券 | 35銘柄 | 77.16% |
| | 特殊債券 | 3 銘柄 | |
| | 社債券 | 112銘柄 | |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

コモディティ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年 3月29日現在 金 額 (円) | 平成22年 9月27日現在 金 額 (円) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,166,932 | 212,581 |
| 社債券 | 2,285,481,360 | 1,715,494,116 |
| 未収入金 | - | 270,867,492 |
| 未収利息 | 7,240,642 | 12,370,993 |
| 流動資産合計 | 2,293,888,934 | 1,998,945,182 |
| 資産合計 | 2,293,888,934 | 1,998,945,182 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 流動負債合計 | - | - |
| 負債合計 | - | - |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,644,797,440 | 3,206,615,133 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 1,350,908,506 | 1,207,669,951 |
| 元本等合計 | 2,293,888,934 | 1,998,945,182 |
| 純資産合計 | 2,293,888,934 | 1,998,945,182 |
| 負債純資産合計 | 2,293,888,934 | 1,998,945,182 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|-------------------------------------|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 社債券 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | - | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 4,722,754,213円 | 3,644,797,440円 |
| 期中追加設定元本額 | - | - |
| 期中一部解約元本額 | 1,077,956,773円 | 438,182,307円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル資産分散オープン | 3,644,797,440円 | 3,206,615,133円 |
| 合計 | 3,644,797,440円 | 3,206,615,133円 |
| 2. 受益権の総数 | 3,644,797,440口 | 3,206,615,133口 |
| 3. 元本の欠損 | 1,350,908,506円 | 1,207,669,951円 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|-------|---------------|-------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 社 債 券 | 2,285,481,360 | 28,166,634 |
| 合計 | 2,285,481,360 | 28,166,634 |

「計算期間」とは、「コモディティ・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月28日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|-------|----------------------|
| 社 債 券 | 132,541,256 |
| 合計 | 132,541,256 |

「計算期間」とは、「コモディティ・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平

成22年3月30日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項

（平成22年 3月29日現在）

該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（通貨関連）

| 区分 | 種類 | 平成22年 9月27日現在 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|------------------|-------------|---------|
| | | 契約額等 （円） | うち 1年超 （円） | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル | 272,529,180 | - | 272,529,180 | 0 |
| | 合計 | - | - | 272,529,180 | 0 |

評価損益は、「コモディティ・マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、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相場の仲値が発表されている場合には、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当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

B．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）

該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|--|--|
| 1口当たり純資産額 0.6294円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 6,294円) 」 | 1口当たり純資産額 0.6234円 「 1口 = 1円 (10,000口 = 6,234円) 」 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------|--------------------|------------------------------|----------------|-------------------|----|
| アメリカ・ ドル | 社債券 | DJUBS / BARCLAYS 10/19/10 | 16,600,000.000 | 17,783,580.000 | |
| | 社債券 | DJUBS / BARCLAYS 10/19/10 | 2,200,000.000 | 2,356,860.000 | |
| | 社債券 | DJUBS / BARCLAYS 10/19/10 | 200,000.000 | 214,260.000 | |
| | 小計 (アメリカ・ドル) 1銘柄 | | 19,000,000.000 | 20,354,700.000 | |
| 合計 | | | | (1,715,494,116) | |
| | | | | 1,715,494,116 | |
| | | | | (1,715,494,116) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 時価比率 | 有価証券の合計 金額に対する比率 |
|---------|---------|----------------|---------------------|
| アメリカ・ドル | 社債券 1銘柄 | 85.81% | 100.00% |

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

アジア・オセアニア債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区 分 | 平成22年 3月29日現在 金 額 (円) | 平成22年 9月27日現在 金 額 (円) |
|--------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 13,345,298 | 8,645,557 |
| コール・ローン | 23,824,336 | 35,368,717 |
| 国債証券 | 2,355,913,026 | 2,361,198,328 |
| 特殊債券 | 2,370,002,041 | 1,259,259,178 |
| 未収利息 | 22,016,181 | 49,619,316 |
| 前払費用 | 27,078,798 | 7,846,806 |
| 流動資産合計 | 4,812,179,680 | 3,721,937,902 |
| 資産合計 | 4,812,179,680 | 3,721,937,902 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 流動負債合計 | - | - |
| 負債合計 | - | - |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,280,824,666 | 4,176,113,199 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 468,644,986 | 454,175,297 |
| 元本等合計 | 4,812,179,680 | 3,721,937,902 |
| 純資産合計 | 4,812,179,680 | 3,721,937,902 |
| 負債純資産合計 | 4,812,179,680 | 3,721,937,902 |

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|---|---------------------------------|
| | 至 平成22年 3月29日 | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 国債証券及び特殊債券 同左 同左 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 | 同左 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 | 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左 |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 | 外貨建資産等の会計処理 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 1. 元本状況 | | |
| 開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額 | 6,696,274,487円 | 5,280,824,666円 |
| 期中追加設定元本額 | - | - |
| 期中一部解約元本額 | 1,415,449,821円 | 1,104,711,467円 |
| 元本の内訳 | | |
| グローバル資産分散オープン | 5,280,824,666円 | 4,176,113,199円 |
| 合計 | 5,280,824,666円 | 4,176,113,199円 |
| 2. 受益権の総数 | 5,280,824,666口 | 4,176,113,199口 |
| 3. 元本の欠損 | 468,644,986円 | 454,175,297円 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「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。

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成22年 3月30日 |
|----------------------------|--|
| | 至 平成22年 9月27日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、法務コンプライアンス部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、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拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成22年 9月27日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 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)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成22年3月29日現在）

| 種類 | 貸借対照表計上額（円） | 計算期間 の損益に |
|------|---------------|-------------|
| | | 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 2,355,913,026 | 13,556,176 |
| 特殊債券 | 2,370,002,041 | 56,982,989 |
| 合計 | 4,725,915,067 | 70,539,165 |

「計算期間」とは、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年3月28日から平成22年3月29日まで）を指しております。

（平成22年9月27日現在）

| 種類 | 計算期間 の損益に含まれた評価差額（円） |
|------|----------------------|
| 国債証券 | 12,994,412 |
| 特殊債券 | 16,726,413 |
| 合計 | 29,720,825 |

「計算期間」とは、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年3月30日から平成22年9月27日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
取引の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日 |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容 | 当ファンドは為替予約取引を行っております。 |
| 2. 取引に対する取組方針 | 為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。 |
| 3. 取引の利用目的 | 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ため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容 | 為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。 |
| 5. 取引に係るリスク管理体制 | 価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 該当事項はありません。 |

取引の時価等に関する事項
（平成22年 3月29日現在）
該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
（自 平成21年 9月29日 至 平成22年 3月29日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 3月30日 至 平成22年 9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

| 平成22年 3月29日現在 | 平成22年 9月27日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 0.9113円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,113円）」 | 1口当たり純資産額 0.8912円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,912円）」 |

（3）附属明細表
有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------|-------------------|--------------------|----------------|-----------------|----|
| オーストラリア・ドル | 特殊債券 | ASIA 6.25 06/15/11 | 3,000,000.000 | 3,022,950.000 | |
| | 特殊債券 | EIB 5.375 05/20/14 | 12,600,000.000 | 12,534,984.000 | |
| | 小計（オーストラリア・ドル）2銘柄 | | 15,600,000.000 | 15,557,934.000 | |
| | | | | (1,259,259,178) | |
| 香港・ドル | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 800,000.000 | 844,096.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 700,000.000 | 738,584.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 3,000,000.000 | 3,165,360.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 1,500,000.000 | 1,582,680.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 1,000,000.000 | 1,055,120.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 1,000,000.000 | 1,055,120.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 1,000,000.000 | 1,055,120.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 2,000,000.000 | 2,110,240.000 | |
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 3,000,000.000 | 3,165,360.000 | |

| | | | | | |
|--------------|----------------------|---------------------|-------------------|-------------------|--|
| | 国債証券 | HKGB 4.06 03/19/12 | 500,000.000 | 527,560.000 | |
| | 小計（香港・ドル）1 銘柄 | | 14,500,000.000 | 15,299,240.000 | |
| | | | | (166,149,746) | |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 400,000.000 | 413,352.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 200,000.000 | 206,676.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 200,000.000 | 206,676.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 250,000.000 | 258,345.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 200,000.000 | 206,676.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 200,000.000 | 206,676.000 | |
| | 国債証券 | SIGB 2.625 04/01/12 | 250,000.000 | 258,345.000 | |
| | 小計（シンガポール・ドル）1 銘柄 | | 1,700,000.000 | 1,756,746.000 | |
| | | | | (111,992,558) | |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 | NZGB 6 12/15/17 | 8,300,000.000 | 8,869,878.000 | |
| | 国債証券 | NZGB 6.5 04/15/13 | 10,700,000.000 | 11,369,178.000 | |
| | 小計（ニュージーランド・ドル）2 銘柄 | | 19,000,000.000 | 20,239,056.000 | |
| | | | | (1,255,023,863) | |
| 韓国・ウォン | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 400,000,000.000 | 409,556,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 2,000,000,000.000 | 2,047,780,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 2,000,000,000.000 | 2,047,780,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 1,000,000,000.000 | 1,023,890,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 2,000,000,000.000 | 2,047,780,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 600,000,000.000 | 614,334,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 500,000,000.000 | 511,945,000.000 | |
| | 国債証券 | NDFB 4.75 03/10/12 | 500,000,000.000 | 511,945,000.000 | |
| | 小計（韓国・ウォン）1 銘柄 | | 9,000,000,000.000 | 9,215,010,000.000 | |
| | | | | (677,303,235) | |
| マレーシア・リングgit | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 200,000.000 | 200,992.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 400,000.000 | 401,984.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 200,000.000 | 200,992.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 600,000.000 | 602,976.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 1,000,000.000 | 1,004,960.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 300,000.000 | 301,488.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 1,000,000.000 | 1,004,960.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 1,500,000.000 | 1,507,440.000 | |
| | 国債証券 | MGS 3.756 04/28/11 | 300,000.000 | 301,488.000 | |
| | 小計（マレーシア・リングgit）1 銘柄 | | 5,500,000.000 | 5,527,280.000 | |
| | | | | (150,728,926) | |
| 合計 | | | | 3,620,457,506 | |
| | | | | (3,620,457,506) | |

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入有価証券 | | 有価証券の合計 |
|-------------|-----------|--------|----------|---------|
| | | 時価比率 | 金額に対する比率 | |
| オーストラリア・ドル | 特殊債券 2 銘柄 | 33.83% | | 34.78% |
| 香港・ドル | 国債証券 1 銘柄 | 4.46% | | 4.59% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 1 銘柄 | 3.01% | | 3.09% |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 2 銘柄 | 33.72% | | 34.67% |
| 韓国・ウォン | 国債証券 1 銘柄 | 18.20% | | 18.71% |

| | | | | |
|--------------|------|------|-------|-------|
| マレーシア・リングgit | 国債証券 | 1 銘柄 | 4.05% | 4.16% |
|--------------|------|------|-------|-------|

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

(参考)

T . Rowe Price Funds SICAV (以下、同ファンド) は、変動資本を有する会社型投資信託として、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき組成されたオープン・エンド型の投資信託であり、投資信託に関する「2002年12月20日法Part 」に準拠する投資法人として登記されています。

同ファンドの2010年6月30日現在の財務諸表は、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき、一般に公正妥当と認められる会計基準に準拠した財務諸表が作成されています。

同ファンドの「貸借対照表」、「損益および純資産変動計算書」、「投資証券口数計算書」、「一口当たり純資産額および純資産推移」および「有価証券明細表」等は、2010年6月30日現在の財務諸表の原文を委託会社で抜粋・翻訳したものです。

T . ロウ・プライス・ファンズ SICAV

貸借対照表

2010年6月30日現在(未監査)

| | グローバル・エマージ ング・マーケット・エ クイティ・ファンド | グローバル・ハイ・ ールド・ボンド・ ファンド | USアグリゲート・ ボンド・ファンド |
|-----------------|---------------------------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 資 産 | | | |
| 有価証券、取得原価 | 544,442,043 | 978,642,431 | 195,587,470 |
| 未実現評価益(損) | 71,142,538 | 31,685,912 | 10,637,514 |
| 有価証券、時価 | 615,584,581 | 1,010,328,343 | 206,224,984 |
| 現金預金 | 18,105,136 | 20,642,993 | 9,404,992 |
| 有価証券売却未収金 | 662,102 | 8,777,038 | 403,186 |
| 未収配当金および利息 | 814,357 | 19,518,661 | 1,788,927 |
| 発行未収金 | 43,462 | 2,110,682 | - |
| 委託証拠金 | - | - | - |
| その他の資産 | 36,387 | 73,563 | 18,582 |
| スワップ契約、時価 | - | - | - |
| 為替予約取引にかかる未実現利益 | - | - | - |
| 資産合計 | 635,246,025 | 1,061,451,280 | 217,840,671 |
| 負 債 | | | |
| 当座貸越 | - | - | - |
| 有価証券購入未払金 | 1,194,709 | 12,939,534 | 1,207,409 |
| 買戻未払金 | 24,048 | 56,114 | - |
| 為替予約取引にかかる未実現損失 | - | 17,378,856 | - |
| 投資運用報酬 | 556,016 | 759,002 | - |
| その他の負債 | 111,641 | 198,009 | 44,003 |
| スワップ契約、時価 | - | 1,183,762 | - |
| 先物取引にかかる未実現損失 | - | - | - |
| 外国税未払金 | 70,327 | - | - |
| 負債合計 | 1,956,741 | 32,515,277 | 1,251,412 |
| 純資産 | 633,289,284 | 1,028,936,003 | 216,589,259 |

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

2010年6月30日現在(未監査)

| | グローバル・エマージ ング・マーケット・エ クイティ・ファンド | グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド | USアグリゲート・ ボンド・ファンド |
|--------------------------|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| (特段の注記のない限り、口数以外の金額は米ドル) | | | |
| クラスA | | | |
| 純資産 | 103,810,415 | 81,532,117 | - |
| 発行済投資証券口数 | 5,176,478 | 4,605,355 | - |
| 一口当たり純資産額 | 20.05 | 17.70 | - |
| クラスA d | | | |
| 純資産 | - | 31,348,412 | - |
| 発行済投資証券口数 | - | 2,623,245 | - |
| 一口当たり純資産額 | - | 11.95 | - |
| 一口当たり公表配当金 | - | - | - |
| クラスA h (EUR) | | | |
| 純資産(基準通貨) | - | 225,213,589 | - |
| 純資産(クラス通貨) | - | EUR 183,862,840 | - |
| 発行済投資証券口数 | - | 12,186,868 | - |
| 一口当たり純資産額(クラス通貨) | - | EUR 15.09 | - |
| クラスA h (NOK) | | | |
| 純資産(基準通貨) | - | 28,658,873 | - |
| 純資産(クラス通貨) | - | NOK 186,372,951 | - |
| 発行済投資証券口数 | - | 1,429,526 | - |
| 一口当たり純資産額(クラス通貨) | - | NOK 130.37 | - |
| クラスI | | | |
| 純資産 | 483,787,630 | 251,599,825 | - |
| 発行済投資証券口数 | 20,141,192 | 13,795,318 | - |
| 一口当たり純資産額 | 24.02 | 18.24 | - |
| クラスI d | | | |
| 純資産 | - | - | - |
| 発行済投資証券口数 | - | - | - |
| 一口当たり純資産額 | - | - | - |
| 一口当たり公表配当金 | - | - | - |
| クラスI (GBP) | | | |
| 純資産(基準通貨) | - | - | - |
| 純資産(クラス通貨) | - | - | - |
| 発行済投資証券口数 | - | - | - |
| 一口当たり純資産額 | - | - | - |
| クラスJ | | | |
| 純資産 | - | - | - |
| 発行済投資証券口数 | - | - | - |
| 一口当たり純資産額 | - | - | - |
| クラスJ d | | | |
| 純資産 | 21,548,962 | 215,490,032 | 216,589,259 |
| 発行済投資証券口数 | 3,445,321 | 23,387,346 | 20,266,229 |
| 一口当たり純資産額 | 6.25 | 9.21 | 10.69 |
| 一口当たり公表配当金 | 0.0564 | 0.4112 | 0.2336 |
| クラスS | | | |
| 純資産 | - | - | - |
| 発行済投資証券口数 | - | - | - |
| 一口当たり純資産額 | - | - | - |
| クラスS d | | | |
| 純資産 | - | 1,736,859 | - |
| 発行済投資証券口数 | - | 137,057 | - |
| 一口当たり純資産額 | - | 12.67 | - |
| 一口当たり公表配当金 | - | 0.5513 | - |
| クラスZ | | | |
| 純資産 | 24,142,277 | 193,356,296 | - |

| | | | |
|-----------|---------|-----------|---|
| 発行済投資証券口数 | 693,000 | 9,600,521 | - |
| 一口当たり純資産額 | 34.84 | 20.14 | - |

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T・ロウ・プライス・ファンズ SICAV 損益および純資産変動計算書 2010年6月30日に終了した期間（未監査）

| | グローバル・エマージ ング・マーケッツ・エ クイティ・ファンド 米ドル | グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド 米ドル | U S アグリゲート・ ボンド・ファンド 米ドル |
|--------------------------------|--|---------------------------------------|--------------------------------|
| 収益 | | | |
| 受取利息（源泉税控除後） | 1,404 | 48,615,146 | 5,086,018 |
| 受取配当金（源泉税控除後） | 5,573,439 | 804,474 | - |
| スワップにかかる利息 | - | 63,194 | - |
| 収益合計 | 5,574,843 | 49,482,814 | 5,086,018 |
| 費用 | | | |
| 投資運用報酬 | 3,397,789 | 3,312,143 | - |
| 管理会社報酬 | 79,881 | 160,711 | 26,073 |
| 専門家報酬 | 112,758 | 162,703 | 38,387 |
| カストディーフィー | 138,615 | 154,850 | 31,412 |
| 年次税 | 57,949 | 115,304 | 11,409 |
| その他の費用 | 22,525 | 27,661 | 6,914 |
| スワップにかかる利息 | - | - | - |
| 費用合計 | 3,809,517 | 3,933,372 | 114,195 |
| 投資運用会社により免除または負担された費用控除前の投資純損益 | 1,765,326 | 45,549,442 | 4,971,823 |
| 投資運用会社により免除または負担された費用 | 55,590 | 120,167 | 32,520 |
| 投資純損益 | 1,820,916 | 45,669,609 | 5,004,343 |
| 以下にかかる実現損益： | | | |
| 有価証券（外国税控除後） | 41,629,568 | 27,170,214 | 2,865,318 |
| 為替予約取引 | (36,300) | (35,830,955) | - |
| 先物取引 | - | - | - |
| スワップ | - | 1,918,689 | - |
| 外貨取引 | 154,287 | (80,280) | - |
| 実現純損益 | 41,747,555 | (6,822,332) | 2,865,318 |
| 以下にかかる未実現評価損益の純変動： | | | |
| 有価証券（外国税控除後） | (88,601,347) | (40,381,348) | 4,028,503 |
| 為替予約取引 | - | (12,772,737) | - |
| 先物取引 | - | - | - |
| スワップ | - | (1,183,762) | - |
| 支払外国税 | 235,285 | - | - |
| 外貨建のその他の資産および負債 | (11,660) | 1,122,174 | - |
| 未実現評価損益の純変動 | (88,377,722) | (53,215,673) | 4,028,503 |
| 運用による純資産の純増減 | (44,809,251) | (14,368,396) | 11,898,164 |
| 分配金： | | | |
| 分配による純資産の純減少 | (202,479) | (10,160,677) | (5,109,685) |
| 資本取引： | | | |
| 投資証券発行受領額 | 79,072,264 | 378,901,867 | 5,109,670 |
| 投資証券買戻支払額 | (238,058,456) | (363,722,777) | (39,086,399) |
| 資本取引による純資産の純増減 | (158,986,192) | 15,179,090 | (33,976,729) |
| 純資産の増減合計 | (203,997,922) | (9,349,983) | (27,188,250) |
| 期首現在純資産 | 837,287,206 | 1,024,807,232 | 243,777,509 |
| 換算調整 | - | 13,478,754 | - |
| 期末現在純資産 | 633,289,284 | 1,028,936,003 | 216,589,259 |

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T・ロウ・プライス・ファンズ SICAV
投資証券口数変動計算書
2010年6月30日に終了した期間（未監査）

| | グローバル・エマージン グ・マーケッツ・エクイ ティ・ファンド | グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド | U S アグリゲート・ ボンド・ファンド |
|----------------------|---------------------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| クラス A | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | 6,112,495 | 2,841,832 | - |
| 発行投資証券口数 | 882,238 | 3,164,221 | - |
| 買戻投資証券口数 | (1,818,255) | (1,400,698) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | 5,176,478 | 4,605,355 | - |
| クラス A d | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | 3,565,989 | - |
| 発行投資証券口数 | - | 1,215,788 | - |
| 買戻投資証券口数 | - | (2,158,532) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | 2,623,245 | - |
| クラス A h (EUR) | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | 11,930,905 | - |
| 発行投資証券口数 | - | 11,580,479 | - |
| 買戻投資証券口数 | - | (11,324,516) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | 12,186,868 | - |
| クラス A h (NOK) | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | 1,358,703 | - |
| 発行投資証券口数 | - | 362,523 | - |
| 買戻投資証券口数 | - | (291,700) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | 1,429,526 | - |
| クラス I | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | 17,734,362 | 12,192,668 | - |
| 発行投資証券口数 | 2,431,776 | 3,321,270 | - |
| 買戻投資証券口数 | (24,946) | (1,718,620) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | 20,141,192 | 13,795,318 | - |
| クラス I d | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | - | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | - | - | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | - | - |
| クラス I (GBP) | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | - | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | - | - | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | - | - |
| クラス J | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | - | - | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | - | - | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | - | - |
| クラス J d | | | |
| 期首現在発行済投資証券 | 4,350,830 | 26,456,386 | 23,489,319 |
| 発行投資証券口数 | 33,305 | 1,185,805 | 485,514 |

| | | | |
|-------------|-----------|-------------|-------------|
| 買戻投資証券口数 | (938,814) | (4,254,845) | (3,708,604) |
| 期末現在発行済投資証券 | 3,445,321 | 23,387,346 | 20,266,229 |

クラス S

| | | | |
|-------------|---|---|---|
| 期首現在発行済投資証券 | - | - | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | - | - | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | - | - |

クラス S d

| | | | |
|-------------|---|---------|---|
| 期首現在発行済投資証券 | - | 137,057 | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | - | - | - |
| 期末現在発行済投資証券 | - | 137,057 | - |

クラス Z

| | | | |
|-------------|-------------|-----------|---|
| 期首現在発行済投資証券 | 5,956,034 | 9,907,912 | - |
| 発行投資証券口数 | - | - | - |
| 買戻投資証券口数 | (5,263,034) | (307,391) | - |
| 期末現在発行済投資証券 | 693,000 | 9,600,521 | - |

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

T・ロウ・プライス・ファンズ SICAV

一口当たり純資産額および純資産推移

| (特段の注記のない限り金額は米ドル) | グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド | | グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド | | USアグリゲート・ボンド・ファンド |
|----------------------------------|-------------------------------|------------|------------------------|-----|-------------------|
| | 米ドル | 米ドル | 米ドル | 米ドル | 米ドル |
| 以下の時点のクラス A 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | 20.05 | 17.70 | - | - | - |
| 2009年12月31日 | 21.55 | 17.21 | - | - | - |
| 2008年12月31日 | 11.60 | 12.01 | - | - | - |
| 以下の時点のクラス A d 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | - | - | 11.95 | - | - |
| 2009年12月31日 | - | - | 11.62 | - | - |
| 2008年12月31日 | - | - | - | - | - |
| 以下の時点のクラス A h (EUR) 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | - | EUR 15.09 | - | - | - |
| 2009年12月31日 | - | EUR 14.55 | - | - | - |
| 2008年12月31日 | - | EUR 10.26 | - | - | - |
| 以下の時点のクラス A h (NOK) 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | - | NOK 130.37 | - | - | - |
| 2009年12月31日 | - | NOK 125.24 | - | - | - |
| 2008年12月31日 | - | NOK 88.10 | - | - | - |
| 以下の時点のクラス I 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | 24.02 | 18.24 | - | - | - |
| 2009年12月31日 | 25.69 | 17.67 | - | - | - |
| 2008年12月31日 | 13.69 | 12.25 | - | - | - |
| 以下の時点のクラス I d 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | - | - | - | - | - |
| 2009年12月31日 | - | - | - | - | - |
| 2008年12月31日 | - | - | - | - | - |
| 以下の時点のクラス I (GBP) 証券一口当たり純資産額： | | | | | |
| 2010年 6月30日 | - | - | - | - | - |
| 2009年12月31日 | - | - | - | - | - |
| 2008年12月31日 | - | - | - | - | - |
| 以下の時点のクラス J 証券一口当たり純資産額： | | | | | |

| | | | |
|-------------|---|---|---|
| 2010年 6月30日 | - | - | - |
| 2009年12月31日 | - | - | - |
| 2008年12月31日 | - | - | - |

以下の時点のクラスJ d 証券一口当たり純資産額：

| | | | |
|-------------|------|------|-------|
| 2010年 6月30日 | 6.25 | 9.21 | 10.69 |
| 2009年12月31日 | 6.72 | 9.30 | 10.38 |
| 2008年12月31日 | 3.61 | 7.06 | 9.56 |

以下の時点のクラスS 証券一口当たり純資産額：

| | | | |
|-------------|----|--|---|
| 2010年 6月30日 | -- | | - |
| 2009年12月31日 | -- | | - |
| 2008年12月31日 | -- | | - |

以下の時点のクラスS d 証券一口当たり純資産額：

| | | | |
|-------------|--------|--|---|
| 2010年 6月30日 | -12.67 | | - |
| 2009年12月31日 | -12.79 | | - |
| 2008年12月31日 | -9.70 | | - |

以下の時点のクラスZ 証券一口当たり純資産額：

| | | | |
|-------------|-------|-------|---|
| 2010年 6月30日 | 34.84 | 20.14 | - |
| 2009年12月31日 | 37.06 | 19.45 | - |
| 2008年12月31日 | 19.53 | 13.38 | - |

以下の時点の純資産：

| | | | |
|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 2010年 6月30日 | 633,289,284 | 1,028,936,003 | 216,589,259 |
| 2009年12月31日 | 837,287,206 | 1,024,807,232 | 243,777,509 |
| 2008年12月31日 | 521,324,982 | 712,223,267 | 242,876,091 |

