

【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23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23年6月28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、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

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

(1) ファンドの目的及び基本的性格

ファンドの特色

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1

投資信託証券への投資を通じて、先進国から新興国までの幅広い地域の債券、株式、REIT(不動産投資信託)およびコモディティ等へ実質的に分散投資し、安定した利子・配当収益の確保とともに、信託財産の中長期的な成長を目指します。

- 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- 分散投資にあたっては、資産の分散・地域の分散などを考慮します。

<当ファンドが投資対象とする資産・投資対象>

資産	地域・種類別	主要投資対象
債券	米国債券	主に米国の多種多様な投資適格の債券へ投資します。
	欧州債券	主に欧州地域の債券を中心に投資します。
	アジア・オセアニア債券	主にアジアおよびオセアニア地域の債券へ投資します。
	新興国債券	主に新興国の債券へ投資します。
	ハイ・イールド債券	主にハイ・イールド債券へ分散投資します。
株式	日本株式	主にわが国の株式へ投資します。
	先進国株式	主に先進国の株式を中心に投資します。
	新興国株式	主に新興国の株式を中心に投資します。
REIT・コモディティ	世界REIT	日本を含む世界のREITへ分散投資します。
	コモディティ	商品市況に中長期的な動きが概ね連動する証券へ投資します。

※将来投資環境に応じて、資産クラスの増加・変更を行う場合があります。

- 投資信託証券への投資は、主に前記の当該資産クラスを主要投資対象とする以下の投資信託証券（以下「指定投資信託証券」といいます。）の中から行います。

<当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券>

資産	地域・種類	指定投資信託証券
債券	米国債券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund(以下、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」)
	欧州債券	欧州債券マザーファンド
	アジア・オセアニア債券	アジア・オセアニア債券マザーファンド
	新興国債券	新興国債券マザーファンド
	ハイ・イールド債券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund(以下、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」)
株式	日本株式	日本好配当株マザーファンド
	先進国株式	グローバル好配当株マザーファンド
	新興国株式	T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund(以下、「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」)
REIT・コモディティ	世界REIT	世界REITマザーファンド
	コモディティ	コモディティマザーファンド

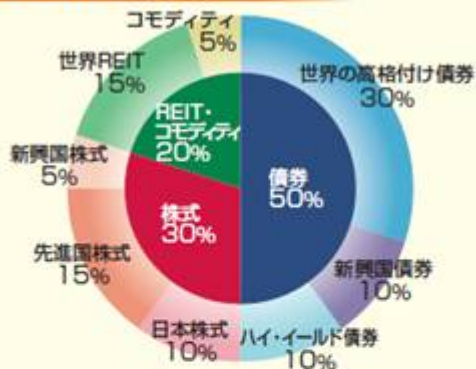
※上記の指定投資信託証券の全てに投資することを約束するものではありません。

※指定投資信託証券は、将来投資環境に応じて、追加または変更になる場合があります。

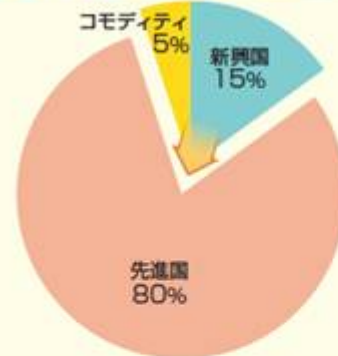
2

各資産への配分は、信託財産の純資産総額に対し、概ね「債券:50%程度、株式:30%程度、REIT・コモディティ:20%程度」を基本資産配分とします。

資産配分のイメージ



地域別配分のイメージ



資産	資産クラス	基本資産配分	
債券	世界の 高格付け債券	米国債券	10%
		欧州債券	10%
		アジア・ オセアニア債券	10%
	新興国債券	10%	
	ハイ・イールド債券	10%	
株式	日本株式	10%	
	先進国株式	15%	
	新興国株式	5%	
REIT・ コモディティ	世界REIT	15%	
	コモディティ	5%	

※指定投資信託証券における有価証券の組入状況によっては、実際の資産配分で上記イメージとの乖離が生じる場合があります。

※実質組入有価証券の値動きや資金流入などによっては上記の比率は変動します。

※投資環境の変化や各資産の利回り水準などを考慮し、基本資産配分の調整等を行う場合があります。

3

年6回の分配を目指します。

- 決算日は、毎年1、3、5、7、9、11月の27日(休業日の場合は翌営業日)とします。
- 毎年5月および11月の決算時には、基準価額水準などを考慮し、売買益(評価益を含みます。)等を中心に分配する場合があります。
- 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には分配を行わないことがあります。
- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

分配のイメージ図



※あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではなく、分配金が支払われない場合もあります。

※上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、あるいはやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

下記は投資信託における「収益分配金に関する留意事項」を説明するものであり、当ファンドの分配金額や基準価額を示すものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- ① 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

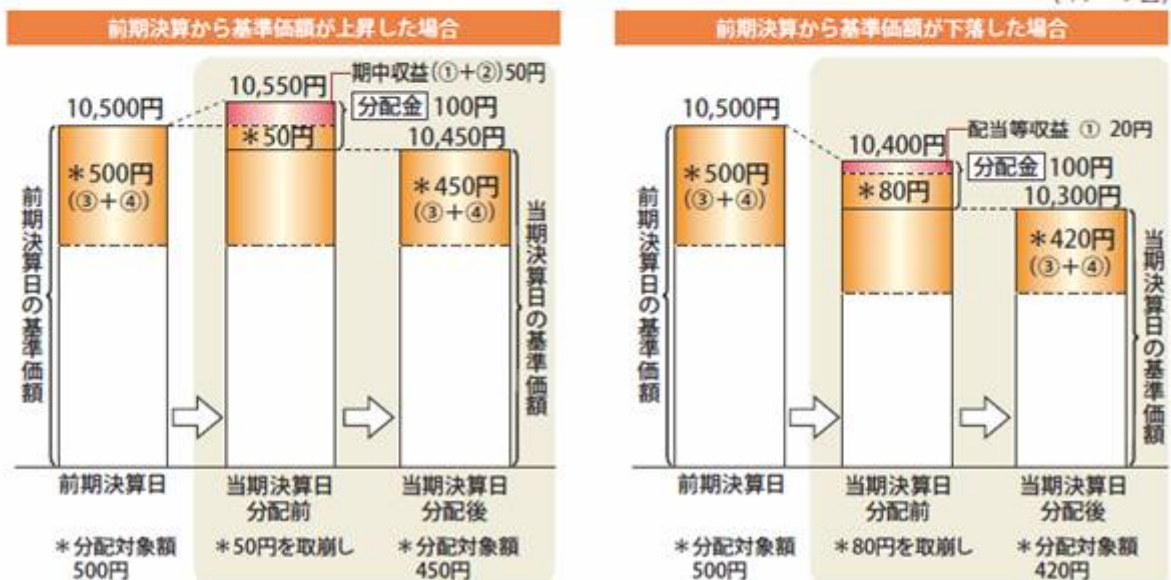


(イメージ図)

- ② 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金が計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

(イメージ図)



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

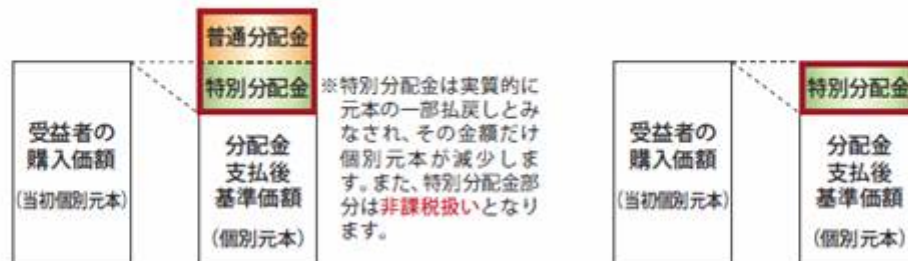
※上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- ③ 受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

(イメージ図)

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金: 個別元本(受益者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

特別分配金: 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の受益者の個別元本は、特別分配金の額だけ減少します。

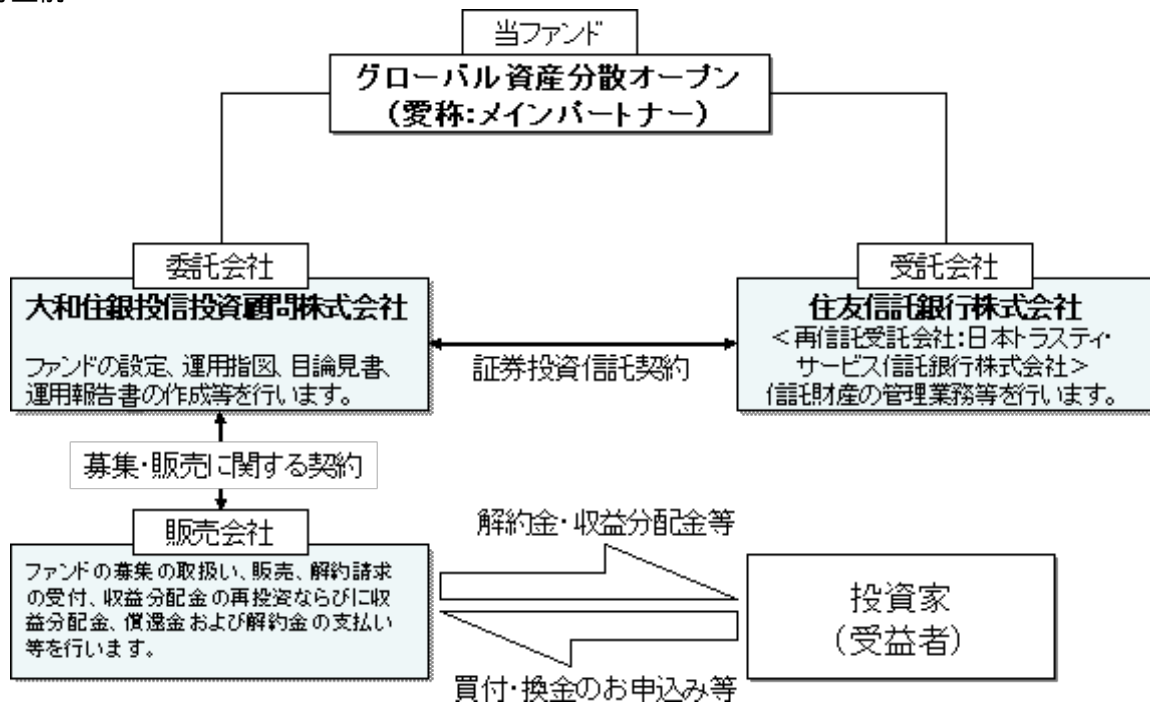
当ファンドの運用の仕組み



(3) ファンドの仕組み

下線部が訂正部分です。

<訂正前>



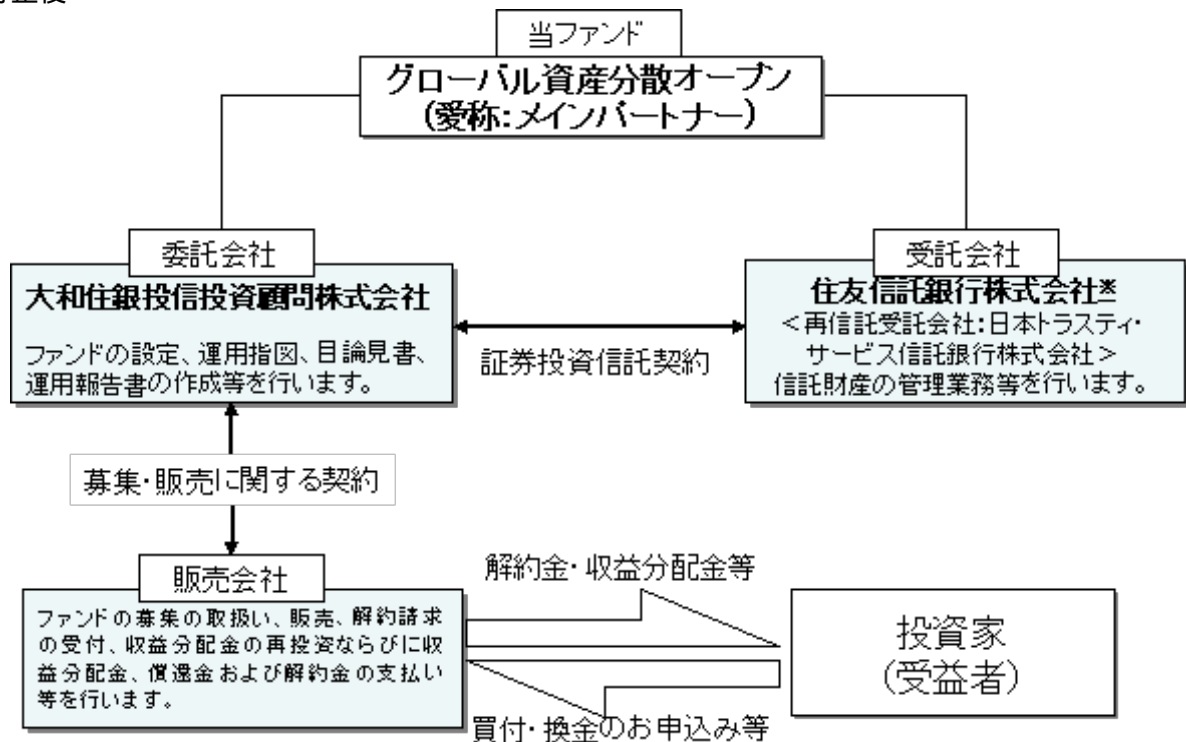
委託会社等が関係法人と締結している契約等の概要

(以下略)

委託会社等の概況（平成23年4月末現在）

(以下略)

<訂正後>



住友信託銀行株式会社は、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。本書において、以下同じです。

委託会社等が関係法人と締結している契約等の概要

(以下略)

委託会社等の概況（平成23年10月末現在）

(以下略)

[次へ](#)

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。

<p>指定投資信託証券の概要は、平成23年4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。</p>

<p>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。</p>

(以下略)

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

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

<p><u>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</u>は、世界的な不動産サービス会社である米国シービー・リチャードエリス・グループの不動産証券専門の運用会社です。同社は、シービー・リチャードエリス・グループの世界各国に展開したネットワークから不動産/マーケット情報・リサーチ情報を最大限活用することができます。</p>
--

1 . T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund

(以下略)

9 . 世界REITマザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

投資信託委託会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
投資顧問会社	<u>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</u>

（以下略）

投資態度	<p>世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 グローバルベースでのマクロ分析、不動産市場のファンダメンタルズ分析とボトムアップ・アプローチによる個別銘柄の分析によりポートフォリオを構築します。 北米地域 / 欧州地域 / アジア・オセアニア地域への投資比率は、原則として概ね均等とすることを基本とします。 運用の指図に関する権限をシービー・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・エルエルシーに委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 資金動向、市況動向等によっては、あるいはやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。</p>
------	--

（以下略）

< 運用プロセス >

地域・国別配分：

- _____ グローバルベースでのマクロ経済の状況や不動産市場のファンダメンタルズ（賃料、空室率、キャップレートの動向など）の分析
- _____ 成長が見込まれる地域・国、不動産セクターの特定
- _____ 相対的魅力度に基づき地域・国別配分を決定

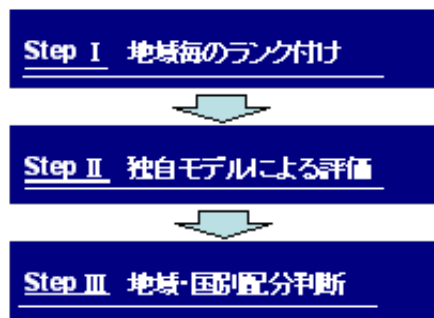
銘柄選定：

- _____ NAV（純資産総額）とキャッシュフローの予測
- _____ 経営陣との面談により経営陣の資質を評価
- _____ REITの運用戦略を評価
- _____ 保有物件の視察
- _____ 各国の特有の要因を考慮し、同一地域内での個別銘柄毎の相対的な魅力度を評価

ポートフォリオの構築：

（以下略）

<トップダウンによる地域・国別配分>



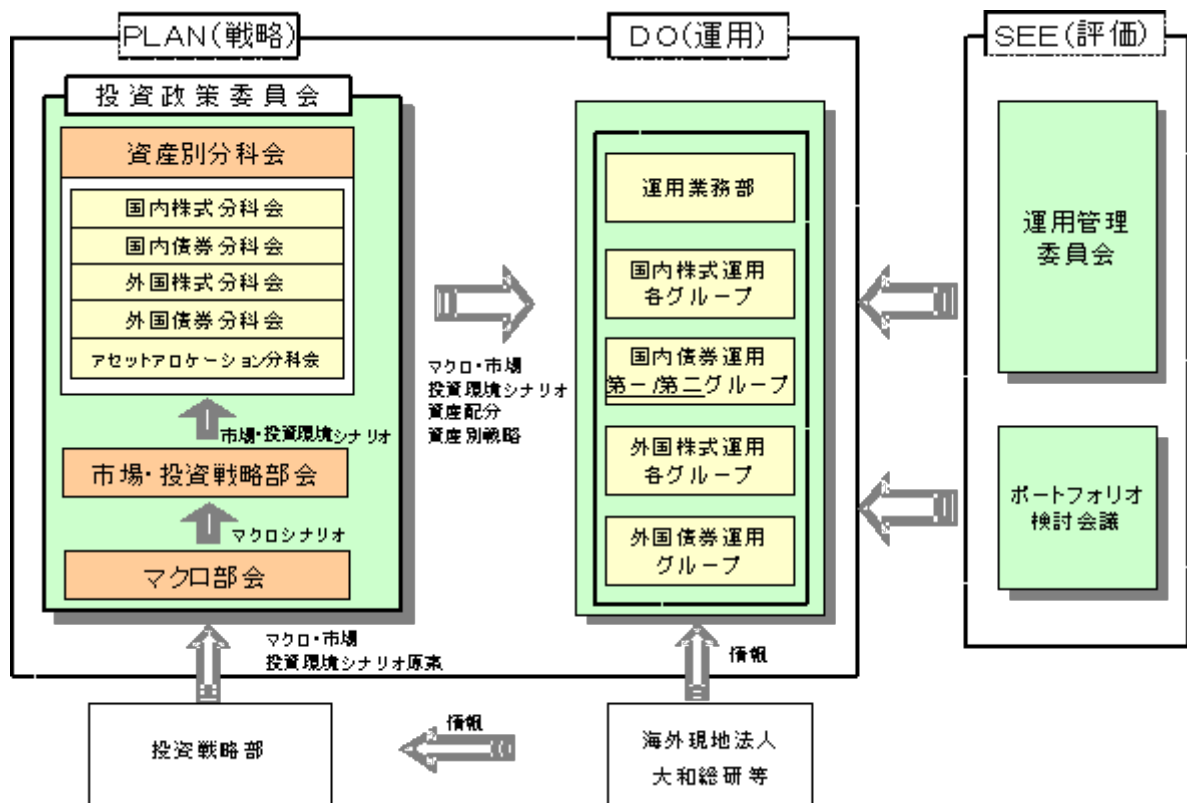
<ボトムアップによる個別銘柄分析>



運用プロセスは将来変更になる場合があります。

（以下略）

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成23年4月末現在で約100名です。

(以下略)

(4) 配分方針

毎決算時（毎年1、3、5、7、9、11月の27日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき配分を行います。

(以下略)

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

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

(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23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)

シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー

(CBRE Clarion Securities, LLC 所在地：米国ペンシルバニア州ラドノー)

シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシーは、世界的な不動産サービス会社である米国シービーアールイー・グループの上場不動産証券投資部門を担う運用会社です。同社は、シービーアールイー・グループの世界各国に展開したネットワークから不動産/マーケット情報・リサーチ情報を最大限活用することができます。

「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」が2011年7月1日付けで「アイエヌジー・クラリオン・リアルエステート・セキュリティーズ・エルエルシー」と統合され、商号が「シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー」に変更されております。本書において、以下同じです。

1 . T.Rowe Price Funds SICAV – U.S. Aggregate Bond Fund

(以下略)

9 . 世界REITマザーファンド

<指定投資信託証券の概要>

投資信託委託会社	大和住銀投信投資顧問株式会社
投資顧問会社	シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー

(以下略)

投資態度	<p>世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 グローバルベースでのマクロ分析、不動産市場のファンダメンタルズ分析とボトムアップ・アプローチによる個別銘柄の分析によりポートフォリオを構築します。 北米地域 / 欧州地域 / アジア・オセアニア地域への投資比率は、原則として概ね均等とすることを基本とします。 運用の指図に関する権限をシービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシーに委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 資金動向、市況動向等によっては、あるいはやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。</p>
------	---

(以下略)

<運用プロセス>

地域・国別配分：

- マクロ経済動向の分析
- 資本市場の分析（不動産と債券や株式などの他資産との相対比較）
- 不動産市場動向（賃料、空室率、キャップレートなど）の分析
- 上場不動産市場の分析（キャッシュフロー、トータルリターン予測の比較など）
- 不動産セクター別テーマ、国別配分目標の設定

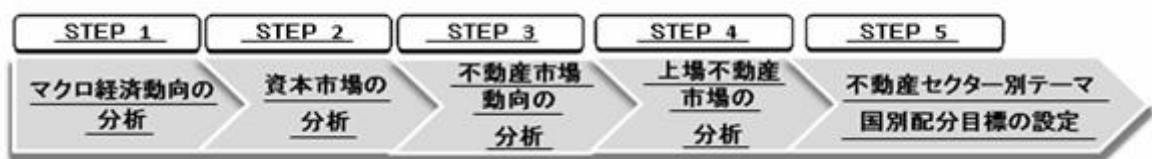
銘柄選定：

- 投資ユニバースのスクリーニング
- 不動産市場ファンダメンタルズ調査
- 経営陣との面談、保有物件視察
- NAV予測、収益モデルの作成
- 個別銘柄の固有リスク分析
- バリュエーション分析
- 銘柄選定

ポートフォリオの構築：

(以下略)

トップダウンによる地域・国別配分



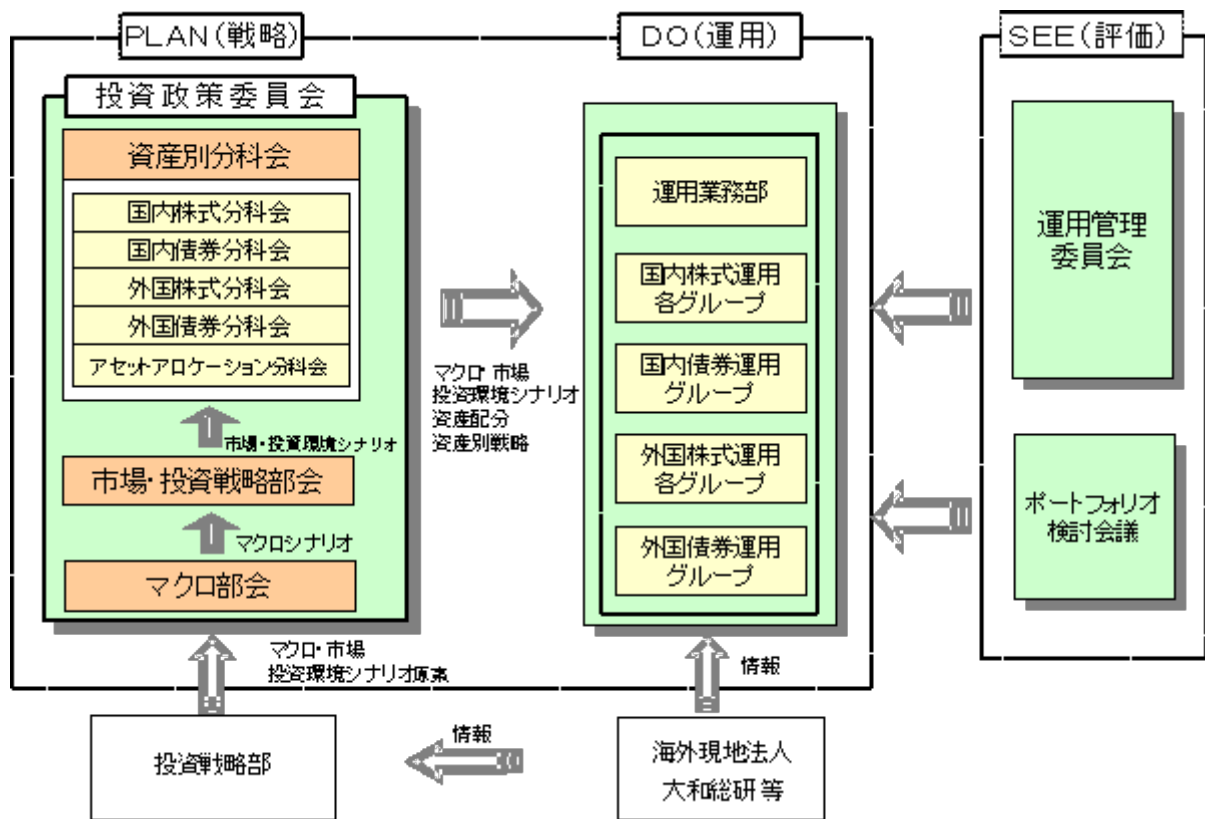
ボトムアップによる個別銘柄分析



運用プロセスは将来変更になる場合があります。

（以下略）

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成23年10月末現在で約100名です。

(以下略)

(4) 配分方針

毎決算時（毎年1、3、5、7、9、11月の27日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

(以下略)

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

(以下略)

3 投資リスク

下線部が訂正部分です。

<訂正前>

<当ファンドの有するリスク>

当ファンドは、投資信託証券を通じて実質的に株式、債券、REIT、コモディティなど値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、外貨建資産は為替の変動による影響も受けます。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

当ファンドの投資目的は確実に達成されるものではなく、元本および元本からの収益を確保する保証はありません。

投資家の皆様におかれましては、当ファンドの内容とリスクを十分ご理解のうえお申込みくださいますよう、よろしく願いいたします。

（以下略）

<その他の留意点>

(1)分配金に関する留意点

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

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

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

(2)繰上償還について

（以下略）

(3)資産および投資先の配分について

（以下略）

(4)換金請求の受付に関する留意点

（以下略）

(5)クーリング・オフについて

（以下略）

(6)法令・税制・会計等の変更可能性について

（以下略）

(7)その他

委託会社と投資顧問会社（T．ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド、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）との合意等により、指定投資信託証券の運用指図にかかる権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

<訂正後>

<当ファンドの有するリスク>

当ファンドは、投資信託証券を通じて実質的に株式、債券、REIT、コモディティなど値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、外貨建資産は為替の変動による影響も受けます。したがって、投資家の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの投資目的は確実に達成されるものではなく、元本および元本からの収益を確保する保証はありません。

投資家の皆様におかれましては、当ファンドの内容とリスクを十分ご理解のうえお申込みくださいますよう、よろしく願いいたします。

（以下略）

<その他の留意点>

(1)繰上償還について

（以下略）

(2)資産および投資先の配分について

（以下略）

(3)換金請求の受付に関する留意点

（以下略）

(4)クーリング・オフについて

（以下略）

(5)法令・税制・会計等の変更可能性について

（以下略）

(6)その他

委託会社と投資顧問会社（T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド、シービーアールイー・クラリオン・セキュリティーズ・エルエルシー）との合意等により、指定投資信託証券の運用指図にかかる権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

4 手数料等及び税金

下線部が訂正部分です。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

< 平成23年12月31日まで >

(以下略)

< 平成24年1月1日以降 >

(以下略)

法人の受益者に対する課税

< 平成23年12月31日まで >

(以下略)

< 平成24年1月1日以降 >

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

< 平成25年12月31日まで >

(以下略)

< 平成26年1月1日以降 >

(以下略)

法人の受益者に対する課税

< 平成25年12月31日まで >

(以下略)

< 平成26年1月1日以降 >

(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23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	3,447,458,937	14.87%
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	3,427,910,767	14.79%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	2,398,894,377	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	2,371,284,605	10.23%
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	2,251,781,072	9.71%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	2,193,750,840	9.46%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	1,099,101,578	4.74%
投資証券	ルクセンブルグ	5,612,669,378	24.21%
純資産総額		23,182,741,523	-

（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23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	28,134,100,400	94.61%
純資産総額		29,737,760,563	-

（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	1,031,895,714	29.63%
	オーストラリア	656,444,922	18.85%
	イギリス	489,132,484	14.04%
	フランス	316,095,755	9.08%
	日本	241,102,700	6.92%
	カナダ	231,424,500	6.64%
	シンガポール	212,236,570	6.09%
	オランダ	117,061,815	3.36%
	ベルギー	101,272,500	2.91%
ドイツ	29,823,432	0.86%	
純資産総額		3,482,980,256	-

（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	68,822,367,601	30.06%
	オーストラリア	29,533,498,857	12.90%
	イギリス	28,118,978,499	12.28%
	フランス	14,961,681,611	6.54%
	台湾	13,137,050,828	5.74%
	香港	10,567,419,913	4.62%
	韓国	8,561,292,068	3.74%
	シンガポール	8,478,170,775	3.70%
	ドイツ	5,695,824,931	2.49%
	ノルウェー	5,640,071,232	2.46%
	オランダ	4,521,918,386	1.98%
	スイス	3,614,028,190	1.58%
	ベルギー	3,196,744,735	1.40%
	スウェーデン	2,979,330,660	1.30%
	ジャージー	2,665,316,966	1.16%
	スペイン	2,665,246,522	1.16%
	カナダ	1,771,997,917	0.77%
	バミューダ	1,179,529,660	0.52%
	フィンランド	1,082,545,432	0.47%
オランダ領アンチル	457,706,475	0.20%	
純資産総額		228,943,596,867	-