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表
Global Emerging Markets Equity Fund
2010年6月30日現在(未監査)

| 銘柄名 | 通貨 | 株数 | 評価額 (アメリカ・ドル) | 対純資産比率 (%) |
|---|----------|------------|-------------------|---------------|
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 | | | | |
| 普通株式 | | | | |
| パミューダ | | | | |
| Genpact | アメリカ・ドル | 188,900 | 2,933,617 | 0.46 |
| パミューダ 計 | | | 2,933,617 | 0.46 |
| ブラジル | | | | |
| Banco do Brasil | ブラジル・レアル | 157,800 | 2,157,986 | 0.34 |
| BM&F BOVESPA | ブラジル・レアル | 906,162 | 5,831,611 | 0.92 |
| BRF - Brasil Foods | ブラジル・レアル | 233,512 | 3,070,310 | 0.48 |
| Cia Vale do Rio Doce ADR | アメリカ・ドル | 492,000 | 11,980,200 | 1.89 |
| Cielo | ブラジル・レアル | 548,400 | 4,624,511 | 0.73 |
| Lojas Renner | ブラジル・レアル | 325,700 | 8,853,981 | 1.40 |
| Petroleo Brasileiro ADR | アメリカ・ドル | 227,300 | 7,800,936 | 1.23 |
| Usinas Siderurgicas de Minas Gerais | ブラジル・レアル | 189,000 | 4,970,097 | 0.79 |
| Weg | ブラジル・レアル | 416,500 | 3,858,835 | 0.61 |
| ブラジル 計 | | | 53,148,467 | 8.39 |
| チリ | | | | |
| Banco Santander (Chile) ADR | アメリカ・ドル | 48,770 | 3,271,979 | 0.52 |
| Empresas La Polar | チリ・ペソ | 476,106 | 2,580,504 | 0.41 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile ADR | アメリカ・ドル | 87,800 | 2,863,158 | 0.45 |
| チリ 計 | | | 8,715,641 | 1.38 |
| 中国 | | | | |
| Alibaba.com | 香港・ドル | 2,258,500 | 4,518,653 | 0.71 |
| Anhui Conch Cement Class A ¹ | 中国・人民元 | 682,306 | 1,620,897 | 0.26 |
| Anhui Conch Cement H-shares | 香港・ドル | 300,000 | 882,223 | 0.14 |
| Baidu.com ADR | アメリカ・ドル | 53,400 | 3,635,472 | 0.57 |
| Bank of China H-shares | 香港・ドル | 15,717,000 | 8,012,750 | 1.27 |
| China Merchants Bank Class A ¹ | 中国・人民元 | 1,277,736 | 2,451,315 | 0.39 |
| China National Building Material H-shares | 香港・ドル | 2,972,000 | 4,785,946 | 0.76 |
| China Shanshui Cement Group | 香港・ドル | 7,644,000 | 3,425,844 | 0.54 |
| Industrial & Commercial Bank of China H-shares | 香港・ドル | 13,741,000 | 10,093,361 | 1.59 |
| Parkson Retail Group | 香港・ドル | 1,369,000 | 2,331,140 | 0.37 |
| Ping An Insurance Group of China Class A ¹ | 中国・人民元 | 279,400 | 1,928,616 | 0.30 |
| Ping An Insurance Group of China H-shares | 香港・ドル | 337,500 | 2,788,970 | 0.44 |
| Shenzhen Development Bank Class A ¹ | 中国・人民元 | 546,687 | 1,411,580 | 0.22 |
| Shimao Property Holdings | 香港・ドル | 1,413,000 | 2,224,611 | 0.35 |
| Sina | アメリカ・ドル | 141,100 | 4,975,186 | 0.79 |
| Tencent Holdings | 香港・ドル | 340,500 | 5,706,227 | 0.90 |
| Uni-President China Holdings | 香港・ドル | 8,677,000 | 4,958,509 | 0.78 |
| Want Want China Holdings | 香港・ドル | 3,061,000 | 2,594,351 | 0.41 |
| Wumart Stores H-shares | 香港・ドル | 851,000 | 1,534,328 | 0.24 |
| 中国 計 | | | 69,879,979 | 11.03 |
| キプロス | | | | |
| Eurasia Drilling GDR | アメリカ・ドル | 17,200 | 331,960 | 0.05 |
| キプロス 計 | | | 331,960 | 0.05 |
| エジプト | | | | |
| Egyptian Financial Group-Hermes Holding | エジプト・ポンド | 400,636 | 2,053,822 | 0.32 |
| エジプト 計 | | | 2,053,822 | 0.32 |
| 香港 | | | | |
| Agile Property Holdings | 香港・ドル | 1,738,000 | 1,805,593 | 0.28 |
| Beijing Enterprises Holdings | 香港・ドル | 1,677,000 | 10,993,862 | 1.74 |
| Belle International Holdings | 香港・ドル | 2,039,000 | 2,922,153 | 0.46 |
| C C Land Holdings | 香港・ドル | 7,089,000 | 2,385,106 | 0.38 |

| | | | | |
|---|-------------|------------|-------------------|--------------|
| China Merchants Holdings International | アメリカ・ドル | 736,900 | 2,455,655 | 0.39 |
| China Taiping Insurance Holdings | 香港・ドル | 2,750,800 | 9,025,502 | 1.42 |
| China Unicom | 香港・ドル | 3,700,000 | 5,007,994 | 0.79 |
| CNOOC | 香港・ドル | 7,162,000 | 12,305,858 | 1.94 |
| GOME Electrical Appliances Holdings | 中国・人民元 | 12,251,900 | 3,744,569 | 0.59 |
| Kingboard Chemical Holdings | 香港・ドル | 1,075,000 | 4,666,020 | 0.74 |
| Kingboard Chemical Holdings warrants/2012 | 香港・ドル | 95,600 | 37,689 | 0.01 |
| Li & Fung | 香港・ドル | 1,152,000 | 5,199,951 | 0.82 |
| Lifestyle International Holdings | 香港・ドル | 2,796,000 | 5,457,606 | 0.86 |
| 香港 計 | | | 66,007,558 | 10.42 |
| インド | | | | |
| Adani Power | インド・ルピー | 1,106,118 | 3,024,588 | 0.48 |
| Bajaj Auto | インド・ルピー | 124,256 | 6,655,167 | 1.05 |
| BF Investment | インド・ルピー | 58,035 | 224,668 | 0.03 |
| BF Utilities | インド・ルピー | 39,920 | 608,534 | 0.10 |
| Container of India | インド・ルピー | 202,127 | 5,875,152 | 0.93 |
| Educomp Solutions | インド・ルピー | 155,629 | 1,784,481 | 0.28 |
| GMR Infrastructure | インド・ルピー | 2,968,271 | 3,802,608 | 0.60 |
| GVK Power & Infrastructure | インド・ルピー | 3,015,593 | 2,873,076 | 0.45 |
| Housing Development Finance | インド・ルピー | 145,828 | 9,244,198 | 1.46 |
| ICICI Bank | インド・ルピー | 246,689 | 4,576,852 | 0.72 |
| Infosys Technologies | インド・ルピー | 65,565 | 3,939,970 | 0.62 |
| Jaiprakash Associates | インド・ルピー | 2,281,831 | 6,315,629 | 1.00 |
| Mundra Port and Special Economic Zone | インド・ルピー | 286,838 | 4,560,876 | 0.72 |
| Reliance Industries | インド・ルピー | 175,591 | 4,120,311 | 0.65 |
| United Spirits | インド・ルピー | 152,094 | 4,290,691 | 0.68 |
| インド 計 | | | 61,896,801 | 9.77 |
| インドネシア | | | | |
| Astra International | インドネシア・ルピア | 1,082,000 | 5,765,096 | 0.91 |
| Bank Mandiri | インドネシア・ルピア | 7,307,000 | 4,836,404 | 0.76 |
| Telekomunikasi Indonesia | インドネシア・ルピア | 4,698,500 | 3,991,004 | 0.63 |
| インドネシア 計 | | | 14,592,504 | 2.30 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| MHP GDR | アメリカ・ドル | 191,408 | 2,488,304 | 0.39 |
| Tenaris ADR | アメリカ・ドル | 216,000 | 7,475,760 | 1.18 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 9,964,064 | 1.57 |
| マレーシア | | | | |
| CIMB Group Holdings Berhad | マレーシア・リンギット | 3,500,208 | 7,568,017 | 1.20 |
| マレーシア 計 | | | 7,568,017 | 1.20 |
| メキシコ | | | | |
| America Movil (Series L) ADR | アメリカ・ドル | 331,910 | 15,765,725 | 2.49 |
| Fresnillo | イギリス・ポンド | 244,516 | 3,583,211 | 0.57 |
| Grupo Financiero Banorte Class O | メキシコ・ペソ | 1,875,100 | 7,297,004 | 1.15 |
| Urbi Desarrollos Urbanos | メキシコ・ペソ | 1,984,500 | 3,685,782 | 0.58 |
| Wal-Mart de Mexico (Series V) | メキシコ・ペソ | 5,434,440 | 12,079,907 | 1.91 |
| メキシコ 計 | | | 42,411,629 | 6.70 |
| オランダ | | | | |
| VimpelCom ADR | アメリカ・ドル | 241,100 | 3,900,998 | 0.62 |
| オランダ 計 | | | 3,900,998 | 0.62 |
| オマーン | | | | |
| Bank Muscat | オマーン・リアル | 350,000 | 719,558 | 0.11 |
| Bank Muscat GDR | アメリカ・ドル | 515,367 | 4,238,022 | 0.67 |
| オマーン 計 | | | 4,957,580 | 0.78 |
| フィリピン | | | | |
| Metro Pacific Investments | フィリピン・ペソ | 55,411,000 | 3,347,013 | 0.53 |
| フィリピン 計 | | | 3,347,013 | 0.53 |
| カタール | | | | |
| Qatar National Bank | カタール・リアル | 178,989 | 6,615,479 | 1.05 |
| カタール 計 | | | 6,615,479 | 1.05 |

| | | | | |
|-------------------------------------|-----------|-----------|-------------------|--------------|
| ロシア | | | | |
| CTC Media | アメリカ・ドル | 252,700 | 3,648,988 | 0.58 |
| Magnit GDR | アメリカ・ドル | 292,150 | 5,051,273 | 0.80 |
| Magnitogorsk Iron & Steel Works GDR | アメリカ・ドル | 215,464 | 2,001,660 | 0.32 |
| NovaTek GDR | アメリカ・ドル | 65,433 | 4,730,806 | 0.75 |
| OA0 Gazprom ADR | アメリカ・ドル | 344,040 | 6,567,724 | 1.04 |
| Rosneft Oil GDR | アメリカ・ドル | 1,019,246 | 6,298,940 | 0.99 |
| Sberbank of Russian Federation | アメリカ・ドル | 4,116,056 | 10,043,177 | 1.58 |
| X5 Retail Group GDR | アメリカ・ドル | 140,342 | 4,757,594 | 0.75 |
| ロシア 計 | | | 43,100,162 | 6.81 |
| 南アフリカ | | | | |
| AngloGold Ashanti | 南アフリカ・ランド | 207,475 | 8,984,232 | 1.42 |
| MTN Group | 南アフリカ・ランド | 349,757 | 4,608,189 | 0.73 |
| Truworths International | 南アフリカ・ランド | 624,934 | 4,372,044 | 0.69 |
| 南アフリカ 計 | | | 17,964,465 | 2.84 |
| 韓国 | | | | |
| Amorepacific | 韓国・ウォン | 4,237 | 3,609,528 | 0.57 |
| Hana Financial Group | 韓国・ウォン | 118,610 | 3,188,584 | 0.50 |
| Hyundai Development | 韓国・ウォン | 105,160 | 2,366,598 | 0.37 |
| Hyundai Mobis | 韓国・ウォン | 36,041 | 6,105,320 | 0.96 |
| KCC | 韓国・ウォン | 18,181 | 4,411,474 | 0.70 |
| LG | 韓国・ウォン | 85,639 | 4,625,479 | 0.73 |
| LG Display | 韓国・ウォン | 96,750 | 3,246,206 | 0.51 |
| LG Household & Health Care | 韓国・ウォン | 41,580 | 11,841,452 | 1.87 |
| POSCO | 韓国・ウォン | 12,401 | 4,734,233 | 0.75 |
| Samsung Electronics | 韓国・ウォン | 32,569 | 20,629,401 | 3.26 |
| Samsung Fire & Marine Insurance | 韓国・ウォン | 37,039 | 5,925,804 | 0.94 |
| Shinsegae | 韓国・ウォン | 8,305 | 3,608,904 | 0.57 |
| 韓国 計 | | | 74,292,983 | 11.73 |
| スイス | | | | |
| Compagnie Financière Richemont | 南アフリカ・ランド | 905,233 | 3,170,642 | 0.50 |
| スイス 計 | | | 3,170,642 | 0.50 |
| 台湾 | | | | |
| Far Eastern New Century | 台湾・ドル | 2,995,508 | 3,113,766 | 0.49 |
| Foxconn Technology | 台湾・ドル | 750,000 | 2,509,220 | 0.40 |
| Hon Hai Precision Indus新トルコ・リラ | 台湾・ドル | 2,756,921 | 9,781,336 | 1.55 |
| MediaTek | 台湾・ドル | 202,688 | 2,854,405 | 0.45 |
| Siliconware Precision Industries | 台湾・ドル | 2,938,000 | 3,204,858 | 0.51 |
| Taiwan Fertilizer | 台湾・ドル | 628,000 | 1,661,298 | 0.26 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing | 台湾・ドル | 2,800,050 | 5,280,894 | 0.83 |
| Uni-President Enterprises | 台湾・ドル | 4,235,711 | 4,692,943 | 0.74 |
| 台湾 計 | | | 33,098,720 | 5.23 |
| タイ | | | | |
| Kasikornbank | タイ・バーツ | 1,197,100 | 3,354,024 | 0.53 |
| タイ 計 | | | 3,354,024 | 0.53 |
| トルコ | | | | |
| BIM Birlesik Magazalar | 新トルコ・リラ | 235,046 | 6,532,148 | 1.03 |
| Turkiye Garanti Bankasi | 新トルコ・リラ | 1,046,401 | 4,395,116 | 0.69 |
| Turkiye Halk Bankasi | 新トルコ・リラ | 471,752 | 3,515,979 | 0.56 |
| トルコ 計 | | | 14,443,243 | 2.28 |
| アラブ首長国連邦 | | | | |
| Aldar Properties | ディルハム | 1,729,030 | 1,299,279 | 0.20 |
| DP World | アメリカ・ドル | 7,152,507 | 3,147,103 | 0.50 |
| アラブ首長国連邦 計 | | | 4,446,382 | 0.70 |
| イギリス | | | | |
| Antofagasta | イギリス・ポンド | 592,113 | 6,967,291 | 1.10 |
| Eurasian Natural Resources | イギリス・ポンド | 435,513 | 5,610,026 | 0.88 |
| Standard Chartered | イギリス・ポンド | 125,541 | 3,082,157 | 0.49 |
| イギリス 計 | | | 15,659,474 | 2.47 |
| 優先株式 | | | | |

| | | | | |
|------------------------------------|----------|-----------|--------------------|---------------|
| ブラジル | | | | |
| Banco Bradesco | ブラジル・リアル | 480,705 | 7,496,598 | 1.18 |
| Cia Vale do Rio Doce ADR | アメリカ・ドル | 417,100 | 8,767,442 | 1.39 |
| Itau Unibanco Holding | ブラジル・リアル | 1,027,985 | 18,535,097 | 2.93 |
| Petroleo Brasileiro ADR | アメリカ・ドル | 433,900 | 12,930,220 | 2.04 |
| ブラジル 計 | | | 47,729,357 | 7.54 |
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計 | | | 615,584,581 | 97.20 |
| 有価証券合計 | | | 615,584,581 | 97.20 |
| その他資産(負債控除後) | | | 17,704,703 | 2.80 |
| 純資産 | | | 633,289,284 | 100.00 |

1. 中国 A 株は制限を受けることがある。2010年6月30日現在で保有する中国 A 株の評価額は7,412,408アメリカ・ドル、対純資産比率1.17%である（詳細は注記3 b 参照）。

* T. ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

* 対純資産比率は、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドの純資産に対する比率

* 添付の注記は、当財務書類と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表

Global High Yield Bond Fund

2010年6月30日現在(未監査)

| 銘柄名 | 通貨 | 株数または 額面金額 | 評価額 (アメリカ・ドル) | 対純資産 比率 (%) |
|---|---------|---------------|-------------------|-------------------|
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 | | | | |
| ケイマン諸島 | | | | |
| Transocean 5.25%/2013 | アメリカ・ドル | 1,125,000 | 1,058,918 | 0.10 |
| ケイマン諸島 計 | | | 1,058,918 | 0.10 |
| フランス | | | | |
| Europcar Groupe SerRegS 8.125%/2014 | ユーロ | 574,000 | 629,268 | 0.06 |
| Europcar Groupe SerRegS VR 4.183%/2013 | ユーロ | 2,300,000 | 2,451,025 | 0.24 |
| フランス 計 | | | 3,080,293 | 0.30 |
| ドイツ | | | | |
| Grohe Holding SerRegS VR 3.519%/2014 | ユーロ | 785,000 | 841,353 | 0.08 |
| HeidelbergCement 8%/2017 | ユーロ | 3,902,000 | 4,767,611 | 0.46 |
| Hella KGAA Hueck 7.25%/2014 | ユーロ | 2,500,000 | 3,161,896 | 0.31 |
| Unitymedia Hessen Ser144A 8.125%/2017 | アメリカ・ドル | 1,775,000 | 1,748,375 | 0.17 |
| ドイツ 計 | | | 10,519,235 | 1.02 |
| アイルランド | | | | |
| Ardagh Glass Finance SerRegS 8.75%/2020 | ユーロ | 1,125,000 | 1,374,567 | 0.13 |
| Ardagh Glass Group 10.75%/2015 | ユーロ | 1,275,000 | 1,534,417 | 0.15 |
| アイルランド 計 | | | 2,908,984 | 0.28 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| Wind Acquisition Finance SerRegS 11%/2015 | ユーロ | 1,375,000 | 1,701,080 | 0.17 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 1,701,080 | 0.17 |
| オランダ | | | | |
| Clondalkin Acquisition SerRegS VR 2.719%/2013 | ユーロ | 625,000 | 679,437 | 0.06 |
| Hertz Holdings Netherlands SerRegS 8.5%/2015 | ユーロ | 1,225,000 | 1,508,005 | 0.15 |
| New World Resources SerRegS 7.875%/2018 | ユーロ | 3,625,000 | 4,307,054 | 0.42 |
| オランダ 計 | | | 6,494,496 | 0.63 |
| スペイン | | | | |
| Campofrio Food SerRegS 8.25%/2016 | ユーロ | 2,175,000 | 2,597,553 | 0.25 |
| Obrascon Huarte Lain SerEMTN 7.375%/2015 | ユーロ | 900,000 | 1,030,864 | 0.10 |
| スペイン 計 | | | 3,628,417 | 0.35 |
| イギリス | | | | |
| BP Capital Markets 1.55%/2011 | アメリカ・ドル | 2,725,000 | 2,597,116 | 0.25 |
| EC Finance SerRegS 9.75%/2017 | ユーロ | 1,025,000 | 1,240,519 | 0.12 |
| Kerling SerRegS 10.625%/2017 | ユーロ | 1,750,000 | 2,180,061 | 0.21 |
| MU Finance Ser144A 8.375%/2017 | アメリカ・ドル | 3,775,000 | 3,638,156 | 0.35 |
| Royal Bank of Scotland Group VR 7.648%/2049 | アメリカ・ドル | 1,740,000 | 1,313,700 | 0.13 |
| Vedanta Resources Ser144A 9.5%/2018 | アメリカ・ドル | 2,450,000 | 2,615,375 | 0.26 |
| イギリス 計 | | | 13,584,927 | 1.32 |
| アメリカ | | | | |
| AES 7.75%/2014 | アメリカ・ドル | 50,000 | 51,125 | 0.01 |
| AES 8%/2017 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,674,750 | 0.16 |
| AK Steel 7.625%/2020 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 1,974,375 | 0.19 |
| American Axle & Manufacturing 7.875%/2017 | アメリカ・ドル | 5,500,000 | 4,798,750 | 0.47 |
| American General Finance SerMTN 6.9%/2017 | アメリカ・ドル | 3,775,000 | 3,024,719 | 0.29 |
| Anvil Holdings com stk | アメリカ・ドル | 218 | 654 | 0.00 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| ArvinMeritor 8.125%/2015 | アメリカ・ドル | 1,150,000 | 1,109,750 | 0.11 |
| B&G Foods Class A com stk | アメリカ・ドル | 122,047 | 1,315,667 | 0.13 |
| Beazer Homes USA 6.5%/2013 | アメリカ・ドル | 1,250,000 | 1,159,375 | 0.11 |
| Beazer Homes USA 8.125%/2016 | アメリカ・ドル | 825,000 | 742,500 | 0.07 |
| Berry Petroleum 10.25%/2014 | アメリカ・ドル | 3,175,000 | 3,429,000 | 0.33 |
| Charter Communications com stk | アメリカ・ドル | 60,989 | 2,152,912 | 0.21 |
| Chesapeake Energy 9.5%/2015 | アメリカ・ドル | 3,525,000 | 3,912,750 | 0.38 |
| Cincinnati Bell 7%/2015 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 1,908,562 | 0.19 |
| CIT Group com stk | アメリカ・ドル | 49,450 | 1,674,377 | 0.16 |
| Community Health Systems 8.875%/2015 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,584,375 | 0.25 |
| Constellation Brands 7.25%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,013,750 | 0.10 |
| Constellation Brands 8.375%/2014 | アメリカ・ドル | 225,000 | 240,750 | 0.02 |
| Continental Airlines SerB 9.25%/2017 | アメリカ・ドル | 500,000 | 522,812 | 0.05 |
| Crown Castle International 9%/2015 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,125,000 | 0.21 |
| Dana Holding com stk | アメリカ・ドル | 140,825 | 1,408,250 | 0.14 |
| Deluxe 7.375%/2015 | アメリカ・ドル | 2,660,000 | 2,653,350 | 0.26 |
| Discover Financial Services 10.25%/2019 | アメリカ・ドル | 3,700,000 | 4,410,300 | 0.43 |
| Domtar 9.5%/2016 | アメリカ・ドル | 275,000 | 308,000 | 0.03 |
| Dynegy Holdings 7.5%/2015 | アメリカ・ドル | 1,675,000 | 1,333,719 | 0.13 |
| Dynegy Holdings 7.75%/2019 | アメリカ・ドル | 4,150,000 | 2,889,437 | 0.28 |
| El Paso 12%/2013 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,893,750 | 0.28 |
| Ferrellgas Finance 6.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,477,500 | 0.14 |
| Ford Motor Credit 12%/2015 | アメリカ・ドル | 2,975,000 | 3,447,097 | 0.34 |
| GenCorp 9.5%/2013 | アメリカ・ドル | 1,522,000 | 1,546,732 | 0.15 |
| Goodyear Tire & Rubber 10.5%/2016 | アメリカ・ドル | 4,000,000 | 4,370,000 | 0.42 |
| Hawk 8.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,660,312 | 0.16 |
| Hertz 10.5%/2016 | アメリカ・ドル | 2,525,000 | 2,632,312 | 0.26 |
| Hertz 8.875%/2014 | アメリカ・ドル | 2,375,000 | 2,416,562 | 0.23 |
| Jabil Circuit 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,925,000 | 2,021,250 | 0.20 |
| Lakes Entertainment com stk | アメリカ・ドル | 102,025 | 156,098 | 0.02 |
| Lear com stk | アメリカ・ドル | 23,225 | 1,537,495 | 0.15 |
| Loral Space & Communications com stk | アメリカ・ドル | 57,926 | 2,474,599 | 0.24 |
| Ltd Brands 7%/2020 | アメリカ・ドル | 5,275,000 | 5,340,937 | 0.52 |
| MetroPCS Communications com stk | アメリカ・ドル | 169,550 | 1,388,614 | 0.14 |
| Mobile Mini 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 2,975,000 | 3,056,813 | 0.30 |
| Motors Liquidation 6.75%/2028 | アメリカ・ドル | 1,800,000 | 504,000 | 0.05 |
| Nextel Communications SerD 7.375%/2015 | アメリカ・ドル | 2,425,000 | 2,315,875 | 0.23 |
| Patriot Coal 8.25%/2018 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,644,750 | 0.16 |
| Peabody Energy 7.375%/2016 | アメリカ・ドル | 2,005,000 | 2,097,731 | 0.20 |
| Petrohawk Energy 10.5%/2014 | アメリカ・ドル | 2,800,000 | 3,024,000 | 0.29 |
| Phillips-Van Heusen 7.375%/2020 | アメリカ・ドル | 1,950,000 | 1,976,813 | 0.19 |
| Plains Exploration & Production 10%/2016 | アメリカ・ドル | 1,975,000 | 2,123,125 | 0.21 |
| PNM Resources 9.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,325,000 | 2,484,844 | 0.24 |
| Reynolds Group SerRegS 9.5%/2017 | ユーロ | 1,950,000 | 2,352,727 | 0.23 |
| Rite Aid 8.625%/2015 | アメリカ・ドル | 2,725,000 | 2,234,500 | 0.22 |
| Rite Aid 10.375%/2016 | アメリカ・ドル | 450,000 | 456,188 | 0.04 |
| Rock-Tenn Class A com stk | アメリカ・ドル | 25,175 | 1,250,442 | 0.12 |
| RRI Energy 7.625%/2014 | アメリカ・ドル | 400,000 | 396,000 | 0.04 |
| RRI Energy 7.875%/2017 | アメリカ・ドル | 1,075,000 | 1,021,250 | 0.10 |
| Sealy CV 8%/2016 | アメリカ・ドル | 3,350 | 262,975 | 0.03 |
| SLM SerC 7.25%/2010 pref stk | アメリカ・ドル | 3,475 | 1,989,438 | 0.19 |
| SLM SerMTN 8.45%/2018 | アメリカ・ドル | 7,850,000 | 7,254,177 | 0.71 |
| SLM SerMTNA 5.375%/2014 | アメリカ・ドル | 2,900,000 | 2,653,877 | 0.26 |
| Smurfit Kappa Group warrants/2013 | アメリカ・ドル | 150 | 6,620 | 0.00 |
| Smurfit-Stone Container SerA CV 7%/2012 | アメリカ・ドル | 7,275 | 81,189 | 0.01 |
| Solutia 7.875%/2020 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,005,000 | 0.19 |
| Spanish Broadcasting System SerB 10.75%/2049 | アメリカ・ドル | 1,900,000 | 1,586,500 | 0.15 |
| Spanish Broadcasting System SerB pref stk | アメリカ・ドル | 1,823 | 1,266,985 | 0.12 |
| Sprint Capital 8.75%/2032 | アメリカ・ドル | 2,575,000 | 2,472,000 | 0.24 |
| Sprint Nextel com stk | アメリカ・ドル | 392,375 | 1,663,670 | 0.16 |

| | | | | |
|---|---------|-----------|--------------------|--------------|
| Standard Pacific 8.375%/2018 | アメリカ・ドル | 750,000 | 716,250 | 0.07 |
| Swift Energy 7.125%/2017 | アメリカ・ドル | 1,750,000 | 1,623,125 | 0.16 |
| Tenet Healthcare 6.5%/2012 | アメリカ・ドル | 450,000 | 446,625 | 0.04 |
| Tenet Healthcare 9.875%/2014 | アメリカ・ドル | 4,000,000 | 4,160,000 | 0.40 |
| Tenneco 8.125%/2015 | アメリカ・ドル | 1,525,000 | 1,540,250 | 0.15 |
| Tenneco 8.625%/2014 | アメリカ・ドル | 725,000 | 734,969 | 0.07 |
| Terex 8%/2017 | アメリカ・ドル | 4,500,000 | 4,185,000 | 0.41 |
| TreeHouse Foods 7.75%/2018 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,404,000 | 0.14 |
| Windstream 8.125%/2013 | アメリカ・ドル | 500,000 | 519,375 | 0.05 |
| Windstream 8.625%/2016 | アメリカ・ドル | 1,439,000 | 1,456,988 | 0.14 |
| アメリカ 計 | | | 146,750,338 | 14.27 |
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計 | | | 189,726,688 | 18.44 |
| その他の規制のある市場において取引されている有価証券 | | | | |
| バミューダ | | | | |
| Intelsat Jackson Holdings 11.25%/2016 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,819,000 | 0.18 |
| バミューダ 計 | | | 1,819,000 | 0.18 |
| カナダ | | | | |
| Cascades 7.75%/2017 | アメリカ・ドル | 1,200,000 | 1,200,000 | 0.12 |
| Cascades 7.875%/2020 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,000,000 | 0.10 |
| Novelis 7.25%/2015 | アメリカ・ドル | 1,125,000 | 1,091,250 | 0.11 |
| Novelis 11.5%/2015 | アメリカ・ドル | 3,000,000 | 3,150,000 | 0.31 |
| OPTI Canada 7.875%/2014 | アメリカ・ドル | 2,200,000 | 1,925,000 | 0.19 |
| OPTI Canada 8.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,400,000 | 0.13 |
| Russel Metals 6.375%/2014 | アメリカ・ドル | 825,000 | 798,187 | 0.08 |
| Telesat Canada/Telesat 11%/2015 | アメリカ・ドル | 5,000,000 | 5,425,000 | 0.53 |
| Telesat Canada/Telesat 12.5%/2017 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,856,250 | 0.18 |
| Videotron 6.375%/2015 | アメリカ・ドル | 875,000 | 870,625 | 0.08 |
| Videotron 6.875%/2014 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,013,758 | 0.19 |
| Videotron 9.125%/2018 | アメリカ・ドル | 1,050,000 | 1,144,500 | 0.11 |
| カナダ 計 | | | 21,874,570 | 2.13 |
| ケイマン諸島 | | | | |
| Seagate Technology HDD Holdings 6.8%/2016 | アメリカ・ドル | 850,000 | 828,750 | 0.08 |
| Transocean Series B CV 1.5%/2037 | アメリカ・ドル | 2,315,000 | 2,066,137 | 0.20 |
| ケイマン諸島 計 | | | 2,894,887 | 0.28 |
| フランス | | | | |
| Compagnie Générale de Géophysique-Véritas 7.5%/2015 | アメリカ・ドル | 2,585,000 | 2,475,138 | 0.24 |
| フランス 計 | | | 2,475,138 | 0.24 |
| ドイツ | | | | |
| Kabel Deutschland 10.625%/2014 | アメリカ・ドル | 2,125,000 | 2,212,656 | 0.21 |
| ドイツ 計 | | | 2,212,656 | 0.21 |
| アイルランド | | | | |
| Smurfit Kappa Funding 7.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,150,000 | 1,141,375 | 0.11 |
| アイルランド 計 | | | 1,141,375 | 0.11 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| FMC Finance III 6.875%/2017 | アメリカ・ドル | 316,000 | 320,740 | 0.03 |
| Intelsat Luxembourg step coupon 11.25%/2017 | アメリカ・ドル | 6,535,000 | 6,649,363 | 0.65 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 6,970,103 | 0.68 |
| アメリカ | | | | |
| Accellent 10.5%/2013 | アメリカ・ドル | 1,300,000 | 1,287,000 | 0.13 |
| ACCO Brands 10.625%/2015 | アメリカ・ドル | 700,000 | 763,000 | 0.07 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Advanced Micro Devices CV 6%/2015 | アメリカ・ドル | 2,315,000 | 2,210,825 | 0.21 |
| Affinia Group 9%/2014 | アメリカ・ドル | 1,075,000 | 1,085,750 | 0.11 |
| Affinity Group 9%/2012 | アメリカ・ドル | 1,625,000 | 1,220,781 | 0.12 |
| Alcatel-Lucent USA SerB CV 2.875%/2025 | アメリカ・ドル | 2,075,000 | 1,758,562 | 0.17 |
| Ally Financial 8%/2031 | アメリカ・ドル | 6,500,000 | 6,028,750 | 0.59 |
| Ally Financial Ser144A 7%/2049 | アメリカ・ドル | 11,525 | 9,284,469 | 0.90 |
| AMC Entertainment 8.75%/2019 | アメリカ・ドル | 2,150,000 | 2,171,500 | 0.21 |
| American International Group 8.25%/2018 | アメリカ・ドル | 5,575,000 | 5,672,562 | 0.55 |
| American International Group VR 8.175%/2058 | アメリカ・ドル | 4,950,000 | 3,947,625 | 0.38 |
| American Railcar Industries 7.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,575,000 | 1,535,625 | 0.15 |
| AmeriGas Partners 7.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,010,000 | 0.20 |
| AmeriGas Partners/AmeriGas Eagle Finance 7.125%/2016 | アメリカ・ドル | 1,253,000 | 1,253,000 | 0.12 |
| Ameristar Casinos 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 2,450,000 | 2,578,625 | 0.25 |
| AMH Holdings step coupon 11.25%/2014 | アメリカ・ドル | 2,700,000 | 2,767,500 | 0.27 |
| Anixter 10%/2014 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,742,000 | 0.17 |
| ARAMARK 5%/2012 | アメリカ・ドル | 675,000 | 662,344 | 0.06 |
| ARAMARK VR 3.844%/2015 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 1,873,125 | 0.18 |
| Ashland 9.125%/2017 | アメリカ・ドル | 2,850,000 | 3,135,000 | 0.30 |
| Avis Budget Car Rental 7.625%/2014 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,418,750 | 0.24 |
| BAC Capital Trust VI 5.625%/2035 | アメリカ・ドル | 5,605,000 | 4,500,327 | 0.44 |
| Ball 7.375%/2019 | アメリカ・ドル | 1,275,000 | 1,323,878 | 0.13 |
| Bausch & Lomb 9.875%/2015 | アメリカ・ドル | 2,325,000 | 2,400,562 | 0.23 |
| BE Aerospace 8.5%/2018 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 2,157,625 | 0.21 |
| Beazer Homes 9.125%/2018 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,581,000 | 0.15 |
| Belo 8%/2016 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,755,250 | 0.17 |
| Berry Plastics 8.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,975,000 | 2,967,562 | 0.29 |
| Berry Plastics 8.875%/2014 | アメリカ・ドル | 1,050,000 | 1,015,875 | 0.10 |
| Bill Barrett 9.875%/2016 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,704,000 | 0.17 |

[前へ](#) [次へ](#)

| | | | | |
|--|---------|------------|------------|------|
| Biomet 10.375%/2017 | アメリカ・ドル | 5,350,000 | 5,778,000 | 0.56 |
| Biomet 11.625%/2017 | アメリカ・ドル | 2,175,000 | 2,365,312 | 0.23 |
| Boise Cascade 7.125%/2014 | アメリカ・ドル | 3,037,000 | 2,873,761 | 0.28 |
| Broadview Networks Holdings 11.375%/2012 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 1,974,375 | 0.19 |
| Burlington Coat Factory Warehouse 11.125%/2014 | アメリカ・ドル | 600,000 | 624,000 | 0.06 |
| Cablevision Systems 7.75%/2018 | アメリカ・ドル | 1,750,000 | 1,758,750 | 0.17 |
| Cablevision Systems 8%/2020 | アメリカ・ドル | 700,000 | 712,250 | 0.07 |
| Case New Holland 7.75%/2013 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,568,750 | 0.25 |
| CaseIla Waste Systems 9.75%/2013 | アメリカ・ドル | 2,250,000 | 2,261,250 | 0.22 |
| CB Richard Ellis Services 11.625%/2017 | アメリカ・ドル | 950,000 | 1,068,750 | 0.10 |
| CCH II Capital 13.5%/2016 | アメリカ・ドル | 725,000 | 848,250 | 0.08 |
| Cellu Tissue Holdings 11.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,627,500 | 0.16 |
| Centene 7.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,875,000 | 1,884,375 | 0.18 |
| Central Garden and Pet 8.25%/2018 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,444,562 | 0.14 |
| Cinemark 8.625%/2019 | アメリカ・ドル | 1,475,000 | 1,489,750 | 0.14 |
| CIT Group 7%/2017 | アメリカ・ドル | 23,704,000 | 21,452,120 | 2.08 |
| Citigroup Capital XXI VR 8.3%/2057 | アメリカ・ドル | 3,850,000 | 3,768,911 | 0.37 |
| Clear Channel Communications 10.75%/2016 | アメリカ・ドル | 4,400,000 | 3,113,000 | 0.30 |
| Clearwater Paper 10.625%/2016 | アメリカ・ドル | 2,250,000 | 2,489,062 | 0.24 |
| Columbus McKinnon 8.875%/2013 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,025,000 | 0.20 |
| Complete Production Services 8%/2016 | アメリカ・ドル | 3,225,000 | 3,168,562 | 0.31 |
| Concho Resources 8.625%/2017 | アメリカ・ドル | 2,650,000 | 2,742,750 | 0.27 |
| Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019 | アメリカ・ドル | 700,000 | 745,500 | 0.07 |
| Cricket Communications 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 375,000 | 384,375 | 0.04 |
| Cricket Communications 9.375%/2014 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,040,000 | 0.20 |
| Cricket Communications 10%/2015 | アメリカ・ドル | 3,382,000 | 3,551,100 | 0.35 |
| Crosstex Energy Finance 8.875%/2018 | アメリカ・ドル | 2,700,000 | 2,710,125 | 0.26 |
| Denbury Resources 8.25%/2020 | アメリカ・ドル | 1,172,000 | 1,230,600 | 0.12 |
| Denbury Resources 9.75%/2016 | アメリカ・ドル | 3,550,000 | 3,851,750 | 0.37 |
| Dole Food 13.875%/2014 | アメリカ・ドル | 1,073,000 | 1,263,457 | 0.12 |
| Dollar General 10.625%/2015 | アメリカ・ドル | 833,000 | 916,994 | 0.09 |
| Dollar General 11.875%/2017 | アメリカ・ドル | 1,904,000 | 2,172,940 | 0.21 |
| Dycom Investments 8.125%/2015 | アメリカ・ドル | 2,575,000 | 2,549,250 | 0.25 |
| E*Trade Financial 7.375%/2013 | アメリカ・ドル | 5,275,000 | 4,773,875 | 0.46 |
| E*Trade Financial 7.875%/2015 | アメリカ・ドル | 2,875,000 | 2,587,500 | 0.25 |
| E*Trade Financial 12.5%/2017 | アメリカ・ドル | 7,578,000 | 8,089,515 | 0.79 |
| Echostar DBS 7.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,300,000 | 1,345,500 | 0.13 |
| Education Management 8.75%/2014 | アメリカ・ドル | 3,000,000 | 3,007,500 | 0.29 |
| Education Management 10.25%/2016 | アメリカ・ドル | 238,000 | 248,710 | 0.02 |
| El Paso 8.25%/2016 | アメリカ・ドル | 165,000 | 173,662 | 0.02 |
| Encore Acquisition 9.5%/2016 | アメリカ・ドル | 525,000 | 559,125 | 0.05 |
| Equinix 8.125%/2018 | アメリカ・ドル | 1,725,000 | 1,772,437 | 0.17 |
| First Data 9.875%/2015 | アメリカ・ドル | 1,125,000 | 860,625 | 0.08 |
| First Data 9.875%/2015 | アメリカ・ドル | 2,250,000 | 1,698,750 | 0.17 |
| First Data 10.55%/2015 | アメリカ・ドル | 2,304,565 | 1,699,617 | 0.17 |
| Ford Motor Credit 8.125%/2020 | アメリカ・ドル | 3,500,000 | 3,578,309 | 0.35 |
| Ford Motor Credit 8.7%/2014 | アメリカ・ドル | 2,625,000 | 2,738,153 | 0.27 |
| Forest Oil 8.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,250,000 | 1,309,375 | 0.13 |
| FTI Consulting 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,750,000 | 1,776,250 | 0.17 |
| Gaylord Entertainment 6.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,413,790 | 0.14 |
| GCI 7.25%/2014 | アメリカ・ドル | 2,175,000 | 2,183,156 | 0.21 |
| General Cable step coupon CV 4.5%/2029 | アメリカ・ドル | 1,900,000 | 1,790,750 | 0.17 |
| General Motors Liquidation SerC CV 6.25%/2033 | アメリカ・ドル | 154,300 | 1,027,484 | 0.10 |
| Genworth Financial 8.625%/2016 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,669,330 | 0.26 |
| Gibraltar Industries SerB 8%/2015 | アメリカ・ドル | 3,775,000 | 3,661,750 | 0.36 |
| Goodman Global 13.5%/2016 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,823,250 | 0.18 |
| Graphic Packaging International 9.5%/2013 | アメリカ・ドル | 1,150,000 | 1,175,875 | 0.11 |
| Graphic Packaging International 9.5%/2017 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,100,000 | 0.20 |
| Great Atlantic & Pacific Tea CV 6.75%/2012 | アメリカ・ドル | 3,125,000 | 2,503,906 | 0.24 |
| Greif 7.75%/2019 | アメリカ・ドル | 450,000 | 465,750 | 0.05 |
| Hanesbrands 8%/2016 | アメリカ・ドル | 1,075,000 | 1,095,156 | 0.11 |
| Harrah's Operating 10%/2018 | アメリカ・ドル | 3,525,000 | 2,908,125 | 0.28 |
| Harrah's Operating 11.25%/2017 | アメリカ・ドル | 6,175,000 | 6,530,062 | 0.63 |
| HCA 9.25%/2016 | アメリカ・ドル | 2,550,000 | 2,709,375 | 0.26 |
| HCA 9.625%/2016 | アメリカ・ドル | 3,181,000 | 3,411,622 | 0.33 |

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| HCA 9.875%/2017 | アメリカ・ドル | 575,000 | 621,000 | 0.06 |
| Healthsouth 10.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,725,000 | 1,871,625 | 0.18 |
| Hexion US Finance / Nova Scotia Finance 8.875%/2018 | アメリカ・ドル | 4,450,000 | 4,038,375 | 0.39 |
| Host Hotels & Resorts SerQ 6.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 993,750 | 0.10 |
| HSN 11.25%/2016 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,250,000 | 0.22 |
| Hughes Network Systems 9.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,400,000 | 1,424,500 | 0.14 |
| Hughes Network Systems SRP 9.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,400,000 | 1,424,500 | 0.14 |
| Inergy Finance 8.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,975,000 | 2,019,437 | 0.20 |
| Ingles Markets 8.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 2,096,125 | 0.20 |
| Intelsat 9.25%/2016 | アメリカ・ドル | 2,650,000 | 2,795,750 | 0.27 |
| International Coal Group 9.125%/2018 | アメリカ・ドル | 2,935,000 | 2,949,675 | 0.29 |
| International Lease Finance SerMTN 5.65%/2014 | アメリカ・ドル | 1,325,000 | 1,182,562 | 0.11 |
| Interpublic Group of 10%/2017 | アメリカ・ドル | 1,575,000 | 1,738,417 | 0.17 |
| iPayment 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 2,150,000 | 1,967,250 | 0.19 |
| iPCS 3.594%/2014 | アメリカ・ドル | 3,091,705 | 2,844,369 | 0.28 |
| Janus Capital Group 6.95%/2017 | アメリカ・ドル | 3,500,000 | 3,518,319 | 0.34 |
| Jarden 8%/2016 | アメリカ・ドル | 2,175,000 | 2,245,687 | 0.22 |
| JBS Finance 11.625%/2014 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,858,313 | 0.18 |
| K Hovnanian Enterprises 10.625%/2016 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,010,000 | 0.20 |
| KAR Auction Services 8.75%/2014 | アメリカ・ドル | 700,000 | 707,000 | 0.07 |
| KAR Auction Services 10%/2015 | アメリカ・ドル | 5,000,000 | 5,125,000 | 0.50 |
| Koppers 7.875%/2019 | アメリカ・ドル | 3,000,000 | 3,045,000 | 0.30 |
| Lamar Media 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,587,750 | 0.15 |
| Lamar Media SerB 6.625%/2015 | アメリカ・ドル | 575,000 | 547,688 | 0.05 |
| Leap Wireless International CV 4.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,950,000 | 1,642,875 | 0.16 |
| Level 3 Financing 8.75%/2017 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 1,761,750 | 0.17 |
| Level 3 Financing 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 2,575,000 | 2,349,688 | 0.23 |
| Level 3 Financing VR 4.14%/2015 | アメリカ・ドル | 2,200,000 | 1,716,000 | 0.17 |
| Levi Strauss 8.875%/2016 | アメリカ・ドル | 575,000 | 598,361 | 0.06 |
| Ltd Brands 8.5%/2019 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,569,625 | 0.15 |
| Lucent Technologies Capital Trust I CV 7.75%/2017 | アメリカ・ドル | 10,675 | 7,734,037 | 0.75 |
| Mac-Gray 7.625%/2015 | アメリカ・ドル | 2,650,000 | 2,563,875 | 0.25 |
| Manitowoc 7.125%/2013 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 970,000 | 0.09 |
| Manitowoc 9.5%/2018 | アメリカ・ドル | 675,000 | 678,375 | 0.07 |
| Mediacom Broadband 8.5%/2015 | アメリカ・ドル | 1,275,000 | 1,224,000 | 0.12 |
| Mercer International 9.25%/2013 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,431,250 | 0.24 |
| Metals USA 11.125%/2015 | アメリカ・ドル | 2,055,000 | 2,168,025 | 0.21 |
| MetroPCS Wireless 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,035,000 | 0.10 |
| MetroPCS Wireless 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 3,475,000 | 3,596,625 | 0.35 |
| MGM Mirage 13%/2013 | アメリカ・ドル | 1,800,000 | 2,083,500 | 0.20 |
| Michaels Stores 11.375%/2016 | アメリカ・ドル | 2,150,000 | 2,246,750 | 0.22 |
| Michaels Stores step coupon 0%/2016 | アメリカ・ドル | 3,400,000 | 3,043,000 | 0.30 |
| Mobile Mini 6.875%/2015 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,538,625 | 0.15 |
| Momentive Performance Materials 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 4,250,000 | 4,037,500 | 0.39 |
| Momentive Performance Materials 11.5%/2016 | アメリカ・ドル | 2,725,000 | 2,418,438 | 0.23 |
| Moog 7.25%/2018 | アメリカ・ドル | 1,575,000 | 1,551,375 | 0.15 |
| Motors Liquidation 8.25%/2023 | アメリカ・ドル | 4,075,000 | 1,253,063 | 0.12 |
| Neenah Paper 7.375%/2014 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,000,000 | 0.19 |
| Neiman-Marcus Group 9%/2015 | アメリカ・ドル | 2,848,538 | 2,869,902 | 0.28 |
| Neiman-Marcus Group 10.375%/2015 | アメリカ・ドル | 3,900,000 | 3,987,750 | 0.39 |
| NetFlix 8.5%/2017 | アメリカ・ドル | 3,042,000 | 3,178,890 | 0.31 |
| Nexstar Finance Holdings step coupon 11.375%/2013 | アメリカ・ドル | 846,915 | 827,859 | 0.08 |
| Nielsen Finance 10%/2014 | アメリカ・ドル | 650,000 | 667,875 | 0.06 |
| Nielsen Finance 11.5%/2016 | アメリカ・ドル | 1,750,000 | 1,920,625 | 0.19 |
| Nielsen Finance 11.625%/2014 | アメリカ・ドル | 3,825,000 | 4,197,938 | 0.41 |
| NII Capital 8.875%/2019 | アメリカ・ドル | 675,000 | 685,125 | 0.07 |
| NII Capital 10%/2016 | アメリカ・ドル | 4,975,000 | 5,261,063 | 0.51 |
| Northwest Airlines Ser992A 7.575%/2019 | アメリカ・ドル | 670,962 | 677,671 | 0.07 |
| NRG Energy 7.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,695,000 | 1,722,544 | 0.17 |
| NRG Energy 7.375%/2016 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 2,019,938 | 0.20 |
| Nuveen Investments 5.5%/2015 | アメリカ・ドル | 5,150,000 | 3,733,750 | 0.36 |
| Nuveen Investments 10.5%/2015 | アメリカ・ドル | 7,175,000 | 6,278,125 | 0.61 |
| O'Charleys 9%/2013 | アメリカ・ドル | 1,775,000 | 1,783,875 | 0.17 |
| Oshkosh 8.25%/2017 | アメリカ・ドル | 1,675,000 | 1,750,375 | 0.17 |
| Oshkosh 8.5%/2020 | アメリカ・ドル | 1,675,000 | 1,750,375 | 0.17 |
| OSI Restaurant Partners 10%/2015 | アメリカ・ドル | 5,500,000 | 5,403,750 | 0.53 |
| PAETEC Holding 8.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,250,000 | 2,261,250 | 0.22 |
| PAETEC Holding 9.5%/2015 | アメリカ・ドル | 1,975,000 | 1,930,563 | 0.19 |
| Pantry 7.75%/2014 | アメリカ・ドル | 2,225,000 | 2,158,250 | 0.21 |
| Penn Virginia 10.375%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,070,000 | 0.10 |
| Penn Virginia CV 4.5%/2012 | アメリカ・ドル | 1,289,000 | 1,208,438 | 0.12 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|--------------------|--------------|
| Penn Virginia Resource Partners Finance 8.25%/2018 | アメリカ・ドル | 1,200,000 | 1,185,000 | 0.12 |
| PetroHawk Energy 7.875%/2015 | アメリカ・ドル | 250,000 | 251,875 | 0.02 |
| PetroHawk Energy 9.125%/2013 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,095,000 | 0.20 |
| Pinnacle Foods Finance 9.25%/2015 | アメリカ・ドル | 700,000 | 717,500 | 0.07 |
| Pinnacle Foods Finance 10.625%/2017 | アメリカ・ドル | 325,000 | 340,438 | 0.03 |
| Ply Gem Industries 11.75%/2013 | アメリカ・ドル | 2,750,000 | 2,887,500 | 0.28 |
| Potlatch 7.5%/2019 | アメリカ・ドル | 1,925,000 | 1,949,063 | 0.19 |
| Quicksilver Resources 11.75%/2016 | アメリカ・ドル | 2,830,000 | 3,134,225 | 0.30 |
| Qwest 8.375%/2016 | アメリカ・ドル | 225,000 | 246,938 | 0.02 |
| Qwest Communications International SerB 7.5%/2014 | アメリカ・ドル | 1,725,000 | 1,737,938 | 0.17 |
| Realogy 10.5%/2014 | アメリカ・ドル | 3,475,000 | 2,962,438 | 0.29 |
| Reckson Operating Partnership 6%/2016 | アメリカ・ドル | 1,575,000 | 1,528,112 | 0.15 |
| Reddy Ice Holdings step coupon 10.5%/2012 | アメリカ・ドル | 750,000 | 765,000 | 0.07 |
| Regal Cinemas 8.625%/2019 | アメリカ・ドル | 3,225,000 | 3,257,250 | 0.32 |
| Residential Capital 9.625%/2015 | アメリカ・ドル | 5,675,000 | 5,618,250 | 0.55 |
| Rite Aid 9.75%/2016 | アメリカ・ドル | 700,000 | 735,000 | 0.07 |
| Rite Aid 10.25%/2019 | アメリカ・ドル | 2,375,000 | 2,377,969 | 0.23 |
| Ryerson 12%/2015 | アメリカ・ドル | 2,100,000 | 2,157,750 | 0.21 |
| Sally Holdings 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,900,000 | 1,980,750 | 0.19 |
| Sally Holdings 10.5%/2016 | アメリカ・ドル | 275,000 | 295,625 | 0.03 |
| SandRidge Energy 8.625%/2015 | アメリカ・ドル | 725,000 | 707,781 | 0.07 |
| Silgan Holdings 7.25%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,030,000 | 0.10 |
| Smurfit-Stone Container Enterprises 8%/2017 | アメリカ・ドル | 3,550,000 | 2,760,125 | 0.27 |
| Solo Cup Operating 10.5%/2013 | アメリカ・ドル | 2,925,000 | 3,038,344 | 0.30 |
| Solutia 8.75%/2017 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 2,142,250 | 0.21 |
| Speedway Motorsports 8.75%/2016 | アメリカ・ドル | 565,000 | 596,075 | 0.06 |
| Spirit Aerosystems 7.5%/2017 | アメリカ・ドル | 750,000 | 738,750 | 0.07 |
| Sprint Nextel 8.375%/2017 | アメリカ・ドル | 7,525,000 | 7,562,625 | 0.73 |
| Standard Pacific 10.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,675,000 | 1,800,625 | 0.18 |
| Steel Dynamics 6.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,513,125 | 0.15 |
| Sungard Data Systems 9.125%/2013 | アメリカ・ドル | 1,250,000 | 1,276,563 | 0.12 |
| Sungard Data Systems 10.25%/2015 | アメリカ・ドル | 450,000 | 466,875 | 0.05 |
| Swift Energy 8.875%/2020 | アメリカ・ドル | 3,650,000 | 3,613,500 | 0.35 |
| Symbion 11%/2015 | アメリカ・ドル | 2,477,725 | 2,174,204 | 0.21 |
| Terex 10.875%/2016 | アメリカ・ドル | 125,000 | 135,313 | 0.01 |
| Terremark Worldwide 12%/2017 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,525,500 | 0.15 |
| Ticketmaster Entertainment 10.75%/2016 | アメリカ・ドル | 3,350,000 | 3,626,375 | 0.35 |
| TransDigm 7.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,612,000 | 0.16 |
| Travelport 11.875%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,015,000 | 0.10 |
| Tube City IMS 9.75%/2015 | アメリカ・ドル | 5,000,000 | 4,862,500 | 0.47 |
| United Components 9.375%/2013 | アメリカ・ドル | 1,020,000 | 1,030,200 | 0.10 |
| United Rentals North America 10.875%/2016 | アメリカ・ドル | 2,350,000 | 2,532,125 | 0.25 |
| United Surgical Partners International 8.875%/2017 | アメリカ・ドル | 1,150,000 | 1,152,875 | 0.11 |
| Universal Hospital Services 8.5%/2015 | アメリカ・ドル | 425,000 | 420,750 | 0.04 |
| US Oncology 9.125%/2017 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,548,750 | 0.15 |
| US Oncology 10.75%/2014 | アメリカ・ドル | 350,000 | 360,500 | 0.04 |
| US Oncology Holdings 6.643%/2012 | アメリカ・ドル | 1,796,000 | 1,679,260 | 0.16 |
| Valeant Pharmaceuticals International 8.375%/2016 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,929,500 | 0.19 |
| Viasat 8.875%/2016 | アメリカ・ドル | 1,050,000 | 1,073,625 | 0.10 |
| WCA Waste 9.25%/2014 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 2,057,688 | 0.20 |
| Wendy's/Arby's Restaurants 10%/2016 | アメリカ・ドル | 4,500,000 | 4,702,500 | 0.46 |
| West 9.5%/2014 | アメリカ・ドル | 2,150,000 | 2,171,500 | 0.21 |
| West 11%/2016 | アメリカ・ドル | 675,000 | 690,188 | 0.07 |
| Yankee Acquisition/MA SerB 8.5%/2015 | アメリカ・ドル | 2,250,000 | 2,286,563 | 0.22 |
| アメリカ 計 | | | 500,433,222 | 48.63 |
| その他の規制のある市場において取引されている有価証券 計 | | | 539,820,951 | 52.46 |
| 直近に発行された取引可能な有価証券 | | | | |
| バミューダ | | | | |
| Digicel Group Ser144A 8.25%/2017 | アメリカ・ドル | 2,275,000 | 2,263,625 | 0.22 |
| Digicel Group Ser144A 10.5%/2018 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,658,000 | 0.16 |
| バミューダ 計 | | | 3,921,625 | 0.38 |
| カナダ | | | | |
| Garda World Security Ser144A 9.75%/2017 | アメリカ・ドル | 1,225,000 | 1,249,500 | 0.12 |
| Reliance Intermediate Holdings Ser144A 9.5%/2019 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,646,875 | 0.26 |
| カナダ 計 | | | 3,896,375 | 0.38 |
| ケイマン諸島 | | | | |

| | | | | |
|--|---------|-----------|------------------|-------------|
| RDS Ultra-Deepwater Ser144A 11.875%/2017 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,279,125 | 0.12 |
| ケイマン諸島 計 | | | 1,279,125 | 0.12 |

[前へ](#) [次へ](#)

フランス

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Novasep Holding SAS Ser144A 9.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,300,000 | 1,283,750 | 0.13 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

フランス 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 1,283,750 | 0.13 |
|--|--|--|------------------|-------------|

イタリア

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Wind Acquisition Holdings Finance Ser144A 12.25%/2017 | アメリカ・ドル | 1,100,000 | 1,006,500 | 0.10 |
|---|---------|-----------|-----------|------|

イタリア 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 1,006,500 | 0.10 |
|--|--|--|------------------|-------------|

ルクセンブルグ

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Wind Acquisition Finance Ser144A 11.75%/2017 | アメリカ・ドル | 2,775,000 | 2,858,250 | 0.28 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

ルクセンブルグ 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 2,858,250 | 0.28 |
|--|--|--|------------------|-------------|

メキシコ

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Kansas City Southern de Mexico Ser144A 8%/2018 | アメリカ・ドル | 1,075,000 | 1,118,000 | 0.11 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

メキシコ 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 1,118,000 | 0.11 |
|--|--|--|------------------|-------------|

アメリカ

| | | | | |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Accellent Ser144A 8.375%/2017 | アメリカ・ドル | 1,525,000 | 1,502,125 | 0.15 |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Advanced Micro Devices Ser144A 8.125%/2017 | アメリカ・ドル | 2,625,000 | 2,625,000 | 0.25 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---|---------|---------|---------|------|
| Alliance One International Ser144A 10%/2016 | アメリカ・ドル | 400,000 | 409,000 | 0.04 |
|---|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Alliance One International Ser144A 10%/2016 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 2,070,562 | 0.20 |
|---|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Ally Financial Ser144A 8.3%/2015 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,030,000 | 0.20 |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Altra Holdings Ser144A 8.125%/2016 | アメリカ・ドル | 2,110,000 | 2,102,087 | 0.20 |
|------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Amsted Industries Ser144A 8.125%/2018 | アメリカ・ドル | 1,425,000 | 1,428,562 | 0.14 |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Antero Resources Finance Ser144A 9.375%/2017 | アメリカ・ドル | 3,350,000 | 3,366,750 | 0.33 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Aquilex Holdings/Aquilex Finance Ser144A 11.125%/2016 | アメリカ・ドル | 1,950,000 | 1,959,750 | 0.19 |
|---|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Arch Coal Ser144A 8.75%/2016 | アメリカ・ドル | 2,825,000 | 2,959,187 | 0.29 |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Aspect Software Ser144A 10.625%/2017 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,005,000 | 0.10 |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Avis Budget Car Rental Ser144A 9.625%/2018 | アメリカ・ドル | 850,000 | 862,750 | 0.08 |
|--|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Bankrate Ser144A 11.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,337,539 | 0.13 |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|------------------------------|---------|---------|---------|------|
| BioScrip Ser144A 10.25%/2015 | アメリカ・ドル | 500,000 | 497,500 | 0.05 |
|------------------------------|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|---------|------|
| Boise Paper Holdings Ser144A 8%/2020 | アメリカ・ドル | 950,000 | 952,375 | 0.09 |
|--------------------------------------|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Boise Paper Holdings Ser144A 9%/2017 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,397,250 | 0.14 |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Bumble Bee Foods Ser144A 7.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,513,125 | 0.15 |
|-------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| BWAY Holding Ser144A 10%/2018 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,518,875 | 0.15 |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Capella Healthcare Ser144A 9.25%/2017 | アメリカ・ドル | 1,800,000 | 1,822,500 | 0.18 |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Case New Holland Ser144A 7.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,025,000 | 2,050,312 | 0.20 |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| CCO Holdings Ser144A 7.875%/2018 | アメリカ・ドル | 2,550,000 | 2,575,500 | 0.25 |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| CCO Holdings Ser144A 8.125%/2020 | アメリカ・ドル | 1,225,000 | 1,258,687 | 0.12 |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| CEDC Finance International Ser144A 9.125%/2016 | アメリカ・ドル | 1,075,000 | 1,042,750 | 0.10 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Cemex Finance Ser144A 9.5%/2016 | アメリカ・ドル | 1,580,000 | 1,532,600 | 0.15 |
|---------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Clear Channel Worldwide Holdings Ser144A 9.25%/2017 | アメリカ・ドル | 1,825,000 | 1,843,250 | 0.18 |
|---|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Clearwire Communications Ser144A 12%/2015 | アメリカ・ドル | 5,500,000 | 5,479,375 | 0.53 |
|---|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| Coleman Cable Ser144A 9%/2018 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 1,968,000 | 0.19 |
|-------------------------------|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Colt Defense/Colt Finance Ser144A 8.75%/2017 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,156,375 | 0.11 |
|--|---------|-----------|-----------|------|