（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	1,288,153,159	6.82%
	ブラジル	1,163,006,892	6.16%
	トルコ	1,152,187,081	6.10%
	メキシコ	920,135,068	4.87%
	ウクライナ	708,657,739	3.75%
	ヴェネズエラ	528,687,342	2.80%
	ペルー	501,789,671	2.66%
	イラク	415,950,437	2.20%
	リトアニア	411,091,742	2.18%
	インドネシア	402,307,656	2.13%
	セルビア	362,124,842	1.92%
	ベトナム	333,574,323	1.77%
	アルゼンチン	322,111,859	1.71%
	ジャマイカ	260,399,328	1.38%
	ハンガリー	210,484,858	1.11%
	ガボン	208,331,125	1.10%
	フィリピン	185,045,000	0.98%
	レバノン	179,019,375	0.95%
	アイスランド	164,792,135	0.87%
	グレナダ	142,282,500	0.75%
	エジプト	140,217,304	0.74%
	ドミニカ共和国	111,425,512	0.59%
	ウルグアイ	92,387,992	0.49%
	グルジア	86,807,875	0.46%
	ナイジェリア	61,977,440	0.33%
	パキスタン	31,585,937	0.17%
	地方債証券	アルゼンチン	81,637,500

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
特殊債券	メキシコ	350,049,937	1.85%
	ジャマイカ	198,262,500	1.05%
	ロシア	176,541,093	0.93%
	南アフリカ	119,715,562	0.63%
	レバノン	30,237,876	0.16%
社債券	オランダ	969,782,747	5.13%
	フィリピン	908,924,712	4.81%
	ケイマン諸島	849,563,520	4.50%
	アメリカ	486,776,422	2.58%
	ブラジル	400,101,305	2.12%
	ヴェネズエラ	362,609,712	1.92%
	アイルランド	339,240,549	1.80%
	メキシコ	330,635,451	1.75%
	ルクセンブルグ	316,565,928	1.68%
	カザフスタン	269,211,318	1.43%
	バミューダ	259,331,237	1.37%
	トルコ	202,062,531	1.07%
	コロンビア	125,255,250	0.66%
	アルゼンチン	96,149,148	0.51%
	トリニダードトバゴ	91,262,950	0.48%
	キプロス	46,384,678	0.25%
	韓国	39,965,055	0.21%
	チリ	38,382,453	0.20%
	インドネシア	38,330,750	0.20%
	ペルー	38,291,875	0.20%
	パナマ	20,883,339	0.11%
	純資産総額		18,887,051,117

（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	ドイツ	422,506,473	17.61%
	フランス	297,103,795	12.38%
	イタリア	282,735,341	11.79%
	イギリス	242,000,319	10.09%
	スペイン	142,838,435	5.95%
	ベルギー	82,877,556	3.45%
	ポーランド	51,677,871	2.15%
	オランダ	46,806,795	1.95%
	オーストリア	43,915,004	1.83%
	スウェーデン	31,746,018	1.32%
	アイルランド	15,664,942	0.65%
	ブラジル	13,036,927	0.54%
	ルーマニア	11,992,674	0.50%
	チェコ	6,282,954	0.26%
	特殊債券	スウェーデン	25,303,185
国際機関		22,604,802	0.94%
ルクセンブルグ		17,814,161	0.74%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
社債券	アメリカ	156,800,104	6.54%
	イギリス	82,415,092	3.44%
	オランダ	49,924,649	2.08%
	フランス	45,771,445	1.91%
	イタリア	42,883,993	1.79%
	スペイン	32,427,313	1.35%
	ルクセンブルグ	17,377,888	0.72%
	ドイツ	11,485,430	0.48%
	スウェーデン	11,164,638	0.47%
	アイルランド	10,631,721	0.44%
	スイス	7,544,071	0.31%
	カナダ	5,740,850	0.24%
	ガーンジー	5,730,976	0.24%
	韓国	5,706,565	0.24%
	デンマーク	5,651,710	0.24%
ケイマン諸島	5,453,958	0.23%	
	ノルウェー	5,405,082	0.23%
純資産総額		2,398,915,928	-

（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	アメリカ	1,098,514,977	99.95%
純資産総額		1,099,091,957	-

（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	771,738,859	34.27%
	韓国	372,742,701	16.55%
	香港	106,748,842	4.74%
	シンガポール	75,743,879	3.36%
	マレーシア	72,975,144	3.24%
特殊債券	国際機関	780,795,338	34.67%
純資産総額		2,251,755,061	-

（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23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 -	6,853,795,104	0.4434 3,039,658,128	0.5030 3,447,458,937	- -	14.87%
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 -	3,744,713,532	0.8156 3,054,562,828	0.9154 3,427,910,767	- -	14.79%
3	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	3,037,728,729	0.7468 2,268,879,587	0.7897 2,398,894,377	- -	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 -	2,132,833,788	1.0399 2,218,147,139	1.1118 2,371,284,605	- -	10.23%
5	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 -	2,375,547,075	0.8767 2,082,879,675	0.9479 2,251,781,072	- -	9.71%
6	T.Rowe Price Funds SICAV-Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	3,036,282	715 2,172,066,157	740 2,247,395,432	- -	9.69%
7	T.Rowe Price Funds SICAV-U. S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	2,671,775	846 2,262,105,043	839 2,243,489,954	- -	9.68%
8	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	3,385,940,486	0.6302 2,134,158,288	0.6479 2,193,750,840	- -	9.46%
9	T.Rowe Price Funds SICAV-Global Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	2,046,537	464 951,527,414	548 1,121,783,992	- -	4.84%
10	コモディティ・マザーファン ド	親投資信託受 益証券	1,764,774,532	0.5778	0.6228	-	4.74%

	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
	日本	-		1,019,686,725	1,099,101,578	-	

(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	258,400	3,540 914,736,000	3,600 930,240,000	- -	3.13%
2	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	221,800	3,790 840,622,000	4,030 893,854,000	- -	3.01%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	2,509,700	336 843,259,200	345 865,846,500	- -	2.91%
4	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,130,000	711 803,430,000	735 830,550,000	- -	2.79%
5	三井住友トラスト・ホール ディングス 日本	株式 銀行業	2,806,000	259 726,754,000	272 763,232,000	- -	2.57%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	300,900	2,346 706,156,472	2,406 723,965,400	- -	2.43%
7	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	5,738,600	110 631,246,000	111 636,984,600	- -	2.14%
8	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	1,335,000	438 584,730,000	464 619,440,000	- -	2.08%
9	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	230,800	2,597 599,410,932	2,644 610,235,200	- -	2.05%
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	371,800	1,525 567,332,930	1,641 610,123,800	- -	2.05%
11	三井物産 日本	株式 卸売業	466,000	1,108 516,430,839	1,165 542,890,000	- -	1.83%
12	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	3,798	142,700 541,974,600	139,300 529,061,400	- -	1.78%
13	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,257	372,736 468,529,804	395,500 497,143,500	- -	1.67%
14	大東建託 日本	株式 建設業	70,000	7,200 504,000,000	7,020 491,400,000	- -	1.65%
15	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	1,260,000	356 448,560,000	355 447,300,000	- -	1.50%
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	968,000	382 369,776,000	427 413,336,000	- -	1.39%
17	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	514,000	753 387,042,000	787 404,518,000	- -	1.36%
18	アイシン精機 日本	株式 輸送用機器	157,000	2,482 389,820,205	2,537 398,309,000	- -	1.34%
19	住友商事 日本	株式 卸売業	352,400	951 335,132,400	987 347,818,800	- -	1.17%
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	180,000	1,929 347,298,590	1,892 340,560,000	- -	1.15%
21	キヤノン電子 日本	株式 電気機器	175,000	2,074 362,950,000	1,927 337,225,000	- -	1.13%
22	山武 日本	株式 電気機器	191,800	1,566 300,358,800	1,751 335,841,800	- -	1.13%

	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
23	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	114,600	2,903 332,683,800	2,887 330,850,200	- -	1.11%
24	野村不動産ホールディングス 日本	株式 不動産業	253,500	1,183 299,991,965	1,290 327,015,000	- -	1.10%
25	豊田自動織機 日本	株式 輸送用機器	142,000	2,163 307,146,000	2,253 319,926,000	- -	1.08%
26	NTN 日本	株式 機械	905,000	359 325,452,735	353 319,465,000	- -	1.07%
27	パンダイナムコホールディングス 日本	株式 その他製品	272,000	1,077 292,944,000	1,150 312,800,000	- -	1.05%
28	三菱瓦斯化学 日本	株式 化学	575,000	463 266,225,000	519 298,425,000	- -	1.00%
29	日立キャピタル 日本	株式 その他金融業	304,000	916 278,464,000	974 296,096,000	- -	1.00%
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	136,000	2,266 308,176,000	2,106 286,416,000	- -	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。

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 -	297,592	776 230,997,184	636 189,308,508	- -	5.44%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	17,752	8,135 144,426,753	10,063 178,641,615	- -	5.13%
3	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	10,960	16,125 176,733,404	16,028 175,673,795	- -	5.04%
4	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券 -	229,515	704 161,680,962	645 148,225,009	- -	4.26%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券 -	34,331	3,927 134,820,926	4,162 142,910,855	- -	4.10%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	24,796	4,165 103,289,965	4,567 113,263,478	- -	3.25%
7	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資証券 -	516,692	211 109,118,131	215 111,273,755	- -	3.19%
8	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券 -	120,986	911 110,289,716	876 106,024,096	- -	3.04%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	172,500	561 96,857,715	518 89,360,658	- -	2.57%
10	SEGRO PLC イギリス	投資証券 -	272,398	377 102,806,667	311 84,871,414	- -	2.44%
11	CAPITAMALL TRUST シンガポール	投資証券 -	696,356	116 81,297,291	118 82,243,891	- -	2.36%
12	VENTAS INC アメリカ	投資証券 -	17,600	3,890 68,476,386	4,357 76,685,136	- -	2.20%
13	CORIO NV オランダ	投資証券 -	17,050	5,029 85,761,317	4,124 70,323,534	- -	2.02%
14	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	974,600	70 68,841,904	71 69,424,461	- -	1.99%
15	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	259,000	252 65,297,754	260 67,576,855	- -	1.94%
16	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資証券 -	229,300	261 59,881,432	275 63,246,420	- -	1.82%
17	ICADE フランス	投資証券 -	8,700	9,080 79,002,922	7,226 62,871,399	- -	1.81%
18	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	489,205	125 61,198,084	127 62,363,657	- -	1.79%
19	DERWENT LONDON PLC イギリス	投資証券 -	28,478	2,079 59,224,215	2,129 60,651,305	- -	1.74%
20	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	229,438	311 71,427,427	262 60,243,788	- -	1.73%
21	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	74	809,416 59,896,825	759,000 56,166,000	- -	1.61%
22	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	535,000	102 54,841,009	103 55,170,992	- -	1.58%
23	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ	投資証券 -	28,467	1,717 48,898,084	1,877 53,440,529	- -	1.53%
24	GLIMCHER REALTY TRUST - G アメリカ	投資証券 -	26,995	1,938 52,324,673	1,885 50,897,385	- -	1.46%
25	WAREHOUSES DE PAUW SCA ベルギー	投資証券 -	11,342	4,365 49,510,865	4,223 47,906,736	- -	1.38%
26	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR アメリカ	投資証券 -	12,800	3,466 44,364,847	3,532 45,221,888	- -	1.30%
27	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	6,633	6,515 43,216,295	6,461 42,861,135	- -	1.23%
28	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR カナダ	投資証券 -	21,863	1,913 41,835,295	1,947 42,582,084	- -	1.22%
29	DUKE REALTY CORP アメリカ	投資証券 -	41,900	1,031 43,230,973	978 40,982,180	- -	1.18%
30	SILIC フランス	投資証券 -	4,899	10,118 49,571,538	8,263 40,482,186	- -	1.16%

（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	21,208,900	205 4,361,700,511	218 4,631,239,879	- -	2.02%
2	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	2,641,700	1,684 4,450,224,586	1,733 4,580,378,115	- -	2.00%
3	UNILEVER NV-CVA オランダ	株式 食品・飲料・タ バコ	1,659,300	2,558 4,244,914,994	2,725 4,521,918,386	- -	1.98%
4	TELSTRA CORP オーストラリア	株式 電気通信サービス	17,465,600	243 4,253,226,405	257 4,499,161,265	- -	1.97%
5	HJ HEINZ CO アメリカ	株式 食品・飲料・タ バコ	1,030,000	4,085 4,207,662,128	4,193 4,319,650,050	- -	1.89%
6	DIAGEO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タ バコ	2,597,500	1,625 4,221,856,087	1,660 4,313,373,174	- -	1.88%
7	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS シンガポール	株式 電気通信サービス	21,025,000	196 4,137,893,214	203 4,283,158,335	- -	1.87%
8	POWER ASSETS HOLDINGS LTD 香港	株式 公益事業	7,154,500	597 4,271,251,323	593 4,243,280,291	- -	1.85%
9	AT&T INC アメリカ	株式 電気通信サービス	1,822,700	2,283 4,162,073,088	2,312 4,214,601,869	- -	1.84%
10	FOSTER'S GROUP LTD オーストラリア	株式 食品・飲料・タ バコ	9,455,400	424 4,017,768,711	440 4,166,574,960	- -	1.82%
11	HERSHEY CO/THE アメリカ	株式 食品・飲料・タ バコ	928,000	4,494 4,170,555,884	4,466 4,145,132,400	- -	1.81%
12	CHINA MOBILE LTD 香港	株式 電気通信サービス	5,490,000	770 4,231,248,512	747 4,102,383,285	- -	1.79%
13	SANOFI フランス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	704,700	5,949 4,192,770,859	5,741 4,045,770,294	- -	1.77%
14	KT&G CORP 韓国	株式 食品・飲料・タ バコ	774,400	4,847 3,754,269,164	5,069 3,925,580,736	- -	1.71%
15	STATOIL ASA ノルウェー	株式 エネルギー	1,870,400	1,851 3,463,602,358	2,062 3,856,792,856	- -	1.68%
16	ABBOTT LABORATORIES 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	898,700	4,145 3,725,985,793	4,215 3,788,564,213	- -	1.65%
17	BRISTOL MYERS-SQUIBB 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	1,497,400	2,283 3,419,339,104	2,494 3,736,009,256	- -	1.63%
18	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC イギリス	株式 食品・飲料・タ バコ	1,005,600	3,538 3,558,349,388	3,682 3,703,228,191	- -	1.62%
19	VERIZON COMM	株式	1,238,900	2,846	2,925	-	1.58%

	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
	アメリカ	電気通信サービス		3,526,207,254	3,624,689,994	-	
20	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	276,900	12,404 3,434,696,674	13,051 3,614,028,190	-	1.58%
21	PROCTER AND GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パー ソナル用品	713,600	4,753 3,392,298,357	5,032 3,591,375,752	-	1.57%
22	JOHNSON & JOHNSON 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	701,400	5,280 3,703,939,092	5,100 3,577,420,560	-	1.56%
23	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 食品・飲料・タ バコ	655,100	5,328 3,490,589,908	5,359 3,510,882,343	-	1.53%
24	KIMBERLY CLARK CORP アメリカ	株式 家庭用品・パー ソナル用品	595,400	5,198 3,095,179,160	5,471 3,257,592,669	-	1.42%
25	BELGACOM SA ベルギー	株式 電気通信サービ ス	1,301,100	2,558 3,328,690,480	2,456 3,196,744,735	-	1.40%
26	COCA-COLA AMATIL LIMITED オーストラリア	株式 食品・飲料・タ バコ	3,108,100	954 2,965,753,992	1,022 3,179,432,449	-	1.39%
27	MCDONALDS CORP アメリカ	株式 消費者サービス	413,700	6,743 2,789,884,645	7,253 3,000,689,175	-	1.31%
28	ELI LILLY & CO 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	1,008,100	2,942 2,966,674,483	2,976 3,000,377,787	-	1.31%
29	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE 台湾	株式 半導体・半導体 製造装置	16,193,131	181 2,933,353,294	184 2,994,806,226	-	1.31%
30	SODEXO フランス	株式 消費者サービス	512,300	5,783 2,962,732,081	5,789 2,965,907,929	-	1.30%

(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。

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 -	13,969,550	9,116.17 1,273,488,273	9,221.15 1,288,153,159	7.5000 2030/03/31	6.82%
2	NATIONAL POWER CORP フィリピン	社債券 -	9,020,000	8,884.80 801,409,275	8,882.93 801,240,962	6.8750 2016/11/02	4.24%
3	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	5,785,000	10,443.76 604,172,022	10,779.26 623,580,191	8.8750 2019/10/14	3.30%
4	TURKEY REP OF トルコ	国債証券 -	5,750,000	9,596.29 551,786,890	9,723.41 559,096,362	8.0000 2034/02/14	2.96%
5	INTERGAS FINANCE BV オランダ	社債券 -	5,350,000	8,299.81 444,039,968	8,280.37 443,000,062	6.3750 2017/05/14	2.35%
6	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	4,180,000	9,467.61 395,746,411	10,437.16 436,273,288	7.1250 2037/01/20	2.31%
7	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	56,600,000	708.82 401,192,120	747.32 422,984,744	10.0000 2036/11/20	2.24%
8	REPUBLIC OF IRAQ	国債証券	6,211,000	7,153.00	6,696.99	5.8000	2.20%

	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
	イラク	-		444,272,830	415,950,437	2028/01/15	
9	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	4,250,000	8,710.25 370,185,826	9,466.06 402,307,656	6.6250 2037/02/17	2.13%
10	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	4,168,371	7,891.62 328,952,048	7,736.12 322,470,399	6.7500 2024/11/01	1.71%
11	SOCIALIST REP OF VIETNAM ベトナム	国債証券 -	3,880,000	8,178.00 317,306,691	7,965.48 309,060,915	6.7500 2020/01/29	1.64%
12	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	3,500,000	8,400.88 294,031,062	8,319.25 291,173,750	4.8750 2015/03/15	1.54%
13	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	5,650,000	4,626.12 261,376,062	4,917.68 277,849,343	5.2500 2017/04/12	1.47%
14	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券 -	2,863,000	8,399.72 240,484,019	9,634.39 275,832,621	6.5500 2037/03/14	1.46%
15	REPUBLIC OF VENEZUELA ヴェネズエラ	国債証券 -	3,766,000	7,295.74 274,757,907	7,234.24 272,441,807	8.5000 2014/10/08	1.44%
16	REPUBLIC OF LITHUANIA リトアニア	国債証券 -	3,036,000	8,919.86 270,807,215	8,791.19 266,900,604	7.3750 2020/02/11	1.41%
17	PEMEX PROJ FDG MASTER TR アメリカ	社債券 -	2,882,000	8,454.76 243,666,420	8,669.12 249,844,182	5.7500 2018/03/01	1.32%
18	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	3,000,000	8,134.59 244,037,812	8,206.51 246,195,375	5.6250 2021/03/30	1.30%
19	TRANSCAPIT (TRANSNEFT) アイルランド	社債券 -	2,550,000	9,680.65 246,856,638	9,586.18 244,447,749	8.7000 2018/08/07	1.29%
20	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	3,000,000	8,319.25 249,577,500	7,697.25 230,917,500	7.6500 2013/06/11	1.22%
21	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	2,547,000	8,907.81 226,882,111	8,996.45 229,139,645	7.0000 2020/06/05	1.21%
22	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	2,985,000	7,930.16 236,715,511	7,427.45 221,709,606	6.5800 2016/11/21	1.17%
23	REPUBLIC OF HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	2,755,000	8,249.27 227,267,526	7,640.10 210,484,858	6.2500 2020/01/29	1.11%
24	GABONESE REPUBLIC ガボン	国債証券 -	2,300,000	9,164.78 210,789,968	9,057.87 208,331,125	8.2000 2017/12/12	1.10%
25	DIGICEL GROUP LTD バミューダ	社債券 -	2,610,000	8,086.00 211,044,600	7,736.12 201,912,862	8.8750 2015/01/15	1.07%
26	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	6,750,000	3,401.56 229,605,468	2,973.93 200,740,781	2.5000 2038/12/31	1.06%
27	CLARENDON ALUMINA PROD ジャマイカ	特殊債券 -	2,500,000	7,969.37 199,234,375	7,930.50 198,262,500	8.5000 2021/11/16	1.05%
28	GOVERNMENT OF JAMAICA ジャマイカ	国債証券 -	2,225,000	9,164.78 203,916,382	8,766.31 195,050,453	10.6250 2017/06/20	1.03%
29	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券 -	2,000,000	8,377.56 167,551,250	9,252.25 185,045,000	6.3750 2034/10/23	0.98%
30	LEBANESE REPUBLIC レバノン	国債証券 -	2,000,000	8,785.75 175,715,000	8,950.96 179,019,375	8.5000 2015/08/06	0.95%

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

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	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	1,324,000	11,442.75 151,502,049	11,459.20 151,719,933	4.0000 2013/04/25	6.32%
2	GERMAN TREASURY BILL ドイツ	国債証券 -	1,100,000	10,968.28 120,651,172	10,959.48 120,554,284	- 2011/11/23	5.03%
3	UK GILT イギリス	国債証券 -	651,000	12,546.93 81,680,550	14,337.04 93,334,151	4.2500 2046/12/07	3.89%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	969,000	10,161.92 98,469,010	9,335.22 90,458,319	3.7500 2021/03/01	3.77%
5	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	629,000	13,492.35 84,866,914	13,773.98 86,638,339	5.7500 2032/10/25	3.61%
6	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	605,000	11,430.86 69,156,720	11,547.85 69,864,523	3.7500 2013/07/04	2.91%
7	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	536,000	11,606.56 62,211,199	12,859.10 68,924,824	4.0000 2037/01/04	2.87%
8	UK GILT イギリス	国債証券 -	442,000	13,910.14 61,482,856	13,734.44 60,706,253	3.7500 2021/09/07	2.53%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	社債券 -	550,000	11,139.95 61,269,743	11,003.91 60,521,521	3.6250 2011/12/12	2.52%
10	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	500,000	11,055.36 55,276,803	11,337.43 56,687,157	2.5000 2021/01/04	2.36%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	637,000	10,123.13 64,484,370	8,754.85 55,768,445	5.0000 2040/09/01	2.32%
12	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	484,000	11,189.52 54,157,312	10,710.98 51,841,178	4.2500 2014/08/01	2.16%
13	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	451,000	11,166.31 50,360,082	11,012.68 49,667,230	4.4000 2015/01/31	2.07%
14	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	444,000	11,723.61 52,052,831	10,739.51 47,683,432	5.2500 2017/08/01	1.99%
15	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	420,000	10,897.79 45,770,730	10,426.83 43,792,721	5.7500 2032/07/30	1.83%
16	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	297,000	13,220.05 39,263,563	14,456.48 42,935,765	5.5000 2028/01/15	1.79%
17	UK GILT イギリス	国債証券 -	288,000	12,411.26 35,744,453	14,117.80 40,659,273	4.2500 2039/09/07	1.69%
18	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	281,000	12,455.26 34,999,303	12,370.89 34,762,227	4.7500 2035/04/25	1.45%
19	SWEDISH GOVERNMENT スウェーデン	国債証券 -	2,100,000	1,378.27 28,943,705	1,511.71 31,746,018	5.0000 2020/12/01	1.32%
20	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	296,000	10,815.21 32,013,026	10,587.34 31,338,538	4.6000 2019/07/30	1.31%
21	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	261,000	10,761.26 28,086,906	11,786.14 30,761,839	3.0000 2020/07/04	1.28%
22	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	251,000	11,563.43 29,024,219	11,928.76 29,941,208	3.7500 2015/01/04	1.25%
23	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	216,000	13,390.65 28,923,812	13,260.64 28,642,999	6.0000 2016/06/20	1.19%
24	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	244,000	11,648.38 28,422,070	11,191.51 27,307,301	5.0000 2035/03/28	1.14%
25	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券 -	180,000	13,885.33 24,993,605	14,416.44 25,949,596	6.2500 2027/07/15	1.08%
26	UK GILT イギリス	国債証券 -	182,000	12,447.82 22,655,033	14,122.81 25,703,522	4.2500 2032/06/07	1.07%
27	SWEDISH EXPORT CREDIT スウェーデン	特殊債券 -	220,000	11,265.02 24,783,050	11,501.44 25,303,185	3.6250 2014/05/27	1.05%
28	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	320,000	8,864.56 28,366,617	7,837.68 25,080,583	4.0000 2037/02/01	1.05%
29	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	213,000	10,819.60 23,045,748	10,833.86 23,076,127	3.2500 2016/09/28	0.96%
30	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	135,000	16,484.34 22,253,862	16,744.29 22,604,802	8.7500 2017/08/25	0.94%

(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/GS 10/19/12 アメリカ	社債券 -	13,700,000	7,775.00 1,065,175,000	8,018.35 1,098,514,977	1.1500 2012/10/19	99.95%

(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 -	9,300,000	8,241.83 766,490,514	8,395.64 780,795,338	5.3750 2014/05/20	34.67%
2	NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド	国債証券 -	6,000,000	6,709.99 402,599,790	7,038.18 422,291,130	6.0000 2017/12/15	18.75%
3	NEW ZEALAND GOVERNMENT ニュージーランド	国債証券 -	5,200,000	6,774.80 352,289,821	6,720.14 349,447,729	6.5000 2013/04/15	15.52%
4	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	3,000,000,000	7.15 214,730,040	7.10 213,077,781	4.7500 2012/03/10	9.46%
5	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	2,200,000,000	7.23 159,201,411	7.25 159,664,920	4.7500 2014/03/10	7.09%
6	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	10,500,000	1,038.30 109,022,263	1,016.65 106,748,842	4.0600 2012/03/19	4.74%
7	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	1,200,000	6,394.85 76,738,219	6,311.98 75,743,879	2.6250 2012/04/01	3.36%
8	MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	2,900,000	2,505.13 72,649,022	2,516.38 72,975,144	3.7410 2015/02/27	3.24%

(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	74.15%
投資証券	24.21%
合計	98.36%

(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	94.61%
合計	94.61%

(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	98.38%
合計	98.38%

（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	95.07%
合計	95.07%

（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	54.98%
社債券	32.98%
特殊債券	4.63%
地方債証券	0.43%
合計	93.03%

（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	70.50%
社債券	20.93%
特殊債券	2.74%
合計	94.17%

(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	99.95%
合計	99.95%

(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	62.17%
特殊債券	34.67%
合計	96.85%

(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)	
銀行業	11.10%
輸送用機器	10.85%
電気機器	10.27%
化学	8.72%
情報・通信業	7.86%
卸売業	7.34%
機械	4.92%
医薬品	3.77%
建設業	3.53%
小売業	3.24%
石油・石炭製品	2.54%
その他金融業	2.39%
保険業	2.27%
陸運業	2.10%
不動産業	2.03%
食料品	1.98%
ゴム製品	1.57%
その他製品	1.39%
精密機器	1.26%
鉄鋼	0.99%

業種別	投資比率
サービス業	0.99%
電気・ガス業	0.84%
ガラス・土石製品	0.77%
非鉄金属	0.76%
パルプ・紙	0.52%
証券、商品先物取引業	0.45%
金属製品	0.11%
小計	94.61%
合計	94.61%

（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)	
食品・飲料・タバコ	18.90%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14.47%
電気通信サービス	13.81%
エネルギー	6.67%
素材	5.65%
消費者サービス	4.01%
銀行	3.91%
半導体・半導体製造装置	3.35%
小売	2.99%
家庭用品・パーソナル用品	2.99%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.92%
公益事業	2.91%
資本財	2.53%
食品・生活必需品小売り	2.08%
メディア	2.00%
耐久消費財・アパレル	1.89%
保険	1.32%
自動車・自動車部品	0.96%
商業・専門サービス	0.81%
ヘルスケア機器・サービス	0.57%
運輸	0.33%
小計	95.07%
合計	95.07%

(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23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23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 2312月	買建	188	1,415,640,000	1,426,920,000	4.80%

（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
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
第6特定期間末 （平成22年3月29日）	48,227	48,936	0.6584	0.6674
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11月末日	34,540	-	0.6218	-
平成22年12月末日	33,093	-	0.6222	-
平成23年1月末日	32,317	-	0.6283	-
平成23年2月末日	31,595	-	0.6338	-
第8特定期間末 （平成23年3月28日）	30,336	30,802	0.6301	0.6391
平成23年3月末日	30,928	-	0.6455	-
平成23年4月末日	30,440	-	0.6563	-
平成23年5月末日	28,895	-	0.6395	-
平成23年6月末日	27,652	-	0.6337	-
平成23年7月末日	26,348	-	0.6153	-
平成23年8月末日	24,434	-	0.5852	-
第9特定期間末 （平成23年9月27日）	22,105	22,491	0.5447	0.5537
平成23年9月末日	22,371	-	0.5525	-
平成23年10月末日	23,182	-	0.5882	-

（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
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	0.0090
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23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