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Commercial Vehicle Group Ser144A 11%/2013 | アメリカ・ドル | 1,509,388 | 1,515,048 | 0.15 |
| Consol Energy Ser144A 8%/2017 | アメリカ・ドル | 4,000,000 | 4,150,000 | 0.40 |
| Consol Energy Ser144A 8.25%/2020 | アメリカ・ドル | 2,875,000 | 3,011,562 | 0.29 |
| Cooper-Standard Automotive Ser144A 8.5%/2018 | アメリカ・ドル | 1,375,000 | 1,392,187 | 0.13 |
| Cott Beverages Ser144A 8.375%/2017 | アメリカ・ドル | 1,125,000 | 1,139,063 | 0.11 |
| CPM Holdings Ser144A 10.625%/2014 | アメリカ・ドル | 2,475,000 | 2,626,594 | 0.25 |
| Delta Air Lines Ser144A 9.5%/2014 | アメリカ・ドル | 2,375,000 | 2,505,625 | 0.24 |
| Delta Air Lines Ser144A 12.25%/2015 | アメリカ・ドル | 1,550,000 | 1,662,375 | 0.16 |
| Easton-Bell Sports Ser144A 9.75%/2016 | アメリカ・ドル | 550,000 | 572,000 | 0.06 |
| Edgen Murray Ser144A 12.25%/2015 | アメリカ・ドル | 3,400,000 | 2,890,000 | 0.28 |
| Geo Group Ser144A 7.75%/2017 | アメリカ・ドル | 1,625,000 | 1,645,313 | 0.16 |
| GeoEye Ser144A 9.625%/2015 | アメリカ・ドル | 875,000 | 896,875 | 0.09 |
| Global Geophysical Services Ser144A 10.5%/2017 | アメリカ・ドル | 2,325,000 | 2,243,625 | 0.22 |
| Great Atlantic & Pacific Tea Ser144A 11.375%/2015 | アメリカ・ドル | 2,450,000 | 2,045,750 | 0.20 |
| Hercules Offshore Ser144A 10.5%/2017 | アメリカ・ドル | 1,725,000 | 1,539,563 | 0.15 |
| Icahn Enterprises Finance Ser144A 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 3,000,000 | 2,932,500 | 0.29 |
| International Lease Finance Ser144A 8.625%/2015 | アメリカ・ドル | 9,150,000 | 8,692,500 | 0.84 |
| JDA Software Group Ser144A 8%/2014 | アメリカ・ドル | 1,275,000 | 1,287,750 | 0.13 |
| Kratos Defense & Security Solutions Ser144A 10%/2017 | アメリカ・ドル | 1,225,000 | 1,249,500 | 0.12 |
| Lamar Media Ser144A 7.875%/2018 | アメリカ・ドル | 875,000 | 877,188 | 0.09 |
| LBI Escrow Ser144A 8%/2017 | アメリカ・ドル | 7,775,000 | 8,027,688 | 0.78 |
| Levi Strauss Ser144A 7.625%/2020 | アメリカ・ドル | 2,150,000 | 2,117,750 | 0.21 |
| LIN Television Ser144A 8.375%/2018 | アメリカ・ドル | 1,475,000 | 1,475,000 | 0.14 |
| Linn Energy Finance Ser144A 8.625%/2020 | アメリカ・ドル | 5,100,000 | 5,246,625 | 0.51 |
| Lions Gate Entertainment Ser144A 10.25%/2016 | アメリカ・ドル | 2,850,000 | 2,850,000 | 0.28 |
| McClatchy Ser144A 11.5%/2017 | アメリカ・ドル | 2,825,000 | 2,881,500 | 0.28 |
| MGM Mirage Ser144A 9%/2020 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,548,750 | 0.15 |
| MGM Mirage Ser144A 11.375%/2018 | アメリカ・ドル | 3,600,000 | 3,402,000 | 0.33 |
| MGM Mirage Ser144A CV 4.25%/2015 | アメリカ・ドル | 1,100,000 | 875,875 | 0.08 |
| Michael Foods Ser144A 9.75%/2018 | アメリカ・ドル | 3,025,000 | 3,123,313 | 0.30 |
| New Communications Holdings Ser144A 8.25%/2017 | アメリカ・ドル | 800,000 | 807,000 | 0.08 |
| Nexstar Mission Broadcasting Ser144A 8.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,725,000 | 2,752,250 | 0.27 |
| North American Energy Alliance Finance Ser144A 10.875%/2016 | アメリカ・ドル | 1,425,000 | 1,474,875 | 0.14 |
| OnCure Medical Ser144A 11.75%/2017 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,508,000 | 0.15 |
| Parker Drilling Ser144A 9.125%/2018 | アメリカ・ドル | 3,050,000 | 2,912,750 | 0.28 |
| Penson Worldwide Ser144A 12.5%/2017 | アメリカ・ドル | 1,825,000 | 1,815,875 | 0.18 |
| PH Glatfelter Ser144A 7.125%/2016 | アメリカ・ドル | 1,625,000 | 1,592,500 | 0.15 |
| Pinnacle Entertainment Ser144A 8.625%/2017 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,759,500 | 0.17 |
| Pinnacle Entertainment Ser144A 8.75%/2020 | アメリカ・ドル | 1,325,000 | 1,233,906 | 0.12 |
| Pinnacle Foods Finance Ser144A 9.25%/2015 | アメリカ・ドル | 3,100,000 | 3,177,500 | 0.31 |
| Plastipak Holdings Ser144A 10.625%/2019 | アメリカ・ドル | 425,000 | 473,875 | 0.05 |
| Provident Funding Associates Ser144A 10.25%/2017 | アメリカ・ドル | 1,600,000 | 1,624,000 | 0.16 |
| Radiation Therapy Services Ser144A 9.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,125,000 | 2,050,625 | 0.20 |
| RBS Global & Rexnord Ser144A 8.5%/2018 | アメリカ・ドル | 5,750,000 | 5,606,250 | 0.54 |
| Reddy Ice Ser144A 11.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,350,000 | 2,432,250 | 0.24 |
| Reynolds Group Issuer Ser144A 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 1,700,000 | 1,670,250 | 0.16 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|--------------------|--------------|
| Reynolds Group Issuer Ser144A 8.5%/2018 | アメリカ・ドル | 3,175,000 | 3,131,344 | 0.30 |
| RSC Equipment Rental Ser144A 10%/2017 | アメリカ・ドル | 450,000 | 484,875 | 0.05 |
| Ryerson Holding Ser144A 0%/2015 | アメリカ・ドル | 6,125,000 | 2,664,375 | 0.26 |
| SBA Telecommunications Ser144A 8%/2016 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,600,000 | 0.25 |
| SBA Telecommunications Ser144A 8.25%/2019 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,586,250 | 0.15 |
| Severstal Columbus Ser144A 10.25%/2018 | アメリカ・ドル | 2,275,000 | 2,360,313 | 0.23 |
| Sirius XM Radio Ser144A 8.75%/2015 | アメリカ・ドル | 2,500,000 | 2,475,000 | 0.24 |
| Sirius XM Radio Ser144A 9.75%/2015 | アメリカ・ドル | 250,000 | 266,875 | 0.03 |
| Steel Dynamics Ser144A 7.625%/2020 | アメリカ・ドル | 1,850,000 | 1,850,000 | 0.18 |
| Susser Holdings Ser144A 8.5%/2016 | アメリカ・ドル | 1,950,000 | 1,959,750 | 0.19 |
| Talecris Biotherapeutics Holdings Ser144A 7.75%/2016 | アメリカ・ドル | 5,800,000 | 6,206,000 | 0.60 |
| Toys R Us Property Ser144A 8.5%/2017 | アメリカ・ドル | 2,525,000 | 2,600,750 | 0.25 |
| United Air Lines Ser144A 9.875%/2013 | アメリカ・ドル | 800,000 | 824,000 | 0.08 |
| United Air Lines Ser144A 12%/2013 | アメリカ・ドル | 75,000 | 78,375 | 0.01 |
| United Maritime Group Finance Ser144A 11.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,450,000 | 1,377,500 | 0.13 |
| Universal City Development Partners Ser144A 8.875%/2015 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 2,020,000 | 0.20 |
| Universal City Development Partners Ser144A 10.875%/2016 | アメリカ・ドル | 2,125,000 | 2,178,125 | 0.21 |
| USG Ser144A 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 1,550,000 | 1,619,750 | 0.16 |
| Vanguard Health Holding II Ser144A 8%/2018 | アメリカ・ドル | 2,525,000 | 2,430,313 | 0.24 |
| Wynn Las Vegas Capital Ser144A 7.875%/2017 | アメリカ・ドル | 2,525,000 | 2,569,188 | 0.25 |
| アメリカ 計 | | | 200,864,494 | 19.52 |
| 直近に発行された取引可能な有価証券 計 | | | 216,228,119 | 21.02 |
| その他の取引可能な有価証券 | | | | |
| バミューダ | | | | |
| Digicel Group Ser144A 8.875%/2015 | アメリカ・ドル | 3,050,000 | 2,996,625 | 0.29 |
| Digicel Group Ser144A 12%/2014 | アメリカ・ドル | 400,000 | 449,000 | 0.04 |
| バミューダ 計 | | | 3,445,625 | 0.33 |
| カナダ | | | | |
| Connacher Oil and Gas Ser144A 10.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,725,000 | 2,704,562 | 0.26 |
| カナダ 計 | | | 2,704,562 | 0.26 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| Steel Capital for Severstal Ser144A 9.75%/2013 | アメリカ・ドル | 3,125,000 | 3,355,469 | 0.33 |
| Wind Acquisition Finance Ser144A 12%/2015 | アメリカ・ドル | 850,000 | 884,000 | 0.08 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 4,239,469 | 0.41 |
| オランダ | | | | |
| Clondalkin Acquisition Ser144A VR 2.537%/2013 | アメリカ・ドル | 800,000 | 700,000 | 0.07 |
| オランダ 計 | | | 700,000 | 0.07 |
| アメリカ | | | | |
| ACE Hardware Ser144A 9.125%/2016 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,052,500 | 0.10 |

| | | | | |
|---|---------|-----------|-------------------|-------------|
| Affinity Group Holding 10.875%/2012 | アメリカ・ドル | 313,529 | 126,979 | 0.01 |
| Allison Transmission Ser144A 11.25%/2015 | アメリカ・ドル | 3,415,500 | 3,611,891 | 0.35 |
| Anvil Holdings warrants Class A/2012 | アメリカ・ドル | 2,416 | 48 | 0.00 |
| Anvil Holdings warrants Class B/2012 | アメリカ・ドル | 2,684 | 27 | 0.00 |
| Cengage Learning Acquisitions Ser144A step coupon 13.25%/2015 | アメリカ・ドル | 2,000,000 | 1,870,000 | 0.18 |
| Crown Americas Capital II Ser144A 7.625%/2017 | アメリカ・ドル | 1,350,000 | 1,404,000 | 0.14 |
| Esco Ser144A 8.625%/2013 | アメリカ・ドル | 1,207,000 | 1,203,982 | 0.12 |
| Esco Ser144A VR 4.412%/2013 | アメリカ・ドル | 900,000 | 828,000 | 0.08 |
| GGP Ser144A CV 3.98%/2027 | アメリカ・ドル | 1,952,000 | 2,010,560 | 0.20 |
| HUB International Holdings Ser144A 9%/2014 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,428,750 | 0.14 |
| HUB International Holdings Ser144A 10.25%/2015 | アメリカ・ドル | 3,950,000 | 3,643,875 | 0.35 |
| Huntsman International Ser144A 5.5%/2016 | アメリカ・ドル | 6,425,000 | 5,654,000 | 0.55 |
| iPayment Investors Ser144A 11.625%/2014 | アメリカ・ドル | 2,585,111 | 2,281,360 | 0.22 |
| Land O'Lakes Capital Trust I Ser144A 7.45%/2028 | アメリカ・ドル | 2,050,000 | 1,773,250 | 0.17 |
| MGM Mirage Ser144A 10.375%/2014 | アメリカ・ドル | 1,625,000 | 1,775,312 | 0.17 |
| MGM Mirage Ser144A 11.125%/2017 | アメリカ・ドル | 2,575,000 | 2,851,813 | 0.28 |
| Plastipak Holdings Ser144A 8.5%/2015 | アメリカ・ドル | 700,000 | 705,600 | 0.07 |
| Shingle Springs Tribal Gaming Authority Ser144A 9.375%/2015 | アメリカ・ドル | 1,125,000 | 897,188 | 0.09 |
| Spanish Broadcasting System SerB 10.75%/2049 | アメリカ・ドル | 24,424 | 170 | 0.00 |
| Sunstate Equipment Ser144A 10.5%/2013 | アメリカ・ドル | 925,000 | 800,125 | 0.08 |
| Swift Transportation Ser144A VR 8.186%/2015 | アメリカ・ドル | 275,000 | 250,250 | 0.02 |
| Tenet Healthcare Ser144A 8.875%/2019 | アメリカ・ドル | 1,500,000 | 1,597,500 | 0.16 |
| UCI Holdco 8.257%/2013 | アメリカ・ドル | 3,593,457 | 3,503,621 | 0.34 |
| Umbrella Acquisition Ser144A 9.75%/2015 | アメリカ・ドル | 6,876,442 | 5,759,020 | 0.56 |
| Universal Hospital Services VR 4.134%/2015 | アメリカ・ドル | 1,980,000 | 1,673,100 | 0.16 |
| USI Holdings Ser144A 9.75%/2015 | アメリカ・ドル | 1,612,000 | 1,487,070 | 0.15 |
| XM Satellite Radio Ser144A 11.25%/2013 | アメリカ・ドル | 900,000 | 965,250 | 0.09 |
| Xm Satellite Radio Ser144A 13%/2013 | アメリカ・ドル | 3,925,000 | 4,307,688 | 0.42 |
| アメリカ 計 | | | 53,462,929 | 5.20 |

| | | | | |
|------------------------|--|--|-------------------|-------------|
| その他の取引可能な有価証券 計 | | | 64,552,585 | 6.27 |
|------------------------|--|--|-------------------|-------------|

| | | | | |
|----------------|--|--|----------------------|--------------|
| 有価証券 合計 | | | 1,010,328,343 | 98.19 |
|----------------|--|--|----------------------|--------------|

為替予約取引

| 決済日 | 買い | 売り | 未実現評価益（損） （アメリカ・ドル） |
|-----------------------------|-------------------|------------------|-------------------------|
| 2010年9月9日 | ユーロ 3,658,000 | アメリカ・ドル4,431,903 | 54,232 |
| 2010年9月9日 | アメリカ・ドル30,117,009 | ユーロ 24,952,000 | (483,873) |
| 為替予約取引にかかる未実現評価損益 合計 | | | (429,641) (0.04) |

クレジット・デフォルト・スワップ取引

| 銘柄名 | 満期日 | 想定元本 | 評価額 （アメリカ・ドル） |
|---|---------|-----------|------------------|
| Morgan Stanley & Co. International Limited, Protection sold (Relevant Credit: BP P.L.C. 4.20% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2011年9月 | 1,500,000 | (36,074) |

| | | | | |
|---|----------|-----------|----------------------|---------------|
| JPMorgan Chase Protection sold (Relevant Credit: BP P.L.C. 4.20% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2011年 9月 | 1,200,000 | (28,859) | |
| Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Univision Communications 9.75% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2013年 6月 | 2,000,000 | (220,403) | |
| JPMorgan Chase, Protection sold (Relevant Credit: Ford Motor 6.50% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2015年 3月 | 5,000,000 | (417,810) | |
| Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Mediacomm 9.125% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2015年 6月 | 2,500,000 | (318,765) | |
| JPMorgan Chase, Protection sold (Relevant Credit: Ford Motor 6.50% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default | 2015年 6月 | 1,750,000 | (161,851) | |
| スワップ取引評価額合計 | | | (1,183,762) | (0.11) |
| 為替予約取引に係る未実現損失合計（詳細は注記の3a参照） | | | (16,949,215) | (1.65) |
| その他資産（負債控除後） | | | 37,170,278 | 3.61 |
| 純資産 | | | 1,028,936,003 | 100.00 |

T. ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

* 対純資産比率は、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの純資産に対する比率

* 添付の注記は、当財務諸類と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

有価証券明細表

US Aggregate Bond Fund

2010年6月30日現在(未監査)

| 銘柄名 | 通貨 | 額面金額 | 評価額 (アメリカ・ドル) | 対純資産 比率 (%) |
|--|---------|-----------|------------------|-------------------|
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 | | | | |
| オーストラリア | | | | |
| Rio Tinto Finance USA 5.875%/2013 | アメリカ・ドル | 345,000 | 378,264 | 0.17 |
| オーストラリア 計 | | | 378,264 | 0.17 |
| ブラジル | | | | |
| Federal Republic of Brazil 11%/2040 | アメリカ・ドル | 380,000 | 509,295 | 0.24 |
| ブラジル 計 | | | 509,295 | 0.24 |
| カナダ | | | | |
| Canadian Natural Resources 6.25%/2038 | アメリカ・ドル | 380,000 | 416,849 | 0.19 |
| Devon Financing 7.875%/2031 | アメリカ・ドル | 200,000 | 254,752 | 0.12 |
| EnCana 5.9%/2017 | アメリカ・ドル | 390,000 | 438,972 | 0.20 |
| EnCana 6.5%/2034 | アメリカ・ドル | 385,000 | 425,120 | 0.20 |
| Thomson Reuters 6.5%/2018 | アメリカ・ドル | 240,000 | 283,948 | 0.13 |
| TransCanada Pipelines 7.125%/2019 | アメリカ・ドル | 95,000 | 115,667 | 0.05 |
| カナダ 計 | | | 1,935,308 | 0.89 |
| ケイマン諸島 | | | | |
| Petrobras International Finance 5.875%/2018 | アメリカ・ドル | 365,000 | 377,477 | 0.17 |
| Petrobras International Finance 7.875%/2019 | アメリカ・ドル | 150,000 | 172,373 | 0.08 |
| ケイマン諸島 計 | | | 549,850 | 0.25 |
| チリ | | | | |
| Corp Nacional del Cobre de Chile Ser144A 7.5%/2019 | アメリカ・ドル | 155,000 | 193,061 | 0.09 |
| チリ 計 | | | 193,061 | 0.09 |
| マン島 | | | | |
| AngloGold Ashanti Holdings 5.375%/2020 | アメリカ・ドル | 75,000 | 76,289 | 0.04 |
| マン島 計 | | | 76,289 | 0.04 |
| リトアニア | | | | |
| Republic of Lithuania Ser144A 6.75%/2015 | アメリカ・ドル | 375,000 | 394,886 | 0.18 |
| リトアニア 計 | | | 394,886 | 0.18 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| Telecom Italia Capital 5.25%/2013 | アメリカ・ドル | 525,000 | 542,404 | 0.25 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 542,404 | 0.25 |
| メキシコ | | | | |
| America Movil 5.625%/2017 | アメリカ・ドル | 475,000 | 521,602 | 0.24 |
| America Movil 6.375%/2035 | アメリカ・ドル | 480,000 | 516,081 | 0.24 |
| United Mexican States SerMTN 6.375%/2013 | アメリカ・ドル | 1,060,000 | 1,167,590 | 0.54 |
| メキシコ 計 | | | 2,205,273 | 1.02 |
| オランダ | | | | |
| EDP Finance Ser144A 4.9%/2019 | アメリカ・ドル | 240,000 | 223,380 | 0.10 |
| オランダ 計 | | | 223,380 | 0.10 |
| 南アフリカ | | | | |
| Republic of South Africa 5.5%/2020 | アメリカ・ドル | 295,000 | 306,431 | 0.14 |
| Republic of South Africa 6.5%/2014 | アメリカ・ドル | 160,000 | 179,280 | 0.08 |
| 南アフリカ 計 | | | 485,711 | 0.22 |
| スペイン | | | | |
| Telefonica Emisiones 5.877%/2019 | アメリカ・ドル | 170,000 | 181,637 | 0.08 |
| Telefonica Emisiones 6.221%/2017 | アメリカ・ドル | 370,000 | 403,022 | 0.19 |
| スペイン 計 | | | 584,659 | 0.27 |
| スウェーデン | | | | |
| Svensk Exportkredit 5.125%/2017 | アメリカ・ドル | 650,000 | 726,192 | 0.34 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|----------------|-------------|
| スウェーデン 計 | | | 726,192 | 0.34 |
| イギリス | | | | |
| HBOS Ser144A 6%/2033 | アメリカ・ドル | 505,000 | 370,146 | 0.17 |
| Standard Chartered Ser144A 3.85%/2015 | アメリカ・ドル | 230,000 | 232,306 | 0.11 |
| イギリス 計 | | | 602,452 | 0.28 |
| アメリカ | | | | |
| Altria Group 4.125%/2015 | アメリカ・ドル | 35,000 | 35,702 | 0.02 |
| Altria Group 9.25%/2019 | アメリカ・ドル | 500,000 | 625,064 | 0.29 |
| American Express 5.25%/2011 | アメリカ・ドル | 300,000 | 311,326 | 0.14 |
| American Express Credit SerMTN 5.875%/2013 | アメリカ・ドル | 350,000 | 383,197 | 0.18 |
| Appalachian Power 6.375%/2036 | アメリカ・ドル | 335,000 | 363,433 | 0.17 |
| AT&T 5.8%/2019 | アメリカ・ドル | 430,000 | 484,945 | 0.22 |
| AvalonBay Communities SerMTN 6.125%/2012 | アメリカ・ドル | 206,000 | 223,082 | 0.10 |
| Baltimore Gas & Electric 5.9%/2016 | アメリカ・ドル | 500,000 | 576,660 | 0.27 |
| Bank of America 5.625%/2020 | アメリカ・ドル | 540,000 | 545,321 | 0.25 |
| Black Hills 6.5%/2013 | アメリカ・ドル | 300,000 | 326,282 | 0.15 |
| Bunge NA Finance 5.9%/2017 | アメリカ・ドル | 505,000 | 539,637 | 0.25 |
| Centerpoint Energy SerB 7.25%/2010 | アメリカ・ドル | 460,000 | 463,711 | 0.21 |
| Citigroup 5.5%/2012 | アメリカ・ドル | 375,000 | 391,086 | 0.18 |
| Citigroup 5.5%/2013 | アメリカ・ドル | 440,000 | 457,674 | 0.21 |
| Citigroup 6.125%/2018 | アメリカ・ドル | 220,000 | 229,968 | 0.11 |
| Citigroup 6.5%/2013 | アメリカ・ドル | 400,000 | 426,372 | 0.20 |
| Comcast Cable Communications Holdings 8.375%/2013 | アメリカ・ドル | 66,000 | 76,473 | 0.04 |
| Consumers Energy SerJ 6%/2014 | アメリカ・ドル | 600,000 | 654,474 | 0.30 |
| Devon Energy 5.625%/2014 | アメリカ・ドル | 165,000 | 183,303 | 0.08 |
| Diamond Offshore Drilling 5.15%/2014 | アメリカ・ドル | 1,000,000 | 1,039,086 | 0.48 |
| Dow Chemical 8.55%/2019 | アメリカ・ドル | 300,000 | 367,830 | 0.17 |
| Duke Realty 6.25%/2013 | アメリカ・ドル | 190,000 | 202,632 | 0.09 |
| Dun & Bradstreet 5.5%/2011 | アメリカ・ドル | 350,000 | 360,704 | 0.17 |
| El Paso Electric 6%/2035 | アメリカ・ドル | 400,000 | 390,432 | 0.18 |
| Enbridge Energy Partners 5.2%/2020 | アメリカ・ドル | 55,000 | 56,780 | 0.03 |
| Enterprise Products Operating SerL 6.3%/2017 | アメリカ・ドル | 195,000 | 218,451 | 0.10 |
| EOG Resources 5.875%/2017 | アメリカ・ドル | 260,000 | 293,167 | 0.14 |
| Federal Home Loan Banks 5.125%/2013 | アメリカ・ドル | 1,690,000 | 1,891,815 | 0.87 |
| Federal National Mortgage Association SerS VR 8.25%/2049 | アメリカ・ドル | 10,650 | 3,621 | 0.00 |
| Federal Realty Investment Trust 6%/2012 | アメリカ・ドル | 205,000 | 219,612 | 0.10 |
| FHLMC (Gold) Pool A18166 5.5%/2034 | アメリカ・ドル | 185,377 | 199,987 | 0.09 |
| FHLMC (Gold) Pool A27886 6%/2034 | アメリカ・ドル | 779,935 | 856,149 | 0.40 |
| FHLMC (Gold) Pool A39034 5.5%/2035 | アメリカ・ドル | 1,479,462 | 1,593,288 | 0.74 |
| FHLMC (Gold) Pool A90052 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 140,315 | 145,687 | 0.07 |
| FHLMC (Gold) Pool A90053 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 183,751 | 190,785 | 0.09 |
| FHLMC (Gold) Pool A90257 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 100,772 | 104,629 | 0.05 |
| FHLMC (Gold) Pool A90763 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 132,926 | 137,935 | 0.06 |
| FHLMC (Gold) Pool A91160 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 1,406,076 | 1,459,902 | 0.67 |
| FHLMC (Gold) Pool A91703 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 1,624,392 | 1,682,515 | 0.78 |
| FHLMC (Gold) Pool C01787 6%/2034 | アメリカ・ドル | 862,586 | 948,763 | 0.44 |
| FHLMC (Gold) Pool E01341 5.5%/2018 | アメリカ・ドル | 77,843 | 84,202 | 0.04 |
| FHLMC (Gold) Pool E01497 5.5%/2018 | アメリカ・ドル | 77,138 | 83,615 | 0.04 |
| FHLMC (Gold) Pool G01443 6.5%/2032 | アメリカ・ドル | 393,023 | 437,263 | 0.20 |
| FHLMC (Gold) Pool G01444 6.5%/2032 | アメリカ・ドル | 490,959 | 546,529 | 0.25 |
| FHLMC (Gold) Pool G08016 6%/2034 | アメリカ・ドル | 3,188,705 | 3,500,302 | 1.62 |
| FHLMC (Gold) Pool G08079 5%/2035 | アメリカ・ドル | 247,316 | 262,320 | 0.12 |
| FHLMC (Gold) Pool G12738 6%/2022 | アメリカ・ドル | 322,467 | 351,426 | 0.16 |
| FHLMC (Gold) Pool J03615 6%/2021 | アメリカ・ドル | 345,477 | 376,503 | 0.17 |
| FHLMC (Gold) Pool J03640 6%/2021 | アメリカ・ドル | 389,530 | 424,511 | 0.20 |
| FHLMC (Gold) Pool J03672 6%/2021 | アメリカ・ドル | 148,902 | 162,274 | 0.07 |
| FHLMC Pool 1B3203 VR 5.901%/2037 | アメリカ・ドル | 121,557 | 129,446 | 0.06 |
| FHLMC Pool 1G1762 VR 5.073%/2035 | アメリカ・ドル | 362,220 | 385,338 | 0.18 |
| FHLMC Pool 1H1218 VR 4.847%/2034 | アメリカ・ドル | 974,272 | 1,022,062 | 0.47 |
| FHLMC Pool 1J0248 VR 5.251%/2037 | アメリカ・ドル | 181,415 | 191,093 | 0.09 |
| FHLMC Pool 1Q0081 VR 5.033%/2036 | アメリカ・ドル | 417,930 | 443,962 | 0.21 |
| FHLMC REMICS 3195 PN 6.5%/2030 | アメリカ・ドル | 479,311 | 493,441 | 0.23 |
| FNMA 4.375%/2015 | アメリカ・ドル | 1,300,000 | 1,439,506 | 0.66 |
| FNMA 4.875%/2016 | アメリカ・ドル | 750,000 | 848,906 | 0.39 |
| FNMA 7.125%/2030 | アメリカ・ドル | 100,000 | 136,516 | 0.06 |
| FNMA Pool 190346 5.5%/2033 | アメリカ・ドル | 1,123,296 | 1,211,650 | 0.56 |
| FNMA Pool 254140 5.5%/2017 | アメリカ・ドル | 77,617 | 84,039 | 0.04 |
| FNMA Pool 254767 5.5%/2033 | アメリカ・ドル | 2,303,539 | 2,484,726 | 1.15 |
| FNMA Pool 256232 5.5%/2036 | アメリカ・ドル | 365,405 | 392,891 | 0.18 |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|-----------|------|
| FNMA Pool 256844 6%/2037 | アメリカ・ドル | 274,468 | 298,244 | 0.14 |
| FNMA Pool 257407 6%/2038 | アメリカ・ドル | 126,186 | 137,038 | 0.06 |
| FNMA Pool 357280 6.5%/2017 | アメリカ・ドル | 164,489 | 179,537 | 0.08 |
| FNMA Pool 545759 6.5%/2032 | アメリカ・ドル | 1,261,054 | 1,408,124 | 0.65 |
| FNMA Pool 555526 5.5%/2018 | アメリカ・ドル | 58,059 | 62,935 | 0.03 |
| FNMA Pool 569097 6.5%/2016 | アメリカ・ドル | 75,725 | 82,440 | 0.04 |
| FNMA Pool 602309 6.5%/2016 | アメリカ・ドル | 131,609 | 143,279 | 0.07 |
| FNMA Pool 670373 6.5%/2017 | アメリカ・ドル | 178,823 | 194,679 | 0.09 |
| FNMA Pool 725027 5%/2033 | アメリカ・ドル | 1,586,752 | 1,687,726 | 0.78 |
| FNMA Pool 725424 5.5%/2034 | アメリカ・ドル | 317,873 | 342,876 | 0.16 |
| FNMA Pool 725866 4.5%/2034 | アメリカ・ドル | 394,392 | 413,015 | 0.19 |
| FNMA Pool 735318 4.5%/2019 | アメリカ・ドル | 216,941 | 231,472 | 0.11 |
| FNMA Pool 735575 5.5%/2018 | アメリカ・ドル | 2,176,298 | 2,356,352 | 1.09 |
| FNMA Pool 745336 5%/2036 | アメリカ・ドル | 2,620,394 | 2,781,821 | 1.28 |
| FNMA Pool 745453 5.5%/2021 | アメリカ・ドル | 382,298 | 414,883 | 0.19 |
| FNMA Pool 745516 5.5%/2036 | アメリカ・ドル | 2,009,141 | 2,162,150 | 1.00 |
| FNMA Pool 745526 6%/2021 | アメリカ・ドル | 494,186 | 539,705 | 0.25 |
| FNMA Pool 745946 5.5%/2036 | アメリカ・ドル | 230,176 | 247,490 | 0.11 |
| FNMA Pool 745947 6.5%/2036 | アメリカ・ドル | 55,308 | 60,756 | 0.03 |
| FNMA Pool 750412 6.5%/2033 | アメリカ・ドル | 291,653 | 319,497 | 0.15 |
| FNMA Pool 750911 5%/2018 | アメリカ・ドル | 2,204,325 | 2,371,199 | 1.09 |
| FNMA Pool 763199 VR 1.742%/2033 | アメリカ・ドル | 46,236 | 47,275 | 0.02 |
| FNMA Pool 764852 5%/2019 | アメリカ・ドル | 623,154 | 670,329 | 0.31 |
| FNMA Pool 788357 5.5%/2034 | アメリカ・ドル | 946,754 | 1,021,813 | 0.47 |
| FNMA Pool 789292 5%/2034 | アメリカ・ドル | 168,658 | 179,913 | 0.08 |
| FNMA Pool 805466 4.5%/2034 | アメリカ・ドル | 40,133 | 42,028 | 0.02 |
| FNMA Pool 829242 4.5%/2035 | アメリカ・ドル | 38,493 | 40,262 | 0.02 |
| FNMA Pool 831811 6%/2036 | アメリカ・ドル | 225,623 | 246,781 | 0.11 |
| FNMA Pool 848522 VR 5.629%/2035 | アメリカ・ドル | 101,377 | 108,011 | 0.05 |
| FNMA Pool 850863 VR 5.288%/2035 | アメリカ・ドル | 290,990 | 309,975 | 0.14 |
| FNMA Pool 852517 5.5%/2036 | アメリカ・ドル | 479,067 | 515,101 | 0.24 |
| FNMA Pool 888485 4.5%/2037 | アメリカ・ドル | 1,705,919 | 1,784,338 | 0.82 |
| FNMA Pool 889829 5%/2035 | アメリカ・ドル | 2,997,169 | 3,170,911 | 1.46 |
| FNMA Pool 892278 5.5%/2021 | アメリカ・ドル | 13,179 | 14,265 | 0.01 |
| FNMA Pool 892413 6%/2021 | アメリカ・ドル | 92,131 | 100,473 | 0.05 |
| FNMA Pool 900724 5.5%/2021 | アメリカ・ドル | 133,276 | 144,260 | 0.07 |
| FNMA Pool 901646 6.5%/2036 | アメリカ・ドル | 38,450 | 42,238 | 0.02 |
| FNMA Pool 902382 6.5%/2036 | アメリカ・ドル | 86,968 | 95,535 | 0.04 |
| FNMA Pool 905196 VR 5.962%/2036 | アメリカ・ドル | 198,160 | 210,827 | 0.10 |
| FNMA Pool 905743 6.5%/2036 | アメリカ・ドル | 107,041 | 117,584 | 0.05 |
| FNMA Pool 906163 VR 5.531%/2037 | アメリカ・ドル | 420,818 | 446,092 | 0.21 |
| FNMA Pool 908949 6%/2037 | アメリカ・ドル | 38,071 | 41,441 | 0.02 |
| FNMA Pool 923128 5.5%/2037 | アメリカ・ドル | 112,043 | 120,254 | 0.06 |
| FNMA Pool 923129 5.5%/2034 | アメリカ・ドル | 84,586 | 91,107 | 0.04 |
| FNMA Pool 929836 6%/2038 | アメリカ・ドル | 402,465 | 437,077 | 0.20 |
| FNMA Pool 929848 6%/2038 | アメリカ・ドル | 255,183 | 277,128 | 0.13 |
| FNMA Pool 931837 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 754,544 | 784,254 | 0.36 |
| FNMA Pool 933051 6.5%/2037 | アメリカ・ドル | 371,318 | 407,313 | 0.19 |
| FNMA Pool 937638 4.5%/2037 | アメリカ・ドル | 1,602,678 | 1,665,833 | 0.77 |
| FNMA Pool 942345 6%/2037 | アメリカ・ドル | 200,780 | 218,173 | 0.10 |
| FNMA Pool 942347 6%/2037 | アメリカ・ドル | 124,010 | 134,752 | 0.06 |
| FNMA Pool 942477 6%/2022 | アメリカ・ドル | 16,191 | 17,627 | 0.01 |
| FNMA Pool 944625 6%/2037 | アメリカ・ドル | 52,178 | 56,698 | 0.03 |
| FNMA Pool 944713 6%/2037 | アメリカ・ドル | 30,763 | 33,427 | 0.02 |
| FNMA Pool 947117 6%/2037 | アメリカ・ドル | 126,874 | 137,865 | 0.06 |
| FNMA Pool 948410 6%/2022 | アメリカ・ドル | 36,504 | 39,741 | 0.02 |
| FNMA Pool 949782 VR 5.791%/2037 | アメリカ・ドル | 354,779 | 379,113 | 0.18 |
| FNMA Pool 952354 6.5%/2037 | アメリカ・ドル | 157,803 | 173,100 | 0.08 |
| FNMA Pool 952502 6.5%/2037 | アメリカ・ドル | 166,613 | 182,765 | 0.08 |
| FNMA Pool 953221 6%/2037 | アメリカ・ドル | 43,712 | 47,499 | 0.02 |
| FNMA Pool 964926 6%/2038 | アメリカ・ドル | 188,757 | 204,990 | 0.09 |
| FNMA Pool 965014 6%/2038 | アメリカ・ドル | 51,515 | 55,945 | 0.03 |
| FNMA Pool 965051 6%/2038 | アメリカ・ドル | 66,116 | 71,802 | 0.03 |
| FNMA Pool 969705 6%/2038 | アメリカ・ドル | 159,677 | 173,409 | 0.08 |

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| FNMA Pool 973961 4.5%/2038 | アメリカ・ドル | 863,948 | 897,588 | 0.41 |
| FNMA Pool 974321 6%/2033 | アメリカ・ドル | 1,459,670 | 1,595,581 | 0.74 |
| FNMA Pool 983288 6%/2038 | アメリカ・ドル | 392,680 | 426,451 | 0.20 |
| FNMA Pool 985153 6%/2038 | アメリカ・ドル | 556,562 | 604,426 | 0.28 |
| FNMA Pool 995024 5.5%/2037 | アメリカ・ドル | 1,019,599 | 1,098,203 | 0.51 |
| FNMA Pool AA5588 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 2,329,787 | 2,419,775 | 1.12 |
| FNMA Pool AA9346 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 125,271 | 129,832 | 0.06 |
| FNMA Pool AC9564 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 70,941 | 73,735 | 0.03 |
| FNMA Pool AD1655 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 1,136,483 | 1,181,054 | 0.55 |
| FNMA Pool AD3685 4.5%/2040 | アメリカ・ドル | 1,086,097 | 1,128,692 | 0.52 |
| FNMA REMICS 2005-57 PA 5.5%/2027 | アメリカ・ドル | 91,223 | 91,276 | 0.04 |
| GNMA I Pool 604639 5%/2033 | アメリカ・ドル | 1,550,511 | 1,666,848 | 0.77 |
| GNMA I Pool 605561 5.5%/2034 | アメリカ・ドル | 479,448 | 521,145 | 0.24 |
| GNMA I Pool 612919 5%/2033 | アメリカ・ドル | 302,586 | 325,289 | 0.15 |
| GNMA I Pool 615278 5%/2033 | アメリカ・ドル | 169,392 | 182,102 | 0.08 |
| GNMA I Pool 616826 5.5%/2035 | アメリカ・ドル | 36,438 | 39,578 | 0.02 |
| GNMA II Pool 3306 5.5%/2032 | アメリカ・ドル | 484,577 | 528,248 | 0.24 |
| GNMA II Pool 3490 6.5%/2033 | アメリカ・ドル | 809,013 | 899,515 | 0.42 |
| GNMA II Pool 3611 6%/2034 | アメリカ・ドル | 281,101 | 309,950 | 0.14 |
| GNMA II Pool 4060 6%/2037 | アメリカ・ドル | 55,230 | 60,410 | 0.03 |
| GNMA II Pool 4222 6%/2038 | アメリカ・ドル | 169,015 | 184,631 | 0.09 |
| GNMA II Pool 4498 6%/2039 | アメリカ・ドル | 38,114 | 41,955 | 0.02 |
| GNMA II Pool 4558 4.5%/2039 | アメリカ・ドル | 187,036 | 194,877 | 0.09 |
| Goldman Sachs Group 6.15%/2018 | アメリカ・ドル | 1,140,000 | 1,196,010 | 0.55 |
| Goldman Sachs Group 6.75%/2037 | アメリカ・ドル | 640,000 | 629,345 | 0.29 |
| Goldman Sachs Group 7.5%/2019 | アメリカ・ドル | 365,000 | 408,647 | 0.19 |
| Hess 6%/2040 | アメリカ・ドル | 130,000 | 135,765 | 0.06 |
| Hess 7.875%/2029 | アメリカ・ドル | 180,000 | 222,090 | 0.10 |
| Hess 8.125%/2019 | アメリカ・ドル | 85,000 | 106,129 | 0.05 |
| Home Depot 5.4%/2016 | アメリカ・ドル | 300,000 | 334,314 | 0.15 |
| International Lease Finance SerMTN 6.625%/2013 | アメリカ・ドル | 290,000 | 270,425 | 0.12 |
| JC Penney 5.65%/2020 | アメリカ・ドル | 40,000 | 39,300 | 0.02 |
| JC Penney 9%/2012 | アメリカ・ドル | 325,000 | 359,531 | 0.17 |
| JPMorgan Chase 4.75%/2013 | アメリカ・ドル | 525,000 | 560,444 | 0.26 |
| JPMorgan Chase 6%/2018 | アメリカ・ドル | 585,000 | 646,965 | 0.30 |
| Lincoln National 4.3%/2015 | アメリカ・ドル | 45,000 | 45,821 | 0.02 |
| Macys Retail Holdings 5.35%/2012 | アメリカ・ドル | 235,000 | 241,462 | 0.11 |
| Magellan Midstream Partners 6.55%/2019 | アメリカ・ドル | 125,000 | 140,624 | 0.06 |
| Marathon Oil 6%/2017 | アメリカ・ドル | 400,000 | 447,598 | 0.21 |
| Marathon Oil 6.6%/2037 | アメリカ・ドル | 145,000 | 158,970 | 0.07 |
| Merrill Lynch 5.45%/2013 | アメリカ・ドル | 355,000 | 372,632 | 0.17 |
| Merrill Lynch SerMTN 6.875%/2018 | アメリカ・ドル | 695,000 | 742,536 | 0.34 |
| MetLife 6.75%/2016 | アメリカ・ドル | 315,000 | 356,814 | 0.16 |
| Morgan Stanley SerGMTN 4.1%/2015 | アメリカ・ドル | 215,000 | 209,749 | 0.10 |
| Nabors Industries 6.15%/2018 | アメリカ・ドル | 120,000 | 128,862 | 0.06 |
| Nordstrom 4.75%/2020 | アメリカ・ドル | 115,000 | 119,335 | 0.06 |
| Pacific Gas & Electric 6.35%/2038 | アメリカ・ドル | 180,000 | 210,471 | 0.10 |
| Pemex Project Funding Master Trust 5.75%/2018 | アメリカ・ドル | 680,000 | 715,758 | 0.33 |
| Plains All American Pipeline/PAA Finance 5.75%/2020 | アメリカ・ドル | 250,000 | 258,797 | 0.12 |
| Principal Financial Group 6.05%/2036 | アメリカ・ドル | 330,000 | 309,990 | 0.14 |
| Regions Financial 5.75%/2015 | アメリカ・ドル | 90,000 | 89,526 | 0.04 |
| Reynolds American 7.25%/2013 | アメリカ・ドル | 120,000 | 132,100 | 0.06 |
| Roper Industries 6.25%/2019 | アメリカ・ドル | 210,000 | 233,229 | 0.11 |
| Simon Property Group 5.75%/2015 | アメリカ・ドル | 260,000 | 286,167 | 0.13 |
| SLM SerMTN 5.125%/2012 | アメリカ・ドル | 125,000 | 123,201 | 0.06 |
| SLM SerMTN 8.45%/2018 | アメリカ・ドル | 200,000 | 184,820 | 0.09 |
| Southern California Edison Ser08-A 5.95%/2038 | アメリカ・ドル | 675,000 | 782,780 | 0.36 |
| Southwest Airlines 5.125%/2017 | アメリカ・ドル | 205,000 | 208,321 | 0.10 |
| Spectra Energy Capital 5.65%/2020 | アメリカ・ドル | 70,000 | 73,691 | 0.03 |
| Sunoco 9.625%/2015 | アメリカ・ドル | 136,000 | 161,360 | 0.07 |

| | | | | |
|--|---------|------------|--------------------|--------------|
| Time Warner Cable 5.4%/2012 | アメリカ・ドル | 585,000 | 625,179 | 0.29 |
| United Technologies 5.7%/2040 | アメリカ・ドル | 320,000 | 358,579 | 0.17 |
| US Treasury 1.75%/2012 | アメリカ・ドル | 14,255,000 | 14,587,997 | 6.74 |
| US Treasury 2.25%/2014 | アメリカ・ドル | 1,420,000 | 1,465,373 | 0.68 |
| US Treasury 2.625%/2014 | アメリカ・ドル | 975,000 | 1,018,951 | 0.47 |
| US Treasury 2.625%/2016 | アメリカ・ドル | 4,930,000 | 5,066,344 | 2.34 |
| US Treasury 3.125%/2013 | アメリカ・ドル | 1,045,000 | 1,112,762 | 0.51 |
| US Treasury 4%/2018 | アメリカ・ドル | 3,105,000 | 3,415,742 | 1.58 |
| US Treasury 4.625%/2040 | アメリカ・ドル | 4,505,000 | 5,064,607 | 2.34 |
| Verizon Global Funding 7.75%/2030 | アメリカ・ドル | 315,000 | 393,644 | 0.18 |
| Verizon Virginia SerA 4.625%/2013 | アメリカ・ドル | 375,000 | 395,978 | 0.18 |
| Wachovia 5.75%/2018 | アメリカ・ドル | 415,000 | 455,356 | 0.21 |
| Waste Management 6.1%/2018 | アメリカ・ドル | 355,000 | 405,247 | 0.19 |
| WellPoint 5%/2011 | アメリカ・ドル | 430,000 | 438,450 | 0.20 |
| WellPoint 6%/2014 | アメリカ・ドル | 195,000 | 218,841 | 0.10 |
| Xerox 5.5%/2012 | アメリカ・ドル | 145,000 | 154,632 | 0.07 |
| Xerox 5.65%/2013 | アメリカ・ドル | 50,000 | 54,154 | 0.02 |
| Xerox 6.35%/2018 | アメリカ・ドル | 270,000 | 301,639 | 0.14 |
| アメリカ 計 | | | 128,426,758 | 59.30 |
| 公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計 | | | 137,833,782 | 63.64 |
| その他の規制のある市場において取引されている有価証券 | | | | |
| オーストラリア | | | | |
| Westpac Banking 4.875%/2019 | アメリカ・ドル | 375,000 | 388,013 | 0.18 |
| オーストラリア 計 | | | 388,013 | 0.18 |
| ベルギー | | | | |
| Delhaize Group 6.5%/2017 | アメリカ・ドル | 140,000 | 161,551 | 0.08 |
| ベルギー 計 | | | 161,551 | 0.08 |
| カナダ | | | | |
| Kinder Morgan Finance 5.7%/2016 | アメリカ・ドル | 355,000 | 340,800 | 0.16 |
| Petro Canada 6.8%/2038 | アメリカ・ドル | 100,000 | 114,567 | 0.05 |
| Placer Dome 6.45%/2035 | アメリカ・ドル | 385,000 | 425,085 | 0.20 |
| Teck Resources 10.25%/2016 | アメリカ・ドル | 120,000 | 141,760 | 0.06 |
| Teck Resources 10.75%/2019 | アメリカ・ドル | 55,000 | 67,493 | 0.03 |
| カナダ 計 | | | 1,089,705 | 0.50 |
| ケイマン諸島 | | | | |
| Petrobras International Finance 5.75%/2020 | アメリカ・ドル | 130,000 | 131,566 | 0.06 |
| ケイマン諸島 計 | | | 131,566 | 0.06 |
| フランス | | | | |
| Electricité de France Ser144A 6.95%/2039 | アメリカ・ドル | 210,000 | 253,978 | 0.12 |
| Lafarge 6.15%/2011 | アメリカ・ドル | 220,000 | 225,520 | 0.10 |
| フランス 計 | | | 479,498 | 0.22 |
| ルクセンブルグ | | | | |
| ArceIorMittal 5.375%/2013 | アメリカ・ドル | 460,000 | 484,107 | 0.22 |
| ルクセンブルグ 計 | | | 484,107 | 0.22 |
| メキシコ | | | | |
| Grupo Televisa 6.625%/2040 | アメリカ・ドル | 165,000 | 172,742 | 0.08 |
| メキシコ 計 | | | 172,742 | 0.08 |
| スイス | | | | |
| Credit Suisse 5.4%/2020 | アメリカ・ドル | 440,000 | 438,282 | 0.20 |
| スイス 計 | | | 438,282 | 0.20 |

イギリス

| | | | | |
|--------------------------|---------|---------|---------|------|
| Barclays Bank 6.75%/2019 | アメリカ・ドル | 255,000 | 284,152 | 0.13 |
|--------------------------|---------|---------|---------|------|

イギリス 計

| | | | | |
|--|--|--|----------------|-------------|
| | | | 284,152 | 0.13 |
|--|--|--|----------------|-------------|

アメリカ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Aflac 8.5%/2019 | アメリカ・ドル | 445,000 | 536,280 | 0.25 |
| Allstate 7.45%/2019 | アメリカ・ドル | 200,000 | 236,106 | 0.11 |
| Ally Auto Receivables Trust 2009-B C Ser144A 4.06%/2016 | アメリカ・ドル | 575,000 | 583,086 | 0.27 |
| AMB Property 6.625%/2019 | アメリカ・ドル | 190,000 | 205,102 | 0.09 |
| American Tower 4.625%/2015 | アメリカ・ドル | 175,000 | 182,235 | 0.08 |
| American Tower 7.25%/2019 | アメリカ・ドル | 297,000 | 340,065 | 0.16 |
| American Tower Trust 2007-1A D Ser144A 5.957%/2037 | アメリカ・ドル | 400,000 | 421,305 | 0.19 |
| AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2006-RM A3 5.53%/2014 | アメリカ・ドル | 575,000 | 590,924 | 0.27 |
| AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2010-2 B 2.73%/2015 | アメリカ・ドル | 348,000 | 350,936 | 0.16 |
| Ameriprise Financial 7.3%/2019 | アメリカ・ドル | 100,000 | 118,342 | 0.05 |
| AmerisourceBergen 4.875%/2019 | アメリカ・ドル | 235,000 | 243,932 | 0.11 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide 5.375%/2020 | アメリカ・ドル | 635,000 | 685,556 | 0.32 |
| Bank of America Commercial Mortgage 2003-1 A2 4.648%/2036 | アメリカ・ドル | 250,000 | 262,322 | 0.12 |
| Bank of America Commercial Mortgage 2005-3 A2 4.501%/2043 | アメリカ・ドル | 832,583 | 841,604 | 0.39 |
| Bank of America Mortgage Securities 2004-A 2A2 VR 3.515%/2034 | アメリカ・ドル | 35,748 | 32,774 | 0.02 |

[前へ](#) [次へ](#)