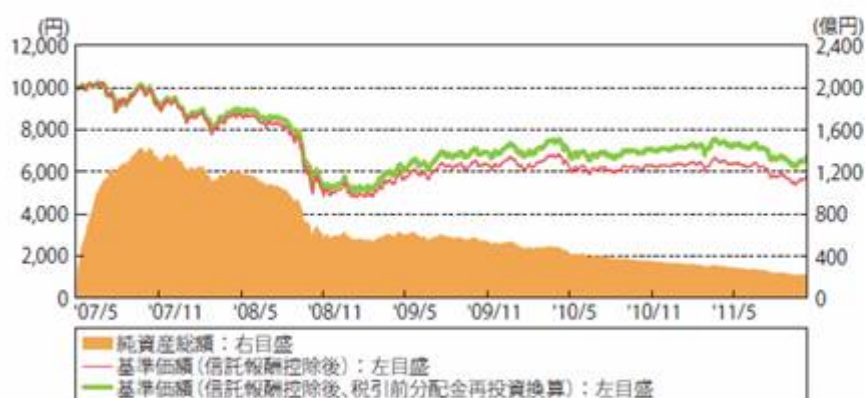
期間	収益率
第1 特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日）	2.5%
第2 特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日）	15.7%
第3 特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日）	4.0%
第4 特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日）	27.1%
第5 特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日）	16.3%
第6 特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	8.7%
第7 特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	3.8%
第8 特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	2.4%
第9 特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	12.1%

（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

（参考情報）

2011年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



* 基準価額(信託報酬控除後、税引前分配金再投資換算)は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

分配の推移

2011年9月	30円
2011年7月	30円
2011年5月	30円
2011年3月	30円
2011年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	950円

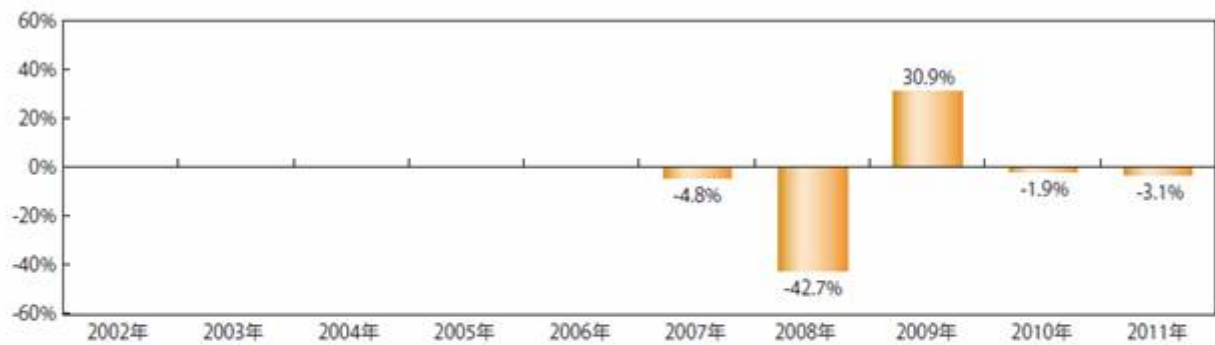
* 分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
世界REITマザーファンド	14.9%
グローバル好配当株マザーファンド	14.8%
欧州債券マザーファンド	10.3%
新興国債券マザーファンド	10.2%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	9.7%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.7%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.7%
日本好配当株マザーファンド	9.5%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	4.8%
コモディティ・マザーファンド	4.7%

* 投資比率は全て純資産総額対比

年間収益率の推移



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2007年は当初設定日(2007年5月22日)から年末までの収益率、2011年は10月末までの収益率です。

*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しております。

*ファンドには、ベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

(4) 設定及び解約の実績

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
第8 特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	273,981,316	11,950,617,466
第9 特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	225,487,243	7,789,551,735

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

[前へ](#)

第2【管理及び運営】

3 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。

(以下略)

(□) 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。

(以下略)

(□) 委託会社とシービーアールイー・クラリオン・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3【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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、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22年9月28日から平成23年3月28日まで）及び当特定期間（平成23年3月29日から平成23年9月27日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

[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23年3月28日現在 金 額（円）	当 期 平成23年9月27日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,348,516	1,261,680
コール・ローン	762,184,647	449,190,155
投資証券	7,365,781,088	5,261,088,988
親投資信託受益証券	22,516,723,218	16,534,843,923
派生商品評価勘定	-	937,502
未収入金	-	199,088,598
流動資産合計	30,646,037,469	22,446,410,846
資産合計	30,646,037,469	22,446,410,846
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	144,445,413	121,753,220
未払解約金	85,815,744	155,500,514
未払受託者報酬	2,186,304	1,738,451
未払委託者報酬	76,520,884	60,846,522
その他未払費用	772,880	707,896
流動負債合計	309,741,225	340,546,603
負債合計	309,741,225	340,546,603
純資産の部		
元本等		
元本	48,148,471,290	40,584,406,798
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,812,175,046	18,478,542,555
（分配準備積立金）	716,361,957	647,706,087
元本等合計	30,336,296,244	22,105,864,243
純資産合計	30,336,296,244	22,105,864,243
負債純資産合計	30,646,037,469	22,446,410,846

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日 金 額 (円)	当 期 自 平成23年 3月29日 至 平成23年 9月27日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	205,513,529	172,004,054
受取利息	253,549	204,882
有価証券売買等損益	1,139,088,032	2,676,675,484
為替差損益	278,998,478	423,602,429
営業収益合計	1,065,856,632	2,928,068,977
営業費用		
受託者報酬	7,082,546	5,759,687
委託者報酬	247,890,326	201,590,858
その他費用	923,069	854,293
営業費用合計	255,895,941	208,204,838
営業利益又は営業損失()	809,960,691	3,136,273,815
経常利益又は経常損失()	809,960,691	3,136,273,815
当期純利益又は当期純損失()	809,960,691	3,136,273,815
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()	43,075,352	51,186,228
期首剰余金又は期首欠損金()	22,477,228,939	17,812,175,046
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,466,147,564	2,888,788,840
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金 減少額	4,466,147,564	2,888,788,840
剰余金減少額又は欠損金増加額	102,227,580	83,936,508
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金 増加額	102,227,580	83,936,508
分配金	465,751,430	386,132,254
期末剰余金又は期末欠損金()	17,812,175,046	18,478,542,555

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。 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られ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られた価額で評価しております。	投資証券及び親投資信託受益証券 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 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。 (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	(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。 (2)当ファンドの特定期間は、当計算期末が休日のため、平成22年9月28日から平成23年3月28日までとなっております。	(1)外貨建資産等の会計処理 同左 (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23年3月29日から平成23年9月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成23年 3月28日現在	平成23年 9月27日現在
1. 元本状況		
期首元本額	59,825,107,440円	48,148,471,290円
期中追加設定元本額	273,981,316円	225,487,243円
期中一部解約元本額	11,950,617,466円	7,789,551,735円
2. 受益権の総数	48,148,471,290口	40,584,406,798口
3. 元本の欠損	17,812,175,046円	18,478,542,555円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	当期 自 平成23年 3月29日 至 平成23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;">22,342,769円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第21期計算期間末（平成22年11月29日）に、投資信託約款に基づき計算した1,173,144,436円（1万口当たり211.05円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い166,756,818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;">170,491,143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;">180,296,218円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">822,357,075円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,173,144,436円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(211.05円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">166,756,818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22期計算期間末（平成23年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,114,755,689円（1万口当たり216.39円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い154,549,199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;">182,026,724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;">168,355,026円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">764,373,939円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,114,755,689円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(216.39円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">154,549,199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23期計算期間末（平成23年3月28日）に、投資信託約款に基づき計算した1,019,460,645円（1万口当たり211.73円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い144,445,413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;">122,001,094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;">158,653,275円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">738,806,276円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,019,460,645円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(211.73円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">144,445,413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）	170,491,143円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	180,296,218円	分配準備積立金	822,357,075円	分配可能額	1,173,144,436円	（1万口当たり分配可能額）	(211.05円)	収益分配金	166,756,818円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	配当等収益 （費用控除後）	182,026,724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	168,355,026円	分配準備積立金	764,373,939円	分配可能額	1,114,755,689円	（1万口当たり分配可能額）	(216.39円)	収益分配金	154,549,199円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	配当等収益 （費用控除後）	122,001,094円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	158,653,275円	分配準備積立金	738,806,276円	分配可能額	1,019,460,645円	（1万口当たり分配可能額）	(211.73円)	収益分配金	144,445,413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;">18,164,123円</p> <p>2. 分配金の計算過程 第24期計算期間末（平成23年5月27日）に、投資信託約款に基づき計算した1,052,043,804円（1万口当たり232.44円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い135,781,314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;">229,426,736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;">150,319,318円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">672,297,750円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">1,052,043,804円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(232.44円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">135,781,314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25期計算期間末（平成23年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した967,393,498円（1万口当たり225.68円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い128,597,720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;">99,588,954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;">143,586,954円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">724,217,590円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">967,393,498円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(225.68円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">128,597,720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26期計算期間末（平成23年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した906,544,050円（1万口当たり223.37円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い121,753,220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;">112,372,666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;">137,084,743円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金</td><td style="text-align: right;">657,086,641円</td></tr> <tr><td>分配可能額</td><td style="text-align: right;">906,544,050円</td></tr> <tr><td>（1万口当たり分配可能額）</td><td style="text-align: right;">(223.37円)</td></tr> <tr><td>収益分配金</td><td style="text-align: right;">121,753,220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）	229,426,736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	150,319,318円	分配準備積立金	672,297,750円	分配可能額	1,052,043,804円	（1万口当たり分配可能額）	(232.44円)	収益分配金	135,781,314円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	配当等収益 （費用控除後）	99,588,954円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	143,586,954円	分配準備積立金	724,217,590円	分配可能額	967,393,498円	（1万口当たり分配可能額）	(225.68円)	収益分配金	128,597,720円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)	配当等収益 （費用控除後）	112,372,666円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	137,084,743円	分配準備積立金	657,086,641円	分配可能額	906,544,050円	（1万口当たり分配可能額）	(223.37円)	収益分配金	121,753,220円	（1万口当たり収益分配金）	(30円)
配当等収益 （費用控除後）	170,491,143円																																																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																																																
収益調整金	180,296,218円																																																																																																
分配準備積立金	822,357,075円																																																																																																
分配可能額	1,173,144,436円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(211.05円)																																																																																																
収益分配金	166,756,818円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																
配当等収益 （費用控除後）	182,026,724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	168,355,026円																																																																																																
分配準備積立金	764,373,939円																																																																																																
分配可能額	1,114,755,689円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(216.39円)																																																																																																
収益分配金	154,549,199円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																
配当等収益 （費用控除後）	122,001,094円																																																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																																																
収益調整金	158,653,275円																																																																																																
分配準備積立金	738,806,276円																																																																																																
分配可能額	1,019,460,645円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(211.73円)																																																																																																
収益分配金	144,445,413円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																
配当等収益 （費用控除後）	229,426,736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	150,319,318円																																																																																																
分配準備積立金	672,297,750円																																																																																																
分配可能額	1,052,043,804円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(232.44円)																																																																																																
収益分配金	135,781,314円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																
配当等収益 （費用控除後）	99,588,954円																																																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																																																
収益調整金	143,586,954円																																																																																																
分配準備積立金	724,217,590円																																																																																																
分配可能額	967,393,498円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(225.68円)																																																																																																
収益分配金	128,597,720円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																
配当等収益 （費用控除後）	112,372,666円																																																																																																
有価証券売買等損益	0円																																																																																																
収益調整金	137,084,743円																																																																																																
分配準備積立金	657,086,641円																																																																																																
分配可能額	906,544,050円																																																																																																
（1万口当たり分配可能額）	(223.37円)																																																																																																
収益分配金	121,753,220円																																																																																																
（1万口当たり収益分配金）	(30円)																																																																																																

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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、当ファンドは投資証券、親投資信託受益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。	同左
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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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	前期	当期
	平成23年 3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (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 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成23年3月28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	48,587,913
投資証券	18,984,084
合計	67,571,997

当期（平成23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	2,439,955,611
投資証券	453,505,503
合計	2,893,461,114

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前期（平成23年3月28日現在）

該当事項はありません。

（通貨関連）

区分	種類	当期 平成23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	200,000,000	-	199,062,498	937,502
	合計	-	-	199,062,498	937,502

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

前期（自平成22年9月28日 至 平成23年3月28日）

該当事項はありません。

当期（自平成23年3月29日 至 平成23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23年3月28日現在	当期 平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.6301円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,301円）」	1口当たり純資産額 0.5447円 「1口 = 1円（10,000口 = 5,447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 受益証券	日本好配当株マザーファンド	3,770,911,229	2,376,805,347	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	7,276,360,074	3,227,065,692	
	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	4,089,937,928	3,336,162,367	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,132,833,788	2,218,147,139	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	3,037,728,729	2,268,879,587	
	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	2,375,547,075	2,082,879,675	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,773,804,286	1,024,904,116	
	小計（日本）7銘柄		24,457,123,109	16,534,843,923	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV-Global Emerging Markets Equity Fund	2,046,537.580	12,238,294.720	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV-Global High Yield Bond Fund	3,015,166.440	27,739,531.240	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV-U.S. Aggregate Bond Fund	2,662,344.020	28,992,926.370	
	小計（アメリカ・ドル）3銘柄		7,724,048.040	68,970,752.330 (5,261,088,988)	
合計				21,795,932,911 (5,261,088,988)	

- (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	23.79%	24.14%

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](#)

< 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23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,731,178,652	1,555,363,468
株式	35,653,530,600	28,291,583,400
派生商品評価勘定	35,930,227	2,831,544
未収入金	1,535,425,145	384,780,062
未収配当金	69,577,500	22,459,200
前払金	139,837,000	50,572,000
差入委託証拠金	52,845,000	36,660,000
流動資産合計	40,218,324,124	30,344,249,674
資産合計	40,218,324,124	30,344,249,674
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	169,356,442	-
未払金	1,452,416,899	297,313,849
未払解約金	14,865,090	39,412,430
流動負債合計	1,636,638,431	336,726,279
負債合計	1,636,638,431	336,726,279
純資産の部		
元本等		
元本	55,301,996,441	47,605,062,079
剰余金		
剰余金又は欠損金()	16,720,310,748	17,597,538,684
元本等合計	38,581,685,693	30,007,523,395
純資産合計	38,581,685,693	30,007,523,395
負債純資産合計	40,218,324,124	30,344,249,674

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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られ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られ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23年 3月28日現在	平成23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	66,796,500,910円	55,301,996,441円
期中追加設定元本額	984,814,397円	286,858,251円
期中一部解約元本額	12,479,318,866円	7,983,792,613円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	50,884,128,054円	43,834,150,850円
グローバル資産分散オープン	4,417,868,387円	3,770,911,229円
合計	55,301,996,441円	47,605,062,079円
2. 受益権の総数	55,301,996,441口	47,605,062,079口
3. 元本の欠損	16,720,310,748円	17,597,538,684円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左

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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	214,983,983
合計	214,983,983

「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10月9日から平成23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	2,149,252,069
合計	2,149,252,069

「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23年4月9日から平成23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）
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23年3月28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	2,440,991,215	-	2,307,565,000	133,426,215
合計		-	-	2,307,565,000	133,426,215

区分	種類	平成23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	1,401,528,456	-	1,404,360,000	2,831,544
合計		-	-	1,404,360,000	2,831,544

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22年9月28日 至 平成23年3月28日）
該当事項はありません。

（自平成23年3月29日 至 平成23年9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年3月28日現在	平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.6977円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,977円）」	1口当たり純資産額 0.6303円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,303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	ホクト	18,000	1,712	30,816,000	
	コムシスホールディングス	205,000	740	151,700,000	
	鹿島建設	1,170,000	247	288,990,000	
	大東建託	70,000	7,180	502,600,000	
	協和エクシオ	139,000	710	98,690,000	
	三機工業	138,000	411	56,718,000	
	日揮	52,000	1,959	101,868,000	
	高砂熱学工業	127,000	662	84,074,000	
	NECネットエスアイ	60,000	1,082	64,920,000	
	キリンホールディングス	107,000	975	104,325,000	
	コカ・コーラウエスト	90,000	1,368	123,120,000	
	伊藤園	31,000	1,378	42,718,000	
	日本たばこ産業	907	367,000	332,869,000	
	王子製紙	215,000	422	90,730,000	
	クラレ	53,000	1,075	56,975,000	
	旭化成	250,000	467	116,750,000	
住友化学	115,000	303	34,845,000		

エア・ウォーター	168,000	948	159,264,000
保土谷化学工業	581,000	275	159,775,000
日本触媒	323,000	940	303,620,000
三菱瓦斯化学	485,000	474	229,890,000
三井化学	135,000	256	34,560,000
東京応化工業	24,000	1,546	37,104,000
日本合成化学工業	275,000	419	115,225,000
住友ベークライト	398,000	407	161,986,000
宇部興産	1,210,000	254	307,340,000
ADEKA	36,000	821	29,556,000
日油	217,000	396	85,932,000
花王	189,000	2,125	401,625,000
太陽ホールディングス	66,800	2,163	144,488,400
ポーラ・オルビスホールディングス	15,000	2,271	34,065,000
ニフコ	56,800	1,958	111,214,400
日本バルカー工業	143,000	204	29,172,000
武田薬品工業	31,600	3,745	118,342,000
アステラス製薬	114,600	2,930	335,778,000
田辺三菱製薬	195,000	1,377	268,515,000
日本新薬	115,000	941	108,215,000
科研製薬	120,000	1,036	124,320,000
エーザイ	56,000	3,190	178,640,000
小野薬品工業	39,000	4,585	178,815,000
参天製薬	90,300	3,150	284,445,000
第一三共	105,000	1,605	168,525,000
昭和シェル石油	110,000	535	58,850,000
東燃ゼネラル石油	268,000	864	231,552,000
JXホールディングス	1,506,000	434	653,604,000
横浜ゴム	440,000	433	190,520,000
住友ゴム工業	270,500	955	258,327,500
旭硝子	131,000	730	95,630,000
ニチアス	62,000	418	25,916,000
住友金属工業	2,553,000	161	411,033,000
丸一鋼管	20,800	1,836	38,188,800
愛知製鋼	150,000	441	66,150,000
古河スカイ	240,000	223	53,520,000
アサヒホールディングス	32,000	1,633	52,256,000
住生活グループ	20,000	2,068	41,360,000
オイレス工業	110,000	1,434	157,740,000
クボタ	423,000	642	271,566,000
ダイフク	105,000	404	42,420,000
マックス	172,000	922	158,584,000
NTN	260,000	369	95,940,000
キッツ	410,000	352	144,320,000
ブラザー工業	24,000	860	20,640,000
日立製作所	968,000	381	368,808,000
東芝テック	190,000	276	52,440,000
富士通	310,000	353	109,430,000
シャープ	50,000	610	30,500,000
山武	158,800	1,620	257,256,000
ローム	13,400	4,000	53,600,000
村田製作所	101,700	4,300	437,310,000
キヤノン電子	175,000	2,020	353,500,000
キヤノン	258,400	3,505	905,692,000
リコー	19,000	646	12,274,000
豊田自動織機	142,000	2,215	314,530,000
東海理化電機製作所	142,000	1,323	187,866,000
日産自動車	970,000	648	628,560,000
トヨタ自動車	121,800	2,660	323,988,000
ティラド	285,000	283	80,655,000
アイシン精機	81,000	2,495	202,095,000
本田技研工業	338,900	2,321	786,586,900
エクセディ	34,500	2,871	99,049,500
タムロン	79,000	2,360	186,440,000

HOYA	117,600	1,826	214,737,600
バンダイナムコホールディングス	115,000	1,022	117,530,000
ピジョン	35,000	3,055	106,925,000
中部電力	122,000	1,495	182,390,000
関西電力	115,100	1,384	159,298,400
九州電力	33,000	1,295	42,735,000
北海道電力	59,000	1,166	68,794,000
電源開発	30,000	2,272	68,160,000
東京瓦斯	390,000	357	139,230,000
大阪瓦斯	325,000	317	103,025,000
東日本旅客鉄道	64,500	4,580	295,410,000
西日本旅客鉄道	35,200	3,350	117,920,000
日本通運	120,000	315	37,800,000
山九	273,000	333	90,909,000
新日鉄ソリューションズ	60,000	1,659	99,540,000
ティーガイア	850	164,400	139,740,000
野村総合研究所	40,000	1,721	68,840,000
オービック	2,800	14,340	40,152,000
トレンドマイクロ	17,000	2,335	39,695,000
日本オラクル	29,600	2,674	79,150,400
伊藤忠テクノソリューションズ	76,000	3,230	245,480,000
日本電信電話	128,800	3,720	479,136,000
KDDI	410	576,000	236,160,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,798	143,700	976,872,600
エヌ・ティ・ティ・データ	320	240,400	76,928,000
カブコン	109,000	1,783	194,347,000
伊藤忠商事	589,000	761	448,229,000
三井物産	451,000	1,208	544,808,000
住友商事	352,400	994	350,285,600
三菱商事	302,800	1,622	491,141,600
オートバックスセブン	55,500	3,440	190,920,000
ローソン	96,600	4,460	430,836,000
カワチ薬品	40,200	1,474	59,254,800
セブン&アイ・ホールディングス	200,000	2,231	446,200,000
良品計画	39,000	4,120	160,680,000
ユニテッドアローズ	52,000	1,341	69,732,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	157,000	607	95,299,000
丸井グループ	98,000	564	55,272,000
イオン	297,000	1,021	303,237,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,509,700	343	860,827,100
三井住友トラスト・ホールディングス	2,806,000	255	715,530,000
千葉銀行	467,000	531	247,977,000
横浜銀行	682,000	378	257,796,000
ふくおかフィナンシャルグループ	470,000	312	146,640,000
みずほフィナンシャルグループ	7,188,600	113	812,311,800
野村ホールディングス	475,000	283	134,425,000
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	18,000	1,673	30,114,000
東京海上ホールディングス	160,000	1,874	299,840,000
クレディセゾン	140,000	1,497	209,580,000
イオンクレジットサービス	193,000	1,102	212,686,000
日立キャピタル	304,000	933	283,632,000
野村不動産ホールディングス	248,500	1,076	267,386,000
東京建物	255,000	225	57,375,000
東急不動産	865,000	270	233,550,000
住友不動産販売	12,000	3,125	37,500,000
NECフィールディング	63,500	953	60,515,500
メッセージ	330	256,800	84,744,000
もしもしホットライン	63,000	1,438	90,594,000
セコム	18,000	3,655	65,790,000
ベネッセホールディングス	78,500	3,365	264,152,500
合計 141銘柄	41,829,415	-	28,291,583,400

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△](#) [次△](#)

世界REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成23年 3月28日現在 金額(円)	平成23年 9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	47,756,401	37,388,260
コール・ローン	12,040,200	10,717,844
投資証券	4,440,840,057	3,206,037,001
派生商品評価勘定	274,556	-
未収入金	31,091,688	-
未収配当金	5,210,970	4,842,477
流動資産合計	4,537,213,872	3,258,985,582
資産合計	4,537,213,872	3,258,985,582
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	264,171	-
流動負債合計	264,171	-
負債合計	264,171	-
純資産の部		
元本等		
元本	8,495,927,261	7,348,838,907
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,958,977,560	4,089,853,325
元本等合計	4,536,949,701	3,258,985,582
純資産合計	4,536,949,701	3,258,985,582
負債純資産合計	4,537,213,872	3,258,985,582

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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、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。</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 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	<p>(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。</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 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。</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	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23年 3月28日現在	平成23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	11,324,671,189円	8,495,927,261円
期中追加設定元本額	505,406円	641,981,366円
期中一部解約元本額	2,829,249,334円	1,789,069,720円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	8,390,038,676円	7,276,360,074円
グローバル・リート・インカム・ファンド	105,888,585円	72,478,833円
合計	8,495,927,261円	7,348,838,907円
2. 受益権の総数	8,495,927,261口	7,348,838,907口
3. 元本の欠損	3,958,977,560円	4,089,853,325円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左
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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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23年 3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 - (2)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28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	376,244,507
合計	376,244,507

「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23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	376,981,102
合計	376,981,102

「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23年3月29日から平成23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)

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23年3月28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	30,821,782	-	31,096,338	274,556
	売建 オーストラリア・ドル	15,791,035	-	15,980,298	189,263
	シンガポール・ドル	15,030,747	-	15,105,655	74,908
	合計	-	-	62,182,291	10,385

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。

(平成23年9月27日現在)

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22年9月28日 至 平成23年3月28日)

該当事項はありません。

(自平成23年3月29日 至 平成23年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年3月28日現在	平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.5340円 「1口 = 1円(10,000口 = 5,340円)」	1口当たり純資産額 0.4435円 「1口 = 1円(10,000口 = 4,435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	日本アコモデーションファンド投資法人	60	32,040,000	
	投資証券	産業ファンド投資法人	47	17,672,000	
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	65	9,230,000	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	62	49,414,000	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	338	26,059,800	
	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	53	39,538,000	
	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	65	20,767,500	
		小計（日本）7銘柄		690	194,721,300
アメリカ・ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,934.000	422,141.920	
	投資証券	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	11,500.000	430,905.000	
	投資証券	APARTMENT INVT & MGMT CO-U	10,678.000	269,833.060	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	21,425.000	505,630.000	
	投資証券	COUSINS PROPERTIES INC-A	15,475.000	383,006.250	
	投資証券	COUSINS PROPERTIES INC-B	15,729.000	380,641.800	
	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,500.000	524,495.000	
	投資証券	DUKE REALTY CORP	57,200.000	604,032.000	
	投資証券	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	22,800.000	901,740.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	14,596.000	778,550.640	
	投資証券	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	18,700.000	244,596.000	
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	37,400.000	467,126.000	
	投資証券	GLIMCHER REALTY TRUST - G	29,895.000	727,345.350	
	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	38,531.000	1,849,488.000	
	投資証券	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	21,300.000	479,676.000	
	投資証券	KITE REALTY GROUP TRUST	65,928.000	244,592.880	
	投資証券	LASALLE HOTEL PROPERTIES-D	22,235.000	544,090.450	
	投資証券	LTC PROPERTIES INC	10,800.000	282,528.000	
	投資証券	MACK-CALI REALTY CORP	14,600.000	404,566.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	19,452.000	2,207,802.000	
	投資証券	VENTAS INC	7,000.000	349,860.000	
	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	6,633.000	525,399.930	
	小計（アメリカ・ドル）22銘柄		478,311.000	13,528,046.280 (1,031,919,370)	
カナダ・ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	39,367.000	927,880.190	
	投資証券	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	19,200.000	493,632.000	
	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,705.000	500,175.500	
	投資証券	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	30,400.000	221,008.000	
	投資証券	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	14,000.000	439,040.000	
	投資証券	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	17,700.000	361,788.000	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,863.000	568,438.000	
		小計（カナダ・ドル）7銘柄		166,235.000	3,511,961.690 (261,008,992)
オーストラリア・ドル	投資証券	CHARTER HALL RETAIL REIT	248,400.000	767,556.000	
	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	993,200.000	804,492.000	
	投資証券	GPT GROUP	300,000.000	936,000.000	
	投資証券	INVESTA OFFICE FUND	853,970.000	495,302.600	
	投資証券	STOCKLAND	386,238.000	1,062,154.500	
	投資証券	WESTFIELD GROUP	297,592.000	2,223,012.240	
	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	563,992.000	1,353,580.800	
		小計（オーストラリア・ドル）7銘柄		3,643,392.000	7,642,098.140 (570,559,047)
シンガポール・ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	461,205.000	959,306.400	
	投資証券	CAPITACOMMERCIAL TRUST	495,500.000	510,365.000	
	投資証券	CAPITAMALL TRUST	696,356.000	1,284,776.820	
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	577,120.000	484,780.800	
		小計（シンガポール・ドル）4銘柄		2,230,181.000	3,239,229.020 (190,855,373)
イギリス・ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	230,815.000	1,100,987.550	
	投資証券	DERWENT LONDON PLC	31,378.000	474,121.580	
	投資証券	HAMMERSON PLC	190,000.000	697,300.000	
	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,986.000	772,781.310	
	投資証券	SEGRO PLC	249,398.000	541,193.660	

	小計(イギリス・ポンド)5銘柄		823,577.000	3,586,384.100 (424,914,788)
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	33,824.000	285,576.030
	投資証券	BEFIMMO S.C.A.	4,047.000	223,960.980
	投資証券	COFINIMMO	3,195.000	287,454.150
	投資証券	CORIO NV	18,150.000	597,951.750
	投資証券	EUROCOMMERCIAL	13,655.000	385,548.920
	投資証券	ICADE	8,700.000	482,589.000
	投資証券	KLEPIERRE	17,933.000	357,763.350
	投資証券	SILIC	4,099.000	289,799.300
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,460.000	1,590,519.000
	投資証券	VASTNED RETAIL NV	5,284.000	191,597.840
	投資証券	WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,442.000	481,895.700
	小計(ユーロ)11銘柄		134,789.000	5,174,656.020 (532,058,131)
合計				3,206,037.001 (3,011,315,701)

- (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 22銘柄	31.66%	32.19%
カナダ・ドル	投資証券 7銘柄	8.01%	8.14%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	17.51%	17.80%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	5.86%	5.95%
イギリス・ポンド	投資証券 5銘柄	13.04%	13.25%
ユーロ	投資証券 11銘柄	16.32%	16.60%

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23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	10,078,438,796	6,333,383,429
コール・ローン	9,610,820,027	7,934,388,621
株式	313,256,199,528	198,792,681,997
派生商品評価勘定	7,718,634	635,748
未収入金	584,670,296	-
未収配当金	1,071,642,753	905,057,015
流動資産合計	334,609,490,034	213,966,146,810
資産合計	334,609,490,034	213,966,146,810
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,725,202	1,815,987
未払金	911,155,223	-
未払解約金	558,727,319	366,874,717
流動負債合計	1,478,607,744	368,690,704
負債合計	1,478,607,744	368,690,704
純資産の部		
元本等		
元本	329,259,739,545	261,851,572,335
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,871,142,745	48,254,116,229
元本等合計	333,130,882,290	213,597,456,106
純資産合計	333,130,882,290	213,597,456,106
負債純資産合計	334,609,490,034	213,966,146,810