| | | | | |
|---|---------|-----------|-----------|------|
| Bank of America Mortgage Securities 2004-B 2A2 VR 3.059%/2034 | アメリカ・ドル | 237,873 | 229,194 | 0.11 |
| Bank of America Mortgage Securities 2004-D 2A2 VR 2.961%/2034 | アメリカ・ドル | 570,532 | 527,780 | 0.24 |
| Bank of America Mortgage Securities 2004-H 2A2 VR 3.709%/2034 | アメリカ・ドル | 216,345 | 198,310 | 0.09 |
| Bank of America Mortgage Securities 2004-I 3A2 VR 4.823%/2034 | アメリカ・ドル | 189,040 | 185,722 | 0.09 |
| Bank of America Mortgage Securities 2005-J 3A1 VR 5.245%/2035 | アメリカ・ドル | 341,343 | 261,890 | 0.12 |
| Bank of America 5.65%/2018 | アメリカ・ドル | 1,175,000 | 1,206,048 | 0.56 |
| Bank of America 5.75%/2016 | アメリカ・ドル | 275,000 | 284,961 | 0.13 |
| Bank of America 7.375%/2014 | アメリカ・ドル | 490,000 | 549,638 | 0.25 |
| Bank of America Mortgage Securities 2005-J 2A1 VR 5.067%/2035 | アメリカ・ドル | 1,192,396 | 1,001,143 | 0.46 |
| Bay Area Toll Authority California 6.263%/2049 | アメリカ・ドル | 250,000 | 263,090 | 0.12 |
| BB&T 5.7%/2014 | アメリカ・ドル | 235,000 | 258,291 | 0.12 |
| BB&T Capital Trust II 6.75%/2036 | アメリカ・ドル | 220,000 | 223,016 | 0.10 |
| Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2002-TOP8 A2 4.83%/2038 | アメリカ・ドル | 55,000 | 57,706 | 0.03 |
| Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2005-PWR9 AAB 4.804%/2042 | アメリカ・ドル | 1,650,000 | 1,724,873 | 0.80 |
| Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2007-PW17 A1 5.282%/2050 | アメリカ・ドル | 1,102,281 | 1,123,380 | 0.52 |
| Boardwalk Pipelines 5.5%/2017 | アメリカ・ドル | 240,000 | 248,502 | 0.11 |
| Buckeye Partners 5.5%/2019 | アメリカ・ドル | 220,000 | 228,365 | 0.11 |
| Buckeye Partners 6.05%/2018 | アメリカ・ドル | 165,000 | 182,708 | 0.08 |
| Cabela's Master Credit Card Trust 2006-3A B Ser144A VR 0.55%/2014 | アメリカ・ドル | 595,000 | 596,140 | 0.28 |
| California State Taxable VR 7.625%/2040 | アメリカ・ドル | 260,000 | 281,182 | 0.13 |
| Capital Auto Receivables Asset Trust 2007-SN2 A4 1.26%/2011 | アメリカ・ドル | 445,717 | 446,204 | 0.21 |
| Capital One Capital IV VR 6.745%/2037 | アメリカ・ドル | 535,000 | 452,075 | 0.21 |
| Capital One Financial 7.375%/2014 | アメリカ・ドル | 220,000 | 251,775 | 0.12 |
| Carmax Auto Owner Trust 2010-2 B 3.96%/2016 | アメリカ・ドル | 380,000 | 379,983 | 0.18 |
| CBS 5.75%/2020 | アメリカ・ドル | 125,000 | 134,418 | 0.06 |
| Cellco Partnership/Verizon Wireless Capital 8.5%/2018 | アメリカ・ドル | 235,000 | 306,016 | 0.14 |
| Chicago Illinois Metropolitan Water Reclamation 5.72%/2038 | アメリカ・ドル | 210,000 | 228,071 | 0.11 |
| Chicago Illinois O'Hare International Airport General Third Lien 6.395%/2040 | アメリカ・ドル | 170,000 | 181,545 | 0.08 |
| Chicago Illinois Transit Authority Sales And Taxable-pension Funding Series A 6.899%/2040 | アメリカ・ドル | 320,000 | 355,856 | 0.16 |
| Citigroup / Deutsche Bank Commercial Mortgage Trust 2006-CD3 AAB 5.608%/2048 | アメリカ・ドル | 1,625,000 | 1,751,050 | 0.81 |
| Citigroup / Deutsche Bank Commercial Mortgage Trust 2006-CD3 A5 5.617%/2048 | アメリカ・ドル | 240,000 | 246,258 | 0.11 |
| Citigroup 5.5%/2014 | アメリカ・ドル | 250,000 | 257,272 | 0.12 |
| Citigroup 5.85%/2013 | アメリカ・ドル | 385,000 | 403,356 | 0.19 |
| Cliffs Natural Resources 5.9%/2020 | アメリカ・ドル | 35,000 | 37,602 | 0.02 |
| CNH Equipment Trust 2007-A B 5.09%/2014 | アメリカ・ドル | 455,000 | 460,097 | 0.21 |
| Comcast 6.4%/2040 | アメリカ・ドル | 400,000 | 432,013 | 0.20 |
| Commercial Mortgage Pass Through Certificates 2007-C9 A4 VR 5.816%/2049 | アメリカ・ドル | 325,000 | 336,572 | 0.16 |
| Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019 | アメリカ・ドル | 100,000 | 106,500 | 0.05 |
| COX Communications 7.125%/2012 | アメリカ・ドル | 160,000 | 177,871 | 0.08 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 2006-C4 A3 5.467%/2039 | アメリカ・ドル | 1,830,000 | 1,802,233 | 0.83 |
| DIRECTV Holdings 3.55%/2015 | アメリカ・ドル | 235,000 | 236,813 | 0.11 |
| DIRECTV Holdings 5.875%/2019 | アメリカ・ドル | 505,000 | 552,648 | 0.26 |
| Discovery Communications 3.7%/2015 | アメリカ・ドル | 225,000 | 230,938 | 0.11 |
| Discovery Communications 5.625%/2019 | アメリカ・ドル | 170,000 | 184,352 | 0.09 |
| District Columbia Income Tax Secured Revenue 5.591%/2034 | アメリカ・ドル | 60,000 | 62,837 | 0.03 |
| El Paso Natural Gas 5.95%/2017 | アメリカ・ドル | 110,000 | 117,437 | 0.05 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------|------|
| Enterprise Products Operating 5.25%/2020 | アメリカ・ドル | 75,000 | 77,359 | 0.04 |
| Enterprise Products Operating 7.55%/2038 | アメリカ・ドル | 215,000 | 251,119 | 0.12 |
| ERP Operating 5.25%/2014 | アメリカ・ドル | 220,000 | 235,603 | 0.11 |
| Exelon Generation 6.25%/2039 | アメリカ・ドル | 225,000 | 241,178 | 0.11 |
| Express Scripts 6.25%/2014 | アメリカ・ドル | 165,000 | 186,981 | 0.09 |
| Federal Realty Investment Trust 5.9%/2020 | アメリカ・ドル | 30,000 | 31,760 | 0.01 |
| Fifth Third Bancorp 6.25%/2013 | アメリカ・ドル | 345,000 | 375,594 | 0.17 |
| Fifth Third Bancorp 8.25%/2038 | アメリカ・ドル | 150,000 | 168,660 | 0.08 |
| FirstEnergy Solutions 4.8%/2015 | アメリカ・ドル | 220,000 | 230,444 | 0.11 |
| Ford Credit Floorplan Master Owner Trust 2010-3 C Ser144A 4.99%/2017 | アメリカ・ドル | 590,000 | 608,148 | 0.28 |
| Genworth Financial 7.7%/2020 | アメリカ・ドル | 60,000 | 60,038 | 0.03 |
| Genworth Financial 8.625%/2016 | アメリカ・ドル | 160,000 | 170,837 | 0.08 |
| GMAC Commercial Mortgage Securities 2001-C1 A2 6.465%/2034 | アメリカ・ドル | 184,140 | 188,088 | 0.09 |
| GMAC Commercial Mortgage Securities 2001-C2 A2 6.7%/2034 | アメリカ・ドル | 231,633 | 239,077 | 0.11 |
| Goldman Sachs Capital I 6.345%/2034 | アメリカ・ドル | 265,000 | 238,464 | 0.11 |
| Goldman Sachs Group 6%/2020 | アメリカ・ドル | 150,000 | 154,959 | 0.07 |
| Greenwich Capital Commercial Funding 2005-GG3 AAB 4.619%/2042 | アメリカ・ドル | 1,124,794 | 1,163,651 | 0.54 |
| Historic TW 6.875%/2018 | アメリカ・ドル | 485,000 | 571,541 | 0.26 |
| Hospitality Properties Trust 5.625%/2017 | アメリカ・ドル | 275,000 | 263,664 | 0.12 |
| Jefferies Group 6.25%/2036 | アメリカ・ドル | 535,000 | 480,287 | 0.22 |
| Johnson Controls 5%/2020 | アメリカ・ドル | 140,000 | 147,429 | 0.07 |
| JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2001-CIBC A3 6.26%/2033 | アメリカ・ドル | 1,230,026 | 1,246,861 | 0.58 |
| JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2005-LDP4 ASB VR 4.824%/2042 | アメリカ・ドル | 1,307,084 | 1,365,834 | 0.63 |
| JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-CB15 A4 VR 5.814%/2043 | アメリカ・ドル | 1,560,000 | 1,621,586 | 0.75 |
| JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-LDP9 A3 5.336%/2047 | アメリカ・ドル | 160,000 | 158,456 | 0.07 |
| JP Morgan Mortgage Acquisition 2007-CH1 AV2 VR 0.41%/2036 | アメリカ・ドル | 53,825 | 51,428 | 0.02 |
| JPMorgan Chase 3.7%/2015 | アメリカ・ドル | 205,000 | 209,901 | 0.10 |
| JPMorgan Chase 4.65%/2014 | アメリカ・ドル | 730,000 | 779,078 | 0.36 |
| JPMorgan Chase 6.3%/2019 | アメリカ・ドル | 485,000 | 548,746 | 0.25 |
| JPMorgan Chase Capital XXII SerV 6.45%/2037 | アメリカ・ドル | 330,000 | 312,450 | 0.14 |
| JPMorgan Chase Capital XXVII SerAA 7%/2039 | アメリカ・ドル | 380,000 | 387,649 | 0.18 |
| Kansas Development Finance Authority Revenue Public Employees Retirement System C 5.501%/2034 | アメリカ・ドル | 200,000 | 199,768 | 0.09 |
| Kraft Foods 6.5%/2040 | アメリカ・ドル | 240,000 | 269,334 | 0.12 |
| Kroger 3.9%/2015 | アメリカ・ドル | 260,000 | 274,593 | 0.13 |
| LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2004-C2 A2 3.246%/2029 | アメリカ・ドル | 98,716 | 98,779 | 0.05 |
| Life Technologies 4.4%/2015 | アメリカ・ドル | 180,000 | 186,383 | 0.09 |
| Los Angeles California Department Airports Taxable-build America Bond 6.582%/2039 | アメリカ・ドル | 175,000 | 190,225 | 0.09 |
| Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-1A A Ser144A 5.737%/2028 | アメリカ・ドル | 443,800 | 455,008 | 0.21 |
| Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-2A A Ser144A 5.362%/2028 | アメリカ・ドル | 138,554 | 140,908 | 0.06 |
| Maryland Transportation Authority 5.888%/2043 | アメリカ・ドル | 165,000 | 178,683 | 0.08 |
| MBNA Credit Card Master Note Trust 2006-C3 C3 VR 0.64%/2013 | アメリカ・ドル | 355,000 | 350,671 | 0.16 |
| MDC Holdings 5.5%/2013 | アメリカ・ドル | 610,000 | 632,657 | 0.29 |
| Metropolitan Transportation Authority New York Taxable Series C-build America Bds- 7.336%/2039 | アメリカ・ドル | 80,000 | 97,766 | 0.05 |
| Morgan Stanley 4.2%/2014 | アメリカ・ドル | 225,000 | 222,393 | 0.10 |
| Morgan Stanley 7.3%/2019 | アメリカ・ドル | 1,505,000 | 1,621,162 | 0.75 |
| Morgan Stanley SerMTN 6%/2015 | アメリカ・ドル | 1,180,000 | 1,234,474 | 0.57 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|-------------------|--------------|
| Nabors Industries 9.25%/2019 | アメリカ・ドル | 185,000 | 227,798 | 0.11 |
| Navistar Financial Owner Trust 2010-A B Ser144A 4.17%/2014 | アメリカ・ドル | 455,000 | 458,767 | 0.21 |
| Nevada Power SerN 6.65%/2036 | アメリカ・ドル | 235,000 | 268,084 | 0.12 |
| New York City Municipal Water Finance Taxable Series Dd 5.952%/2042 | アメリカ・ドル | 120,000 | 126,402 | 0.06 |
| New York New York City Housing Development Corporation Taxable Series A 6.42%/2027 | アメリカ・ドル | 258,950 | 251,163 | 0.12 |
| New York New York Taxable Series H1-build America Bds-5.846%/2040 | アメリカ・ドル | 100,000 | 101,452 | 0.05 |
| News America 6.15%/2037 | アメリカ・ドル | 360,000 | 376,707 | 0.17 |
| News America 6.4%/2035 | アメリカ・ドル | 155,000 | 169,242 | 0.08 |
| Northern States Power 5.35%/2039 | アメリカ・ドル | 133,000 | 140,344 | 0.06 |
| Northern Trust SerBKNT 4.6%/2013 | アメリカ・ドル | 250,000 | 266,921 | 0.12 |
| Partnerre Finance B 5.5%/2020 | アメリカ・ドル | 175,000 | 169,439 | 0.08 |
| Peco Energy Transition Trust 2001-A A1 6.52%/2010 | アメリカ・ドル | 200,523 | 202,544 | 0.09 |
| PNC Funding 5.625%/2017 | アメリカ・ドル | 325,000 | 346,234 | 0.16 |
| PNC Funding 6.7%/2019 | アメリカ・ドル | 90,000 | 103,316 | 0.05 |
| Principal Financial Group 8.875%/2019 | アメリカ・ドル | 20,000 | 24,562 | 0.01 |
| Provident 7%/2018 | アメリカ・ドル | 165,000 | 175,622 | 0.08 |
| Prudential Financial 5.375%/2020 | アメリカ・ドル | 155,000 | 157,281 | 0.07 |
| Prudential Financial 6.2%/2015 | アメリカ・ドル | 100,000 | 110,162 | 0.05 |
| Prudential Financial SerMTN 4.75%/2015 | アメリカ・ドル | 250,000 | 258,403 | 0.12 |
| PSE&G Transition Funding 2001-1 A6 6.61%/2015 | アメリカ・ドル | 2,950,000 | 3,262,690 | 1.51 |
| Public Service of Oklahoma 5.15%/2019 | アメリカ・ドル | 135,000 | 142,424 | 0.07 |
| Reckson Operating Partnership 6%/2016 | アメリカ・ドル | 400,000 | 388,092 | 0.18 |
| Regency Centers 5.875%/2017 | アメリカ・ドル | 130,000 | 137,237 | 0.06 |
| Regency Centers 6%/2020 | アメリカ・ドル | 105,000 | 108,614 | 0.05 |
| Reinsurance Group of America 6.45%/2019 | アメリカ・ドル | 150,000 | 160,599 | 0.07 |
| San Diego County California Water Authority Taxable Series B 6.138%/2049 | アメリカ・ドル | 125,000 | 135,560 | 0.06 |
| Sequoia Mortgage Trust 2010-H1 A1 VR 3.75%/2040 | アメリカ・ドル | 146,974 | 148,250 | 0.07 |
| Simon Property Group 6.75%/2014 | アメリカ・ドル | 295,000 | 331,841 | 0.15 |
| SLM Student Loan Trust VR 1.366%/2016 | アメリカ・ドル | 600,000 | 610,736 | 0.28 |
| Southern Copper 5.375%/2020 | アメリカ・ドル | 40,000 | 40,293 | 0.02 |
| Staples 9.75%/2014 | アメリカ・ドル | 125,000 | 153,452 | 0.07 |
| Tampa Electric 6.15%/2037 | アメリカ・ドル | 335,000 | 370,938 | 0.17 |
| Teco Finance 5.15%/2020 | アメリカ・ドル | 190,000 | 198,417 | 0.09 |
| Tobacco Settlement Finance Authority Turbo Series A 7.467%/2047 | アメリカ・ドル | 433,000 | 323,031 | 0.15 |
| USAA Auto Owner Trust 2008-1 A3 4.16%/2012 | アメリカ・ドル | 132,812 | 133,790 | 0.06 |
| Utah Transit Authority Sales Tax Revenue Series B 5.937%/2039 | アメリカ・ドル | 135,000 | 148,032 | 0.07 |
| Valero Energy 6.125%/2017 | アメリカ・ドル | 410,000 | 436,035 | 0.20 |
| Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust 2005-AR2 2A2 VR 2.876%/2035 | アメリカ・ドル | 174,824 | 158,811 | 0.07 |
| Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust 2006-AR16 A1 VR 5.554%/2036 | アメリカ・ドル | 446,208 | 367,427 | 0.17 |
| Westar Energy 5.1%/2020 | アメリカ・ドル | 460,000 | 515,526 | 0.24 |
| Williams Partners Series WI 6.3%/2040 | アメリカ・ドル | 240,000 | 241,941 | 0.11 |
| Xcel Energy 4.7%/2020 | アメリカ・ドル | 160,000 | 166,916 | 0.08 |
| アメリカ 計 | | | 56,929,069 | 26.29 |
| その他の規制のある市場において取引されている有価証券 計 | | | 60,558,685 | 27.96 |

直近に発行された取引可能な有価証券

オーストラリア

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|---------|---------|------|
| Coca-Cola Amatil Ser144A 3.25%/2014 | アメリカ・ドル | 200,000 | 203,349 | 0.09 |
| Woodside Finance Ser144A 4.5%/2014 | アメリカ・ドル | 125,000 | 127,614 | 0.06 |

オーストラリア 計

330,963 0.15

日本

| | | | | |
|---|---------|---------|---------|------|
| Bank of Tokyo-Mitsubishi Ser144A 3.85%/2015 | アメリカ・ドル | 140,000 | 145,805 | 0.07 |
|---|---------|---------|---------|------|

日本 計

145,805 0.07

ルクセンブルグ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Enel Finance International Ser144A 6%/2039 | アメリカ・ドル | 355,000 | 342,689 | 0.16 |
| Holcim US Finance Ser144A 6%/2019 | アメリカ・ドル | 135,000 | 144,275 | 0.06 |

ルクセンブルグ 計

486,964 0.22

メキシコ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Coca-Cola Femsa Ser144A 4.625%/2020 | アメリカ・ドル | 135,000 | 137,705 | 0.07 |
| Grupo Bimbo SAB de Ser144A 4.875%/2020 | アメリカ・ドル | 435,000 | 440,662 | 0.20 |

メキシコ 計

578,367 0.27

イギリス

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|---------|---------|------|
| Lloyds TSB Bank Ser144A 4.375%/2015 | アメリカ・ドル | 365,000 | 352,017 | 0.16 |
|-------------------------------------|---------|---------|---------|------|

イギリス 計

352,017 0.16

アメリカ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Allegheny Energy Supply Ser144A 6.75%/2039 | アメリカ・ドル | 300,000 | 294,738 | 0.14 |
| Crown Castle Towers Ser144A 6.113%/2020 | アメリカ・ドル | 398,000 | 437,628 | 0.20 |
| Enogex Ser144A 6.25%/2020 | アメリカ・ドル | 125,000 | 134,114 | 0.06 |
| ERAC USA Finance Ser144A 5.25%/2020 | アメリカ・ドル | 190,000 | 192,375 | 0.09 |
| Kilroy Realty Ser144A 6.625%/2020 | アメリカ・ドル | 225,000 | 228,980 | 0.10 |
| Massachusetts Electric Ser144A 5.9%/2039 | アメリカ・ドル | 250,000 | 274,613 | 0.13 |
| Motiva Enterprises Ser144A 6.85%/2040 | アメリカ・ドル | 95,000 | 108,942 | 0.05 |
| NBC Universal Ser144A 5.15%/2020 | アメリカ・ドル | 575,000 | 600,874 | 0.28 |
| Pacific LifeCorp Ser144A 6%/2020 | アメリカ・ドル | 315,000 | 334,893 | 0.15 |
| TCM Sub Ser144A 3.55%/2015 | アメリカ・ドル | 245,000 | 250,765 | 0.12 |

アメリカ 計

2,857,922 1.32

直近に発行された取引可能な有価証券 計

4,752,038 2.19

その他の取引可能な有価証券

オーストラリア

| | | | | |
|---|---------|---------|---------|------|
| WEA Finance/WT Finance Aust Pty Ser144A 7.5%/2014 | アメリカ・ドル | 245,000 | 277,888 | 0.13 |
|---|---------|---------|---------|------|

オーストラリア 計

| | | | | |
|--|--|--|----------------|-------------|
| | | | 277,888 | 0.13 |
|--|--|--|----------------|-------------|

トリニダード・トバコ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| National Gas of Trinidad & Tobago Ser144A 6.05%/2036 | アメリカ・ドル | 340,000 | 312,290 | 0.14 |
|--|---------|---------|---------|------|

トリニダード・トバコ 計

| | | | | |
|--|--|--|----------------|-------------|
| | | | 312,290 | 0.14 |
|--|--|--|----------------|-------------|

アラブ首長国連邦

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Abu Dhabi National Energy Ser144A 5.62%/2012 | アメリカ・ドル | 565,000 | 586,789 | 0.27 |
|--|---------|---------|---------|------|

アラブ首長国連邦 計

| | | | | |
|--|--|--|----------------|-------------|
| | | | 586,789 | 0.27 |
|--|--|--|----------------|-------------|

イギリス

| | | | | |
|---|---------|---------|---------|------|
| BAT International Finance Ser144A 8.125%/2013 | アメリカ・ドル | 260,000 | 307,159 | 0.14 |
|---|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| British Sky Broadcasting Group Ser144A 6.1%/2018 | アメリカ・ドル | 280,000 | 314,753 | 0.14 |
|--|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--|---------|--------|--------|------|
| UnumProvident Finance Ser144A 6.85%/2015 | アメリカ・ドル | 35,000 | 37,214 | 0.02 |
|--|---------|--------|--------|------|

イギリス 計

| | | | | |
|--|--|--|----------------|-------------|
| | | | 659,126 | 0.30 |
|--|--|--|----------------|-------------|

アメリカ

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| COX Communications Ser144A 8.375%/2039 | アメリカ・ドル | 200,000 | 272,753 | 0.13 |
|--|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--|---------|--------|--------|------|
| Gulfstream Natural Gas System Ser144A 6.95%/2016 | アメリカ・ドル | 70,000 | 78,006 | 0.04 |
|--|---------|--------|--------|------|

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Southern Natural Gas Ser144A 5.9%/2017 | アメリカ・ドル | 110,000 | 117,091 | 0.05 |
|--|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|--|---------|---------|---------|------|
| Texas Gas Transmission Ser144A 5.5%/2013 | アメリカ・ドル | 480,000 | 517,544 | 0.24 |
|--|---------|---------|---------|------|

| | | | | |
|------------------------------------|---------|---------|---------|------|
| West Penn Power Ser144A 5.95%/2017 | アメリカ・ドル | 240,000 | 258,992 | 0.12 |
|------------------------------------|---------|---------|---------|------|

アメリカ 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 1,244,386 | 0.58 |
|--|--|--|------------------|-------------|

その他の取引可能な有価証券 計

| | | | | |
|--|--|--|------------------|-------------|
| | | | 3,080,479 | 1.42 |
|--|--|--|------------------|-------------|

有価証券 合計

| | | | | |
|--|--|--|--------------------|--------------|
| | | | 206,224,984 | 95.21 |
|--|--|--|--------------------|--------------|

その他資産(負債控除後)

| | | | | |
|--|--|--|-------------------|-------------|
| | | | 10,364,275 | 4.79 |
|--|--|--|-------------------|-------------|

純資産

| | | | | |
|--|--|--|--------------------|---------------|
| | | | 216,589,259 | 100.00 |
|--|--|--|--------------------|---------------|

T. ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

* 対純資産比率は、USアグリゲート・ボンド・ファンドの純資産に対する比率

* 添付の注記は、当財務諸類と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記

2010年6月30日現在(未監査)

1. T.ロウ・プライス・ファンズ SICAVについて

T.ロウ・プライス・ファンズ SICAV(以下「当社」)は、自己運用の可変資本型投資会社(Société d'Investissement à Capital Variable、略称:SICAV)としてルクセンブルグ大公国の法律に基づき組織されたオープン・エンド型の投資法人であり、投資信託に関連する2002年12月20日法パートIに準拠した投資信託として登記されている。当社は2001年6月5日に設立され、譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託(「UCITS」)としての資格を有している。

当社は、機関投資家および個人投資家の双方に対して、特定の予想投資リスクおよび分散投資要件を満たすように設計された様々な投資目標を持った投資ポートフォリオ(「ファンド」)の選択を提供できる構成となっている。2010年6月30日に終了した6ヶ月間に、発行済投資証券を有するファンドは以下のとおりである。

| ファンド名 | クラス | 設定日 | 基準通貨 |
|-------------------------------|----------------|-------------|------------|
| エマージング・ローカル・マーケット・ボンド | I | 2007年8月8日 | 米ドル |
| ユーロ・コーポレート・ボンド | A | 2004年11月9日 | ユーロ |
| | I | 2002年2月5日 | ユーロ |
| | Sd | 2008年10月28日 | ユーロ |
| | Z | 2001年6月20日 | ユーロ |
| グローバル・アグリゲート・ボンド | A | 2003年3月28日 | 米ドル |
| | I | 2004年12月28日 | 米ドル |
| | Id | 2008年10月7日 | 米ドル |
| | Z | 2001年7月9日 | 米ドル |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | A | 2006年6月27日 | 米ドル |
| | I | 2004年12月31日 | 米ドル |
| | Id | 2008年10月7日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| グローバル・フィックスド・インカム・アプソルート・リターン | I | 2009年6月25日 | 米ドル |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | A | 2001年8月17日 | 米ドル |
| | Ad | 2009年6月2日 | 米ドル |
| | Ah(ユーロ) | 2003年4月2日 | ユーロ |
| | Ah(ノルウェー・クローネ) | 2004年7月15日 | ノルウェー・クローネ |
| | I | 2002年3月4日 | 米ドル |
| | Jd | 2003年12月5日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| | Z | 2001年6月28日 | 米ドル |
| USアグリゲート・ボンド | Jd | 2003年12月5日 | 米ドル |
| アジア・Ex-ジャパン・エクイティ | A | 2008年1月28日 | 米ドル |
| | I | 2006年12月13日 | 米ドル |
| | S | 2008年6月27日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ | A | 2008年11月11日 | ユーロ |
| | I | 2008年11月11日 | ユーロ |
| ヨーロッパ・エクイティ | A | 2007年5月3日 | ユーロ |
| | I | 2007年2月26日 | ユーロ |
| ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ | Ad* | 2007年7月11日 | ユーロ |

| | | | |
|---------------------------|----------|-------------|------|
| | I | 2007年2月26日 | ユーロ |
| ヨーロッパ・スモーカー・カンパニー・エクイティ | A | 2008年11月26日 | ユーロ |
| | I | 2008年11月26日 | ユーロ |
| ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ | I | 2005年1月7日 | ユーロ |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | A | 2004年10月26日 | 米ドル |
| | I | 2003年12月2日 | 米ドル |
| | Jd | 2007年10月31日 | 米ドル |
| | Z | 2002年2月20日 | 米ドル |
| グローバル・エクイティ | A | 2003年3月28日 | 米ドル |
| | I | 2006年1月13日 | 米ドル |
| | J | 2008年4月1日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| | Z | 2010年4月28日 | 米ドル |
| グローバル・ラージキャップ・エクイティ | A | 2008年10月27日 | 米ドル |
| | I | 2008年10月27日 | 米ドル |
| | I (英ポンド) | 2009年7月10日 | 英ポンド |
| グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ | A | 2007年11月5日 | 米ドル |
| | I | 2006年11月15日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ | A | 2008年10月27日 | 米ドル |
| | I | 2008年10月27日 | 米ドル |
| ジャパニーズ・エクイティ | A | 2006年4月12日 | ユーロ |
| | I | 2005年12月16日 | ユーロ |
| ラテン・アメリカン・エクイティ | A | 2009年6月19日 | 米ドル |
| | I | 2008年4月24日 | 米ドル |
| ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ | A | 2007年12月24日 | 米ドル |
| | I | 2007年9月4日 | 米ドル |
| USブルー・チップ・エクイティ | A | 2003年2月5日 | 米ドル |
| | J | 2007年2月20日 | 米ドル |
| USラージキャップ・コア・エクイティ | A | 2009年6月26日 | 米ドル |
| | I | 2009年6月26日 | 米ドル |
| USラージキャップ・グロース・エクイティ | A | 2003年11月13日 | 米ドル |
| | I | 2003年7月31日 | 米ドル |
| | J | 2007年2月20日 | 米ドル |
| USラージキャップ・バリュー・エクイティ | A | 2003年1月2日 | 米ドル |
| | I | 2002年3月27日 | 米ドル |
| | J | 2007年2月20日 | 米ドル |
| | Sd | 2008年10月28日 | 米ドル |
| USスモーカー・カンパニー・エクイティ | A | 2001年7月31日 | 米ドル |
| | I | 2001年9月28日 | 米ドル |

* 証券は、2010年1月18日に全額償還された。

2010年6月30日現在、クラスA証券、クラスI証券、クラスJ証券、クラスS証券およびクラスZ証券という最大5つのクラスの投資証券が投資家に販売されている。いずれのクラスの投資証券も、収益を配当

する「配当型」と収益を累積する「累積型」があり、また当該ファンドの建通貨以外の通貨にヘッジされることがある（以下、「ヘッジ付投資証券」）。上記の表で、クラスAd証券およびクラスAh証券は、それぞれクラスA証券の配当型投資証券およびヘッジ付投資証券を指す。

クラスAd証券およびクラスAh証券は現在、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの投資家にのみ販売されており、クラスI(英ポンド)証券は現在、グローバル・ラージ・キャップ・エクイティ・ファンドの投資家にのみ販売されている。クラスI、J、SおよびZ証券は、機関投資家向けの投資証券である。クラスId、JdおよびクラスSd証券は、それぞれクラスI証券、クラスJ証券およびクラスS証券の配当型投資証券であり、グローバル・アグリゲート・ファンドおよびグローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンドでのみ入手可能なクラスId証券を除き、すべてのファンドの投資家に販売されている。

同一ファンドに属するすべてのクラスでは、当該ファンドの特定の投資目標に沿って共通の投資が行われるが、手数料体系、最低申込額、配当方針、通貨ヘッジ、または当社の目論見書に記載された他の個々の項目に関しては相互に異なっている場合がある。

また、ルクセンブルグの監督当局である金融監督委員会（以下、「CSSF」）は、当社が、グローバル・インフラストラクチャー・エクイティ・ファンド、USダラー・インベストメント・グレード・コーポレート・ボンド・ファンドという2つの新しいファンドを追加することを承認している。これらのファンドの運用開始日は未定である。

2. 重要な会計方針

a) 一般的事項

当財務諸表は、ルクセンブルグ大公国において一般に認められている会計基準に従って作成されている。

b) 有価証券の評価

純資産額の算定における投資信託財産の組入資産の評価において、上場されている有価証券は、上場している取引所における計算日の最終相場で評価されている。

未上場の有価証券、上場されているが計算日において取引所の最終相場がない有価証券、および最終相場で評価することが適当でない有価証券は、取締役会によりまた取締役会の監督のもとで合理的と認める売買価格に基づき評価される。

購入時点で、1年以内に償還を迎える短期債については、償却原価で評価され、未収利息が計上される。しかし、償却原価が公正価値を反映していないと見なされる場合は、その有価証券は取締役会の監督の下で合理的と認める公正価格に基づき評価される。

財務報告のため、有価証券は2010年6月30日における各主要市場の終了時点の価格を用いて評価される。市場終了のタイミングにより、財務諸表上で算定表示されている各ファンドの純資産額および各投資証券の一口当たり純資産額は、当社の目論見書に記載されているとおり、2010年6月30日時点において直接投資等の投資証券保有者による取引状況を算出するために計算された金額とは異なることがある。

c) 外貨換算

各ファンドの帳簿および記録は、そのファンドの基準通貨建となっている。基準通貨以外の通貨建の金額は、次の基準で基準通貨に換算される。

- () 当初、他通貨で表示された投資評価額ならびにその他の資産および負債は、各営業日に当該各営業日の実勢為替レートを用いて基準通貨に換算される。
- () 外国投資有価証券の購入および売却、収益ならびに費用支出は、当該各取引日の実勢為替レートを用いて基準通貨に換算される。

為替取引に係わる実現純損益は、() 外貨の保有および売却に伴う為替差損益、() 証券取引に係わる約定日と決済日間に発生した損益、および() 受取配当金および受取利息に関して計上時点と実際の受取時点における差額から生じる損益を表す。各ファンドでは、当期間中に保有していた有価証券の市場価格の変動により生じる差額から、当該証券に係わる外国為替レートの変動による差額を分離して表示することは行わない。

当社の結合報告書の表示通貨は米ドルである。米ドル以外の基準通貨建のファンドおよび投資証券クラスに関しては、財務諸表上の項目は次の基準に基づき、米ドルに換算されている。（ ）資産および負債は、財務諸表日付における実勢為替レートで換算される。（ ）損益および純資産変動計算書の残高は、当期間中の平均為替レートで換算される。かかる換算において用いられた、1ドル等価額として表示された為替レートは次のとおりである。

| 通貨 | 2010年6月30日現在 | 2010年6月30日に終了した6ヶ月間の平均 |
|------------|--------------|------------------------|
| ユーロ | 0.8164 | 0.7524 |
| ノルウェー・クローネ | 6.5032 | 6.0449 |

d) 有価証券取引および投資収益について

有価証券に係わる取引は約定日基準で計上される。財務報告の目的上、有価証券に係わる取引は2010年6月30日における各ファンドの主要市場の終了時点を経済的期間として、約定日基準で計上されている。実現損益は、売却有価証券の平均原価に基づいて決定される。

受取配当金は、配当落ち日に計上される。受取利息および支払利息は、発生基準で計上される。債券のプレミアムまたはディスカウント部分については、定額法で損益として認識される。

現金預金は、一定の信用基準を充足する各種金融機関における翌日物から3カ月物の定期預金の現金残高、および当社の保管銀行が管理するキャッシュ・スイープ・プログラムに係わる現金残高を含んでいる。各ファンドの取引先金融機関が預金の払い戻しを履行できない場合には、かかる預金価額の回収の遅滞、および元利金の減価の可能性がある。手数料控除後の収益は受取利息として日次ベースで計上され、当座借越費用は、付属する損益および純資産変動計算書の「その他費用」の項目に含まれている。

e) クラス別会計および設定費の処理

各クラスに個別に発生する費用は、関連するクラスに直接割り当てられる。すべてのクラスに共通の費用、投資収益ならびに実現損益および未実現損益は、計上日における各クラスの純資産額の比率に基づき各クラスに按分される。

新ファンドの設定費用および新株発行費用は、5年を超えない期間にわたり、当該ファンド資産に対して、公平な基準に基づき取締役会が決定した金額で各年度において繰り延べ、償却される場合がある。

3. 有価証券に係わる取引

a) デリバティブ

各ファンドは、為替取引、金融先物、オプションおよびスワップに係わる契約を締結することがある。かかる契約は、オプションの買いの場合を除き、貸借対照表に表示された金額を超える市場リスクを持つ。表示された契約額は、契約の対象となる資産に投資している該当ファンドの契約額である。為替予約取引および先物契約は、それぞれ実勢先物為替レートおよび最新の決済価格を用いて毎日評価される。オプション契約およびスワップ契約は、独立したプライシング・サービスを利用して毎日評価される。公正価値の変動は、契約の終了または期日まで、未実現損益として毎日計上される。スワップ契約に伴う定期的な差額の支払いまたは受領は、毎日未実現損益として計上され、支払いまたは受領時に実現損益として計上される。

かかる契約に関連する市場リスクは、為替レート、金利、信用の質、インデックス、およびかかる商品の原資産となる証券価額の変動の可能性により生じる。その他の市場リスクおよび信用リスクには、当該契約に対して流動性のある市場が存在しない可能性、契約の価額の変動とヘッジされている通貨、インデックス、証券の価格変動が直接的に連動しない可能性、または当該契約の相手方が契約条件に基づく義務を履行できない可能性が含まれている。各ファンドのすべてのクラスに係わる未決済契約が存在する場合には、各ファンドの有価証券明細書に反映されている。

ファンドは先物取引の証拠金としてまた将来の各種の証拠金取引に備えてブローカーの口座に現金を預けることがある。ブローカーに預けられた預金は、貸借対照表の委託証拠金に含まれる。

グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド - クラスAhヘッジ付投資証券

クラスAh証券では、基準通貨建以外の特定のヘッジ付投資証券クラスに帰属する純資産の通貨エクスポージャーを減少させることを目指している。このため、クラスAh証券（ユーロ）に帰属するユーロ建てでない純資産額の最大100%、およびクラスAh証券（ノルウェー・クローネ）に帰属するノルウェー・クローネ建てでない純資産額の最大100%が、実現可能で合理的な範囲で、為替予約取引を利用してそれぞれ