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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
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23年 3月28日現在	平成23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	439,448,659,766円	329,259,739,545円
期中追加設定元本額	21,765,214,502円	7,709,115,800円
期中一部解約元本額	131,954,134,723円	75,117,283,010円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	324,644,177,247円	257,761,634,407円
グローバル資産分散オープン	4,615,562,298円	4,089,937,928円
合計	329,259,739,545円	261,851,572,335円
2. 受益権の総数	329,259,739,545口	261,851,572,335口
3. 元本の欠損	-	48,254,116,229円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左
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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年 3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,543,593,575
合計	7,543,593,575

「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23年1月12日から平成23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	17,366,708,488
合計	17,366,708,488

「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23年7月9日から平成23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)

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23年3月28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	581,770,955	-	585,824,238	4,053,283
	シンガポール・ドル	907,489,871	-	911,155,222	3,665,351
	売建				
	アメリカ・ドル	907,489,871	-	913,315,732	5,825,861
	シンガポール・ドル	581,770,955	-	584,670,296	2,899,341
合計		-	-	2,994,965,488	1,006,568

区分	種類	平成23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	183,144,281	-	181,328,294	1,815,987
	売建				
	オーストラリア・ドル	183,144,281	-	182,508,533	635,748
合計		-	-	363,836,827	1,180,239

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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日）
該当事項はありません。

（自 平成23年 3月29日 至 平成23年 9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 3月28日現在		平成23年 9月27日現在	
1口当たり純資産額	1.0118円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,118円）」	1口当たり純資産額	0.8157円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,157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	898,700	50.750	45,609,025.000	
	ALTRIA GROUP INC	637,200	26.000	16,567,200.000	
	AT&T INC	1,822,700	28.340	51,655,318.000	
	BARRICK GOLD CORP	448,200	47.390	21,240,198.000	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	1,497,400	30.940	46,329,556.000	
	CARDINAL HEALTH INC	573,700	43.350	24,869,895.000	
	CBS CORP-CL B	260,700	22.010	5,738,007.000	
	CHEVRON CORP	121,800	91.510	11,145,918.000	
	COCA-COLA CO/THE	655,100	68.760	45,044,676.000	
	CONAGRA FOODS INC	732,500	24.150	17,689,875.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	535,500	56.790	30,411,045.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	206,400	47.840	9,874,176.000	
	ELI LILLY & CO	1,008,100	36.640	36,936,784.000	
	GENUINE PARTS CO	399,100	50.820	20,282,262.000	
	HERSHEY CO/THE	928,000	60.000	55,680,000.000	
	HJ HEINZ CO	1,030,000	50.720	52,241,600.000	
	JOHNSON & JOHNSON	701,400	62.690	43,970,766.000	
	KIMBERLY CLARK CORP	787,300	70.800	55,740,840.000	
	LIMITED BRANDS INC	469,300	42.270	19,837,311.000	
	MATTEL INC	683,500	26.050	17,805,175.000	
	MCDONALDS CORP	502,200	89.340	44,866,548.000	
	MERCK & CO INC	933,400	31.600	29,495,440.000	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	89,500	55.050	4,926,975.000	
	PFIZER INC	2,478,800	17.770	44,048,276.000	
	PROCTER AND GAMBLE CO	713,600	62.540	44,628,544.000	
	REYNOLDS AMERICAN INC	849,800	37.060	31,493,588.000	
	SCHLUMBERGER LTD	77,500	63.270	4,903,425.000	
	STARBUCKS CORP	313,300	39.520	12,381,616.000	
	TIFFANY & CO	123,900	69.890	8,659,371.000	
	VERIZON COMM	1,238,900	36.360	45,046,404.000	
	YUM! BRANDS INC	459,000	52.600	24,143,400.000	
小計（アメリカ・ドル）31銘柄	22,176,500	-	923,263,214.000 (70,426,517,964)		
オーストラリア・ドル	AMP LTD	5,323,200	3.720	19,802,304.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	933,500	18.780	17,531,130.000	
	BRAMBLES LTD	3,310,100	6.410	21,217,741.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	3,108,100	12.090	37,576,929.000	
	COMMONWEALTH BK	396,300	43.850	17,377,755.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	9,455,400	5.260	49,735,404.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	810,300	21.160	17,145,948.000	
	ORICA LTD	554,600	21.440	11,890,624.000	
	SANTOS LTD	981,200	10.400	10,204,480.000	
	TELSTRA CORP	17,465,600	3.040	53,095,424.000	
	WESFARMERS LIMITED	1,030,300	30.470	31,393,241.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	948,900	19.190	18,209,391.000	
	WOOLWORTHS LIMITED	1,002,100	24.770	24,822,017.000	
小計（オーストラリア・ドル）13銘柄	45,319,600	-	330,002,388.000 (24,637,978,288)		

香港・ドル	CHINA MERCHANTS HLDGS INT	2,950,000	19.980	58,941,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	5,490,000	75.600	415,044,000.000	
	CNOOC LTD	4,820,000	11.880	57,261,600.000	
	HANG SENG BANK LTD	707,900	98.600	69,798,940.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	7,154,500	62.100	444,294,450.000	
	小計（香港・ドル）5銘柄	21,122,400	-	1,045,339,990.000 (10,223,425,102)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	1,728,000	8.050	13,910,400.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	3,840,000	3.350	12,864,000.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	8,609,000	3.720	32,025,480.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	21,025,000	3.090	64,967,250.000	
	小計（シンガポール・ドル）4銘柄	35,202,000	-	123,767,130.000 (7,292,359,300)	
台湾・ドル	DELTA ELECTRONICS INC	3,556,547	76.000	270,297,572.000	
	HTC CORP	1,082,850	638.000	690,858,300.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	1,100,000	664.000	730,400,000.000	
	MEDIATEK INC	1,800,000	306.000	550,800,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	9,200,000	50.000	460,000,000.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	7,400,000	75.000	555,000,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	16,193,131	67.200	1,088,178,403.200	
	小計（台湾・ドル）7銘柄	40,332,528	-	4,345,534,275.200 (10,863,835,688)	
イギリス・ポンド	ARM HOLDINGS PLC	4,220,200	5.640	23,801,928.000	
	ASTRAZENECA PLC	636,300	27.835	17,711,410.500	
	BHP BILLITON PLC	448,400	17.470	7,833,548.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,005,600	27.090	27,241,704.000	
	BT GROUP PLC	5,493,100	1.710	9,393,201.000	
	DIAGEO PLC	2,597,500	12.350	32,079,125.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	2,641,700	13.295	35,121,401.500	
	PEARSON PLC	1,327,500	11.370	15,093,675.000	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	302,200	61.700	18,645,740.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	465,200	19.995	9,301,674.000	
	VODAFONE GROUP PLC	21,208,900	1.625	34,464,462.500	
	小計（イギリス・ポンド）11銘柄	40,346,600	-	230,687,869.500 (27,331,898,778)	
スイス・フラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	276,900	140.100	38,793,690.000	
	小計（スイス・フラン）1銘柄	276,900	-	38,793,690.000 (3,276,515,057)	
ノルウェー・クローネ	SEADRILL LTD	446,800	167.700	74,928,360.000	
	STATOIL ASA	1,870,400	119.500	223,512,800.000	
	TELENOR ASA	1,268,700	86.450	109,679,115.000	
	小計（ノルウェー・クローネ）3銘柄	3,585,900	-	408,120,275.000 (5,387,187,630)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	1,048,500	107.700	112,923,450.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	499,300	193.600	96,664,480.000	
	小計（スウェーデン・クローナ）2銘柄	1,547,800	-	209,587,930.000 (2,336,905,419)	
韓国・ウォン	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	143,700	91,600.000	13,162,920,000.000	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	207,200	90,200.000	18,689,440,000.000	
	KT&G CORP	894,900	71,500.000	63,985,350,000.000	
	LG CHEM LTD	41,900	299,500.000	12,549,050,000.000	
	LG ELECTRONICS INC	173,100	58,400.000	10,109,040,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	57,400	133,500.000	7,662,900,000.000	
	小計（韓国・ウォン）6銘柄	1,518,200	-	126,158,700,000.000 (8,124,620,280)	
ユーロ	ACCOR SA	553,200	19.750	10,925,700.000	
	ADIDAS AG	471,900	47.190	22,268,961.000	
	AIR LIQUIDE SA	178,700	85.280	15,239,536.000	
	BANCO SANTANDER	1,904,100	5.916	11,264,655.600	
	BASF SE	173,100	45.400	7,858,740.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	209,200	50.800	10,627,360.000	
	BELGACOM SA	1,301,100	22.025	28,656,727.500	
	INDITEX	179,300	65.200	11,690,360.000	
	LINDE AG	152,500	99.020	15,100,550.000	
	MICHELIN (CGDE)-B	125,900	44.295	5,576,740.500	

SAMPO OYJ-A SHS	675,900	18.050	12,199,995.000	
SANOFI	704,700	48.100	33,896,070.000	
SODEXO	512,300	49.270	25,241,021.000	
TECHNIP SA	318,800	57.790	18,423,452.000	
TOTAL SA	436,400	31.315	13,665,866.000	
UNILEVER NV-CVA	1,659,300	23.115	38,354,719.500	
小計（ユーロ）16銘柄	9,556,400	-	280,990,454.100 (28,891,438,491)	
合計	220,984,828	-	198,792,681,997 (198,792,681,997)	

- (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	外国株式 31銘柄	32.97%	35.43%
オーストラリア・ドル	外国株式 13銘柄	11.53%	12.39%
香港・ドル	外国株式 5銘柄	4.79%	5.14%
シンガポール・ドル	外国株式 4銘柄	3.41%	3.67%
台湾・ドル	外国株式 7銘柄	5.09%	5.46%
イギリス・ポンド	外国株式 11銘柄	12.80%	13.75%
スイス・フラン	外国株式 1銘柄	1.53%	1.65%
ノルウェー・クローネ	外国株式 3銘柄	2.52%	2.71%
スウェーデン・クローナ	外国株式 2銘柄	1.09%	1.18%
韓国・ウォン	外国株式 6銘柄	3.80%	4.09%
ユーロ	外国株式 16銘柄	13.53%	14.53%

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](#)

新興国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,299,981,791	811,494,805
コール・ローン	204,015,593	220,064,936
国債証券	14,719,113,501	10,037,653,444
地方債証券	117,415,345	76,661,400
特殊債券	940,174,887	911,295,321
社債券	7,169,179,910	5,964,686,515
派生商品評価勘定	2,097,370	20,530,174
未収入金	-	42,536,270
未収利息	441,833,944	349,220,645
前払費用	22,632,134	12,954,676
流動資産合計	24,916,444,475	18,447,098,186
資産合計	24,916,444,475	18,447,098,186
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	526,083	34,273,598
未払金	-	37,477,508
未払解約金	4,000,000	19,999,999
流動負債合計	4,526,083	91,751,105
負債合計	4,526,083	91,751,105
純資産の部		
元本等		
元本	22,278,921,090	17,649,465,267
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,632,997,302	705,881,814
元本等合計	24,911,918,392	18,355,347,081
純資産合計	24,911,918,392	18,355,347,081
負債純資産合計	24,916,444,475	18,447,098,186

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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23年 3月28日現在	平成23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	24,368,567,044円	22,278,921,090円
期中追加設定元本額	1,056,493,011円	18,799,217円
期中一部解約元本額	3,146,138,965円	4,648,255,040円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	2,748,450,128円	2,132,833,788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）	15,524,161,832円	13,167,059,232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）	4,006,309,130円	2,349,572,247円
合計	22,278,921,090円	17,649,465,267円
2. 受益権の総数	22,278,921,090口	17,649,465,267口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左
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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年 3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)金銭債権及び金銭債務 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成23年3月28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	853,799,999
地方債証券	2,509,074
特殊債証券	9,372,615
社債証券	85,531,187
合計	951,212,875

「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11月9日から平成23年3月28日まで）を指しております。

（平成23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	407,190,535
地方債証券	10,107,100
特殊債証券	34,352,889
社債証券	403,335,732
合計	854,986,256

「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23年5月10日から平成23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）

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23年3月28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 メキシコ・ペソ	133,276,676	-	135,022,799	1,746,123
	売建 アメリカ・ドル	143,276,676	-	143,451,512	174,836
	合計	-	-	278,474,311	1,571,287

区分	種類	平成23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	303,961,680	-	293,644,256	10,317,424
	メキシコ・ペソ	252,237,957	-	228,281,783	23,956,174
	売建 アメリカ・ドル	252,237,957	-	249,617,983	2,619,974
	メキシコ・ペソ	303,961,680	-	286,051,480	17,910,200
	合計	-	-	1,057,595,502	13,743,424

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

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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日）

該当事項はありません。

（自 平成23年 3月29日 至 平成23年 9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年 3月28日現在	平成23年 9月27日現在
1口当たり純資産額 1.1182円 「1口 = 1円（10,000口 = 11,182円）」	1口当たり純資産額 1.0400円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,400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	国債証券	ARGBN 7 10/03/15	1,601,945.000	1,365,289.660	
	国債証券	ARGENT 8.28 12/31/33	827,250.650	566,666.690	
	国債証券	ARGENT FL 12/31/38	6,750,000.000	2,278,125.000	
	国債証券	BRAZIL 7.125 01/20/37	4,680,000.000	5,995,080.000	
	国債証券	BRAZIL 8.75 02/04/25	920,000.000	1,292,600.000	
	国債証券	BRAZIL 8.875 10/14/19	5,785,000.000	7,865,286.000	
	国債証券	COLOM 7.375 09/18/37	1,000,000.000	1,288,450.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	700,000.000	698,250.000	
	国債証券	DOMREP 8.625 04/20/27	160,000.000	168,000.000	
	国債証券	DOMREP 9.04 01/23/18	475,444.950	522,989.440	
	国債証券	EGYPT 5.75 04/29/20	800,000.000	799,520.000	
	国債証券	EGYPT 6.875 04/30/40	1,020,000.000	939,726.000	
	国債証券	GABON 8.2 12/12/17	2,300,000.000	2,599,000.000	
	国債証券	GEORG 6.875 04/12/21	1,100,000.000	1,080,750.000	
	国債証券	GRENAD FL 09/15/25	3,000,000.000	1,830,000.000	
	国債証券	ICELND 4.875 06/16/16	2,150,000.000	2,117,642.500	
	国債証券	INDON 6.625 02/17/37	4,250,000.000	4,621,875.000	
	国債証券	IRAQ 5.8 01/15/28	6,211,000.000	5,005,134.350	
	国債証券	JAMAN 10.625 06/20/17	2,225,000.000	2,539,281.250	
	国債証券	JAMAN 8.5 02/28/36	820,000.000	824,100.000	
	国債証券	LEBAN 8.5 08/06/15	2,000,000.000	2,315,000.000	
	国債証券	LITHUN 6.75 01/15/15	1,704,000.000	1,818,508.800	
	国債証券	LITHUN 7.375 02/11/20	3,036,000.000	3,426,581.400	
	国債証券	MEX 5.125 01/15/20	2,000,000.000	2,170,000.000	
	国債証券	MEX 5.95 03/19/19	1,250,000.000	1,421,875.000	
	国債証券	NGERIA 6.75 01/28/21	750,000.000	739,987.500	
	国債証券	PERU 5.625 11/18/50	2,400,000.000	2,405,760.000	
	国債証券	PERU 6.55 03/14/37	2,863,000.000	3,364,168.150	
	国債証券	PERU 7.125 03/30/19	600,000.000	732,000.000	
	国債証券	PHILIP 6.375 10/23/34	2,000,000.000	2,245,000.000	
	国債証券	PKSTAN 6.875 06/01/17	250,000.000	202,500.000	
	国債証券	PKSTAN 7.125 03/31/16	250,000.000	215,000.000	
	国債証券	REPHUN 6.25 01/29/20	2,755,000.000	2,661,330.000	
	国債証券	RUSSIA FL 03/31/30	14,471,450.000	16,228,573.450	
	国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	500,000.000	461,875.000	
	国債証券	SERBIA FL 11/01/24	4,168,371.160	3,939,110.710	
	国債証券	TURKEY 5.625 03/30/21	3,000,000.000	2,955,000.000	
	国債証券	TURKEY 6 01/14/41	450,000.000	411,750.000	
	国債証券	TURKEY 7 03/11/19	243,000.000	267,300.000	
	国債証券	TURKEY 7 06/05/20	3,547,000.000	3,870,131.700	
国債証券	TURKEY 7.5 11/07/19	655,000.000	735,696.000		
国債証券	TURKEY 8 02/14/34	5,750,000.000	6,672,300.000		
国債証券	UKRAIN 6.25 06/17/16	1,200,000.000	1,075,500.000		
国債証券	UKRAIN 6.58 11/21/16	2,985,000.000	2,694,559.500		
国債証券	UKRAIN 6.75 11/14/17	1,065,000.000	969,150.000		

国債証券	UKRAIN 7.65 06/11/13	3,000,000.000	2,899,500.000
国債証券	UKRAIN 7.75 09/23/20	1,350,000.000	1,226,947.500
国債証券	UKRAIN 7.95 02/23/21	1,000,000.000	910,650.000
国債証券	URUGUA 7.625 03/21/36	900,000.000	1,143,495.000
国債証券	VENZ 7 03/31/38	1,200,000.000	609,600.000
国債証券	VENZ 7.65 04/21/25	835,000.000	467,600.000
国債証券	VENZ 8.5 10/08/14	3,766,000.000	3,228,215.200
国債証券	VENZ 9.25 09/15/27	1,147,000.000	734,080.000
国債証券	VIETNM 6.75 01/29/20	3,880,000.000	3,986,700.000
国債証券	VIETNM 6.875 01/15/16	300,000.000	310,875.000
地方債証券	BUEAIR 12.5 04/06/15	1,000,000.000	1,005,000.000
特殊債証券	CAPJAM 8.5 11/16/21	2,500,000.000	2,550,000.000
特殊債証券	ESKOM 5.75 01/26/21	1,500,000.000	1,521,000.000
特殊債証券	GAZPRU 7.288 08/16/37	3,100,000.000	3,034,125.000
特殊債証券	LIBAN 10 04/25/15	330,000.000	391,838.700
特殊債証券	PEMEX 4.875 03/15/15	3,500,000.000	3,710,000.000
特殊債証券	PEMEX 5.5 01/21/21	250,000.000	265,000.000
特殊債証券	PEMEX 6.5 06/02/41	450,000.000	474,750.000
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	250,000.000	255,000.000
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	200,000.000	197,800.000
社債券	AEROAR 10.75 12/01/20	485,000.000	499,550.000
社債券	AES 9.5 11/12/20	400,000.000	400,000.000
社債券	AGILE 10 11/14/16	845,000.000	734,558.500
社債券	AKBNK 5.125 07/22/15	1,000,000.000	970,000.000
社債券	AKBNK 6.5 03/09/18	150,000.000	146,250.000
社債券	AVINPU 10 10/29/15	750,000.000	573,750.000
社債券	BANCOL 5.95 06/03/21	800,000.000	788,000.000
社債券	BCP 4.75 03/16/16	270,000.000	261,684.000
社債券	BCP 5.375 09/16/20	500,000.000	475,000.000
社債券	BRPRSA 9 PERPETUAL	1,000,000.000	995,000.000
社債券	BTAS FL 07/01/18	735,000.000	356,475.000
社債券	CEELET 10.5 06/03/16	300,000.000	303,000.000
社債券	CEMEX 9 01/11/18	150,000.000	103,518.000
社債券	CEMEX 9.5 12/14/16	500,000.000	385,000.000
社債券	COGARD 11.125 02/23/18	1,000,000.000	830,000.000
社債券	DLLTD 10.5 04/15/18	700,000.000	723,450.000
社債券	DLLTD 8.875 01/15/15	2,610,000.000	2,518,650.000
社債券	DPWORL 6.25 07/02/17	2,150,000.000	2,150,000.000
社債券	DRUMCO 9 10/15/14	500,000.000	513,750.000
社債券	DTEKUA 9.5 04/28/15	800,000.000	752,000.000
社債券	ECOPEL 7.625 07/23/19	660,000.000	775,500.000
社債券	FIBRIA 7.5 05/04/20	1,196,000.000	1,148,160.000
社債券	GARAN 6.25 04/20/21	1,500,000.000	1,413,750.000
社債券	GRTBNL 7.5 05/19/16	300,000.000	301,500.000
社債券	GSHPR 10 PERPETUAL	1,000,000.000	1,022,500.000
社債券	HALYK 7.25 05/03/17	525,000.000	494,560.500
社債券	INTERG 6.375 05/14/17	5,350,000.000	5,644,250.000
社債券	IRSAAR 11.5 07/20/20	1,125,000.000	1,143,281.250
社債券	KKB 8.5 05/11/18	1,000,000.000	874,900.000
社債券	KKB 8.5 05/11/18	500,000.000	421,575.000
社債券	KORELE 4.75 07/13/21	500,000.000	494,625.000
社債券	KTZKZ 7 05/11/16	2,000,000.000	2,086,300.000
社債券	KWGPRO 12.5 08/18/17	100,000.000	79,500.000
社債券	KWGPRO 12.75 03/30/16	650,000.000	519,187.500
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	2,000,000.000	1,918,800.000
社債券	KZOLKZ 11.75 01/23/15	1,200,000.000	1,345,200.000
社債券	LNGFOR 9.5 04/07/16	295,000.000	247,800.000
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	255,000.000
社債券	METINR 6.5 07/21/16	1,000,000.000	859,400.000
社債券	MHPSA 10.25 04/29/15	1,000,000.000	879,530.000
社債券	MPEL 10.25 05/15/18	650,000.000	700,375.000
社債券	NATPOW 6.875 11/02/16	9,020,000.000	10,290,016.000
社債券	NATPOW 9.625 05/15/28	1,000,000.000	1,370,000.000
社債券	NETBZ 7.5 01/27/20	1,300,000.000	1,469,000.000

社債券	NIHD 10 08/15/16	1,800,000.000	2,009,250.000	
社債券	OGXPBZ 8.5 06/01/18	375,000.000	341,250.000	
社債券	PCU 7.5 07/27/35	500,000.000	550,620.000	
社債券	PDVSA 4.9 10/28/14	784,642.000	537,479.770	
社債券	PDVSA 5 10/28/15	290,237.000	175,593.380	
社債券	PDVSA 5.125 10/28/16	435,356.000	248,152.920	
社債券	PDVSA 5.25 04/12/17	5,650,000.000	3,149,875.000	
社債券	PEMEX 5.75 03/01/18	2,882,000.000	3,162,995.000	
社債券	PETMEX 9.5 08/19/14	2,000,000.000	2,060,000.000	
社債券	PETRTT 9.75 08/14/19	1,000,000.000	1,177,500.000	
社債券	PLNIJ 7.75 01/20/20	1,300,000.000	1,448,200.000	
社債券	SABESP 6.25 12/16/20	700,000.000	714,000.000	
社債券	SATMEX 9.5 05/15/17	1,000,000.000	980,000.000	
社債券	SHASHU 8.5 05/25/16	700,000.000	616,665.000	
社債券	TAM 7.375 04/25/17	1,880,000.000	1,842,400.000	
社債券	TAM 9.5 01/29/20	400,000.000	404,000.000	
社債券	TMENRU 7.25 02/02/20	400,000.000	405,220.000	
社債券	TNEFT 8.7 08/07/18	2,550,000.000	2,910,952.500	
社債券	TRUBRU 7.75 01/27/18	1,500,000.000	1,355,925.000	
社債券	URBIMM 9.5 01/21/20	700,000.000	679,000.000	
社債券	VTB 6.875 05/29/18	1,000,000.000	1,020,900.000	
社債券	XINAOG 6 05/13/21	1,000,000.000	987,070.000	
社債券	YASAR 9.625 10/07/15	725,000.000	730,437.500	
小計(アメリカ・ドル) 132銘柄		216,464,696.760	215,060,431.320 (16,404,809,701)	
メキシコ・ペソ	国債証券	MBONO 10 11/20/36	56,600,000.000	69,730,634.000
	国債証券	MBONO 7.5 06/03/27	9,000,000.000	9,132,660.000
	国債証券	MBONO 8.5 11/18/38	23,505,000.000	25,130,840.850
	小計(メキシコ・ペソ) 3銘柄		89,105,000.000	103,994,134.850 (585,486,979)
合計			16,990,296,680 (16,990,296,680)	

- (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	国債証券	55銘柄	89.37%	96.55%
	地方債証券	1銘柄		
	特殊債券	7銘柄		
	社債券	69銘柄		
メキシコ・ペソ	国債証券	3銘柄	3.19%	3.45%

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23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	58,399,753	89,040,535
コール・ローン	554,011	554,194
国債証券	2,124,308,871	1,632,657,483
特殊債券	94,535,438	60,833,502
社債券	540,674,945	444,332,014
派生商品評価勘定	6,033,835	26,085,952
未収入金	-	16,140,328
未収利息	49,761,435	34,448,323
前払費用	7,706,896	3,760,186
流動資産合計	2,881,975,184	2,307,852,517
資産合計	2,881,975,184	2,307,852,517
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,050,206	25,126,140
未払金	-	13,997,938
流動負債合計	10,050,206	39,124,078
負債合計	10,050,206	39,124,078
純資産の部		
元本等		
元本	3,589,284,843	3,037,728,729
剰余金		
剰余金又は欠損金()	717,359,865	769,000,290
元本等合計	2,871,924,978	2,268,728,439
純資産合計	2,871,924,978	2,268,728,439
負債純資産合計	2,881,975,184	2,307,852,517

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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、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、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。	<p>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	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23年 3月28日現在	平成23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	4,646,334,882円	3,589,284,843円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	1,057,050,039円	551,556,114円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	3,589,284,843円	3,037,728,729円
合計	3,589,284,843円	3,037,728,729円
2. 受益権の総数	3,589,284,843口	3,037,728,729口
3. 元本の欠損		
	717,359,865円	769,000,290円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左

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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28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	70,093,360
特殊債券	1,093,990
社債券	6,426,859
合計	77,614,209

「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23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	56,935,505
特殊債券	165,429
社債券	25,050,252
合計	31,719,824

「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23年3月29日から平成23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）
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23年3月28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	175,558,898	-	172,594,243	2,964,655
	スイス・フラン	30,320,261	-	31,179,062	858,801
	デンマーク・クローネ	61,299,386	-	61,925,793	626,407
	ノルウェー・クローネ	60,793,655	-	61,608,171	814,516
	スウェーデン・クローナ	39,853,637	-	40,474,992	621,355
	ポーランド・ズロチ	64,380,723	-	64,185,653	195,070
	ユーロ	86,803,665	-	89,212,586	2,408,921
	売建				
	イギリス・ポンド	48,472,019	-	49,636,436	1,164,417
	スイス・フラン	3,196,135	-	3,221,984	25,849
	ノルウェー・クローネ	4,093,987	-	4,228,600	134,613
	スウェーデン・クローナ	22,181,400	-	22,081,845	99,555
	ポーランド・ズロチ	8,860,124	-	9,408,309	548,185
	ユーロ	432,206,560	-	436,619,697	4,413,137
	合計		-	-	1,046,377,371

区分	種類	平成23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	184,061,430	-	174,582,383	9,479,047	
	スイス・フラン	23,598,686	-	19,869,436	3,729,250	
	デンマーク・クローネ	40,921,640	-	38,485,599	2,436,041	
	ノルウェー・クローネ	36,979,557	-	34,997,435	1,982,122	
	スウェーデン・クローナ	58,849,249	-	55,514,492	3,334,757	
	ポーランド・ズロチ	16,470,496	-	16,426,024	44,472	
	ユーロ	96,224,100	-	92,103,649	4,120,451	
	売建					
	イギリス・ポンド	15,148,024	-	14,976,038	171,986	
	スウェーデン・クローナ	36,480,536	-	34,711,622	1,768,914	
	ポーランド・ズロチ	44,595,540	-	40,927,971	3,667,569	
	ユーロ	360,881,058	-	340,403,575	20,477,483	
	合計		-	-	862,998,224	959,812

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22年9月28日 至 平成23年3月28日）
該当事項はありません。

（自 平成23年3月29日 至 平成23年9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年3月28日現在	平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.8001円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,001円）」	1口当たり純資産額 0.7469円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,469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 3.75 09/07/20	12,000.000	13,446.000	
	国債証券	UKT 3.75 09/07/21	174,000.000	194,375.400	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	182,000.000	207,025.000	
	国債証券	UKT 4.25 09/07/39	288,000.000	324,547.200	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/46	693,000.000	784,268.100	
	国債証券	UKT 8.75 08/25/17	57,000.000	80,045.100	
	特殊債券	EIB 8.75 08/25/17	135,000.000	182,283.750	
	社債券	MANUTD 8.75 02/01/17	50,000.000	53,470.000	
	小計（イギリス・ポンド）8銘柄		1,591,000.000	1,839,460.550 (217,939,287)	
スウェーデン・クローナ	国債証券	SGB 5 12/01/20	2,100,000.000	2,693,061.000	
	小計（スウェーデン・クローナ）1銘柄		2,100,000.000	2,693,061.000 (30,027,631)	
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 5 10/24/13	660,000.000	666,600.000	
	国債証券	POLGB 5.5 04/25/15	524,000.000	533,552.520	
	国債証券	POLGB 5.5 10/25/19	157,000.000	153,467.500	
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	724,000.000	716,760.000	
	小計（ポーランド・ズロチ）4銘柄		2,065,000.000	2,070,380.020 (48,177,744)	
ユーロ	国債証券	BGB 2.75 03/28/16	120,000.000	118,980.000	
	国債証券	BGB 3.25 09/28/16	213,000.000	214,448.400	
	国債証券	BGB 4 03/28/18	100,000.000	103,510.000	
	国債証券	BGB 4.25 09/28/21	79,000.000	81,867.700	
	国債証券	BGB 5 03/28/35	237,000.000	261,429.960	
	国債証券	BRAZIL 11 06/26/17	88,000.000	117,167.600	
	国債証券	BTPS 3.75 03/01/21	969,000.000	851,266.500	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	320,000.000	233,984.000	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	484,000.000	480,418.400	
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	625,000.000	512,437.500	
	国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	444,000.000	445,332.000	
	国債証券	BUBILL 0 09/28/11	115,000.000	114,844.750	
	国債証券	BUBILL 0 11/23/11	1,100,000.000	1,098,900.000	
	国債証券	DBR 2.5 01/04/21	642,000.000	684,564.600	
	国債証券	DBR 3 07/04/20	536,000.000	594,745.600	
	国債証券	DBR 3.75 01/04/15	251,000.000	276,012.150	
	国債証券	DBR 3.75 07/04/13	605,000.000	640,876.500	
	国債証券	DBR 4 01/04/37	536,000.000	675,306.400	
	国債証券	DBR 6 06/20/16	216,000.000	265,140.000	
	国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	122,000.000	167,384.000	
	国債証券	FRTR 3.75 04/25/21	24,000.000	26,529.600	
	国債証券	FRTR 4 04/25/13	1,324,000.000	1,389,008.400	
	国債証券	FRTR 4.75 04/25/35	130,000.000	160,199.000	
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	629,000.000	861,635.650	
	国債証券	FRTR OAT 6 10/25/25	154,000.000	207,388.720	
	国債証券	IRISH 5 04/18/13	299,000.000	283,003.500	
	国債証券	ITALYBTPS6.5 11/1/27	109,000.000	109,239.800	
	国債証券	NETHER 4.5 07/15/17	31,000.000	35,817.400	
	国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	297,000.000	410,394.600	
	国債証券	RAGB 4.65 01/15/18	146,000.000	166,266.260	

国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	180,000.000	252,898.200
国債証券	ROMANI 5.25 06/17/16	110,000.000	108,025.500
国債証券	SPGB 3.8 01/31/17	136,000.000	132,328.000
国債証券	SPGB 4.1 07/30/18	36,000.000	34,950.600
国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	451,000.000	461,003.180
国債証券	SPGB 4.6 07/30/19	296,000.000	292,394.720
国債証券	SPGB 5.75 07/30/32	409,000.000	400,529.610
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	150,000.000	149,625.000
特殊債券	SEK 3.625 05/27/14	220,000.000	231,979.000
社債券	ABIBB 4 06/02/21	25,000.000	25,865.000
社債券	AHOLD 5.875 03/14/12	25,000.000	25,390.000
社債券	ALVGR FL 01/13/25	36,000.000	35,928.000
社債券	ATLIM 5.625 05/06/16	50,000.000	51,700.000
社債券	AVLN FL 05/22/38	50,000.000	44,437.500
社債券	BAC 4.625 02/07/17	50,000.000	39,055.000
社債券	BAC 7 06/15/16	50,000.000	49,857.500
社債券	BACR 5.25 05/27/14	50,000.000	51,727.500
社債券	BACR 6 01/14/21	50,000.000	40,505.000
社債券	BBVASM 4.875 01/23/14	50,000.000	49,992.500
社債券	BNP 2.875 07/13/15	9,000.000	8,788.500
社債券	BOMB 7.25 11/15/16	50,000.000	50,507.500
社債券	C 5 08/02/19	15,000.000	14,333.250
社債券	C 7.375 06/16/14	50,000.000	52,860.000
社債券	C FL 02/10/19	30,000.000	23,848.500
社債券	CCK 7.125 08/15/18	50,000.000	48,437.500
社債券	CEDC 8.875 12/01/16	50,000.000	36,812.500
社債券	CIRSA 8.75 05/15/18	50,000.000	40,160.000
社債券	COFP 4.875 04/10/14	50,000.000	52,175.000
社債券	CS 6.125 08/05/13	50,000.000	53,082.500
社債券	CS 6.375 06/07/13	50,000.000	52,277.500
社債券	DB 5.125 01/31/13	40,000.000	40,786.000
社債券	DT 6 01/20/17	15,000.000	16,948.500
社債券	EIBKOR 5.75 05/22/13	50,000.000	51,820.500
社債券	ENEL 5.25 01/14/15	40,000.000	41,252.000
社債券	EOANGR 5.5 01/19/16	20,000.000	22,340.000
社債券	EUROCA 9.75 08/01/17	50,000.000	37,110.000
社債券	EUTELS 4.125 03/27/17	50,000.000	51,250.000
社債券	EXPNLN 4.75 02/04/20	50,000.000	53,932.500
社債券	F 9.375 01/17/14	50,000.000	52,062.500
社債券	FNCIM 5.75 12/12/18	38,000.000	37,906.900
社債券	GASSM 4.125 01/26/18	50,000.000	46,082.500
社債券	GE 4.625 02/22/27	50,000.000	46,600.000
社債券	GE FL 09/15/66	50,000.000	39,625.000
社債券	GMAC 7.5 04/21/15	50,000.000	45,365.000
社債券	GS 5.125 10/16/14	100,000.000	100,390.000
社債券	GSZFP 5.625 01/18/16	20,000.000	22,569.000
社債券	HSBC 6 06/10/19	50,000.000	49,682.500
社債券	INTNED 5.5 01/04/12	30,000.000	30,030.000
社債券	ISPIM FL 05/28/18	50,000.000	41,985.000
社債券	JPM 3.625 12/12/11	550,000.000	553,025.000
社債券	JPM FL 11/12/19	100,000.000	92,875.000
社債券	KERLIN 10.625 02/01/17	50,000.000	41,920.000
社債券	LGEN FL 06/08/25	50,000.000	40,487.500
社債券	LGFPL FL 04/13/18	50,000.000	45,625.000
社債券	LLOYDS 6.5 03/24/20	50,000.000	38,500.000
社債券	LMETEL 5.375 06/27/17	50,000.000	54,750.000
社債券	LTOIM 5.375 12/05/16	50,000.000	44,582.500
社債券	LXSGR 4.125 05/23/18	15,000.000	14,886.750
社債券	MANAG 7.25 05/20/16	10,000.000	11,767.500
社債券	MET 4.625 05/16/17	50,000.000	51,882.500
社債券	MICH 8.625 04/24/14	15,000.000	17,066.250
社債券	MONTE 4.75 04/30/14	50,000.000	48,670.000
社債券	MRKGR 4.875 09/27/13	8,000.000	8,451.600
社債券	MS 4 11/17/15	70,000.000	65,334.500

社債券	MS 5 05/02/19	50,000.000	46,295.000	
社債券	MTNA 9.375 06/03/16	50,000.000	55,805.000	
社債券	MUNRE FL PERPETUAL	50,000.000	39,687.500	
社債券	NBHSS 4.5 03/26/20	50,000.000	46,637.500	
社債券	NGGLN 5.125 05/14/13	50,000.000	52,625.000	
社債券	NWIDE 3.75 01/20/15	50,000.000	49,765.000	
社債券	NWORLD 7.875 05/01/18	50,000.000	46,250.000	
社債券	OI 6.75 09/15/20	50,000.000	45,750.000	
社債券	PEMEX 6.25 08/05/13	40,000.000	42,070.000	
社債券	PEMEX 6.375 08/05/16	111,000.000	119,741.250	
社債券	PEUGOT 5 10/28/16	10,000.000	9,529.500	
社債券	P RTP 8.625 04/03/14	10,000.000	11,367.000	
社債券	RBS 5.375 09/30/19	50,000.000	44,440.000	
社債券	RENAUL 3.25 01/17/14	20,000.000	19,387.000	
社債券	RENAUL 4.375 01/27/15	10,000.000	9,631.500	
社債券	RENTKL 4.625 03/27/14	50,000.000	51,817.500	
社債券	REPSM 4.625 10/08/14	26,000.000	27,062.100	
社債券	RIFP 7 01/15/15	50,000.000	54,027.500	
社債券	ROSW 4.625 03/04/13	17,000.000	17,748.000	
社債券	RWE 6.625 01/31/19	50,000.000	60,675.000	
社債券	SANTAN 4.125 10/04/17	50,000.000	45,395.000	
社債券	SFGSM 8.25 10/31/16	50,000.000	46,302.500	
社債券	STANLN 5.875 09/26/17	50,000.000	49,240.000	
社債券	TELEFO 3.661 09/18/17	50,000.000	45,588.500	
社債券	TELEFO 5.431 02/03/14	50,000.000	51,072.500	
社債券	TITIM 8.25 03/21/16	100,000.000	108,115.000	
社債券	UBS 6.25 09/03/13	15,000.000	16,008.750	
社債券	UCGIM 5.75 09/26/17	50,000.000	42,320.000	
社債券	VIEFP 4.875 05/28/13	50,000.000	52,270.000	
社債券	VOTORA 5.25 04/28/17	50,000.000	49,315.000	
社債券	ZIGGO 8 05/15/18	50,000.000	47,652.500	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	50,947.500	
	小計（ユーロ）126銘柄	17,303,000.000	17,911,674.150 (1,841,678,337)	
	合計		2,137,822,999 (2,137,822,999)	

- (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
イギリス・ポンド	国債証券	6 銘柄	9.61%
	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	1 銘柄	1.32%
ポーランド・ズロチ	国債証券	4 銘柄	2.12%
ユーロ	国債証券	37 銘柄	81.18%
	特殊債券	2 銘柄	
	社債券	87 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23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	236,326	103,773
社債券	1,405,047,255	1,019,808,830
未収利息	2,680,302	4,909,996
流動資産合計	1,407,963,883	1,024,822,599
資産合計	1,407,963,883	1,024,822,599
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	1,942,010,235	1,773,804,286
剰余金		
剰余金又は欠損金()	534,046,352	748,981,687
元本等合計	1,407,963,883	1,024,822,599
純資産合計	1,407,963,883	1,024,822,599
負債純資産合計	1,407,963,883	1,024,822,599

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	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23年 3月28日現在	平成23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 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 元本の内訳 グローバル資産分散オープン 合計	3,206,615,133円 - 1,264,604,898円 1,942,010,235円 1,942,010,235円	1,942,010,235円 - 168,205,949円 1,773,804,286円 1,773,804,286円
2. 受益権の総数	1,942,010,235口	1,773,804,286口
3. 元本の欠損	534,046,352円	748,981,687円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左

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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28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	181,514,316
合計	181,514,316

「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23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	180,833,029
合計	180,833,029

「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23年3月29日から平成23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)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成23年3月28日現在)

該当事項はありません。

(平成23年9月27日現在)

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22年9月28日 至 平成23年3月28日)

該当事項はありません。

(自平成23年3月29日 至 平成23年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成23年3月28日現在	平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.7250円 「1口 = 1円(10,000口 = 7,250円)」	1口当たり純資産額 0.5778円 「1口 = 1円(10,000口 = 5,778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 10/19/11	13,700,000.000	13,369,282.000	
	小計(アメリカ・ドル) 1銘柄		13,700,000.000	13,369,282.000 (1,019,808,830)	
合計				1,019,808,830 (1,019,808,830)	

- (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	99.51%	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。

[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23年3月28日現在 金額(円)	平成23年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	51,016,687	19,744,166
コール・ローン	27,138,164	7,599,955
国債証券	1,809,660,759	1,311,512,395
特殊債券	1,000,051,718	713,710,031
未収利息	43,143,435	30,363,578
流動資産合計	2,931,010,763	2,082,930,125
資産合計	2,931,010,763	2,082,930,125
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	3,213,472,980	2,375,547,075
剰余金		
剰余金又は欠損金()	282,462,217	292,616,950
元本等合計	2,931,010,763	2,082,930,125
純資産合計	2,931,010,763	2,082,930,125
負債純資産合計	2,931,010,763	2,082,930,125

[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22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。</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>国債証券及び特殊債券 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23年 3月28日現在	平成23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 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	4,176,113,199円 - 962,640,219円	3,213,472,980円 - 837,925,905円
元本の内訳 グローバル資産分散オープン 合計	3,213,472,980円 3,213,472,980円	2,375,547,075円 2,375,547,075円
2. 受益権の総数	3,213,472,980口	2,375,547,075口
3. 元本の欠損	282,462,217円	292,616,950円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 9月28日 至 平成23年 3月28日	自 平成23年 3月29日 至 平成23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。	同左
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。	同左

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。	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、プロダクト管理部運用審査室は、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成23年3月28日現在	平成23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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成23年3月28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	3,445,117
特殊債券	16,447,218
合計	13,002,101

「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23年3月28日まで）を指しております。

(平成23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	20,516,319
特殊債券	22,822,890
合計	43,339,209

「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23年3月29日から平成23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)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成23年3月28日現在)

該当事項はありません。

(平成23年9月27日現在)

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22年9月28日 至 平成23年3月28日）
該当事項はありません。

（自 平成23年3月29日 至 平成23年9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成23年3月28日現在	平成23年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.9121円 「1口 = 1円 (10,000口 = 9,121円)」	1口当たり純資産額 0.8768円 「1口 = 1円 (10,000口 = 8,768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	EIB 5.375 05/20/14	9,300,000.000	9,559,470.000	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄		9,300,000.000	9,559,470.000 (713,710,030)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 4.06 03/19/12	10,500,000.000	10,700,235.000	
	小計（香港・ドル）1銘柄		10,500,000.000	10,700,235.000 (104,648,298)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.625 04/01/12	1,200,000.000	1,214,808.000	
	小計（シンガポール・ドル）1銘柄		1,200,000.000	1,214,808.000 (71,576,487)	
ニュージーランド・ドル	国債証券	NZGB 6 12/15/17	6,000,000.000	6,728,040.000	
	国債証券	NZGB 6.5 04/15/13	5,200,000.000	5,490,472.000	
	小計（ニュージーランド・ドル）2銘柄		11,200,000.000	12,218,512.000 (724,313,392)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 4.75 03/10/12	3,000,000,000.000	3,018,540,000.000	
	国債証券	NDFB 4.75 03/10/14	2,200,000,000.000	2,262,986,000.000	
	小計（韓国・ウォン）2銘柄		5,200,000,000.000	5,281,526,000.000 (340,130,275)	
マレーシア・リングgit	国債証券	MGS 3.741 02/27/15	2,900,000.000	2,940,803.000	
	小計（マレーシア・リングgit）1銘柄		2,900,000.000	2,940,803.000 (70,843,944)	
合計				2,025,222,426 (2,025,222,426)	

- （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
オーストラリア・ドル	特殊債券 1銘柄	34.26%	35.24%
香港・ドル	国債証券 1銘柄	5.02%	5.17%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	3.44%	3.53%
ニュージーランド・ドル	国債証券 2銘柄	34.77%	35.76%
韓国・ウォン	国債証券 2銘柄	16.33%	16.80%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	3.40%	3.50%

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 Ⅰ」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2011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、2011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

2011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
資 産			
有価証券、取得原価	761,023,135	1,635,338,574	168,910,877
未実現評価益（損）	205,033,209	58,397,637	6,084,423
有価証券、時価	966,056,344	1,693,736,211	174,995,300
現金預金	25,786,316	40,852,172	2,605,101
発行未収金	1,955,490	41,505,452	-
有価証券売却未収金	1,377,744	16,589,026	262,350
未収配当金および利息	2,524,600	30,943,760	1,384,076
為替予約取引にかかる未実現利益	-	7,229,657	352,851
委託証拠金	-	-	483,723
その他の資産	13,733	98,051	4,731
先物取引にかかる未実現利益	-	-	-
スワップ契約、時価	-	-	-
資産合計	997,714,227	1,830,954,329	180,088,132
負 債			
有価証券購入未払金	3,238,347	32,140,449	2,212,364
買戻未払金	216,111	1,943,145	61,787
為替予約取引にかかる未実現損失	-	4,165,615	103,211
投資運用報酬	890,455	1,038,182	7,142
その他の負債	245,155	481,615	100,397
スワップ契約、時価	-	1,355,628	-
オプション時価	-	571,911	-
先物取引にかかる未実現損失	-	-	76,422
負債合計	4,590,068	41,696,545	2,561,323
純資産	993,124,159	1,789,257,784	177,526,809

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

2011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	131,584,849	135,664,029	-
発行済投資証券口数	5,235,210	6,698,354	-
一口当たり純資産額	25.13	20.25	-
クラスAd			
純資産	21,162,497	67,680,014	-
発行済投資証券口数	2,080,040	5,462,740	-
一口当たり純資産額	10.17	12.39	-
一口当たり公表配当金	0.0240	0.3964	-
クラスAh（EUR）			
純資産（基準通貨）	-	515,314,865	-
純資産（クラス通貨）	-	EUR 355,426,334	-
発行済投資証券口数	-	20,800,189	-
一口当たり純資産額（クラス通貨）	-	EUR 17.09	-
クラスAh（NOK）			
純資産（基準通貨）	-	56,550,346	-
純資産（クラス通貨）	-	NOK 303,418,056	-
発行済投資証券口数	-	2,031,110	-
一口当たり純資産額（クラス通貨）	-	NOK 149.39	-
クラスI			
純資産	824,384,594	645,228,438	2,884,184
発行済投資証券口数	27,123,954	30,735,919	289,662
一口当たり純資産額	30.39	20.99	9.96
クラスId			
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（クラス通貨）	-	-	-
クラスIh（EUR）			
純資産（基準通貨）	-	-	16,176,779
純資産（クラス通貨）	-	-	EUR 11,157,554
発行済投資証券口数	-	-	1,097,007
一口当たり純資産額（クラス通貨）	-	-	EUR 10.17
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Jd			
純資産	15,992,219	159,339,194	158,465,846
発行済投資証券口数	2,033,913	16,138,558	14,785,297
一口当たり純資産額	7.86	9.87	10.72
一口当たり公表配当金	0.0724	0.3762	0.2397
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Sd			
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	-	0.1732	-
クラスZ			
純資産	-	209,480,898	-
発行済投資証券口数	-	8,974,746	-
一口当たり純資産額	-	23.34	-

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

2011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	USアグリゲート・ ボンド・ファンド
	米ドル	米ドル	米ドル
収益			
受取利息（源泉税控除後）	896	63,237,189	3,972,449
受取配当金（源泉税控除後）	9,990,318	1,096,405	-
スワップにかかる利息	-	674,167	-
収益合計	9,991,214	65,007,761	3,972,449
費用			
投資運用報酬	5,038,977	6,006,009	6,905
管理会社報酬	116,885	194,929	25,285
カストディーフィー	175,083	238,461	23,556
専門家報酬	97,148	176,276	23,592
年次税	79,215	254,957	8,221
その他の費用	7,248	11,554	-
スワップにかかる利息	-	-	-
費用合計	5,514,556	6,882,186	87,559
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	4,476,658	58,125,575	3,884,890
投資運用会社により免除または負担された費用	15,860	116,923	29,021
投資純損益	4,492,518	58,242,498	3,913,911
以下にかかる実現損益：			
有価証券（外国税控除後）	12,978,251	40,346,443	1,579,240
為替予約取引	16,979	29,452,636	(30,166)
先物取引	-	-	(290,701)
オプション	-	128,822	-
スワップ	-	2,153,162	-
外貨取引	257,904	(46,746,879)	164,116
実現純損益	13,253,134	25,334,184	1,422,489
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）	(15,071,165)	(27,147,001)	(280,140)
為替予約取引	-	10,857,111	242,363
先物取引	-	-	(102,359)
オプション	-	31,658	-
スワップ	-	(1,516,761)	-
外貨建のその他の資産および負債	32,518	(1,674,452)	(290,677)
未実現評価損益の純変動	(15,038,647)	(19,449,445)	(430,813)
運用による純資産の純増減	2,707,005	64,127,237	4,905,587
分配金：			
分配による純資産の純減少	(218,768)	(8,653,308)	(3,846,909)
資本取引：			
投資証券発行受領額	238,933,223	312,506,459	22,273,771

投資証券買戻支払額	(92,153,679)	(269,697,159)	(32,970,554)
資本取引による純資産の純増減	146,779,544	42,809,300	(10,696,783)
純資産の増減合計	149,267,781	98,283,229	(9,638,105)
期首現在純資産	843,856,378	1,644,020,195	186,437,681
換算調整	-	46,954,360	727,233
期末現在純資産	993,124,159	1,789,257,784	177,526,809

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

2011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
クラスA			
期首現在発行済投資証券	4,528,121	4,847,349	-
発行投資証券口数	1,417,225	2,323,270	-
買戻投資証券口数	(710,136)	(472,265)	-
期末現在発行済投資証券	5,235,210	6,698,354	-
クラスAd			
期首現在発行済投資証券	-	4,727,755	-
発行投資証券口数	*** 2,092,770	1,947,829	-
買戻投資証券口数	(12,730)	(1,212,844)	-
期末現在発行済投資証券	2,080,040	5,462,740	-
クラスAh (EUR)			
期首現在発行済投資証券	-	23,147,786	-
発行投資証券口数	-	4,234,929	-
買戻投資証券口数	-	(6,582,526)	-
期末現在発行済投資証券	-	20,800,189	-
クラスAh (NOK)			
期首現在発行済投資証券	-	1,940,469	-
発行投資証券口数	-	505,717	-
買戻投資証券口数	-	(415,076)	-
期末現在発行済投資証券	-	2,031,110	-
クラスI			
期首現在発行済投資証券	22,372,220	26,059,395	-
発行投資証券口数	6,077,137	5,186,337	289,662
買戻投資証券口数	(1,325,403)	(509,813)	-
期末現在発行済投資証券	27,123,954	30,735,919	289,662
クラスId			
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Ih (EUR)			

期首現在発行済投資証券	-	-	-
発行投資証券口数	-	-	***** 1,102,742
買戻投資証券口数	-	-	(5,735)
期末現在発行済投資証券	-	-	1,097,007

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Jd

期首現在発行済投資証券	2,572,397	19,206,590	17,496,496
発行投資証券口数	22,324	645,603	360,404
買戻投資証券口数	(560,808)	(3,713,635)	(3,071,603)
期末現在発行済投資証券	2,033,913	16,138,558	14,785,297

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Sd

期首現在発行済投資証券	-	135,379	-
発行投資証券口数	-	-	-
買戻投資証券口数	-	(135,379)	-
期末現在発行済投資証券	-	* -	-

クラスZ

期首現在発行済投資証券	693,000	9,600,521	-
発行投資証券口数	-	652,871	-
買戻投資証券口数	(693,000)	(1,278,646)	-
期末現在発行済投資証券	**** -	8,974,746	-

*クラスは2011年3月22日に全額償還された。
 ***クラスは2011年3月9日に運用を開始した。
 ****クラスは2011年4月18日に全額償還された。
 *****クラスは2011年6月1日に運用を開始した。
 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（未監査）

（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
以下の時点のクラスA証券一口当たり純資産額：				
2011年 6月30日	25.13	20.25	-	-
2010年12月31日	25.21	19.51	-	-
2009年12月31日	21.55	17.21	-	-
以下の時点のクラスAd証券一口当たり純資産額：				
2011年 6月30日	10.17		12.39	-
2010年12月31日	-		12.32	-
2009年12月31日	-		11.62	-
以下の時点のクラスAh（EUR）証券一口当たり純資産額：				
2011年 6月30日	-	EUR 17.09	-	-
2010年12月31日	-	EUR 16.52	-	-
2009年12月31日	-	EUR 14.55	-	-

以下の時点のクラスAh（NOK）証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	-	NOK 149.39	-
2010年12月31日	-	NOK 143.61	-
2009年12月31日	-	NOK 125.24	-
以下の時点のクラスI証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	30.39	20.99	9.96
2010年12月31日	30.34	20.16	-
2009年12月31日	25.69	17.67	-
以下の時点のクラスId証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	-	-	-
2010年12月31日	-	-	-
2009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：			
2011年 6月30日	-	-	-
2010年12月31日	-	-	-
2009年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスIh（EUR）証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	-	-	EUR 10.17
2010年12月31日	-	-	-
2009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：			
2011年 6月30日	-	-	-
2010年12月31日	-	-	-
2009年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスJd証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	7.86	9.87	10.72
2010年12月31日	7.88	9.81	10.66
2009年12月31日	6.72	9.30	10.38
以下の時点のクラスS証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	--	-	-
2010年12月31日	--	-	-
2009年12月31日	--	-	-
以下の時点のクラスSd証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	--	-	-
2010年12月31日	-13.50	-	-
2009年12月31日	-12.79	-	-
以下の時点のクラスZ証券一口当たり純資産額：			
2011年 6月30日	-	23.34	-
2010年12月31日	44.25	22.34	-
2009年12月31日	37.06	19.45	-
以下の時点の純資産：			
2011年 6月30日	993,124,159	1,789,257,784	177,526,809
2010年12月31日	843,856,378	1,644,020,195	186,437,681
2009年12月31日	837,287,206	1,024,807,232	243,777,509

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

2011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				
ブラジル				
Banco do Brasil	ブラジル・レアル	241,600	4,330,165	0.44
BM&F BOVESPA	ブラジル・レアル	1,082,062	7,154,873	0.72
BRF - Brasil Foods	ブラジル・レアル	266,212	4,515,678	0.46
Lojas Renner	ブラジル・レアル	425,700	16,213,250	1.63
Natura Cosméticos	ブラジル・レアル	183,400	4,578,397	0.46
PDG Realty Empreendimentos e Participacoes	ブラジル・レアル	884,000	4,973,826	0.50
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	424,900	14,387,114	1.45
Usinas Siderurgicas de Minas Gerais	ブラジル・レアル	305,400	4,590,041	0.46
Vale ADR	アメリカ・ドル	603,600	19,285,020	1.94
Weg	ブラジル・レアル	444,100	5,059,997	0.51
ブラジル 計			85,088,361	8.57
チリ				
Banco Santander (Chile) ADR	アメリカ・ドル	76,470	7,173,651	0.72
Sociedad Quimica y Minera de Chile ADR	アメリカ・ドル	115,400	7,468,688	0.75
チリ 計			14,642,339	1.47
中国				
Alibaba.com	香港・ドル	2,697,000	4,297,870	0.43
Baidu ADR	アメリカ・ドル	65,200	9,136,476	0.92
Bank of China H-shares	香港・ドル	25,988,100	12,657,979	1.27
China National Building Material H-shares	香港・ドル	6,112,000	11,986,393	1.21
China Shanshui Cement Group	香港・ドル	7,392,000	8,540,283	0.86
China Vanke Class A ¹	中国・人民元	1,517,500	1,983,737	0.20
China Vanke Class B	香港・ドル	367,200	494,555	0.05
Industrial & Commercial Bank of China H-shares	香港・ドル	18,629,445	14,149,400	1.43
Parkson Retail Group	香港・ドル	3,644,000	5,329,313	0.54
Ping An Insurance Group of China Class A ¹	中国・人民元	466,404	3,482,878	0.35
Ping An Insurance Group of China H-shares	香港・ドル	596,000	6,154,358	0.62
Shanghai Pharmaceuticals Holding H-shares	香港・ドル	1,286,500	3,463,733	0.35
Shenzhen Development Bank Class A ¹	中国・人民元	1,107,187	2,923,837	0.29
Shimao Property Holdings	香港・ドル	1,736,000	2,141,764	0.22
Sina	アメリカ・ドル	108,900	11,336,490	1.14
Tencent Holdings	香港・ドル	409,000	11,101,147	1.12
Uni-President China Holdings	香港・ドル	9,127,000	5,653,608	0.57
Want Want China Holdings	香港・ドル	6,071,000	5,890,577	0.59
Wumart Stores H-shares	香港・ドル	1,685,000	4,175,010	0.42
中国 計			124,899,408	12.58
香港				
AIA Group	香港・ドル	2,159,600	7,479,675	0.75
Beijing Enterprises Holdings	香港・ドル	2,101,500	10,951,431	1.10
Belle International Holdings	香港・ドル	2,390,000	5,037,237	0.51
C C Land Holdings	香港・ドル	9,227,000	3,462,534	0.35
China Taiping Insurance Holdings	香港・ドル	3,635,200	8,212,924	0.83
China Unicom	香港・ドル	4,420,000	8,906,744	0.90
CNOOC	香港・ドル	8,778,000	20,486,230	2.06
GOME Electrical Appliances Holdings	香港・ドル	17,406,900	6,957,167	0.70
Kingboard Chemical Holdings	香港・ドル	1,298,000	6,005,205	0.60
Kingboard Chemical Holdings warrants/2012	香港・ドル	95,600	49,758	0.01
Li & Fung	香港・ドル	3,456,000	6,884,241	0.69