ユーロおよびノルウェー・クローネにヘッジされている。それに関連する実現および未実現の為替差損益は、当該のヘッジ付投資証券クラスにのみ割り当てられ、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの他のクラスには割り当てられない。2010年6月30日現在で、貸借対照表に反映された、未決済為替予約取引の未実現利益(損失)は、ヘッジ付投資証券に係わる以下の契約によるものである。

| 決済日 | 買 建 | 売 建 | 未実現損益 (米ドル) |
|-----------------------|-------------|-----------------------|------------------|
| クラスAh証券(ユーロ) : | | | |
| 2010年7月9日 | 107,500,000 | ユーロ 144,133,850 | 米ドル (12,457,103) |
| 2010年8月9日 | 24,300,000 | ユーロ 32,094,833 | 米ドル (2,324,916) |
| 2010年9月9日 | 60,300,000 | ユーロ 74,276,033 | 米ドル (390,619) |
| 2010年7月9日 | 22,448,610 | 米ドル 18,300,000 | ユーロ 32,940 |
| | | | (15,139,698) |
| クラスAh証券(ノルウェー・クローネ) : | | | |
| 2010年7月9日 | 62,700,000 | ノルウェー・クローネ 10,479,386 | 米ドル (837,904) |
| 2010年8月9日 | 71,100,000 | ノルウェー・クローネ 11,884,465 | 米ドル (970,216) |
| 2010年9月9日 | 37,000,000 | ノルウェー・クローネ 5,673,146 | 米ドル (1,397) |
| | | | (1,809,517) |
| | | | (16,949,215) |

b) 中国A株

2010年6月30日に終了した6ヵ月間において、アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンドとグローバル・エマージング・マーケッツ・エクイティ・ファンドは、中国の現地投資家及び適格国外機関投資家(QFII)のみが利用できる株式(A株)に投資した。当該ファンドは、T・ロウ・プライスが投資会社として関与しているT・ロウ・プライス・インターナショナル・インク(T R P I)を通じてA株市場に投資することができる。A株に対する投資判断は、各関係ファンドに固有のものであり、また各ファンドはA株に対する所有や取引の結果として生じる経済的效果や税金を負担する。

A株に関してファンドは、一定の制限や、現金残高、継続投資、収益に関する事務手続きが課されている。また、ファンドは、資産へのアクセスを得ることが遅れる可能性や中国の規則や要請によるコンプライアンス外の要因によって価値を失うかもしれない。

ファンドがA株への投資として実現したキャピタルゲインは課税対象となるかどうか、今の中国の税制では不明確である。マネジメントとしては、中国のキャピタルゲイン課税はおそらく行われると信じているので、計算された税金を附属の財務諸表に反映させている。

c) TBA 購入確約

特定のファンドでは、To Be Announced(以下「TBA」)取引を行った。これは、ある固定単価で、モーゲージ担保証券を購入することに合意するもので、その支払いや引渡しは、かかる有価証券の通常の決済期間を超えた将来の日に予定されている。TBA取引では、取引日時点において具体的な引渡し証券が特定されていない。しかし、引き渡される有価証券は、発行体、利率やローン期間などの点で指定条件を充足している必要があり、かつ、業界内の「適法受け渡し」の基準に合致するものでなければならない。ファンドがTBA取引を実行する場合は一般的に、原モーゲージ証券を所有する目的をもって行われる。ファンドは決済日までTBAの決済に充てる十分な現金準備金と流動資産を確保している。

d) ポートフォリオ回転率

CSSFが定める方法に従って算出された、2010年6月30日までの6ヵ月間におけるポートフォリオの回転率は以下のとおりである。

| ファンド名 | ポートフォリオ回転率 |
|-----------------------|------------|
| エマージング・ローカル・マーケッツ・ボンド | 43.05 |
| ユーロ・コーポレート・ボンド | 41.01 |

| | |
|-------------------------------|---------|
| グローバル・アグリゲート・ボンド | 119.14 |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | 31.47 |
| グローバル・フィックスド・インカム・アブソルート・リターン | 118.85 |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | 21.38 |
| USアグリゲート・ボンド | 66.34 |
| アジアンEx-ジャパン・エクイティ | 21.14 |
| エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ | 27.69 |
| ヨーロッパ・エクイティ | 62.27 |
| ヨーロッパEx-UK・エクイティ | 49.92 |
| ヨーロッパ・スモーカー・カンパニーズ・エクイティ | 60.70 |
| ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ | 28.30 |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | 4.00 |
| グローバル・エクイティ | 73.67 |
| グローバル・ラージキャップ・エクイティ | 119.01 |
| グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ | 25.41 |
| グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ | 20.32 |
| ジャパニーズ・エクイティ | 60.99 |
| ラテン・アメリカン・エクイティ | 10.82 |
| ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ | 62.60 |
| USブルー・チップ・エクイティ | 31.51 |
| USラージキャップ・コア・エクイティ | 74.77 |
| USラージキャップ・グロース・エクイティ | 56.59 |
| USラージキャップ・バリュー・エクイティ | (16.64) |
| USスモーカー・カンパニーズ・エクイティ | 10.39 |

4. 配当金

当社は、配当型投資証券に係わる投資純利益については、実質的にその全額に相当する配当金を公表し支払う意向である。かかる投資証券に関する配当金は、通常、年一回支払われ、当該ファンドの基準通貨で公表される。これらの配当金は権利落ち日に計上される。該当する任意のファンドの配当型投資証券に係わる中間配当に関しては、取締役会の決議による頻度および間隔で、帰属する投資純利益および実現キャピタル・ゲインから支払われる場合がある。

2010年6月30日に終了した6ヵ月間に支払われた配当金は下表のとおりである。

| ファンド名 | クラス | 通貨 | 一口当たり 配当金 | 権利落ち日 |
|------------------------|-----|-----|--------------|------------|
| ユーロ・コーポレート・ボンド | Sd | ユーロ | 0.060008 | 2010年1月22日 |
| | Sd | ユーロ | 0.057901 | 2010年2月24日 |
| | Sd | ユーロ | 0.051186 | 2010年3月24日 |
| | Sd | ユーロ | 0.052096 | 2010年4月23日 |
| | Sd | ユーロ | 0.047133 | 2010年5月21日 |
| | Sd | ユーロ | 0.051071 | 2010年6月24日 |
| グローバル・アグリゲート・ボンド | ld | 米ドル | 0.043076 | 2010年1月22日 |
| | ld | 米ドル | 0.033978 | 2010年2月24日 |
| | ld | 米ドル | 0.031030 | 2010年3月24日 |
| | ld | 米ドル | 0.027059 | 2010年4月23日 |
| | ld | 米ドル | 0.026452 | 2010年5月21日 |
| | ld | 米ドル | 0.028986 | 2010年6月24日 |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | ld | 米ドル | 0.094332 | 2010年1月22日 |

| | | | | |
|--------------------------|----|-----|----------|------------|
| | Id | 米ドル | 0.065543 | 2010年2月24日 |
| | Id | 米ドル | 0.064647 | 2010年3月24日 |
| | Id | 米ドル | 0.067906 | 2010年4月23日 |
| | Id | 米ドル | 0.062269 | 2010年5月21日 |
| | Id | 米ドル | 0.063318 | 2010年6月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.130028 | 2010年1月22日 |
| | Sd | 米ドル | 0.092560 | 2010年2月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.090324 | 2010年3月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.095216 | 2010年4月23日 |
| | Sd | 米ドル | 0.087390 | 2010年5月21日 |
| | Sd | 米ドル | 0.089835 | 2010年6月24日 |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | Jd | 米ドル | 0.075743 | 2010年1月22日 |
| | Jd | 米ドル | 0.070862 | 2010年2月24日 |
| | Jd | 米ドル | 0.064363 | 2010年3月24日 |
| | Jd | 米ドル | 0.063228 | 2010年4月23日 |
| | Jd | 米ドル | 0.063176 | 2010年5月21日 |
| | Jd | 米ドル | 0.073832 | 2010年6月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.101138 | 2010年1月22日 |
| | Sd | 米ドル | 0.098893 | 2010年2月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.085577 | 2010年3月24日 |
| | Sd | 米ドル | 0.083782 | 2010年4月23日 |
| | Sd | 米ドル | 0.083860 | 2010年5月21日 |
| | Sd | 米ドル | 0.098071 | 2010年6月24日 |
| USアグリゲート・ボンド | Jd | 米ドル | 0.042210 | 2010年1月22日 |
| | Jd | 米ドル | 0.039674 | 2010年2月24日 |
| | Jd | 米ドル | 0.036912 | 2010年3月24日 |
| | Jd | 米ドル | 0.036008 | 2010年4月23日 |
| | Jd | 米ドル | 0.036514 | 2010年5月21日 |
| | Jd | 米ドル | 0.042328 | 2009年6月24日 |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | Jd | 米ドル | 0.021248 | 2010年2月24日 |
| | Jd | 米ドル | 0.035145 | 2010年5月21日 |

5. 課税

現行の法規および慣行では、当社にはルクセンブルグの法人税が課されていない。また、当社より支払われる配当金は、ルクセンブルグ国内での源泉税の対象となっていない。さらに、当社資産に係わる実現または未実現の評価利益に対しても、ルクセンブルグの税金は課されていない。

a) 年次税

2010年6月30日に終了した6ヵ月間において、当社には関係するルクセンブルグ法に基づき年次税（「Taxe d' Abonnement」）が課せられている。クラスA投資証券については年率0.05%、クラスI、J、SおよびZ投資証券については年率0.01%の年次税がそれぞれ課せられた。なお、年次税は、各四半期末における各クラスの純資産額に基づき四半期毎に支払われる。

b) 外国税引当金

各ファンドは、投資先となる一部の国により課される外国法人税の対象となっている。外国法人税は収益の減少として計上される。一部の海外諸国において発行された、または海外諸国によって発行された有価証券の処分によってファンドが実現したキャピタル・ゲインは、当該国のキャピタル・ゲイン税の課税対象となっている。税額はすべて、適用される外国税法に従って計算され、キャピタル・ロス、許容される最大範囲まで、キャピタル・ゲインを相殺するために使用される。保有期間に応じて税

率が変わる場合、その範囲内において、各ファンドについて、適用最低税率を用いた繰延税金負債を計上している。

純キャピタル・ゲインに帰属する当期の税金費用および繰延税金費用は、それぞれ投資実現損益、投資未実現損益の一部としての適格払戻金を控除した額をもとにして計上されている。2010年6月30日に終了した6ヶ月間においては、アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドおよびグローバル・エクイティ・ファンドの投資実現損益について、損益および純資産変動計算書に表示されるとおり、キャピタル・ゲインに起因する税額は無い。

2010年6月30日現在、インドの有価証券に係る未実現利益へのキャピタル・ゲイン税に関する繰延税金負債を有するファンドはない。また、キャピタル・ゲイン税の課税対象証券に基づく将来の実現利益を相殺するためにキャピタル・ロスを繰り越しているファンドは次の通りである。

| | |
|--------------------------|---------------------------------|
| アジア・Ex-ジャパン・エクイティ | 7,958,856米ドル（繰越期限：2016年と2017年） |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | 7,035,177米ドル（繰越期限：2016年と2017年） |
| グローバル・エクイティ | 27,066,612米ドル（繰越期限：2016年と2017年） |

2010年6月30日現在、下記のファンドには、中国A株投資による未実現利益に対するキャピタル・ゲイン税に関する繰延税金負債が生じており、貸借対照表上、外国税未払金として計上され、損益及び純資産変動計算書に支払外国税に係る未実現評価損益の純変動が計上されている。

| | |
|--------------------------|-----------|
| アジア・Ex-ジャパン・エクイティ | 47,846米ドル |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | 70,327米ドル |

6. 関連当事者との取引

a) 投資運用報酬

ファンドは、T.ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシズ・リミテッド（以下、「投資運用会社」）により運用されている。当社と投資運用会社との投資運用一任契約（「当契約」）においては、年間運用報酬額が定められている。投資運用報酬は日次ベースで算定され、月次ベースで支払われる。その額は、下表の年間利率に従って各ファンドの日次純資産額に基づいて計算される。

| ファンド名 | クラスA 証券* | クラスI 証券** | クラスJ 証券*** | クラスS 証券**** | クラ スZ 証券 |
|-------------------------------|-------------|--------------|---------------|----------------|----------------|
| エマージング・ローカル・マーケット・ボンド | 1.30% | 0.65% | - | - | - |
| ユーロ・コーポレート・ボンド | 0.90% | 0.50% | - | - | - |
| グローバル・アグリゲート・ボンド | 0.90% | 0.55% | - | - | - |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | 1.30% | 0.65% | - | - | - |
| グローバル・フィックスド・インカム・アプソルート・リターン | 0.90% | 0.55% | - | - | - |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | 1.15% | 0.60% | - | - | - |
| USアグリゲート・ボンド | 0.90% | 0.50% | - | - | - |
| アジア・Ex-ジャパン・エクイティ | 1.90% | 1.00% | - | - | - |
| エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ | 1.90% | 1.00% | - | - | - |
| ヨーロッパ・エクイティ | 1.50% | 0.70% | - | - | - |
| ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ | 1.50% | 0.70% | - | - | - |
| ヨーロッパ・スモーカー・カンパニーズ・ エクイティ | 1.80% | 0.95% | - | - | - |
| ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ | 1.20% | 0.60% | - | - | - |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | 1.90% | 1.00% | - | - | - |
| グローバル・エクイティ | 1.60% | 0.75% | - | - | - |
| グローバル・ラージキャップ・エクイティ | 1.60% | 0.75% | - | - | - |
| グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ | 1.60% | 0.75% | - | - | - |
| グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ | 1.60% | 0.75% | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------|-------|-------|---|---|---|
| ジャパニーズ・エクイティ | 1.60% | 0.75% | - | - | - |
| ラテン・アメリカン・エクイティ | 1.90% | 1.00% | - | - | - |
| ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ | 2.00% | 1.10% | - | - | - |
| USブルー・チップ・エクイティ | 1.50% | 0.65% | - | - | - |
| USラージキャップ・コア・エクイティ | 1.50% | 0.65% | - | - | - |
| USラージキャップ・グロース・エクイティ | 1.50% | 0.65% | - | - | - |
| USラージキャップ・バリュース・エクイティ | 1.50% | 0.65% | - | - | - |
| USスモラー・カンパニーズ・エクイティ | 1.60% | 0.95% | - | - | - |

* AdおよびAh投資証券を含む。

** Id及びId(英ポンド)投資証券を含む。

*** Jd投資証券を含む。

**** Sd投資証券を含む。

投資運用会社は、ファンドに係わる販売手数料にあたる報酬(トレイラー・フィー)を支払うために投資運用報酬の一部を利用することがある。さらに、投資運用会社は、商業上の観点から第三者のためにファンドの投資証券を保有する機関投資家に払戻しを行うことがある。

b) 投資運用報酬等の権利放棄

クラスAおよびクラスI投資証券

個々のファンドに関し、投資運用会社は、適切と判断した期間について、投資運用報酬および費用が投資証券クラスの運用実績に与える影響を低減するために、受領権限を持つ投資運用報酬等のすべてまたは一部の権利を放棄すること、または、その他の費用を当該クラスに払い戻すこと、あるいはその両方を選択することがある。

クラスJ投資証券

クラスJ投資証券に係わる管理・事務代行会社および投資運用会社のサービスに対する報酬に関しては、投資運用会社がそれを負担する。クラスJ投資証券に係わるその他の費用はすべて当該クラスが負担する。クラスJ投資証券は、投資運用会社と専門的サービスに関する契約を締結している機関投資家のみが入手可能である。

クラスS投資証券

クラスS投資証券に係わる投資運用会社のサービスに対する報酬に関しては、投資運用会社がそれを負担する。クラスS投資証券は、投資運用会社と専門的サービスに関する契約を締結している機関投資家のみが入手可能である。投資運用会社は、適切と判断した期間について、投資運用報酬および費用が投資証券クラスの運用実績に与える影響を低減するために、その他の費用を当該クラスに払い戻すことを選択することがある。

クラスZ投資証券

投資運用会社は、クラスZ投資証券に係わるすべての報酬および費用を負担する。クラスZ投資証券は、投資運用会社と専門的サービスに関する契約を締結している機関投資家のみが入手可能である。

投資運用報酬等の権利放棄は契約で定められた条項ではなく、今後も継続することが保証されたものではないが、2010年6月30日に終了した6ヶ月間において、以下の上限経費率が一定のクラスに適用された。

| ファンド名 | クラス | 総経費率* | 上限経費率 |
|-----------------------|-----|-------|-------|
| エマージング・ローカル・マーケット・ボンド | I | 0.98 | 1.01 |
| ユーロ・コーポレート・ボンド | A | 1.23 | 1.25 |
| | I | 0.76 | 0.78 |
| | Sd | 0.26 | 0.28 |
| | Z | - | - |
| グローバル・アグリゲート・ボンド | A | 1.14 | 1.25 |

| | | | |
|-------------------------------|-----------------|------|--------|
| | I | 0.74 | 0.83 |
| | Id | 0.81 | 0.83 |
| | Z | - | - |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | A | 1.73 | 1.75 |
| | I | 0.97 | 1.01 |
| | Id | 0.97 | 1.01 |
| | Sd | 0.32 | 0.36 |
| グローバル・フィックスド・インカム・アブソルート・リターン | I | 0.88 | 0.91 |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | A | 1.30 | 1.60 |
| | Ah (ユーロ) | 1.28 | 1.60 |
| | Ah (ノルウェー・クローネ) | 1.34 | 1.60 |
| | Ad | 1.29 | 1.60 |
| | I | 0.69 | 0.96 |
| | Jd | 0.07 | - |
| | Sd | 0.27 | 0.36 |
| | Z | - | - |
| USアグリゲート・ボンド | Jd | 0.07 | - |
| アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ | A | 2.07 | 2.30 |
| | I | 1.08 | 1.20** |
| | S | 0.11 | 0.32 |
| | Sd | 0.23 | 0.32 |
| エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ | A | 2.35 | 2.40 |
| | I | 1.36 | 1.40 |
| ヨーロッパ・エクイティ | A | 1.83 | 1.85 |
| | I | 0.94 | 0.98 |
| ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ | Ad? | 1.85 | 1.85 |
| | I | 0.95 | 0.98 |
| ヨーロッパ・スモーカー・カンパニー・エクイティ | A | 2.13 | 2.15 |
| | I | 1.21 | 1.23 |
| ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ | I | 0.83 | 0.88 |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | A | 2.04 | 2.40 |
| | I | 1.10 | 1.40 |
| | Jd | 0.07 | - |
| | Z | - | - |
| グローバル・エクイティ | A | 1.76 | 2.00 |
| | I | 0.84 | 1.07 |
| | J | 0.06 | - |
| | Sd | 0.22 | 0.32 |
| グローバル・ラージキャップ・エクイティ | A | 1.99 | 2.00 |
| | I | 1.07 | 1.07 |
| | I(英ポンド) | 1.06 | 1.07 |
| グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ | A | 1.89 | 2.00 |
| | I | 0.85 | 1.07 |
| | Sd | 0.18 | 0.32 |
| グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ | A | 2.00 | 2.00 |
| | I | 1.07 | 1.07 |
| ジャパニーズ・エクイティ | A | 1.85 | 1.95 |

| | | | |
|----------------------|----|------|--------|
| | I | 0.91 | 1.03 |
| ラテン・アメリカン・エクイティ | A | 2.40 | 2.40 |
| | I | 1.19 | 1.20** |
| ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ | A | 2.28 | 2.50 |
| | I | 1.26 | 1.30** |
| USブルー・チップ・エクイティ | A | 1.68 | 1.85 |
| | J | 0.07 | - |
| USラージキャップ・コア・エクイティ | A | 1.85 | 1.85 |
| | I | 0.93 | 0.93 |
| USラージキャップ・グロース・エクイティ | A | 1.66 | 1.85 |
| | I | 0.75 | 0.93 |
| | J | 0.08 | - |
| USラージキャップ・バリュー・エクイティ | A | 1.69 | 1.85 |
| | I | 0.75 | 0.93 |
| | J | 0.07 | - |
| | Sd | 0.21 | 0.28 |
| USスモラー・カンパニーズ・エクイティ | A | 1.81 | 1.95 |
| | I | 1.14 | 1.23 |

* 総経費率は、2010年6月30日に終了した6ヵ月間に、各クラスが負担した支払報酬および費用から権利放棄された費用を控除した額の、当該クラスの平均純資産に対する比率を表す。

** 2010年3月15日から新たな費用は制限されている。

?証券は、当該期間中に全額償還された。

c) その他の費用

2005年度中に、当社は、2002年12月20日法による規制要件を満たすために、ルクセンブルグに事務所を設立した。当該事務所の設立に関する費用は当社が負担し、5年間にわたり定額法で償却される。当該事務所の維持に関わる継続的な費用は、当社と投資運用会社の間で均等に按分され、その費用は、付属する損益および純資産変動計算書の「その他の費用」に含まれている。

d) 直接投資および関係会社勘定

投資運用会社またはその関係会社は、新ファンドの設立のための当初資金を提供する（「直接投資」）目的で、ファンドが十分な純資産を有するまで投資を続ける意図を持ってファンドに投資することがある。さらに、投資運用会社またはその関係会社が管理するその他のファンドまたは口座の資金が、当ファンドに投資されることがある（「関係会社勘定」）。しかし、いかなる関係会社も、当ファンドまたは当社に対する運営権または支配権を行使する目的で投資を行うことは認められない。2010年6月30日現在、投資運用会社またはその関係会社による各ファンドの保有比率（対純資産の比率）は下表のとおりである。

| ファンド名 | 直接投資 | 関係会社勘定 |
|-------------------------------|------|--------|
| エマージング・ローカル・マーケット・ボンド | 72% | - |
| ユーロ・コーポレート・ボンド | 63% | - |
| グローバル・アグリゲート・ボンド | 15% | - |
| グローバル・エマージング・マーケット・ボンド | - | - |
| グローバル・フィックスド・インカム・アブソルート・リターン | 100% | - |
| グローバル・ハイ・イールド・ボンド | - | 21% |
| USアグリゲート・ボンド | - | 100% |
| アジアンEx-ジャパン・エクイティ | - | - |
| エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ | 100% | - |
| ヨーロッパ・エクイティ | 98% | - |
| ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ | 86% | - |

| | | |
|---------------------------|------|-----|
| ヨーロッパ・スモーカー・カンパニーズ・エクイティ | 98% | - |
| ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ | 100% | - |
| グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ | - | 3% |
| グローバル・エクイティ | - | - |
| グローバル・ラージキャップ・エクイティ | 42% | - |
| グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ | - | - |
| グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ | 100% | - |
| ジャパニーズ・エクイティ | 10% | - |
| ラテン・アメリカン・エクイティ | 20% | - |
| ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ | 24% | - |
| USブルー・チップ・エクイティ | - | 10% |
| USラージキャップ・コア・エクイティ | 100% | - |
| USラージキャップ・グロース・エクイティ | - | 2% |
| USラージキャップ・バリュー・エクイティ | - | 5% |
| USスモーカー・カンパニーズ・エクイティ | - | - |

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成22年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 35,549,410,511 円 |
| 負債総額 | 252,838,531 円 |
| 純資産総額 (-) | 35,296,571,980 円 |
| 発行済数量 | 57,377,813,083 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.6152 円 |

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>

(平成22年10月末現在)

日本好配当株マザーファンド

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 44,176,662,260 円 |
| 負債総額 | 878,562,526 円 |
| 純資産総額 (-) | 43,298,099,734 円 |
| 発行済数量 | 64,296,636,037 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.6734 円 |

世界REITマザーファンド

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 5,292,039,655 円 |
| 負債総額 | 438,377 円 |
| 純資産総額 (-) | 5,291,601,278 円 |
| 発行済数量 | 10,523,767,009 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.5028 円 |

グローバル好配当株マザーファンド

| | |
|------------------|-------------------|
| 資産総額 | 406,279,322,851 円 |
| 負債総額 | 432,666,718 円 |
| 純資産総額 (-) | 405,846,656,133 円 |
| 発行済数量 | 430,790,942,748 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.9421 円 |

新興国債券マザーファンド

| | |
|------------------|------------------|
| 資産総額 | 26,561,585,556 円 |
| 負債総額 | 168,711,742 円 |
| 純資産総額 (-) | 26,392,873,814 円 |
| 発行済数量 | 23,590,331,713 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 1.1188 円 |

欧州債券マザーファンド

| | |
|------------------|-----------------|
| 資産総額 | 3,482,475,526 円 |
| 負債総額 | 18,219,471 円 |
| 純資産総額 (-) | 3,464,256,055 円 |
| 発行済数量 | 4,284,147,268 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.8086 円 |

コモディティ・マザーファンド

| | |
|------------------|-----------------|
| 資産総額 | 1,717,241,957 円 |
| 負債総額 | 0 円 |
| 純資産総額 (-) | 1,717,241,957 円 |
| 発行済数量 | 2,757,783,341 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.6227 円 |

アジア・オセアニア債券マザーファンド

| | |
|------------------|-----------------|
| 資産総額 | 3,812,336,385 円 |
| 負債総額 | 160,694,955 円 |
| 純資産総額 (-) | 3,651,641,430 円 |
| 発行済数量 | 4,176,113,199 口 |
| 1 単位当り純資産額 (/) | 0.8744 円 |

[前へ](#)

第5【設定及び解約の実績】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

| グローバル資産分散オープン | | |
|-------------------------------|-----------------|----------------|
| 期間 | 設定総額（円） | 解約総額（円） |
| 第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日） | 143,915,193,041 | 3,444,616,817 |
| 第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日） | 9,456,550,153 | 10,531,107,727 |
| 第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日） | 1,210,147,834 | 19,101,436,301 |
| 第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日） | 1,032,078,680 | 13,023,015,618 |
| 第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日） | 723,370,575 | 19,813,830,702 |
| 第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日） | 420,700,426 | 17,593,714,515 |
| 第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日） | 337,246,711 | 13,762,458,300 |

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額

資本金の額：20億円（平成22年10月末現在）

会社が発行する株式総数：12,800,000株

発行済株式総数：3,850,000株

最近5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社は、8名以内で構成される取締役により運営されます。取締役は、株主総会の決議によって選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上を有する株主が出席し、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上をもってこれを行います。

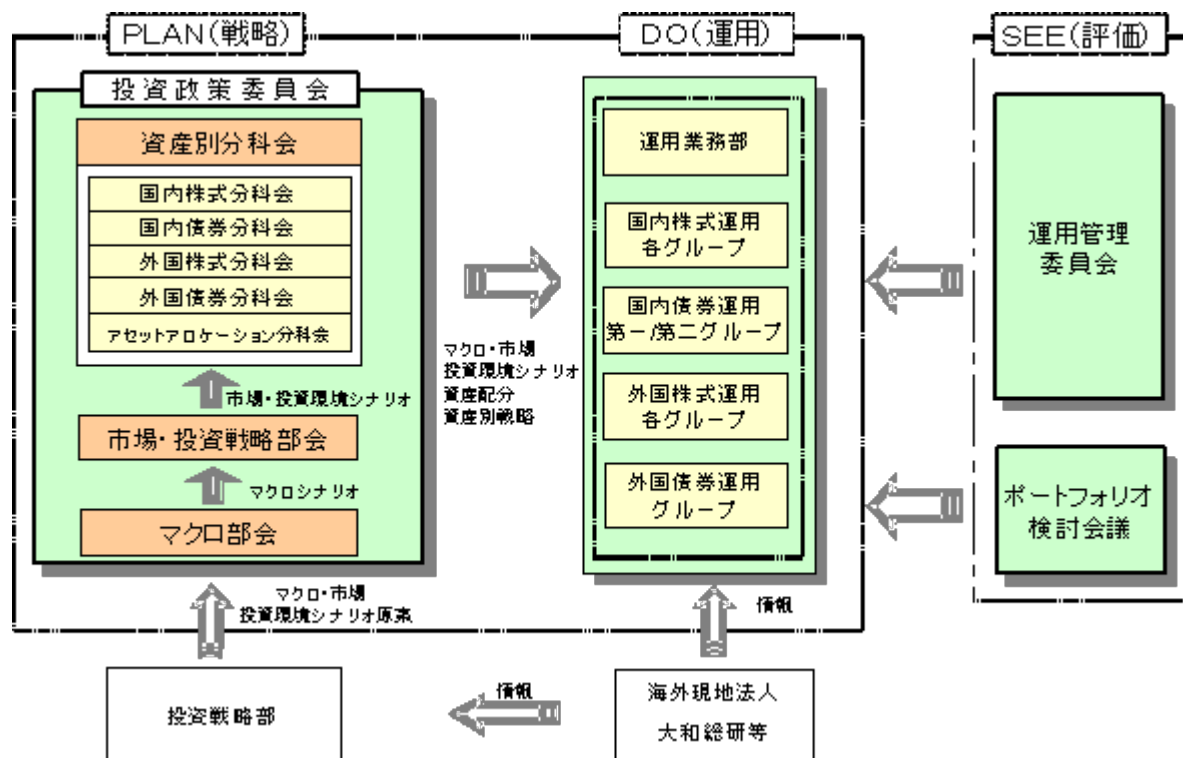
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、取締役会の決議によって取締役の中から取締役社長、取締役副社長各1名、専務取締役および常務取締役若干名を選定することができます。また代表取締役は2名とし、取締役社長および取締役副社長がこれに就任します。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、代表取締役が招集し、招集通知は3日前までにこれを発します。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の6名以上が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