Lifestyle International Holdings	香港・ドル	2,128,500	6,209,407	0.63
香港計			90,642,553	9.13
インド				
Adani Power	インド・ルピー	1,285,948	3,162,910	0.32
BF Investment	インド・ルピー	58,035	80,946	0.01
Coal India	インド・ルピー	735,953	6,467,628	0.65
Container of India	インド・ルピー	227,105	5,282,309	0.53
Dr Reddy's Laboratories	インド・ルピー	38,998	1,336,414	0.13
Dr Reddy's Laboratories ADR	アメリカ・ドル	98,405	3,378,244	0.34
Educomp Solutions	インド・ルピー	76,861	673,828	0.07
GMR Infrastructure	インド・ルピー	3,754,227	2,742,028	0.28
Housing Development Finance	インド・ルピー	843,221	13,322,901	1.34
ICICI Bank	インド・ルピー	476,285	11,663,003	1.17
Infosys Technologies	インド・ルピー	144,074	9,380,240	0.94
Jaiprakash Associates	インド・ルピー	3,334,621	6,038,534	0.61
Mundra Port and Special Economic Zone	インド・ルピー	1,470,609	5,327,781	0.54
Reliance Industries	インド・ルピー	250,482	5,034,575	0.51
United Spirits	インド・ルピー	184,061	4,035,734	0.41
Zee Entertainment Enterprises	インド・ルピー	1,312,325	3,960,240	0.40
インド計			81,887,315	8.25
インドネシア				
Astra International	インドネシア・ルピア	1,307,000	9,685,715	0.97
Bank Mandiri	インドネシア・ルピア	10,389,983	8,723,442	0.88
インドネシア計			18,409,157	1.85
ルクセンブルグ				
MHP GDR	アメリカ・ドル	224,971	3,712,022	0.37
Tenaris ADR	アメリカ・ドル	195,400	8,935,642	0.90
ルクセンブルグ計			12,647,664	1.27
マレーシア				
CIMB Group Holdings Berhad	マレーシア・リンギット	5,210,608	15,410,078	1.55
マレーシア計			15,410,078	1.55
メキシコ				
America Movil (Series L) ADR	アメリカ・ドル	439,610	23,686,187	2.39
Fresnillo	イギリス・ポンド	321,891	7,245,254	0.73
Grupo Financiero Banorte Class O	メキシコ・ペソ	2,388,400	10,855,530	1.09
Urbi Desarrollos Urbanos	メキシコ・ペソ	2,243,700	4,915,251	0.49
Wal-Mart de Mexico (Series V)	メキシコ・ペソ	6,532,140	19,323,089	1.95
メキシコ計			66,025,311	6.65
オマーン				
Bank Muscat	オマーン・リアル	915,015	1,763,255	0.18
Bank Muscat GDR	アメリカ・ドル	477,338	3,670,729	0.37
オマーン計			5,433,984	0.55
フィリピン				
Metro Pacific Investments	フィリピン・ペソ	74,789,000	6,178,484	0.62
SM Investments	フィリピン・ペソ	302,910	3,736,135	0.38
フィリピン計			9,914,619	1.00
カタール				
Qatar National Bank	カタール・リヤル	303,541	11,753,201	1.18
カタール計			11,753,201	1.18
ロシア				
CTC Media	アメリカ・ドル	207,600	4,426,032	0.45

Magnit GDR	アメリカ・ドル	364,390	11,438,202	1.15
Magnitogorsk Iron & Steel Works GDR	アメリカ・ドル	368,963	4,198,799	0.42
NovaTek GDR	アメリカ・ドル	62,109	8,577,253	0.86
OA0 Gazprom ADR	アメリカ・ドル	1,020,884	14,884,489	1.50
Rosneft Oil GDR	アメリカ・ドル	1,215,630	10,235,605	1.03
Sberbank of Russian Federation	アメリカ・ドル	5,210,145	18,663,985	1.88
Uralkali GDR	アメリカ・ドル	100,900	4,540,500	0.46
X5 Retail Group GDR	アメリカ・ドル	205,736	8,044,278	0.81
ロシア 計			85,009,143	8.56
南アフリカ				
AngloGold Ashanti	南アフリカ・ランド	272,108	11,459,925	1.15
Shoprite Holdings	南アフリカ・ランド	203,600	3,057,454	0.31
Standard Bank Group/South Africa	南アフリカ・ランド	378,401	5,580,284	0.56
Truworths International	南アフリカ・ランド	974,120	10,531,532	1.06
南アフリカ 計			30,629,195	3.08
韓国				
Amorepacific	韓国・ウォン	5,840	6,498,309	0.65
Hana Financial Group	韓国・ウォン	175,790	6,141,495	0.62
Hyundai Mobis	韓国・ウォン	51,967	19,469,676	1.96
LG	韓国・ウォン	99,202	7,461,172	0.75
LG Display	韓国・ウォン	60,490	1,674,219	0.17
LG Household & Health Care	韓国・ウォン	56,297	24,202,991	2.44
NHN	韓国・ウォン	24,400	4,319,393	0.43
POSCO	韓国・ウォン	14,809	6,435,982	0.65
Samsung Electronics	韓国・ウォン	41,153	31,838,503	3.21
Samsung Fire & Marine Insurance	韓国・ウォン	30,609	7,110,038	0.72
韓国 計			115,151,778	11.60
スイス				
Compagnie Financière Richemont	南アフリカ・ランド	1,091,801	7,097,753	0.71
スイス 計			7,097,753	0.71
台湾				
Far Eastern New Century	台湾・ドル	4,204,418	6,550,306	0.66
Foxconn Technology	台湾・ドル	1,376,140	5,701,278	0.57
Hon Hai Precision Industry	台湾・ドル	3,979,511	13,646,729	1.37
MediaTek	台湾・ドル	154,093	1,673,787	0.17
Siliconware Precision Industries	台湾・ドル	5,388,000	6,931,140	0.70
Synnex Technology International	台湾・ドル	2,205,000	5,350,619	0.54
Taiwan Semiconductor Manufacturing	台湾・ドル	1,882,050	4,730,761	0.48
Uni-President Enterprises	台湾・ドル	6,537,282	9,467,890	0.95
台湾 計			54,052,510	5.44
タイ				
CP ALL (Foreign)	タイ・バーツ	2,689,200	3,872,973	0.39
Kasikornbank	タイ・バーツ	2,274,400	9,105,002	0.92
タイ 計			12,977,975	1.31
トルコ				
BIM Birlesik Magazalar	トルコ・リラ	295,379	9,594,361	0.96
Turkiye Garanti Bankasi	トルコ・リラ	1,679,757	7,612,692	0.77
Turkiye Halk Bankasi	トルコ・リラ	610,193	4,565,175	0.46
トルコ 計			21,772,228	2.19
アラブ首長国連邦				
DP World	アメリカ・ドル	453,364	5,567,310	0.56
アラブ首長国連邦 計			5,567,310	0.56

イギリス				
Antofagasta	イギリス・債券	587,463	13,147,406	1.33
Standard Chartered	イギリス・債券	144,594	3,802,428	0.38
Tullow Oil	イギリス・債券	251,718	5,011,096	0.50
イギリス 計			21,960,930	2.21
優先株式				
ブラジル				
Banco Bradesco	ブラジル・リアル	795,090	16,133,367	1.63
Itau Unibanco Holding	ブラジル・リアル	1,150,485	26,842,809	2.70
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	563,700	17,294,316	1.74
Vale ADR	アメリカ・ドル	511,500	14,813,040	1.49
ブラジル 計			75,083,532	7.56
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			966,056,344	97.27
有価証券 合計			966,056,344	97.27
その他資産（負債控除後）			27,067,815	2.73
純資産			993,124,159	100.00

1. 中国A株は制限を受けることがある。2011年6月30日現在で保有する中国A株の評価額は 8,390,452アメリカ・ドル、対純資産比率0.84%である（詳細は注記3b参照）。

ADR: American Depositary Receipts

GDR: Global Depositary Receipts

* T.ロウ・ブライス・インターナショナル・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

2011年6月30日現在(未監査)

銘柄名	通貨	株数または 額面金額(アメリカ・ドル)	評価額	対純資 産比率 (%)
公認の証券取引所上で上場または取引されている有価証券				
ベルギー				
Ontex IV SerRegS 7.5%/2018	ユーロ	3,412,000	4,810,849	0.27
ベルギー 計			4,810,849	0.27
バミューダ				
Aircastle 9.75%/2018	アメリカ・ドル	3,150,000	3,488,625	0.20
Petroplus Finance Ser144A 9.375%/2019	アメリカ・ドル	3,620,000	3,656,200	0.20
バミューダ 計			7,144,825	0.40
カナダ				
Bombardier SerRegS 6.125%/2021	ユーロ	2,275,000	3,240,686	0.18
Kinder Morgan Finance 5.7%/2016	アメリカ・ドル	1,467,000	1,534,849	0.09
カナダ 計			4,775,535	0.27
ケイマン諸島				
DP World Sukuk SerRegS 6.25%/2017	アメリカ・ドル	10,120,000	10,499,500	0.59
ケイマン諸島 計			10,499,500	0.59
フランス				
Compagnie Générale de Géophysique-Véritas 9.5%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,097,500	0.06
Crown European Holdings SerRegS 7.125%/2018	ユーロ	600,000	896,007	0.05
Labco SAS SerRegS 8.5%/2018	ユーロ	875,000	1,284,686	0.07
フランス 計			3,278,193	0.18
ドイツ				
HeidelbergCement 8%/2017	ユーロ	3,902,000	6,180,616	0.34
Hella KGAA Hueck 7.25%/2014	ユーロ	2,500,000	3,996,149	0.22
Kabel BW Erste Beteiligungs SerRegS 7.5%/2019	ユーロ	4,150,000	6,219,947	0.35
Musketeer SerRegS 9.5%/2021	ユーロ	2,375,000	3,684,431	0.21
Styrolution SerRegS 7.625%/2016	ユーロ	525,000	750,131	0.04
Unitymedia Hessen Ser144A 8.125%/2017	アメリカ・ドル	1,775,000	1,894,813	0.11
ドイツ 計			22,726,087	1.27
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance SerRegS 9.25%/2020	ユーロ	2,600,000	3,901,942	0.22
Irish Government 5%/2013	ユーロ	4,650,000	5,935,210	0.33
Nara Cable Funding SerRegS 8.875%/2018	ユーロ	2,225,000	3,266,240	0.18
Ono Finance II Ser144A 10.875%/2019	アメリカ・ドル	1,050,000	1,123,500	0.06
アイルランド 計			14,226,892	0.79
日本				
Tokyo Electric Power 2.75%/2012	スイス・フラン	775,000	864,650	0.05
Tokyo Electric Power 4.5%/2014	ユーロ	1,050,000	1,284,476	0.07
日本 計			2,149,126	0.12
ルクセンブルグ				
ALROSA Finance SerRegS 7.75%/2020	アメリカ・ドル	2,375,000	2,588,750	0.14
Codere Finance SerRegS 8.25%/2015	ユーロ	2,250,000	3,327,406	0.18
Sunrise Communications Holdings SerRegS 8.5%/2018	ユーロ	4,475,000	6,809,238	0.38
Sunrise Communications International SerRegS 7%/2017	ユーロ	800,000	1,188,877	0.07
Wind Acquisition Finance Ser144A 7.25%/2018	アメリカ・ドル	3,550,000	3,700,875	0.21
Xefin Lux SerRegS 8%/2018	ユーロ	450,000	654,879	0.04
ルクセンブルグ 計			18,270,025	1.02
オランダ				
Clondalkin Acquisition SerRegS VR 3.471%/2013	ユーロ	625,000	881,237	0.05
Conti-Gummi Finance SerRegS 7.5%/2017	ユーロ	675,000	1,020,202	0.06
Goodyear Dunlop Tires Europe SerRegS 6.75%/2019	ユーロ	775,000	1,115,207	0.06
Hertz Holdings Netherlands SerRegS 8.5%/2015	ユーロ	1,225,000	1,878,936	0.10
New World Resources SerRegS 7.875%/2018	ユーロ	3,625,000	5,439,656	0.30
OI European Group SerRegS 6.75%/2020	ユーロ	1,225,000	1,771,626	0.10

Polish Television Holding SerRegS step coupon 11.25%/2017	ユーロ	925,000	1,401,461	0.08
Refresco Group SerRegS 7.375%/2018	ユーロ	500,000	738,807	0.04
UPC Holding SerRegS 8.375%/2020	ユーロ	3,600,000	5,317,429	0.30
オランダ 計			19,564,561	1.09
スペイン				
Campofrio Food SerRegS 8.25%/2016	ユーロ	2,450,000	3,605,414	0.20
スペイン 計			3,605,414	0.20
スウェーデン				
Cyfrowy Polsat Finance SerRegS 7.125%/2018	ユーロ	782,000	1,128,114	0.06
TVN Finance II SerRegS 10.75%/2017	ユーロ	600,000	961,250	0.06
スウェーデン 計			2,089,364	0.12
アラブ首長国連邦				
DP World SerRegS 6.85%/2037	アメリカ・ドル	3,030,000	2,901,846	0.16
Dubai Electricity & Water Authority SerRegS 7.375%/2020	アメリカ・ドル	2,575,000	2,656,229	0.15
アラブ首長国連邦 計			5,558,075	0.31
イギリス				
Crown Newco 3 SerRegS 7%/2018	イギリス・ポンド	900,000	1,416,007	0.08
EC Finance SerRegS 9.75%/2017	ユーロ	1,500,000	2,316,135	0.13
Kerling SerRegS 10.625%/2017	ユーロ	2,450,000	3,762,117	0.21
MU Finance Ser144A 8.375%/2017	アメリカ・ドル	3,775,000	4,039,250	0.23
Odeon & UCI Finco SerRegS 9%/2018	イギリス・ポンド	750,000	1,173,985	0.06
R&R Ice Cream SerRegS 8.375%/2017	ユーロ	2,475,000	3,534,553	0.20
Vedanta Resources SerRegS 8.25%/2021	アメリカ・ドル	2,975,000	3,012,188	0.17
Vedanta Resources SerRegS 9.5%/2018	アメリカ・ドル	2,450,000	2,695,490	0.15
イギリス 計			21,949,725	1.23
アメリカ				
ACCO Brands 10.625%/2015	アメリカ・ドル	1,445,000	1,618,400	0.09
Advanced Micro Devices 7.75%/2020	アメリカ・ドル	1,075,000	1,112,625	0.06
Advanced Micro Devices 8.125%/2017	アメリカ・ドル	2,625,000	2,756,250	0.15
AK Steel 7.625%/2020	アメリカ・ドル	3,400,000	3,502,000	0.20
Ally Financial pref stk	アメリカ・ドル	359,900	18,442,609	1.03
Springleaf Finance SerMTN 6.9%/2017	アメリカ・ドル	4,875,000	4,475,250	0.25
American International Group 6.25%/2037	アメリカ・ドル	3,675,000	3,362,625	0.19
Ameristar Casinos com stk	アメリカ・ドル	82,575	1,957,853	0.11
Anadarko Petroleum 8.7%/2019	アメリカ・ドル	2,120,000	2,705,514	0.15
Anadarko Petroleum com stk	アメリカ・ドル	32,300	2,472,888	0.14
Anixter 10%/2014	アメリカ・ドル	1,600,000	1,828,000	0.10
Anvil Holdings com stk	アメリカ・ドル	218	1,090	0.00
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
Arch Coal 8.75%/2016	アメリカ・ドル	2,825,000	3,079,250	0.17
Ares Capital com stk	アメリカ・ドル	150,800	2,423,356	0.14
AT&T com stk	アメリカ・ドル	147,725	4,640,042	0.26
Avaya 9.75%/2015	アメリカ・ドル	550,000	563,750	0.03
Ball 7.375%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,392,287	0.08
Beazer Homes 8.125%/2016	アメリカ・ドル	825,000	728,062	0.04
Beazer Homes 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,700,000	1,474,750	0.08
Belo 8%/2016	アメリカ・ドル	6,400,000	7,040,000	0.39
Berry Petroleum 6.75%/2020	アメリカ・ドル	1,460,000	1,470,950	0.08
Berry Petroleum 10.25%/2014	アメリカ・ドル	3,175,000	3,643,312	0.20
Bill Barrett 9.875%/2016	アメリカ・ドル	4,500,000	5,062,500	0.28
Cablevision Systems 7.75%/2018	アメリカ・ドル	1,750,000	1,874,687	0.11
Cablevision Systems 8%/2020	アメリカ・ドル	700,000	754,250	0.04
Case New Holland 7.75%/2013	アメリカ・ドル	2,000,000	2,175,000	0.12
CB Richard Ellis Services 6.625%/2020	アメリカ・ドル	2,450,000	2,529,625	0.14
CB Richard Ellis Services 11.625%/2017	アメリカ・ドル	1,250,000	1,454,687	0.08
CF Industries 6.875%/2018	アメリカ・ドル	3,000,000	3,408,750	0.19
Chesapeake Energy 6.625%/2020	アメリカ・ドル	2,700,000	2,855,250	0.16
Chesapeake Energy 9.5%/2015	アメリカ・ドル	2,000,000	2,330,000	0.13
Cincinnati Bell 7%/2015	アメリカ・ドル	4,675,000	4,756,812	0.27
CIT Group 7%/2014	アメリカ・ドル	2,788,360	2,826,699	0.16
CIT Group 7%/2017	アメリカ・ドル	9,604,000	9,591,995	0.54
CIT Group com stk	アメリカ・ドル	63,475	2,809,403	0.16
Clear Channel Communications 7.25%/2027	アメリカ・ドル	1,125,000	646,875	0.04
Community Health Systems 8.875%/2015	アメリカ・ドル	7,525,000	7,769,562	0.43

Complete Production Services 8%/2016	アメリカ・ドル	3,225,000	3,386,250	0.19
Concho Resources 7%/2021	アメリカ・ドル	1,275,000	1,322,812	0.07
Concho Resources 8.625%/2017	アメリカ・ドル	3,650,000	3,996,750	0.22
Consol Energy 8%/2017	アメリカ・ドル	6,500,000	7,117,500	0.40
Consol Energy 8.25%/2020	アメリカ・ドル	3,475,000	3,805,125	0.21
Constellation Brands 7.25%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,097,500	0.06
Constellation Brands 8.375%/2014	アメリカ・ドル	225,000	257,062	0.01
Crown Castle International 7.125%/2019	アメリカ・ドル	7,079,000	7,486,042	0.42
DaVita 6.375%/2018	アメリカ・ドル	2,925,000	2,968,875	0.17
DaVita 6.625%/2020	アメリカ・ドル	1,500,000	1,533,750	0.09
Denbury Resources 8.25%/2020	アメリカ・ドル	1,172,000	1,274,568	0.07
Denbury Resources 9.75%/2016	アメリカ・ドル	3,550,000	3,984,875	0.22
Discover Financial Services 10.25%/2019	アメリカ・ドル	3,700,000	4,787,896	0.27
Dollar General com stk	アメリカ・ドル	54,050	1,831,754	0.10
Domtar 9.5%/2016	アメリカ・ドル	275,000	338,250	0.02
El Paso 8.25%/2016	アメリカ・ドル	165,000	196,457	0.01
El Paso SerGMTN 7.75%/2032	アメリカ・ドル	500,000	584,136	0.03
El Paso SerGMTN 7.8%/2031	アメリカ・ドル	300,000	351,616	0.02
Encore Acquisition 9.5%/2016	アメリカ・ドル	525,000	586,031	0.03
Energy Transfer Equity 7.5%/2020	アメリカ・ドル	5,675,000	6,043,875	0.34
Esterline Technologies 7%/2020	アメリカ・ドル	3,300,000	3,473,250	0.19
Fidelity National Information Services 7.625%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,865,937	0.10
Fidelity National Information Services 7.875%/2020	アメリカ・ドル	3,050,000	3,252,062	0.18
Ford Motor 7.45%/2031	アメリカ・ドル	3,875,000	4,412,218	0.25
Ford Motor com stk	アメリカ・ドル	179,500	2,475,305	0.14
Ford Motor Credit 5.75%/2021	アメリカ・ドル	8,900,000	8,911,294	0.50
Ford Motor Credit 12%/2015	アメリカ・ドル	4,050,000	5,026,495	0.28
Forest Oil 7.25%/2019	アメリカ・ドル	2,867,000	2,938,675	0.16
Forest Oil 8.5%/2014	アメリカ・ドル	500,000	545,000	0.03
FTI Consulting 7.75%/2016	アメリカ・ドル	1,750,000	1,837,500	0.10
Gaylord Entertainment 6.75%/2014	アメリカ・ドル	900,000	915,750	0.05
General Growth Properties com stk	アメリカ・ドル	111,932	1,868,145	0.10
General Motors SerB pref stk	アメリカ・ドル	103,425	5,040,935	0.28
GenOn Energy 7.875%/2017	アメリカ・ドル	500,000	505,000	0.03
Global Geophysical Services 10.5%/2017	アメリカ・ドル	2,325,000	2,452,875	0.14
GMAC Capital Trust I pref stk	アメリカ・ドル	94,725	2,424,960	0.14
Goodyear Tire & Rubber 10.5%/2016	アメリカ・ドル	235,000	264,791	0.01
Graphic Packaging International 7.875%/2018	アメリカ・ドル	2,025,000	2,156,625	0.12
Graphic Packaging International 9.5%/2017	アメリカ・ドル	2,000,000	2,200,000	0.12
Greif 7.75%/2019	アメリカ・ドル	450,000	488,250	0.03
Hanesbrands 8%/2016	アメリカ・ドル	1,075,000	1,149,261	0.06
HCA 9.625%/2016	アメリカ・ドル	3,181,000	3,391,741	0.19
HCA 9.875%/2017	アメリカ・ドル	374,000	417,945	0.02
Host Hotels & Resorts SerQ 6.75%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,037,500	0.06
Huntsman International 5.5%/2016	アメリカ・ドル	3,100,000	3,065,125	0.17
Inergy Finance 8.75%/2015	アメリカ・ドル	1,282,000	1,368,727	0.08
International Lease Finance 5.75%/2016	アメリカ・ドル	1,875,000	1,848,274	0.10
International Lease Finance 8.25%/2020	アメリカ・ドル	18,025,000	19,512,063	1.09
International Lease Finance 8.875%/2017	アメリカ・ドル	4,700,000	5,193,500	0.29
Interpublic Group of 10%/2017	アメリカ・ドル	1,000,000	1,181,555	0.07
Jabil Circuit 5.625%/2020	アメリカ・ドル	3,500,000	3,447,500	0.19
Jabil Circuit 7.75%/2016	アメリカ・ドル	1,925,000	2,141,563	0.12
Jarden 8%/2016	アメリカ・ドル	2,175,000	2,370,750	0.13
JC Penney 7.125%/2023	アメリカ・ドル	350,000	365,750	0.02
Lakes Entertainment com stk	アメリカ・ドル	102,025	224,455	0.01
Las Vegas Sands Class A pref stk	アメリカ・ドル	17,600	1,971,200	0.11
Lender Processing Services 8.125%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	980,000	0.05
Loral Space & Communications com stk	アメリカ・ドル	30,176	2,096,327	0.12
Lucent Technologies Capital Trust I pref stk	アメリカ・ドル	14,175	13,944,656	0.78
Mac-Gray 7.625%/2015	アメリカ・ドル	1,000,000	1,025,000	0.06
Manitowoc 8.5%/2020	アメリカ・ドル	2,675,000	2,868,938	0.16
Masco 6.125%/2016	アメリカ・ドル	725,000	745,583	0.04
Masco 7.125%/2020	アメリカ・ドル	1,025,000	1,050,918	0.06
McClatchy 11.5%/2017	アメリカ・ドル	3,625,000	3,869,688	0.22
MetroPCS Wireless 7.875%/2018	アメリカ・ドル	5,325,000	5,664,469	0.32
MGM Resorts International 10.375%/2014	アメリカ・ドル	1,625,000	1,852,500	0.10
MGM Resorts International 11.125%/2017	アメリカ・ドル	4,425,000	5,077,688	0.28
MGM Resorts International 11.375%/2018	アメリカ・ドル	600,000	676,500	0.04
MGM Resorts International 13%/2013	アメリカ・ドル	1,800,000	2,146,500	0.12
Moog 7.25%/2018	アメリカ・ドル	1,575,000	1,679,344	0.09
Newfield Exploration 6.875%/2020	アメリカ・ドル	3,325,000	3,549,438	0.20

Nextel Communications SerC 5.95%/2014	アメリカ・ドル	1,000,000	1,003,750	0.06
Nextel Communications SerD 7.375%/2015	アメリカ・ドル	3,700,000	3,718,500	0.21
Owens-Brockway Glass Container 7.375%/2016	アメリカ・ドル	3,500,000	3,823,750	0.21
Patriot Coal 8.25%/2018	アメリカ・ドル	2,700,000	2,808,000	0.16
Peabody Energy 7.375%/2016	アメリカ・ドル	1,005,000	1,140,675	0.06
Penn Virginia 7.25%/2019	アメリカ・ドル	900,000	871,875	0.05
Penn Virginia 10.375%/2016	アメリカ・ドル	1,405,000	1,563,063	0.09
Penn Virginia Resource Partners Finance 8.25%/2018	アメリカ・ドル	2,275,000	2,360,313	0.13
Petrohawk Energy 7.25%/2018	アメリカ・ドル	5,225,000	5,388,281	0.30
Petrohawk Energy 10.5%/2014	アメリカ・ドル	1,600,000	1,808,000	0.10
Petrohawk Energy 7.875%/2015	アメリカ・ドル	250,000	262,863	0.01
Pinnacle Entertainment 8.625%/2017	アメリカ・ドル	1,700,000	1,833,875	0.10
Pinnacle Entertainment 8.75%/2020	アメリカ・ドル	1,725,000	1,815,563	0.10
Plains Exploration & Production 10%/2016	アメリカ・ドル	2,975,000	3,361,750	0.19
PNM Resources 9.25%/2015	アメリカ・ドル	5,325,000	5,964,000	0.33
PolyOne 7.375%/2020	アメリカ・ドル	4,425,000	4,646,250	0.26
Phillips-Van Heusen 7.375%/2020	アメリカ・ドル	3,300,000	3,547,500	0.20
QEP Resources 6.875%/2021	アメリカ・ドル	950,000	1,007,000	0.06
Quicksilver Resources 9.125%/2019	アメリカ・ドル	2,950,000	3,230,250	0.18
Quicksilver Resources 11.75%/2016	アメリカ・ドル	4,980,000	5,727,000	0.32
Qwest 8.375%/2016	アメリカ・ドル	225,000	266,625	0.02
Qwest Communications International SerB 7.5%/2014	アメリカ・ドル	1,725,000	1,755,188	0.10
Range Resources 6.75%/2020	アメリカ・ドル	3,725,000	3,874,000	0.22
Reckson Operating Partnership 6%/2016	アメリカ・ドル	1,575,000	1,689,164	0.09
Regal Cinemas 8.625%/2019	アメリカ・ドル	4,725,000	4,984,875	0.28
Regal Entertainment Group 9.125%/2018	アメリカ・ドル	5,200,000	5,408,000	0.30
Regions Bank SerBKNT 7.5%/2018	アメリカ・ドル	2,825,000	2,958,069	0.17
Rite Aid 8%/2020	アメリカ・ドル	500,000	541,250	0.03
Rite Aid 8.625%/2015	アメリカ・ドル	3,325,000	3,125,500	0.17
Rite Aid 9.5%/2017	アメリカ・ドル	1,200,000	1,101,000	0.06
Rite Aid 10.25%/2019	アメリカ・ドル	2,375,000	2,624,375	0.15
Rite Aid 10.375%/2016	アメリカ・ドル	1,150,000	1,227,625	0.07
Sheraton Holding 7.375%/2015	アメリカ・ドル	775,000	881,563	0.05
SLM SerMTN 5.05%/2014	アメリカ・ドル	175,000	175,120	0.01
SLM SerMTN 6.25%/2016	アメリカ・ドル	5,525,000	5,737,834	0.32
SLM SerMTN 8.45%/2018	アメリカ・ドル	5,475,000	6,017,397	0.34
SLM SerMTNA 5.375%/2014	アメリカ・ドル	3,000,000	3,125,451	0.17
Smithfield Foods 7.75%/2017	アメリカ・ドル	750,000	781,875	0.04
Solutia 8.75%/2017	アメリカ・ドル	3,550,000	3,869,500	0.22
Southwestern Energy 7.5%/2018	アメリカ・ドル	5,850,000	6,656,569	0.37
Spanish Broadcasting System SerB pref stk	アメリカ・ドル	26,247	1,403,898	0.08
Speedway Motorsports 8.75%/2016	アメリカ・ドル	3,470,000	3,760,613	0.21
Spirit Aerosystems 7.5%/2017	アメリカ・ドル	3,750,000	3,965,625	0.22
Sprint Capital 6.875%/2028	アメリカ・ドル	2,825,000	2,690,813	0.15
Sprint Capital 8.75%/2032	アメリカ・ドル	4,525,000	4,920,938	0.28
Sprint Nextel 8.375%/2017	アメリカ・ドル	13,550,000	14,955,813	0.84
Sprint Nextel com stk	アメリカ・ドル	361,475	1,948,350	0.11
Standard Pacific 10.75%/2016	アメリカ・ドル	1,675,000	1,905,313	0.11
Standard Pacific 8.375%/2018	アメリカ・ドル	750,000	747,188	0.04
Swift Energy 7.125%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,780,625	0.10
Swift Energy 8.875%/2020	アメリカ・ドル	3,650,000	3,923,750	0.22
Synovus Financial 5.125%/2017	アメリカ・ドル	3,775,000	3,443,576	0.19
Tenet Healthcare 6.5%/2012	アメリカ・ドル	450,000	454,500	0.03
Tenet Healthcare 8%/2020	アメリカ・ドル	5,400,000	5,514,750	0.31
Tenet Healthcare 8.875%/2019	アメリカ・ドル	4,000,000	4,435,000	0.25
Terex 8%/2017	アメリカ・ドル	4,500,000	4,635,000	0.26
Terex 10.875%/2016	アメリカ・ドル	125,000	144,688	0.01
Tesoro 9.75%/2019	アメリカ・ドル	1,100,000	1,234,750	0.07
Texas Industries 9.25%/2020	アメリカ・ドル	4,125,000	4,011,563	0.22
Ticketmaster Entertainment 10.75%/2016	アメリカ・ドル	3,350,000	3,668,250	0.21
TreeHouse Foods 7.75%/2018	アメリカ・ドル	6,525,000	6,949,125	0.39
Unit com stk	アメリカ・ドル	31,875	1,942,144	0.11
United Rentals North America 8.375%/2020	アメリカ・ドル	3,475,000	3,535,813	0.20
United Rentals North America 10.875%/2016	アメリカ・ドル	6,150,000	6,911,063	0.39
United States Steel 6.05%/2017	アメリカ・ドル	4,600,000	4,566,650	0.26
US Treasury Bill 0%/2011	アメリカ・ドル	2,000,000	1,999,563	0.11
Wendy's/Arby's Restaurants 10%/2016	アメリカ・ドル	4,500,000	4,983,795	0.28
Whiting Petroleum 6.5%/2018	アメリカ・ドル	275,000	287,375	0.02
Zions Bancorporation 7.75%/2014	アメリカ・ドル	1,515,000	1,662,317	0.09
アメリカ 計			538,523,768	30.10

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			679,171,939	37.96
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				
NCL 11.75%/2016	アメリカ・ドル	3,750,000	4,340,625	0.24
バミューダ 計			4,340,625	0.24
カナダ				
Cascades 7.75%/2017	アメリカ・ドル	1,200,000	1,257,000	0.07
Cascades 7.875%/2020	アメリカ・ドル	2,800,000	2,929,500	0.16
Novelis 8.75%/2020	アメリカ・ドル	3,975,000	4,312,875	0.24
Precision Drilling 6.625%/2020	アメリカ・ドル	3,625,000	3,679,375	0.21
Russel Metals 6.375%/2014	アメリカ・ドル	1,285,000	1,302,669	0.07
Telesat Canada/Telesat 11%/2015	アメリカ・ドル	6,000,000	6,592,500	0.37
Telesat Canada/Telesat 12.5%/2017	アメリカ・ドル	2,050,000	2,470,250	0.14
Videotron 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,050,000	1,177,312	0.07
カナダ 計			23,721,481	1.33
ケイマン諸島				
Offshore Group Investments 11.5%/2015	アメリカ・ドル	2,300,000	2,512,750	0.14
Seagate Technology HDD Holdings 6.8%/2016	アメリカ・ドル	3,850,000	4,071,375	0.23
ケイマン諸島 計			6,584,125	0.37
ルクセンブルグ				
Codere Finance Ser144A 8.25%/2015	ユーロ	125,000	184,856	0.01
Intelsat Luxembourg step coupon 11.25%/2017	アメリカ・ドル	11,935,000	12,845,044	0.72
ルクセンブルグ 計			13,029,900	0.73
メキシコ				
Kansas City Southern de Mexico 8%/2018	アメリカ・ドル	3,360,000	3,662,400	0.20
メキシコ 計			3,662,400	0.20
イギリス				
Virgin Media Finance Ser1 9.5%/2016	アメリカ・ドル	1,500,000	1,702,500	0.09
イギリス 計			1,702,500	0.09
アメリカ				
Accellent 10%/2017	アメリカ・ドル	5,000,000	4,925,000	0.27
Accellent 8.375%/2017	アメリカ・ドル	475,000	493,406	0.03
AES 9.75%/2016	アメリカ・ドル	5,675,000	6,469,500	0.36
Ally Financial 7.5%/2020	アメリカ・ドル	3,850,000	4,042,500	0.23
Ally Financial 8%/2031	アメリカ・ドル	3,700,000	4,023,750	0.22
Altra Holdings 8.125%/2016	アメリカ・ドル	2,110,000	2,289,350	0.13
AMC Entertainment 8.75%/2019	アメリカ・ドル	3,261,000	3,456,660	0.19
Amsouth Bank SerA1 5.2%/2015	アメリカ・ドル	2,900,000	2,798,944	0.16
Antero Resources Finance 9.375%/2017	アメリカ・ドル	7,800,000	8,424,000	0.47
Ashland 9.125%/2017	アメリカ・ドル	5,525,000	6,243,250	0.35
Aspect Software 10.625%/2017	アメリカ・ドル	1,000,000	1,080,000	0.06
Avaya 10.125%/2015	アメリカ・ドル	12,175,000	12,570,687	0.70
Avis Budget Car Rental 7.625%/2014	アメリカ・ドル	1,331,000	1,357,620	0.08
Avis Budget Car Rental 9.625%/2018	アメリカ・ドル	850,000	911,625	0.05
BAC Capital Trust VI 5.625%/2035	アメリカ・ドル	3,295,000	2,846,982	0.16
Bausch & Lomb 9.875%/2015	アメリカ・ドル	2,500,000	2,662,500	0.15
BE Aerospace 8.5%/2018	アメリカ・ドル	2,600,000	2,843,750	0.16
Biomet 10.375%/2017	アメリカ・ドル	7,850,000	8,693,875	0.49
Biomet 11.625%/2017	アメリカ・ドル	7,175,000	7,982,187	0.45
Boise Paper Holdings 8%/2020	アメリカ・ドル	950,000	1,002,250	0.06
Boise Paper Holdings 9%/2017	アメリカ・ドル	2,400,000	2,622,000	0.15
BWAY Holding 10%/2018	アメリカ・ドル	3,000,000	3,288,750	0.18
Caesars Entertainment Operating 10%/2018	アメリカ・ドル	1,775,000	1,610,812	0.09
Caesars Entertainment Operating 11.25%/2017	アメリカ・ドル	7,725,000	8,565,094	0.48
CCH II Capital 13.5%/2016	アメリカ・ドル	3,100,000	3,665,750	0.20
CCO Holdings 7%/2019	アメリカ・ドル	525,000	543,375	0.03
CCO Holdings 7.25%/2017	アメリカ・ドル	5,275,000	5,492,594	0.31
CCO Holdings 7.875%/2018	アメリカ・ドル	3,700,000	3,917,375	0.22
CDW 11.5%/2015	アメリカ・ドル	2,275,000	2,411,500	0.13
CDW 12.535%/2017	アメリカ・ドル	11,625,000	12,584,062	0.70
Cedar Fair 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,775,000	1,903,687	0.11
Central Garden and Pet 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,375,000	3,501,562	0.20

Clear Channel Communications 11%/2016	アメリカ・ドル	6,975,000	6,207,750	0.35
Clearwater Paper 7.125%/2018	アメリカ・ドル	650,000	669,500	0.04
Clearwater Paper 10.625%/2016	アメリカ・ドル	2,250,000	2,534,062	0.14
Coleman Cable 9%/2018	アメリカ・ドル	2,050,000	2,152,500	0.12
Columbus McKinnon 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,300,000	1,326,000	0.07
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	666,342	717,983	0.04
Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust SerB 9.25%/2017	アメリカ・ドル	447,216	465,105	0.03
Continental Resources 7.125%/2021	アメリカ・ドル	4,055,000	4,298,300	0.24
Cott Beverages 8.125%/2018	アメリカ・ドル	2,165,000	2,278,662	0.13
Cott Beverages 8.375%/2017	アメリカ・ドル	1,792,000	1,886,080	0.11
Cricket Communications 7.75%/2016	アメリカ・ドル	1,700,000	1,810,500	0.10
Cricket Communications 7.75%/2020	アメリカ・ドル	1,800,000	1,768,500	0.10
Cricket Communications 10%/2015	アメリカ・ドル	3,182,000	3,444,515	0.19
Crown Americas/Crown Americas Capital II 7.625%/2017	アメリカ・ドル	2,625,000	2,812,031	0.16
E*Trade Financial 6.75%/2016	アメリカ・ドル	4,550,000	4,481,750	0.25
E*Trade Financial 7.875%/2015	アメリカ・ドル	2,000,000	2,020,000	0.11
E*Trade Financial 12.5%/2017	アメリカ・ドル	15,328,000	18,010,400	1.01
Easton-Bell Sports 9.75%/2016	アメリカ・ドル	3,550,000	3,931,625	0.22
Equinix 8.125%/2018	アメリカ・ドル	3,283,000	3,590,781	0.20
First Data 11.25%/2016	アメリカ・ドル	7,025,000	6,954,750	0.39
Fresenius Medical Care US Finance 6.875%/2017	アメリカ・ドル	316,000	335,750	0.02
FTI Consulting 6.75%/2020	アメリカ・ドル	825,000	837,375	0.05
GenOn Energy 9.5%/2018	アメリカ・ドル	5,100,000	5,329,500	0.30
GeoEye 9.625%/2015	アメリカ・ドル	875,000	993,125	0.06
Gibraltar Industries SerB 8%/2015	アメリカ・ドル	2,800,000	2,831,500	0.16
Hanesbrands 6.375%/2020	アメリカ・ドル	3,850,000	3,753,750	0.21
Hexion US Finance/Nova Scotia Finance 8.875%/2018	アメリカ・ドル	2,250,000	2,351,250	0.13
Hexion US Finance/Nova Scotia Finance 9%/2020	アメリカ・ドル	1,300,000	1,339,000	0.07
Huntsman International 8.625%/2020	アメリカ・ドル	1,375,000	1,505,625	0.08
Huntsman International 8.625%/2021	アメリカ・ドル	2,300,000	2,512,750	0.14
Inergy Finance 7%/2018	アメリカ・ドル	1,375,000	1,395,625	0.08
Interline Brands 7%/2018	アメリカ・ドル	4,025,000	4,095,438	0.23
JBS Finance 11.625%/2014	アメリカ・ドル	1,650,000	1,905,750	0.11
JDA Software Group 8%/2014	アメリカ・ドル	2,000,000	2,200,000	0.12
Koppers 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,000,000	3,217,500	0.18
Kratos Defense & Security Solutions 10%/2017	アメリカ・ドル	3,150,000	3,339,000	0.19
Lamar Media 7.875%/2018	アメリカ・ドル	3,900,000	4,104,750	0.23
Lamar Media 9.75%/2014	アメリカ・ドル	1,450,000	1,682,000	0.09
Level 3 Financing 8.75%/2017	アメリカ・ドル	1,200,000	1,230,000	0.07
Levi Strauss 7.625%/2020	アメリカ・ドル	2,150,000	2,160,750	0.12
Levi Strauss 8.875%/2016	アメリカ・ドル	2,275,000	2,369,572	0.13
LifePoint Hospitals 6.625%/2020	アメリカ・ドル	3,525,000	3,648,375	0.20
LIN Television 8.375%/2018	アメリカ・ドル	3,475,000	3,674,813	0.21
Linn Energy Finance 8.625%/2020	アメリカ・ドル	3,825,000	4,169,250	0.23
Lyondell Chemical 11%/2018	アメリカ・ドル	2,900,000	3,262,500	0.18
Mediacom Broadband 8.5%/2015	アメリカ・ドル	2,025,000	2,085,750	0.12
Mercer International 9.5%/2017	アメリカ・ドル	3,850,000	4,148,375	0.23
Metals USA 11.125%/2015	アメリカ・ドル	2,055,000	2,178,300	0.12
MGM Resorts International 9%/2020	アメリカ・ドル	3,300,000	3,630,000	0.20

[前](#) [次](#)

Mobile Mini 6.875%/2015	アメリカ・ドル	650,000	664,625	0.04
Momentive Performance Materials 9%/2021	アメリカ・ドル	1,525,000	1,563,125	0.09
Momentive Performance Materials 11.5%/2016	アメリカ・ドル	4,975,000	5,323,250	0.30
NetFlix 8.5%/2017	アメリカ・ドル	2,067,000	2,330,543	0.13
Nexstar Mission Broadcasting 8.875%/2017	アメリカ・ドル	4,500,000	4,758,750	0.27
Nielsen Finance 11.5%/2016	アメリカ・ドル	1,136,000	1,334,800	0.07
Nielsen Finance 11.625%/2014	アメリカ・ドル	2,488,000	2,917,180	0.16
NII Capital 7.625%/2021	アメリカ・ドル	3,025,000	3,176,250	0.18
NII Capital 8.875%/2019	アメリカ・ドル	2,175,000	2,411,531	0.13
NII Capital 10%/2016	アメリカ・ドル	3,825,000	4,456,125	0.25
Niska Gas Storage US/Niska Gas Storage Canada 8.875%/2018	アメリカ・ドル	3,050,000	3,217,750	0.18
Northwest Airlines Ser992A 7.575%/2019	アメリカ・ドル	628,767	661,840	0.04
Nuveen Investments 5.5%/2015	アメリカ・ドル	5,650,000	4,986,125	0.28
Nuveen Investments 10.5%/2015	アメリカ・ドル	7,675,000	7,886,063	0.44
O'Charleys 9%/2013	アメリカ・ドル	1,775,000	1,794,969	0.10
Oshkosh 8.25%/2017	アメリカ・ドル	1,675,000	1,804,813	0.10
Oshkosh 8.5%/2020	アメリカ・ドル	1,675,000	1,821,563	0.10
OSI Restaurant Partners 10%/2015	アメリカ・ドル	4,000,000	4,220,000	0.24
PAETEC Holding 8.875%/2017	アメリカ・ドル	2,250,000	2,373,750	0.13
PH Glatfelter 7.125%/2016	アメリカ・ドル	1,625,000	1,683,906	0.09
PHH 9.25%/2016	アメリカ・ドル	2,700,000	2,966,625	0.17
Pinnacle Foods Finance 9.25%/2015	アメリカ・ドル	3,800,000	3,961,500	0.22
Pinnacle Foods Finance 10.625%/2017	アメリカ・ドル	5,325,000	5,704,406	0.32
Potlatch 7.5%/2019	アメリカ・ドル	1,925,000	2,042,906	0.11
Radiation Therapy Services 9.875%/2017	アメリカ・ドル	2,125,000	2,132,969	0.12
RBS Global & Rexnord 8.5%/2018	アメリカ・ドル	5,750,000	6,102,188	0.34
Realogy VR 11.5%/2017	アメリカ・ドル	5,675,000	5,788,500	0.32
Regency Energy Partners 6.875%/2018	アメリカ・ドル	1,750,000	1,820,000	0.10
Rouse 6.75%/2015	アメリカ・ドル	4,500,000	4,663,125	0.26
RSC Equipment Rental 8.25%/2021	アメリカ・ドル	425,000	425,000	0.02
Ryerson 12%/2015	アメリカ・ドル	3,100,000	3,309,250	0.18
Ryerson Holding 0%/2015	アメリカ・ドル	18,025,000	9,463,125	0.53
SBA Telecommunications 8%/2016	アメリカ・ドル	450,000	480,938	0.03
SBA Telecommunications 8.25%/2019	アメリカ・ドル	3,550,000	3,816,250	0.21
Severstal Columbus 10.25%/2018	アメリカ・ドル	2,275,000	2,525,250	0.14
Silgan Holdings 7.25%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,060,000	0.06
Solo Cup Operating 10.5%/2013	アメリカ・ドル	4,375,000	4,571,875	0.26
Steel Dynamics 7.625%/2020	アメリカ・ドル	1,850,000	1,965,625	0.11
Steel Dynamics 7.75%/2016	アメリカ・ドル	4,275,000	4,510,125	0.25
Susser Holdings 8.5%/2016	アメリカ・ドル	5,025,000	5,313,938	0.30
Texas Competitive Electric Holdings Finance SerA 10.25%/2015	アメリカ・ドル	4,100,000	2,501,000	0.14
Texas Competitive Electric Holdings Finance SerB 10.25%/2015	アメリカ・ドル	2,175,000	1,315,875	0.07
Toys R Us 7.375%/2018	アメリカ・ドル	2,225,000	2,172,156	0.12
Toys R Us Property II 8.5%/2017	アメリカ・ドル	2,525,000	2,651,250	0.15
Travelport 11.875%/2016	アメリカ・ドル	1,002,000	866,730	0.05
Tube City IMS 9.75%/2015	アメリカ・ドル	6,900,000	7,158,750	0.40

United Maritime Group 11.75%/2015	アメリカ・ドル	1,950,000	2,047,500	0.11
United Surgical Partners International 8.875%/2017	アメリカ・ドル	1,150,000	1,207,500	0.07
Universal City Development Partners 8.875%/2015	アメリカ・ドル	2,000,000	2,235,000	0.12
Universal City Development Partners 10.875%/2016	アメリカ・ドル	2,125,000	2,539,375	0.14
Universal Health Services 7%/2018	アメリカ・ドル	3,400,000	3,519,000	0.20
Universal Hospital Services 8.5%/2015	アメリカ・ドル	425,000	439,875	0.02
Vanguard Health Holding 7.75%/2019	アメリカ・ドル	2,175,000	2,213,063	0.12
Vanguard Health Holding 8%/2018	アメリカ・ドル	1,850,000	1,919,375	0.11
Vanguard Health Systems 0% /2016	アメリカ・ドル	4,475,000	2,970,281	0.17
Viasat 8.875%/2016	アメリカ・ドル	1,050,000	1,118,250	0.06
Vulcan Materials 7.5%/2021	アメリカ・ドル	2,075,000	2,075,845	0.12
Windstream 8.625%/2016	アメリカ・ドル	939,000	982,429	0.05
Wynn Las Vegas 7.875%/2017	アメリカ・ドル	3,100,000	3,390,625	0.19
Yankee Candle SerB 8.5%/2015	アメリカ・ドル	2,250,000	2,328,750	0.13
アメリカ 計			460,535,746	25.74
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			513,576,777	28.70

直近に発行された取引可能な有価証券

オーストラリア

FMG Resources August 2006 Property SerRegS 7%/2015	アメリカ・ドル	10,600,000	10,859,482	0.61
--	---------	------------	------------	------

オーストラリア 計			10,859,482	0.61
------------------	--	--	-------------------	-------------

バミューダ

NCL Ser144A 9.5%/2018	アメリカ・ドル	975,000	1,043,250	0.06
-----------------------	---------	---------	-----------	------

バミューダ 計			1,043,250	0.06
----------------	--	--	------------------	-------------

ブラジル

JBS Finance II SerRegS 8.25%/2018	アメリカ・ドル	1,750,000	1,793,750	0.10
-----------------------------------	---------	-----------	-----------	------

OGX Petroleo e Gas Participacoes SerRegS 8.5%/2018	アメリカ・ドル	3,450,000	3,565,575	0.20
--	---------	-----------	-----------	------

ブラジル 計			5,359,325	0.30
---------------	--	--	------------------	-------------

カナダ

CHC Helicopter Ser144A 9.25%/2020	アメリカ・ドル	4,350,000	3,947,625	0.22
-----------------------------------	---------	-----------	-----------	------

Connacher Oil and Gas Ser144A 8.5%/2019	アメリカ・ドル	5,100,000	4,857,750	0.27
---	---------	-----------	-----------	------

MEG Energy Ser144A 6.5%/2021	アメリカ・ドル	850,000	857,437	0.05
------------------------------	---------	---------	---------	------

Thompson Creek Metals Ser144A 7.375%/2018	アメリカ・ドル	1,850,000	1,822,250	0.10
---	---------	-----------	-----------	------

カナダ 計			11,485,062	0.64
--------------	--	--	-------------------	-------------

ケイマン諸島

Offshore Group Investments Ser144A 11.5%/2015	アメリカ・ドル	775,000	846,688	0.05
---	---------	---------	---------	------

ケイマン諸島 計			846,688	0.05
-----------------	--	--	----------------	-------------

フランス

Compagnie Générale de Géophysique-Véritas Ser144A 6.5%/2021	アメリカ・ドル	4,600,000	4,462,000	0.25
---	---------	-----------	-----------	------

フランス 計			4,462,000	0.25
---------------	--	--	------------------	-------------

アイルランド

Ardagh Packaging Finance Ser144A 7.375%/2017	アメリカ・ドル	1,575,000	1,630,125	0.09
--	---------	-----------	-----------	------

アイルランド 計			1,630,125	0.09
-----------------	--	--	------------------	-------------

ルクセンブルグ

Aguila 3 Ser144A 7.875%/2018	アメリカ・ドル	675,000	682,594	0.04
------------------------------	---------	---------	---------	------

Intelsat Jackson Holdings Ser144A 7.25%/2019	アメリカ・ドル	4,050,000	4,029,750	0.23
--	---------	-----------	-----------	------

Intelsat Jackson Holdings Ser144A 7.25%/2020	アメリカ・ドル	2,775,000	2,768,062	0.15
--	---------	-----------	-----------	------

ルクセンブルグ 計			7,480,406	0.42
メキシコ				
Satmex Escrow Ser144A 9.5%/2017	アメリカ・ドル	325,000	331,869	0.02
メキシコ 計			331,869	0.02
オランダ				
NXP Ser144A 9.75%/2018	アメリカ・ドル	450,000	506,250	0.03
Sensata Technologies Ser144A 6.5%/2019	アメリカ・ドル	225,000	225,562	0.01
Sensata Technologies SerRegS 6.5%/2019	アメリカ・ドル	2,500,000	0	0.00
オランダ 計			731,812	0.04
アメリカ				
AEP Industries Ser144A 8.25%/2019	アメリカ・ドル	1,925,000	1,939,437	0.11
AES Ser144A 7.375%/2021	アメリカ・ドル	3,225,000	3,277,406	0.18
Ally Financial Ser144A 6.25%/2017	アメリカ・ドル	900,000	897,374	0.05
Alta Mesa Holdings Ser144A 9.625%/2018	アメリカ・ドル	4,125,000	4,145,625	0.23
AMC Entertainment Ser144A 9.75%/2020	アメリカ・ドル	2,650,000	2,722,875	0.15
American Media Ser144A 11.5%/2017	アメリカ・ドル	1,919,000	2,062,925	0.12
Ameristar Casinos Ser144A 7.5%/2021	アメリカ・ドル	3,825,000	3,963,656	0.22
Associated Materials Ser144A 9.125%/2017	アメリカ・ドル	5,875,000	5,875,000	0.33
Avaya Ser144A 7%/2019	アメリカ・ドル	1,650,000	1,604,625	0.09
Aviv Healthcare Properties Ser144A 7.75%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,387,125	0.08
Bankrate Ser144A 11.75%/2015	アメリカ・ドル	876,000	1,003,020	0.06
Beazer Homes Ser144A 9.125%/2019	アメリカ・ドル	2,125,000	1,838,125	0.10
Buccaneer Merger Sub Ser144A 9.125%/2019	アメリカ・ドル	3,850,000	4,023,250	0.22
Building Materials of America Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	3,100,000	3,123,250	0.17
Bumble Bee Acquisition Ser144A 9%/2017	アメリカ・ドル	1,875,000	1,893,750	0.11
Calpine Ser144A 7.5%/2021	アメリカ・ドル	4,925,000	5,048,125	0.28
Calumet Specialty Products Partners Ser144A 9.375%/2019	アメリカ・ドル	1,225,000	1,267,875	0.07
CDW Ser144A 8%/2018	アメリカ・ドル	900,000	956,250	0.05
CDW Ser144A 8.5%/2019	アメリカ・ドル	4,425,000	4,358,625	0.24
Chrysler Group Ser144A 8.25%/2021	アメリカ・ドル	5,700,000	5,614,500	0.31
Cinemark Ser144A 7.375%/2021	アメリカ・ドル	775,000	775,000	0.04
CIT Group Ser144A 6.625%/2018	アメリカ・ドル	8,350,000	8,746,625	0.49
Claire's Stores Ser144A 8.875%/2019	アメリカ・ドル	4,225,000	3,971,500	0.22
Clearwater Paper Ser144A 7.125%/2018	アメリカ・ドル	975,000	1,004,250	0.06
Clearwire Communications Ser144A CV 8.25%/2040	アメリカ・ドル	2,275,000	2,030,437	0.11
Clearwire Communications Ser144A 12%/2017	アメリカ・ドル	1,650,000	1,732,500	0.10

CommScope Ser144A 8.25%/2019	アメリカ・ドル	5,475,000	5,666,625	0.32
Cricket Communications Ser144A 7.75%/2020	アメリカ・ドル	3,350,000	3,291,375	0.18
Darling International Ser144A 8.5%/2018	アメリカ・ドル	750,000	813,750	0.05
Del Monte Foods Ser144A 7.625%/2019	アメリカ・ドル	5,825,000	5,912,375	0.33
DineEquity Ser144A 9.5%/2018	アメリカ・ドル	5,700,000	6,213,000	0.35
DISH DBS Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	2,450,000	2,523,500	0.14
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma Ser144A 10.5%/2019	アメリカ・ドル	1,400,000	1,400,000	0.08
Ducommun Ser144A 9.75%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,469,531	0.08
Dunkin Brands Ser144A 9.625%/2018	アメリカ・ドル	1,829,000	1,851,862	0.10
Dycom Investments Ser144A 7.125%/2021	アメリカ・ドル	3,300,000	3,382,500	0.19
Eagle Parent Ser144A 8.625%/2019	アメリカ・ドル	2,125,000	2,058,594	0.11
Earthlink Ser144A 8.875%/2019	アメリカ・ドル	1,750,000	1,596,875	0.09
EH Holding Ser144A 6.5%/2019	アメリカ・ドル	4,200,000	4,294,500	0.24
EH Holding Ser144A 7.625%/2021	アメリカ・ドル	4,150,000	4,253,750	0.24
Euramax International Ser144A 9.5%/2016	アメリカ・ドル	3,475,000	3,388,125	0.19
Exopack Holding Ser144A 10%/2018	アメリカ・ドル	2,350,000	2,344,125	0.13
Exterran Holdings Ser144A 7.25%/2018	アメリカ・ドル	3,775,000	3,822,187	0.21
Ferrellgas Ser144A 6.5%/2021	アメリカ・ドル	850,000	807,500	0.04
First Data Ser144A 8.875%/2020	アメリカ・ドル	1,800,000	1,930,500	0.11
First Data Ser144A 12.625%/2021	アメリカ・ドル	18,325,000	19,699,375	1.10
Florida East Coast Holdings Ser144A 10.5%/2017	アメリカ・ドル	1,525,000	1,589,812	0.09
Florida East Coast Railway Ser144A 8.125%/2017	アメリカ・ドル	4,500,000	4,668,750	0.26
GCI Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	2,300,000	2,305,750	0.13
General Motors Financial Ser144A 6.75%/2018	アメリカ・ドル	1,925,000	1,939,437	0.11
Giant Funding Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	2,675,000	2,802,062	0.16
Goodman Networks Ser144A 12.125%/2018	アメリカ・ドル	2,575,000	2,568,563	0.14
Goodrich Petroleum Ser144A 8.875%/2019	アメリカ・ドル	3,325,000	3,341,625	0.19
GTP Acquisition Partners Ser144A 7.628%/2016	アメリカ・ドル	750,000	0	0.00
IASIS Healthcare Ser144A 8.375%/2019	アメリカ・ドル	4,350,000	4,306,500	0.24
iGate Ser144A 9%/2016	アメリカ・ドル	4,425,000	4,491,375	0.25
Inergy Finance Ser144A 6.875%/2021	アメリカ・ドル	1,000,000	1,001,250	0.06
inVentiv Health Ser144A 10%/2018	アメリカ・ドル	5,225,000	5,039,313	0.28
iPayment Ser144A 10.25%/2018	アメリカ・ドル	3,100,000	3,061,250	0.17
J Crew Group Ser144A 8.125%/2019	アメリカ・ドル	3,375,000	3,246,750	0.18
JBS USA Finance Ser144A 7.25%/2021	アメリカ・ドル	2,700,000	2,639,250	0.15
JMC Steel Group Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	2,850,000	2,907,000	0.16
Kindred Healthcare Ser144A 8.25%/2019	アメリカ・ドル	3,900,000	3,900,000	0.22
Kratos Defense & Security Solutions Ser144A 10%/2017	アメリカ・ドル	4,825,000	5,114,500	0.29
Laredo Petroleum Ser144A 9.5%/2019	アメリカ・ドル	2,650,000	2,802,375	0.16

Level 3 Communications Ser144A 11.875%/2019	アメリカ・ドル	2,475,000	2,676,094	0.15
Level 3 Escrow Ser144A 3 8.125%/2019	アメリカ・ドル	1,800,000	1,813,500	0.10
Level 3 Financing Ser144A 9.375%/2019	アメリカ・ドル	4,825,000	4,993,875	0.28
MedAssets Ser144A 8%/2018	アメリカ・ドル	2,575,000	2,562,125	0.14
MEMC Electronic Materials Ser144A 7.75%/2019	アメリカ・ドル	4,000,000	3,970,000	0.22
MGM Resorts International Ser144A 10%/2016	アメリカ・ドル	2,200,000	2,337,500	0.13
Michaels Stores Ser144A 7.75%/2018	アメリカ・ドル	4,075,000	4,105,563	0.23
MPT Operating Partnership Ser144A 6.875%/2021	アメリカ・ドル	2,775,000	2,740,313	0.15
Needle Merger Sub Ser144A 8.125%/2019	アメリカ・ドル	2,275,000	2,303,438	0.13
Nortek Ser144A 8.5%/2021	アメリカ・ドル	3,650,000	3,394,500	0.19
Nortek Ser144A 10%/2018	アメリカ・ドル	1,725,000	1,733,625	0.10
NRG Energy Ser144A 7.625%/2018	アメリカ・ドル	6,875,000	6,900,781	0.39
Nuveen Investments Ser144A 10.5%/2015	アメリカ・ドル	1,525,000	1,551,688	0.09
Oasis Petroleum Ser144A 7.25%/2019	アメリカ・ドル	1,575,000	1,567,125	0.09
Omega Healthcare Investors Ser144A 6.75%/2022	アメリカ・ドル	3,525,000	3,494,156	0.20
Palace Entertainment Holdings Ser144A 8.875%/2017	アメリカ・ドル	1,000,000	1,007,500	0.06
Pinafore Ser144A 9%/2018	アメリカ・ドル	6,370,000	6,895,525	0.39
Ply Gem Industries Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,400,000	3,238,500	0.18
Provident Funding Associates Ser144A 10.125%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,300,500	0.07
RadioShack Ser144A 6.75%/2019	アメリカ・ドル	2,950,000	2,854,125	0.16
Reynolds Group Issuer Ser144A 7.125%/2019	アメリカ・ドル	5,750,000	5,735,625	0.32
Reynolds Group Issuer Ser144A 9%/2019	アメリカ・ドル	2,675,000	2,654,938	0.15
SandRidge Energy Ser144A 7.5%/2021	アメリカ・ドル	2,825,000	2,863,844	0.16
Seminole Indian Tribe of Florida Ser144A 7.75%/2017	アメリカ・ドル	1,625,000	1,690,000	0.09
Seneca Gaming Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	1,775,000	1,841,563	0.10
SESI Ser144A 6.375%/2019	アメリカ・ドル	1,950,000	1,935,375	0.11
Shea Homes Funding Ser144A 8.625%/2019	アメリカ・ドル	3,750,000	3,703,125	0.21
SM Energy Ser144A 6.625%/2019	アメリカ・ドル	825,000	829,125	0.05
Softbrands 11.5%/2018	アメリカ・ドル	1,175,000	1,082,680	0.06
SPX Ser144A 6.875%/2017	アメリカ・ドル	2,900,000	3,117,500	0.17
Texas Competitive Electric Holdings Ser144A 11.5%/2020	アメリカ・ドル	5,400,000	5,332,500	0.30
TransDigm Ser144A 7.75%/2018	アメリカ・ドル	2,500,000	2,637,500	0.15
Univision Communications Ser144A 7.875%/2020	アメリカ・ドル	3,625,000	3,733,750	0.21
Univision Communications Ser144A 8.5%/2021	アメリカ・ドル	7,650,000	7,669,125	0.43
US Foodservice Ser144A 8.5%/2019	アメリカ・ドル	2,750,000	2,681,250	0.15
USG Ser144A 8.375%/2018	アメリカ・ドル	675,000	668,250	0.04
Valeant Pharmaceuticals International Ser144A 6.875%/2018	アメリカ・ドル	3,875,000	3,816,875	0.21
Warner Chilcott Ser144A 7.75%/2018	アメリカ・ドル	5,200,000	5,271,500	0.29
West Corp Ser144A 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,312,875	0.07