< 投信運用の意思決定プロセス >



2 事業の内容及び営業の概況

委託会社は、株式会社住友銀行（現株式会社三井住友フィナンシャルグループ）および大和証券株式会社（現株式会社大和証券グループ本社）の戦略的提携により平成11年4月1日付で、大和投資顧問株式会社と住銀投資顧問株式会社およびエス・ビー・アイ・エム投信株式会社の三社が合併して設立された会社です。

「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る委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成22年10月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、141本であり、その純資産総額は、約2,497,100百万円です（なお、親投資信託47本は、ファンド数及び純資産総額からは除いております。）。

| 種類 | ファンド数 | 純資産総額 |
|------------|-------|--------------|
| 単位型株式投資信託 | 3 | 16,478百万円 |
| 追加型株式投資信託 | 137 | 2,477,520百万円 |
| 追加型公社債投資信託 | 1 | 3,102百万円 |
| 合計 | 141 | 2,497,100百万円 |

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

1．委託会社の財務諸表は、「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。）並びに同規則第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。）に基づいて作成しております。なお、第37期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、第38期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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37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38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の監査を、あずさ監査法人により受けております。

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

(単位 : 千円)

| | | 第37期 (平成21年3月31日) | 第38期 (平成22年3月31日) |
|-----------|---|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金・預金 | | 8,926,038 | 10,732,367 |
| 前払費用 | | 164,321 | 158,204 |
| 未収還付法人税等 | | 304,359 | - |
| 未収収益 | | 2,200,246 | 3,018,894 |
| 繰延税金資産 | | 302,927 | 401,279 |
| その他 | | 96,171 | 3 |
| 流動資産計 | | 11,994,065 | 14,310,748 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | | | |
| 建物 | 1 | 397,192 | 330,961 |
| 器具備品 | 1 | 98,818 | 66,930 |
| 土地 | | 710 | 710 |
| 建設仮勘定 | | 3,911 | - |
| 有形固定資産計 | | 500,632 | 398,601 |
| 無形固定資産 | | | |
| ソフトウェア | | 445,887 | 561,554 |
| 電話加入権 | | 12,706 | 12,706 |
| 無形固定資産計 | | 458,593 | 574,261 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | 3,812,850 | 4,474,278 |
| 関係会社株式 | | 1,169,774 | 1,169,774 |
| 従業員長期貸付金 | | 9,100 | 5,277 |
| 長期差入保証金 | | 742,547 | 743,958 |
| 出資金 | | 161,517 | 161,517 |
| 繰延税金資産 | | 557,369 | 536,417 |
| その他 | | 1,323 | 916 |
| 貸倒引当金 | | 70,350 | 73,350 |
| 投資その他の資産計 | | 6,384,132 | 7,018,789 |
| 固定資産計 | | 7,343,357 | 7,991,652 |

資産合計

19,337,423

22,302,401

(単位：千

円)

| | 第37期 (平成21年3月31日) | 第38期 (平成22年3月31日) |
|-----------|----------------------|----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 73,433 | 183,571 |
| 未払費用 | 1,102,827 | 1,657,874 |
| 未払法人税等 | - | 915,515 |
| 前受収益 | 8,983 | 2,895 |
| 賞与引当金 | 604,600 | 715,800 |
| 役員賞与引当金 | 48,800 | 58,000 |
| その他 | 18,721 | 18,976 |
| 流動負債計 | 1,857,365 | 3,552,633 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 751,197 | 835,692 |
| 役員退職慰労引当金 | 133,802 | 173,442 |
| 固定負債計 | 885,000 | 1,009,135 |
| 負債合計 | 2,742,365 | 4,561,769 |

(単位：千

円)

| | 第37期 (平成21年3月31日) | 第38期 (平成22年3月31日) |
|--------------|----------------------|----------------------|
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 156,268 | 156,268 |
| 資本剰余金合計 | 156,268 | 156,268 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 343,731 | 343,731 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 1,100,000 | 1,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | 13,220,524 | 14,232,788 |
| 利益剰余金合計 | 14,664,255 | 15,676,519 |
| 株主資本合計 | 16,820,524 | 17,832,788 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 225,466 | 92,156 |
| 評価・換算差額等合計 | 225,466 | 92,156 |
| 純資産合計 | 16,595,057 | 17,740,631 |
| 負債純資産合計 | 19,337,423 | 22,302,401 |

(2) 損益計算書

(単位：千円)

| | 第37期 | 第38期 |
|---------|---------------------------------|---------------------------------|
| | (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
| 営業収益 | | |
| 運用受託報酬 | 4,061,953 | 3,603,017 |
| 委託者報酬 | 15,381,937 | 16,956,717 |
| その他営業収益 | 23,815 | 24,464 |
| 営業収益計 | 19,467,706 | 20,584,199 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 7,587,789 | 8,348,565 |
| 広告宣伝費 | 139,283 | 164,821 |
| 公告費 | 1,590 | - |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 1,208,212 | 1,113,852 |
| 委託調査費 | 1,691,482 | 1,923,670 |
| 委託計算費 | 112,690 | 118,521 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 27,023 | 29,464 |
| 印刷費 | 288,628 | 325,398 |
| 協会費 | 21,841 | 16,722 |
| 諸会費 | 8,534 | 6,036 |
| その他 | 4,503 | 34,513 |
| 営業費用計 | 11,091,578 | 12,081,565 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | 205,830 | 205,410 |
| 給料・手当 | 2,704,289 | 2,717,562 |
| 賞与 | 40,459 | 40,152 |
| 退職金 | 5,076 | 4,038 |
| 福利厚生費 | 457,355 | 478,341 |
| 交際費 | 11,634 | 14,440 |
| 旅費交通費 | 144,711 | 129,350 |
| 租税公課 | 57,374 | 59,772 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 不動産賃借料 | 838,846 | 848,510 |
| 退職給付費用 | 171,337 | 190,115 |
| 固定資産減価償却費 | 168,629 | 119,125 |
| 賞与引当金繰入額 | 604,600 | 715,800 |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 39,220 | 39,640 |
| 役員賞与引当金繰入額 | 48,800 | 58,000 |
| 諸経費 | 282,477 | 233,998 |
| 一般管理費計 | 5,780,642 | 5,854,257 |
| 営業利益 | 2,595,485 | 2,648,375 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 354,591 | 502,114 |
| 受取利息 | 22,205 | 14,130 |
| 投資有価証券売却益 | 2,288 | - |
| 為替差益 | 9,761 | - |
| その他 | 4,989 | 32,982 |
| 営業外収益計 | 393,834 | 549,227 |
| 営業外費用 | | |
| 投資有価証券売却損 | 677 | - |
| 為替差損 | - | 8,094 |
| その他 | 4,113 | 66 |
| 営業外費用計 | 4,790 | 8,160 |
| 経常利益 | 2,984,529 | 3,189,442 |
| 特別利益 | | |
| 賞与引当金戻入益 | 100,063 | - |
| 特別利益計 | 100,063 | - |
| 特別損失 | | |
| 貸倒引当金繰入額 | - | 5,000 |
| その他 | 221 | 169 |
| 特別損失計 | 221 | 5,169 |
| 税引前当期純利益 | 3,084,371 | 3,184,273 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 966,000 | 1,378,026 |

| | | |
|---------|-----------|-----------|
| 法人税等調整額 | 164,798 | 168,517 |
| 法人税等合計 | 1,130,798 | 1,209,509 |
| 当期純利益 | 1,953,572 | 1,974,764 |

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

| | 第37期 | 第38期 |
|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | (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 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 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 | 156,268 | 156,268 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 156,268 | 156,268 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 156,268 | 156,268 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 156,268 | 156,268 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 前期末残高 | 343,731 | 343,731 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 343,731 | 343,731 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | |
| 前期末残高 | 1,100,000 | 1,100,000 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 1,100,000 | 1,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 前期末残高 | 12,806,951 | 13,220,524 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,540,000 | 962,500 |
| 当期純利益 | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 当期変動額合計 | 413,572 | 1,012,264 |
| 当期末残高 | 13,220,524 | 14,232,788 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 14,250,683 | 14,664,255 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,540,000 | 962,500 |
| 当期純利益 | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 当期変動額合計 | 413,572 | 1,012,264 |
| 当期末残高 | 14,664,255 | 15,676,519 |
| 株主資本合計 | | |
| 前期末残高 | 16,406,951 | 16,820,524 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,540,000 | 962,500 |
| 当期純利益 | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 当期変動額合計 | 413,572 | 1,012,264 |
| 当期末残高 | 16,820,524 | 17,832,788 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 前期末残高 | 40,620 | 225,466 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目 | 184,845 | 133,310 |
| の当期変動額（純額） | | |
| 当期変動額合計 | 184,845 | 133,310 |
| 当期末残高 | 225,466 | 92,156 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 前期末残高 | 40,620 | 225,466 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目 | 184,845 | 133,310 |
| の当期変動額（純額） | | |
| 当期変動額合計 | 184,845 | 133,310 |
| 当期末残高 | 225,466 | 92,156 |

| 純資産合計 | | |
|-------------------------|------------|------------|
| 前期末残高 | 16,366,330 | 16,595,057 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,540,000 | 962,500 |
| 当期純利益 | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 株主資本以外の項目の当期 変動額（純額） | 184,845 | 133,310 |
| 当期変動額合計 | 228,726 | 1,145,574 |
| 当期末残高 | 16,595,057 | 17,740,631 |

[前△](#) [次△](#)

重要な会計方針

| | 第37期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第38期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|-----------------------|---|---|
| 1.有価証券の評価基準 及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用して おります。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時 価 法（評価差額は、全部純資産直入法 により処理し、売却原価は、総平均 法により算定）を採用してしま す。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用し て おります。</p> | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>(2) その他有価証券 同左</p> |
| 2.固定資産の減価償却の 方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおり であります。</p> <p>建物 15～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 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)に基づく定額法によってしま す。</p> | <p>(1) 有形固定資産 同左</p> <p>(2) 無形固定資産 同左</p> |
| 3.引当金の計上基準 | <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるた め 一般債権については貸倒実績率によ り、貸倒懸念債権等の特定の債権につ いては個別に回収可能性を検討し回収 不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将 来の支給見込額のうち当事業年度の 負 担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来 の支給見込額のうち当事業年度の負担 額を計上しております。</p> | <p>(1) 貸倒引当金 同左</p> <p>(2) 賞与引当金 同左</p> <p>(3) 役員賞与引当金 同左</p> |

| | | |
|----------------------|---|---|
| | <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 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、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p> | <p>(4) 退職給付引当金 同左</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 同左</p> |
| 4.その他財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。 | (1) 消費税等の会計処理 同左 |

会計方針の変更

| 第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|--|---------------------------------------|
| <p>(リース取引に関する会計基準等) 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、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p> | |

表示方法の変更

| 第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|---|---------------------------------------|
| <p>(損益計算書)</p> <p>投資運用業等統一経理基準の一部改正（平成20年3月19日）により、以下の表示方法の変更を行っております。</p> <p>(1) 前事業年度のみ助言手数料を営業費用の「支払手数料」に含めて表示しておりましたが、当事業年度より「委託調査費」として区分掲記することといたしました。なお、前事業年度の「支払手数料」に含まれる助言手数料は、2,333,171千円であり、当事業年度の「調査費」に含まれる助言手数料は、1,651,234千円であります。</p> <p>(2) 前事業年度まで「海外委託費」は、一般管理費に表示しておりましたが、当事業年度より営業費用の「調査費」と「委託調査費」に表示することといたしました。当事業年度の「調査費」、「委託調査費」に含まれる海外委託費の合計額は、360,564千円であります。</p> <p>(3) 前事業年度まで「器具・備品費」は、一般管理費の内訳として区分掲記しておりましたが、当事業年度より「諸経費」の中に含めることといたしました。なお、当事業年度の「器具・備品費」は、84,833千円であります。</p> <p>(4) 前事業年度まで「情報提供料」を一般管理費の「諸経費」に含めて表示しておりましたが、当事業年度より営業費用の「調査費」に含めて表示することといたしました。なお、前事業年度及び当事業年度の「情報提供料」はいずれも40,000千円であります。</p> | - |

注記事項

(貸借対照表関係)

| 第37期 (平成21年3月31日) | 第38期 (平成22年3月31日) |
|--|--|
| <p>1.有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 132,619千円</p> <p>器具備品 184,596千円</p> <p>2.保証債務</p> <p>被保証者 従業員</p> <p>被保証債務の内容 住宅ローン</p> <p>金額 31,092千円</p> | <p>1.有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 207,904千円</p> <p>器具備品 228,436千円</p> <p>2.保証債務</p> <p>被保証者 従業員</p> <p>被保証債務の内容 住宅ローン</p> <p>金額 27,211千円</p> |

（損益計算書関係）

| 第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

（株主資本等変動計算書関係）

第37期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：千株）

| | 前事業年度末 株式数 | 当事業年度 増加株式数 | 当事業年度 減少株式数 | 当事業年度末 株式数 |
|-------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 3,850 | - | - | 3,850 |
| 合計 | 3,850 | - | - | 3,850 |

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 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20日 定時株主総会 | 普通株式 | 1,540,000 | 400 | 平成20年3月31日 | 平成20年6月23日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 （千円） | 配当の 原資 | 1株当たり 配当額 （円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|----------------|-----------|---------------------|------------|------------|
| 平成21年6月24日 定時株主総会 | 普通株式 | 962,500 | 利益 剰余金 | 250 | 平成21年3月31日 | 平成21年6月25日 |

第38期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：千株）

| | 前事業年度末 株式数 | 当事業年度 増加株式数 | 当事業年度 減少株式数 | 当事業年度末 株式数 |
|-------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| 発行済株式 | | | | |

| | | | | |
|------|-------|---|---|-------|
| 普通株式 | 3,850 | - | - | 3,850 |
| 合計 | 3,850 | - | - | 3,850 |

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 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24日 定時株主総会 | 普通株式 | 962,500 | 250 | 平成21年3月31日 | 平成21年6月25日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成22年6月28日開催の第38回定時株主総会において、次のとおり付議致します。

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (千円) | 配当の原資 | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|----------------|-----------|-----------------|------------|------------|
| 平成22年6月28日 定時株主総会 | 普通株式 | 962,500 | 利益 剰余金 | 250 | 平成22年3月31日 | 平成22年6月29日 |

(リース取引関係)

| 第37期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | | | | 第38期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | | | |
|---|---------------------|------------------------|---------------------|--|---------------------|------------------------|---------------------|
| 1. ファイナンス・リース取引 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（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） (借主側) (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 | | | | 1. ファイナンス・リース取引 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（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） (借主側) (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 | | | |
| | 取得価額 相当額 (千円) | 減価償却累 計額相当額 (千円) | 期末残高 相当額 (千円) | | 取得価額 相当額 (千円) | 減価償却累 計額相当額 (千円) | 期末残高 相当額 (千円) |
| 器具備品 | 4,823 | 1,045 | 3,778 | 器具備品 | 4,823 | 2,009 | 2,813 |
| 合計 | 4,823 | 1,045 | 3,778 | 合計 | 4,823 | 2,009 | 2,813 |
| (2) 未経過リース料期末残高相当額 1年以内 926千円 1年超 2,934千円 合計 3,861千円 | | | | (2) 未経過リース料期末残高相当額 1年以内 966千円 1年超 1,968千円 合計 2,934千円 | | | |
| (3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 支払リース料 1,070千円 減価償却費相当額 964千円 支払利息相当額 181千円 | | | | (3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 支払リース料 1,070千円 減価償却費相当額 964千円 支払利息相当額 143千円 | | | |
| (4) 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 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。 支払利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額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。 | | | | (4) 減価償却費相当額及び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 未経過リース料 1年以内 2,104千円 1年超 1,609千円 合計 3,714千円 | | | | 2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料 1年以内 1,609千円 1年超 - 千円 合計 1,609千円 | | | |

(金融商品関係)

第38期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時

価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収収益は、主たる事業である投資運用業等より発生する運用報酬、委託者報酬が大半を占めております。これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどがファンド財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

投資有価証券はその大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払費用は投資信託の販売に係る支払手数料と運用に係る再委託手数料であります。

未払費用の大半を占める支払手数料は、ファンド財産の中から支払われるため、支払期日に支払を実行出来なくなるリスクは極めて軽微であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

また、デリバティブ取引についても行っておりません。

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

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません。

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|------------|------------|------------|----|
| (1) 現金・預金 | 10,732,367 | 10,732,367 | - |
| (2) 未収収益 | 3,014,380 | 3,014,380 | - |
| (3) 投資有価証券 | | | - |
| その他有価証券 | 4,182,854 | 4,182,854 | - |
| 資産計 | 17,929,602 | 17,929,602 | - |
| (1) 未払費用 | 1,472,849 | 1,472,849 | - |
| 負債計 | 1,472,849 | 1,472,849 | - |

(*1) 未収収益のうち、金融商品で時価評価の対象となるものを表示しております。

（*2）未払費用のうち、金融商品で時価評価の対象となるものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

（1）現金・預金、並びに（2）未収収益

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。

（3）投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

（1）未払費用

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表計上額 |
|------------|-----------|
| （1）其他有価証券 | |
| 非上場株式 | 291,423 |
| （2）子会社株式 | |
| 非上場株式 | 1,169,774 |
| （3）長期差入保証金 | 743,958 |

これらについては、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時価開示の対象としておりません。このため、（1）其他有価証券の非上場株式については2、（3）投資有価証券には含めておりません。

（注3）金銭債権の決算日以後の償還予定額

（単位：千円）

| | 1年以内 |
|-------|------------|
| 現金・預金 | 10,732,367 |
| 未収収益 | 3,014,380 |
| 合計 | 13,746,747 |

（有価証券関係）

第37期（平成21年3月31日現在）

1. 其他有価証券で時価のあるもの

| | 種類 | 取得原価（千円） | 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 | （1）株式 | - | - | - |
| | （2）債券 | - | - | - |
| | （3）その他 | - | - | - |
| | 小計 | - | - | - |

| | | | | |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|---------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えない もの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 3,901,000 | 3,521,426 | 379,573 |
| | 小計 | 3,901,000 | 3,521,426 | 379,573 |
| 合計 | | 3,901,000 | 3,521,426 | 379,573 |

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

| | | |
|---------|-------------|-------------|
| 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
| 77,769 | 2,288 | 677 |

3. 時価評価されていない有価証券

(1) 子会社株式及び関連会社株式

| | |
|--------|--------------|
| 区分 | 貸借対照表計上額（千円） |
| 子会社株式 | 1,169,774 |
| 関連会社株式 | - |
| 合計 | 1,169,774 |

(2) その他有価証券

| | |
|-------|--------------|
| 区分 | 貸借対照表計上額（千円） |
| 非上場株式 | 291,423 |
| 合計 | 291,423 |

第38期（平成22年3月31日現在）

1. 子会社株式

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式1,169,774千円）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。

2. その他有価証券

| | 種類 | 取得原価（千円） | 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 | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 1,273,000 | 1,285,821 | 12,821 |
| | 小計 | 1,273,000 | 1,285,821 | 12,821 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えない もの | (1) 株式 | - | - | - |
| | (2) 債券 | - | - | - |
| | (3) その他 | 3,065,000 | 2,897,033 | 167,967 |
| | 小計 | 3,065,000 | 2,897,033 | 167,967 |
| 合計 | | 4,338,000 | 4,182,854 | 155,145 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 291,423千円）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。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

| | | |
|---------|-------------|-------------|
| 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
| - | - | - |

（デリバティブ取引関係）

| 第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） |
|--|---------------------------------------|
| 当社は、デリバティブ取引を全く利用しておりませんので、該当事項はありません。 | 同左 |

（退職給付関係）

| 第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） |
|--|---|
| <p>1.採用している退職給付制度の概要 退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>2.退職給付債務に関する事項 退職給付債務（退職給付引当金） 751,197千円 （注）退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。</p> <p>3.退職給付費用に関する事項 勤務費用 128,898千円 確定拠出年金掛金 42,439千円 合計 171,337千円 （注）退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。</p> <p>4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については記載しておりません。</p> | <p>1.採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2.退職給付債務に関する事項 退職給付債務（退職給付引当金） 835,692千円 （注）退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。</p> <p>3.退職給付費用に関する事項 勤務費用 144,118千円 確定拠出年金掛金 45,997千円 合計 190,115千円 （注）退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。</p> <p>4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 同左</p> |

（税効果会計関係）

| 第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---------------------------------------|-------|-------|--------|--------------------|---------|----------------------|--------|---------|-------|--------------|--------|-------------|---------|-----------|---------|-------------------|------|---|---------|--------|--------|--------|--------------------|-----------|----------------------|--------------|---------|-----|--------|-------------|-------------------|--------|--------|-------------|---------|-----------|---------|---|------|------|-------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|-------|-----|-------|-------------|---------|-----------|---------|------|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------|--------------|--------|-----|--------|-------------|---------|--------|--------|-------------|---------|-----------|---------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">流動資産</th> <th style="text-align: right;">(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">14,717</td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">245,467</td></tr> <tr><td>社会保険料</td><td style="text-align: right;">22,200</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,229</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">15,313</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">302,927</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">302,927</td></tr> </tbody> </table> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">固定資産</th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">304,986</td></tr> <tr><td>投資有価証券</td><td style="text-align: right;">40,700</td></tr> <tr><td>ゴルフ会員権</td><td style="text-align: right;">37,190</td></tr> <tr><td>役員退職慰労引当金</td><td style="text-align: right;">54,323</td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">154,106</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">43,952</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">635,260</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">77,890</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の合計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">557,369</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">557,369</td></tr> </tbody> </table> | 流動資産 | (千円) | 未払事業税 | 14,717 | 賞与引当金 | 245,467 | 社会保険料 | 22,200 | 未払事業所税 | 5,229 | その他 | 15,313 | (繰延税金資産の小計) | 302,927 | 繰延税金資産の純額 | 302,927 | 固定資産 | | 退職給付引当金 | 304,986 | 投資有価証券 | 40,700 | ゴルフ会員権 | 37,190 | 役員退職慰労引当金 | 54,323 | その他有価証券評価差額金 | 154,106 | その他 | 43,952 | (繰延税金資産の小計) | 635,260 | 評価性引当額 | 77,890 | (繰延税金資産の合計) | 557,369 | 繰延税金資産の純額 | 557,369 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">流動資産</th> <th style="text-align: right;">(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">67,959</td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">290,614</td></tr> <tr><td>社会保険料</td><td style="text-align: right;">28,209</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,090</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">9,404</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">401,279</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">401,279</td></tr> </tbody> </table> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">固定資産</th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">339,291</td></tr> <tr><td>投資有価証券</td><td style="text-align: right;">40,700</td></tr> <tr><td>ゴルフ会員権</td><td style="text-align: right;">38,408</td></tr> <tr><td>役員退職慰労引当金</td><td style="text-align: right;">70,417</td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">62,988</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">64,125</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">615,932</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">79,514</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">(繰延税金資産の合計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">536,417</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">536,417</td></tr> </tbody> </table> | 流動資産 | (千円) | 未払事業税 | 67,959 | 賞与引当金 | 290,614 | 社会保険料 | 28,209 | 未払事業所税 | 5,090 | その他 | 9,404 | (繰延税金資産の小計) | 401,279 | 繰延税金資産の純額 | 401,279 | 固定資産 | | 退職給付引当金 | 339,291 | 投資有価証券 | 40,700 | ゴルフ会員権 | 38,408 | 役員退職慰労引当金 | 70,417 | その他有価証券評価差額金 | 62,988 | その他 | 64,125 | (繰延税金資産の小計) | 615,932 | 評価性引当額 | 79,514 | (繰延税金資産の合計) | 536,417 | 繰延税金資産の純額 | 536,417 |
| 流動資産 | (千円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 14,717 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 245,467 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 社会保険料 | 22,200 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業所税 | 5,229 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 15,313 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の小計) | 302,927 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 302,927 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 固定資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 304,986 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券 | 40,700 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ゴルフ会員権 | 37,190 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 役員退職慰労引当金 | 54,323 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 154,106 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 43,952 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の小計) | 635,260 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 77,890 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の合計) | 557,369 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 557,369 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 流動資産 | (千円) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 67,959 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 290,614 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 社会保険料 | 28,209 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業所税 | 5,090 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 9,404 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の小計) | 401,279 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 401,279 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 固定資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 339,291 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券 | 40,700 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ゴルフ会員権 | 38,408 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 役員退職慰労引当金 | 70,417 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 62,988 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 64,125 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の小計) | 615,932 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 79,514 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (繰延税金資産の合計) | 536,417 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 536,417 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>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</p> <p>との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td colspan="2">（調整）</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.9</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.3</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">0.6</td> </tr> <tr> <td>特定外国子会社等課税所得</td> <td style="text-align: right;">1.6</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">1.7</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.7</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">36.6</td> </tr> </tbody> </table> | 法定実効税率 | 40.6% | （調整） | | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.9 | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | 0.3 | 過年度法人税等 | 0.6 | 特定外国子会社等課税所得 | 1.6 | 外国税額控除 | 1.7 | その他 | 0.7 | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 36.6 | <p>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</p> <p>との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td colspan="2">（調整）</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">1.0</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.7</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">0.9</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.2</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">38.0</td> </tr> </tbody> </table> | 法定実効税率 | 40.6% | （調整） | | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 1.0 | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | 4.7 | 過年度法人税等 | 0.9 | その他 | 0.2 | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 38.0 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率 | 40.6% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （調整） | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.9 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | 0.3 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 過年度法人税等 | 0.6 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 特定外国子会社等課税所得 | 1.6 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外国税額控除 | 1.7 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 0.7 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 36.6 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率 | 40.6% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| （調整） | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 1.0 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | 4.7 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 過年度法人税等 | 0.9 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 0.2 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 38.0 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(関連当事者との取引)

第37期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

兄弟会社等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 (億円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有割合 | 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 | 大和証券株式会社 | 東京都千代田区 | 1,000 | 証券業 | - | - | 当社投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 1 | 2,078,153 | 未払費用 | 242,242 |
| その他の関係会社の子会社 | 株式会社三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 6,650 | 銀行業 | - | - | 当社投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 1 | 3,549,060 | 未払費用 | 193,011 |

取引条件 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

(追加情報)

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

なお、これによる開示対象の追加はございません。

第38期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

兄弟会社等

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 (億円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有割合 | 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 | 大和証券株式会社 | 東京都千代田区 | 1,000 | 証券業 | - | - | 当社投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 1 | 2,590,851 | 未払費用 | 385,057 |

| | | | | | | | | | | | |
|--------------|------------|---------|--------|-----|---|---|-------------------|------------------------|-----------|------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | 株式会社三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 17,710 | 銀行業 | - | - | 当社投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 1 | 2,955,228 | 未払費用 | 259,188 |
|--------------|------------|---------|--------|-----|---|---|-------------------|------------------------|-----------|------|---------|

取引条件 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

（1株当たり情報）

| 第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38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 4,310円40銭 1株当たり当期純利益 507円42銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | 1株当たり純資産額 4,607円96銭 1株当たり当期純利益 512円93銭 同左 |

（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37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） |
|------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 損益計算書上の当期純利益（千円） | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益（千円） | 1,953,572 | 1,974,764 |
| 普通株式の期中平均株式数（千株） | 3,850 | 3,850 |

（重要な後発事象）

| 第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日） | 第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日） |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 該当事項はありません。 | 同左 |

[前へ](#) [次へ](#)

4 利害関係人との取引制限

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

(1)自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

(2)運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

(3)通常の見積り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)および(5)において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

(4)委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)上記(3)および(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 その他

(1)定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生していません。

委託会社の営業年度は、毎年4月1日より翌年3月31日までとし、営業年度末に決算を行います。

[前へ](#)

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

下線部が訂正部分です。

<訂正前>

(1) 受託会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） 平成21年9月末日現在 | 事業の内容 |
|------------|---------------------------|--|
| 住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。 |

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

・資本金：51,000百万円（平成21年9月末日現在）

（以下略）

(2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） 平成21年9月末日現在 | 事業の内容 |
|------------|---------------------------|-------------------------------|
| 株式会社三井住友銀行 | <u>1,262,959</u> | 銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。 |

<訂正後>

(1) 受託会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） 平成22年3月末現在 | 事業の内容 |
|------------|--------------------------|--|
| 住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。 |

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

・資本金：51,000百万円（平成22年3月末現在）

（以下略）

(2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） 平成22年3月末現在 | 事業の内容 |
|------------|--------------------------|-------------------------------|
| 株式会社三井住友銀行 | <u>1,770,996</u> | 銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。 |

以上

独立監査人の監査報告書

平成22年11月26日

大和住銀投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

有限責任あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル資産分散オープンの平成22年3月30日から平成22年9月27日までの特定期間の財務諸表、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、グローバル資産分散オープンの平成22年9月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

大和住銀投信投資顧問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

(注)1. 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。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年 6 月16日

大和住銀投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 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」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第38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、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成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

上記は、当社が、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。

独立監査人の監査報告書

平成22年5月14日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 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」に掲げられているグローバル資産分散オープンの平成21年9月29日から平成22年3月29日までの特定期間の財務諸表、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、グローバル資産分散オープンの平成22年3月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

大和住銀投信投資顧問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

-
- (注) 1. 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。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月25日

大和住銀投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第37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、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成21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

上記は、当社が、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。