West Corp Ser144A 8.625%/2018	アメリカ・ドル	6,725,000	6,825,875	0.38
XM Satellite Radio Ser144A 7.625%/2018	アメリカ・ドル	1,250,000	1,312,500	0.07
アメリカ 計			337,864,949	18.88
直近に発行された取引可能な有価証券 計			382,094,968	21.36
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	2,450,000	2,511,740	0.14
Digicel Group Ser144A 10.5%/2018	アメリカ・ドル	1,600,000	1,792,320	0.10
Digicel Ser144A 8.25%/2017	アメリカ・ドル	2,275,000	2,366,455	0.13
Digicel Ser144A 12%/2014	アメリカ・ドル	400,000	465,000	0.03
バミューダ 計			7,135,515	0.40
カナダ				
Connacher Oil and Gas SerRegS 8.75%/2018	カナダ・ドル	1,675,000	0	0.00
Garda World Security Ser144A 9.75%/2017	アメリカ・ドル	1,225,000	1,301,563	0.07
Reliance Intermediate Holdings Ser144A 9.5%/2019	アメリカ・ドル	2,500,000	2,740,625	0.16
Videotron Ltee Ser144A 6.875%/2021	カナダ・ドル	1,000,000	0	0.00
カナダ 計			4,042,188	0.23
ケイマン諸島				
RDS Ultra-Deepwater Ser144A 11.875%/2017	アメリカ・ドル	1,350,000	1,518,750	0.08
ケイマン諸島 計			1,518,750	0.08
ルクセンブルグ				
Intelsat Luxembourg Ser144A 11.5%/2017	アメリカ・ドル	5,925,000	6,384,187	0.35
Steel Capital for Severstal Ser144A 9.75%/2013	アメリカ・ドル	1,000,000	1,124,400	0.06
Wind Acquisition Finance Ser144A 11.75%/2017	アメリカ・ドル	2,000,000	2,275,000	0.13
Wind Acquisition Holdings Finance Ser144A 12.25%/2017	アメリカ・ドル	2,119,199	2,452,973	0.14
ルクセンブルグ 計			12,236,560	0.68
オランダ				
Clondalkin Acquisition Ser144A VR 2.247%/2013	アメリカ・ドル	800,000	772,000	0.04
UPC Holding Ser144A 9.875%/2018	アメリカ・ドル	1,225,000	1,365,875	0.08
オランダ 計			2,137,875	0.12

アメリカ

Amsted Industries Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,503,375	0.08
Assured Guaranty Municipal Holdings Ser144A VR 6.4%/2066	アメリカ・ドル	4,650,000	3,557,250	0.20
Capella Healthcare Ser144A 9.25%/2017	アメリカ・ドル	4,800,000	5,088,000	0.28
Case New Holland Ser144A 7.875%/2017	アメリカ・ドル	6,550,000	7,237,750	0.40
Cemex Finance Ser144A 9.5%/2016	アメリカ・ドル	1,580,000	1,641,225	0.09
Cequel Communications Holdings Ser144A 8.625%/2017	アメリカ・ドル	5,175,000	5,407,875	0.30
Claire's Stores 9.625%/2015	アメリカ・ドル	946,687	925,387	0.05
Clearwire Communications Ser144A 12%/2015	アメリカ・ドル	5,500,000	5,919,375	0.33
Delta Air Lines Ser144A 12.25%/2015	アメリカ・ドル	2,100,000	2,336,250	0.13
Freescale Semiconductor Ser144A 10.125%/2018	アメリカ・ドル	2,800,000	3,122,000	0.18
HUB International Holdings Ser144A 9%/2014	アメリカ・ドル	1,500,000	1,537,500	0.09
HUB International Holdings Ser144A 10.25%/2015	アメリカ・ドル	4,160,000	4,253,600	0.24
Land O'Lakes Capital Trust I Ser144A 7.45%/2028	アメリカ・ドル	2,050,000	1,962,875	0.11
Lions Gate Entertainment Ser144A 10.25%/2016	アメリカ・ドル	3,425,000	3,502,062	0.20
Lyondell Chemical Ser144A 8%/2017	アメリカ・ドル	3,924,000	4,375,260	0.24
McJunkin Red Man Ser144A 9.5%/2016	アメリカ・ドル	2,400,000	2,454,000	0.14
Michael Foods Ser144A 9.75%/2018	アメリカ・ドル	4,050,000	4,353,750	0.24
Michaels Stores step coupon 0%/2016	アメリカ・ドル	3,400,000	3,536,000	0.20
Plastipak Holdings Ser144A 10.625%/2019	アメリカ・ドル	425,000	480,250	0.03
Provident Funding Associates Ser144A 10.25%/2017	アメリカ・ドル	1,600,000	1,760,000	0.10
Reader's Digest Association VR 9.5%/2017	アメリカ・ドル	3,375,000	3,501,562	0.20
Reddy Ice Holdings step coupon 10.5%/2012	アメリカ・ドル	750,000	753,750	0.04
SandRidge Energy Ser144A 8%/2018	アメリカ・ドル	1,375,000	1,409,375	0.08
Sinclair Television Group Ser144A 9.25%/2017	アメリカ・ドル	2,875,000	3,169,687	0.18
Sirius XM Radio Ser144A 8.75%/2015	アメリカ・ドル	5,375,000	5,952,813	0.33
Smurfit-Stone Container pref stk	アメリカ・ドル	7,275	0	0.00
United Air Lines Ser144A 12%/2013	アメリカ・ドル	1,200,000	1,293,000	0.07
Universal Hospital Services VR 3.778%/2015	アメリカ・ドル	2,996,000	2,891,140	0.16
USG Ser144A 9.75%/2014	アメリカ・ドル	1,550,000	1,650,750	0.09
USI Holdings Ser144A 9.75%/2015	アメリカ・ドル	1,612,000	1,624,090	0.09
Xm Satellite Radio Ser144A 13%/2013	アメリカ・ドル	3,925,000	4,621,688	0.26

アメリカ 計**91,821,639 5.13****その他の取引可能な有価証券 計****118,892,527 6.64****有価証券 合計****1,693,736,211 94.66****為替予約取引**

決済日	買い	売り	評価（損）益 （アメリカ・ドル）	
2011年7月8日	イギリス・ボンド 60,000	アメリカ・ドル 98,293	(2,273)	
2011年7月8日	アメリカ・ドル 2,715,851	イギリス・ボンド 1,671,093	41,579	
2011年9月9日	ユーロ 1,931,541	アメリカ・ドル 2,762,837	26,348	
2011年9月9日	アメリカ・ドル 97,711,734	ユーロ 66,731,000	1,350,839	
為替予約取引にかかる評価（損）益 合計			1,416,493	0.08

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）	
Deutsche Bank, Protection sold (Relevant Credit: Ono Finance 11.125% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2014年3月 ユーロ	750,000	(28,710)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Clear Channel Communications 6.875% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2015年3月 アメリカ・ドル	2,750,000	(407,931)	
Deutsche Bank, Protection sold (Relevant Credit: Assured Guaranty Municipal), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年3月 アメリカ・ドル	1,500,000	(84,632)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Sprint Nextel, 6% 2016), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年3月 アメリカ・ドル	925,000	73,531	
Deutsche Bank, Protection sold (Relevant Credit: Assured Guaranty Municipal), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	1,700,000	(24,362)	
Deutsche Bank, Protection sold (Relevant Credit: Mediacom LLC 9.125% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	750,000	(44,475)	
Goldman Sachs, Protection sold (Relevant Credit: Mediacom LLC 9.125% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	1,875,000	(111,189)	
Barclays Bank Protection sold (Relevant Credit: Texas Competitive Electric 10.25% 2015), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	2,150,000	(305,080)	
JP Morgan Chase, Protection sold (Relevant Credit: Level 3 Communications 6.5% 2016), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	2,650,000	(144,688)	
Goldman Sachs, Protection sold (Relevant Credit: Genon Energy 7.875% 2017), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	2,500,000	(177,933)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Univision Communications 8.5% 2021), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年6月 アメリカ・ドル	2,000,000	(100,159)	
スワップ取引評価額 合計			(1,355,628)	(0.08)

オプション取引（売建）

証券名	満期日	契約枚数	通貨	評価額 （アメリカ・ドル）
Anadarko, Put Option, Strike Price 75	2011年11月19日	216	アメリカ・ドル	(130,140)
AT&T, Call Option Strike Price 30	2012年1月21日	1,477	アメリカ・ドル	(292,446)
Potash Corp, Put Option, Strike Price 48.33	2012年1月21日	543	アメリカ・ドル	(149,325)
オプション取引評価額 合計				(571,911) (0.03)

為替予約取引に係る未実現（損）益合計（詳細は3aを参照）	1,647,549	0.09
その他資産（負債控除後）	94,385,070	5.28
純資産	1,789,257,784	100.00

144A: 1933年証券法規則144Aに基づき適格機関投資家のみを提供される証券である。

BKNT: Bank Notes

com stk: common stock

CV: convertible bond

GMTN: Global Medium Term Note

MTN: Medium Term Note

MTNA: Medium Term Note (series A)

pref stk: preferred stock

step coupon: stepped coupon bond for which the coupon rate of interest will adjust on specified future date(s)

VR: variable rate, rate shown is effective rate at period-end

T: ロウ・プライス・インターナショナル・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

U.S. Aggregate Bond Fund

2011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 4.125%/2021	アメリカ・ドル	285,000	283,663	0.16
オーストラリア 計			283,663	0.16
ベルギー				
Delhaize Group 6.5%/2017	アメリカ・ドル	140,000	161,605	0.09
ベルギー 計			161,605	0.09
バミューダ				
Weatherford International Bermuda 6.75%/2040	アメリカ・ドル	315,000	338,472	0.19
バミューダ 計			338,472	0.19
ブラジル				
Federal Republic of Brazil 11%/2040	アメリカ・ドル	75,000	102,638	0.06
Federal Republic of Brazil 11%/2040	アメリカ・ドル	305,000	417,393	0.23
ブラジル 計			520,031	0.29
カナダ				
Canadian Natural Resources 6.25%/2038	アメリカ・ドル	380,000	414,863	0.23
Kinder Morgan Finance 5.7%/2016	アメリカ・ドル	355,000	371,419	0.21
Talisman Energy 3.75%/2021	アメリカ・ドル	300,000	284,146	0.16
Teck Resources 10.25%/2016	アメリカ・ドル	120,000	143,541	0.08
カナダ 計			1,213,969	0.68
ケイマン諸島				
Noble Holding International 6.05%/2041	アメリカ・ドル	100,000	102,873	0.06
Petrobras International Finance 5.75%/2020	アメリカ・ドル	130,000	139,328	0.08
Petrobras International Finance 5.875%/2018	アメリカ・ドル	365,000	394,554	0.22
Petrobras International Finance 7.875%/2019	アメリカ・ドル	150,000	182,387	0.10
ケイマン諸島 計			819,142	0.46
チリ				
Chilean Government International Bond 3.875%/2020	アメリカ・ドル	155,000	156,705	0.09
Corp Nacional del Cobre de Chile Ser144A 7.5%/2019	アメリカ・ドル	155,000	187,063	0.10
チリ 計			343,768	0.19

ジャージー					
BAA Funding Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	280,000	273,845	0.15	
ジャージー 計			273,845	0.15	
リトアニア					
Republic of Lithuania Ser144A 6.75%/2015	アメリカ・ドル	375,000	414,844	0.23	
リトアニア 計			414,844	0.23	
ルクセンブルグ					
ArcelorMittal 5.375%/2013	アメリカ・ドル	460,000	489,992	0.28	
Telecom Italia Capital 5.25%/2013	アメリカ・ドル	525,000	551,437	0.31	
ルクセンブルグ 計			1,041,429	0.59	
メキシコ					
America Movil 5.625%/2017	アメリカ・ドル	225,000	253,608	0.14	
Coca-Cola Femsa 4.625%/2020	アメリカ・ドル	135,000	138,720	0.08	
Grupo Televisa 6.625%/2040	アメリカ・ドル	165,000	174,487	0.10	
メキシコ 計			566,815	0.32	
オランダ					
EDP Finance Ser144A 4.9%/2019	アメリカ・ドル	54,000	46,338	0.03	
EDP Finance Ser144A 5.375%/2012	アメリカ・ドル	121,000	121,197	0.07	
オランダ 計			167,535	0.10	
ポーランド					
Poland Government 3.875%/2015	アメリカ・ドル	185,000	191,521	0.11	
ポーランド 計			191,521	0.11	
南アフリカ					
Republic of South Africa 5.5%/2020	アメリカ・ドル	295,000	323,763	0.18	
Republic of South Africa 6.5%/2014	アメリカ・ドル	160,000	180,002	0.10	
南アフリカ 計			503,765	0.28	
韓国					
Korea Hydro & Nuclear Power Ser144A 3.125%/2015	アメリカ・ドル	100,000	99,442	0.06	
韓国 計			99,442	0.06	
スペイン					
Telefonica Emisiones 3.992%/2016	アメリカ・ドル	70,000	70,881	0.04	
Telefonica Emisiones 5.877%/2019	アメリカ・ドル	170,000	178,802	0.10	
Telefonica Emisiones 6.221%/2017	アメリカ・ドル	370,000	408,383	0.23	
スペイン 計			658,066	0.37	
スウェーデン					

Svensk Exportkredit 5.125%/2017	アメリカ・ドル	650,000	736,765	0.42
スウェーデン 計			736,765	0.42
スイス				
UBS/Stamford Branch SerBKNT 4.875%/2020	アメリカ・ドル	250,000	253,323	0.14
スイス 計			253,323	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	593,956	0.33
アラブ首長国連邦 計			593,956	0.33
イギリス				
Barclays Bank 6.75%/2019	アメリカ・ドル	255,000	286,694	0.16
BP Capital Markets 3.125%/2015	アメリカ・ドル	205,000	210,681	0.12
Ensco 3.25%/2016	アメリカ・ドル	285,000	289,690	0.16
HBOS Ser144A 6%/2033	アメリカ・ドル	505,000	385,946	0.22
HSBC Holdings 5.1%/2021	アメリカ・ドル	520,000	533,907	0.30
Royal Bank of Scotland Ser2 3.4%/2013	アメリカ・ドル	325,000	332,727	0.19
Standard Chartered Ser144A 3.85%/2015	アメリカ・ドル	420,000	435,166	0.25
イギリス 計			2,474,811	1.40
アメリカ				
Affiliated Computer Services 5.2%/2015	アメリカ・ドル	45,000	49,154	0.03
Aflac 8.5%/2019	アメリカ・ドル	290,000	355,200	0.20
Agilent Technologies 5%/2020	アメリカ・ドル	110,000	115,674	0.07
Allegheny Technologies 5.95%/2021	アメリカ・ドル	305,000	325,239	0.18
Allstate 7.45%/2019	アメリカ・ドル	200,000	238,350	0.13
Altria Group 4.75%/2021	アメリカ・ドル	140,000	140,177	0.08
Altria Group 9.25%/2019	アメリカ・ドル	435,000	568,073	0.32
American Tower 7.25%/2019	アメリカ・ドル	297,000	336,549	0.19
Ameriprise Financial 7.3%/2019	アメリカ・ドル	175,000	211,412	0.12
Apache 5.1%/2040	アメリカ・ドル	360,000	347,070	0.20
AT&T 2.95%/2016	アメリカ・ドル	355,000	359,943	0.20
AT&T 6.55%/2039	アメリカ・ドル	205,000	225,601	0.13
Bank of America 5.75%/2016	アメリカ・ドル	275,000	290,240	0.16
Bank of America 7.375%/2014	アメリカ・ドル	465,000	523,093	0.29
Berkshire Hathaway Finance 4.25%/2021	アメリカ・ドル	225,000	229,542	0.13
Black Hills 6.5%/2013	アメリカ・ドル	300,000	324,382	0.18
Buckeye Partners 5.5%/2019	アメリカ・ドル	220,000	238,465	0.13
Buckeye Partners 6.05%/2018	アメリカ・ドル	165,000	185,802	0.10
Bunge Finance 4.1%/2016	アメリカ・ドル	85,000	88,636	0.05
Bunge Finance 5.9%/2017	アメリカ・ドル	205,000	224,337	0.13
Capital One Financial 7.375%/2014	アメリカ・ドル	220,000	251,369	0.14
Cardinal Health 4.625%/2020	アメリカ・ドル	220,000	223,734	0.13
Citigroup 4.587%/2015	アメリカ・ドル	140,000	147,373	0.08

Citigroup 5.5%/2014	アメリカ・ドル	250,000	272,076	0.15
Citigroup 5.85%/2013	アメリカ・ドル	385,000	412,822	0.23
Citigroup 6.125%/2018	アメリカ・ドル	160,000	176,446	0.10
Citigroup 6.5%/2013	アメリカ・ドル	400,000	435,241	0.25
Cliffs Natural Resources 4.875%/2021	アメリカ・ドル	195,000	195,915	0.11
CNA Financial 5.875%/2020	アメリカ・ドル	215,000	223,937	0.13
Constellation Energy Group 5.15%/2020	アメリカ・ドル	280,000	287,482	0.16
Consumers Energy SerJ 6%/2014	アメリカ・ドル	200,000	222,580	0.13
DCP Midstream Operating 3.25%/2015	アメリカ・ドル	140,000	141,028	0.09
Diamond Offshore Drilling 5.15%/2014	アメリカ・ドル	265,000	291,549	0.16
Dow Chemical 2.5%/2016	アメリカ・ドル	95,000	94,519	0.05
Dow Chemical 8.55%/2019	アメリカ・ドル	235,000	303,476	0.17
El Paso Natural Gas 5.95%/2017	アメリカ・ドル	110,000	125,034	0.07
Enbridge Energy Partners 5.2%/2020	アメリカ・ドル	55,000	58,420	0.03
Enbridge Energy Partners 5.5%/2040	アメリカ・ドル	125,000	119,000	0.07
Enterprise Products Operating 3.2%/2016	アメリカ・ドル	120,000	122,028	0.07
Enterprise Products Operating 5.95%/2041	アメリカ・ドル	80,000	79,730	0.04
Enterprise Products Operating 7.55%/2038	アメリカ・ドル	215,000	259,961	0.15
EOG Resources 5.875%/2017	アメリカ・ドル	260,000	298,111	0.17
Exelon Generation 6.25%/2039	アメリカ・ドル	225,000	228,152	0.13
Federal Home Loan Banks 5.125%/2013	アメリカ・ドル	1,690,000	1,854,293	1.04
Federal National Mortgage Association 4.375%/2015	アメリカ・ドル	1,300,000	1,442,030	0.81
Federal National Mortgage Association 4.875%/2016	アメリカ・ドル	750,000	851,973	0.48
Federal Realty Investment Trust 5.9%/2020	アメリカ・ドル	30,000	32,927	0.02
FHLMC (Gold) Pool A27886 6%/2034	アメリカ・ドル	765,348	847,793	0.48
FHLMC (Gold) Pool A39034 5.5%/2035	アメリカ・ドル	1,187,892	1,291,688	0.73
FHLMC (Gold) Pool A90052 4.5%/2039	アメリカ・ドル	130,192	135,134	0.08
FHLMC (Gold) Pool A90053 4.5%/2039	アメリカ・ドル	163,811	169,722	0.10
FHLMC (Gold) Pool A90257 4.5%/2039	アメリカ・ドル	88,810	92,181	0.05
FHLMC (Gold) Pool A90763 4.5%/2040	アメリカ・ドル	122,108	126,743	0.07
FHLMC (Gold) Pool A91160 4.5%/2040	アメリカ・ドル	1,307,573	1,357,207	0.76
FHLMC (Gold) Pool A91703 4.5%/2040	アメリカ・ドル	1,356,859	1,404,123	0.79
FHLMC (Gold) Pool A91947 5%/2040	アメリカ・ドル	62,395	66,207	0.04
FHLMC (Gold) Pool A93101 5%/2040	アメリカ・ドル	312,620	332,595	0.19
FHLMC (Gold) Pool A93451 4.5%/2040	アメリカ・ドル	635,945	657,309	0.37
FHLMC (Gold) Pool A94184 4%/2040	アメリカ・ドル	10,842	10,852	0.01
FHLMC (Gold) Pool A94185 4%/2040	アメリカ・ドル	4,202	4,205	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94250 4%/2040	アメリカ・ドル	1,930	1,932	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94251 4%/2040	アメリカ・ドル	4,939	4,943	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94381 4%/2040	アメリカ・ドル	7,816	7,823	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94576 4%/2040	アメリカ・ドル	2,966	2,968	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94605 4%/2040	アメリカ・ドル	124,914	125,030	0.07
FHLMC (Gold) Pool A94617 4%/2040	アメリカ・ドル	2,946	2,948	0.00
FHLMC (Gold) Pool A95734 4%/2040	アメリカ・ドル	33,433	33,495	0.02
FHLMC (Gold) Pool C01787 6%/2034	アメリカ・ドル	715,975	794,668	0.45
FHLMC (Gold) Pool E01341 5.5%/2018	アメリカ・ドル	57,864	62,737	0.04

FHLMC (Gold) Pool E01497 5.5%/2018	アメリカ・ドル	13,494	14,636	0.01
FHLMC (Gold) Pool G03156 5.5%/2037	アメリカ・ドル	1,828,701	1,980,205	1.12
FHLMC (Gold) Pool G04814 5.5%/2038	アメリカ・ドル	3,151,230	3,412,302	1.92
FHLMC (Gold) Pool G05955 5%/2040	アメリカ・ドル	641,634	682,631	0.38
FHLMC (Gold) Pool G05958 5%/2040	アメリカ・ドル	1,573,860	1,674,423	0.94
FHLMC (Gold) Pool G08016 6%/2034	アメリカ・ドル	1,740,232	1,924,973	1.08
FHLMC (Gold) Pool G08079 5%/2035	アメリカ・ドル	185,493	197,925	0.11
FHLMC (Gold) Pool G08421 4%/2040	アメリカ・ドル	12,700	12,712	0.01
FHLMC (Gold) Pool G12738 6%/2022	アメリカ・ドル	211,529	231,710	0.13
FHLMC (Gold) Pool J03615 6%/2021	アメリカ・ドル	269,075	296,260	0.17
FHLMC (Gold) Pool J03640 6%/2021	アメリカ・ドル	288,024	317,123	0.18
FHLMC (Gold) Pool J03672 6%/2021	アメリカ・ドル	115,564	127,240	0.07
FHLMC Pool 1B3203 VR 6.034%/2037	アメリカ・ドル	79,593	84,319	0.05
FHLMC Pool 1G1762 VR 4.996%/2035	アメリカ・ドル	212,770	226,162	0.13
FHLMC Pool 1H1218 VR 4.92%/2034	アメリカ・ドル	621,446	650,778	0.37
FHLMC Pool 1J0248 VR 5.148%/2037	アメリカ・ドル	125,401	132,589	0.07
FHLMC Pool 1Q0081 VR 5.048%/2036	アメリカ・ドル	286,291	304,546	0.17
FirstEnergy SerC 7.375% /2031	アメリカ・ドル	250,000	285,450	0.16
FNMA 7.125%/2030	アメリカ・ドル	100,000	133,436	0.08
FNMA Pool 190379 5.5%/2037	アメリカ・ドル	294,487	318,736	0.18
FNMA Pool 254140 5.5%/2017	アメリカ・ドル	53,521	58,101	0.03
FNMA Pool 256232 5.5%/2036	アメリカ・ドル	273,221	296,327	0.17
FNMA Pool 256844 6%/2037	アメリカ・ドル	200,148	220,238	0.12
FNMA Pool 357280 6.5%/2017	アメリカ・ドル	108,509	118,845	0.07
FNMA Pool 555526 5.5%/2018	アメリカ・ドル	44,465	48,297	0.03
FNMA Pool 569097 6.5%/2016	アメリカ・ドル	61,869	67,762	0.04
FNMA Pool 602309 6.5%/2016	アメリカ・ドル	104,477	114,428	0.06
FNMA Pool 670373 6.5%/2017	アメリカ・ドル	126,075	138,083	0.08
FNMA Pool 735318 4.5%/2019	アメリカ・ドル	157,559	168,597	0.09
FNMA Pool 735575 5.5%/2018	アメリカ・ドル	54,733	59,416	0.03
FNMA Pool 745336 5%/2036	アメリカ・ドル	1,058,863	1,130,673	0.64
FNMA Pool 745453 5.5%/2021	アメリカ・ドル	291,503	316,991	0.18
FNMA Pool 745516 5.5%/2036	アメリカ・ドル	1,468,155	1,596,670	0.90
FNMA Pool 745526 6%/2021	アメリカ・ドル	363,910	398,743	0.22
FNMA Pool 745947 6.5%/2036	アメリカ・ドル	39,585	44,875	0.03
FNMA Pool 750412 6.5%/2033	アメリカ・ドル	218,309	247,200	0.14
FNMA Pool 750911 5%/2018	アメリカ・ドル	1,345,435	1,454,554	0.82
FNMA Pool 763199 VR 1.86%/2033	アメリカ・ドル	40,266	41,714	0.02
FNMA Pool 764852 5%/2019	アメリカ・ドル	352,638	381,238	0.21
FNMA Pool 831811 6%/2036	アメリカ・ドル	162,401	179,455	0.10
FNMA Pool 842123 5.5%/2035	アメリカ・ドル	429,886	467,516	0.26
FNMA Pool 848522 VR 5.459%/2035	アメリカ・ドル	68,837	73,578	0.04
FNMA Pool 850863 VR 5.254%/2035	アメリカ・ドル	228,601	244,831	0.14
FNMA Pool 888268 6%/2037	アメリカ・ドル	386,547	426,073	0.24
FNMA Pool 888485 4.5%/2037	アメリカ・ドル	1,265,219	1,318,583	0.74
FNMA Pool 888893 5.5%/2037	アメリカ・ドル	391,375	425,634	0.24

FNMA Pool	889829	5%/2035	アメリカ・ドル	973,482	1,034,477	0.58
FNMA Pool	892413	6%/2021	アメリカ・ドル	47,930	52,533	0.03
FNMA Pool	900724	5.5%/2021	アメリカ・ドル	31,218	33,889	0.02
FNMA Pool	901646	6.5%/2036	アメリカ・ドル	19,544	22,156	0.01
FNMA Pool	902382	6.5%/2036	アメリカ・ドル	69,550	79,052	0.04
FNMA Pool	903812	5.5%/2036	アメリカ・ドル	0	0	0.00
FNMA Pool	905196	VR 5.885%/2036	アメリカ・ドル	157,400	167,023	0.09
FNMA Pool	905743	6.5%/2036	アメリカ・ドル	64,721	73,422	0.04
FNMA Pool	906163	VR 5.51%/2037	アメリカ・ドル	304,160	322,689	0.18
FNMA Pool	923129	5.5%/2034	アメリカ・ドル	52,758	57,425	0.03
FNMA Pool	929836	6%/2038	アメリカ・ドル	299,530	331,468	0.19
FNMA Pool	929848	6%/2038	アメリカ・ドル	201,967	223,502	0.13
FNMA Pool	933051	6.5%/2037	アメリカ・ドル	226,432	257,369	0.14
FNMA Pool	937638	4.5%/2037	アメリカ・ドル	1,113,139	1,155,392	0.65
FNMA Pool	942345	6%/2037	アメリカ・ドル	163,544	180,318	0.10
FNMA Pool	942347	6%/2037	アメリカ・ドル	92,046	101,286	0.06
FNMA Pool	942477	6%/2022	アメリカ・ドル	11,268	12,329	0.01
FNMA Pool	944625	6%/2037	アメリカ・ドル	36,352	40,069	0.02
FNMA Pool	944713	6%/2037	アメリカ・ドル	21,935	24,178	0.01
FNMA Pool	947117	6%/2037	アメリカ・ドル	86,684	95,385	0.05
FNMA Pool	948410	6%/2022	アメリカ・ドル	19,402	21,228	0.01
FNMA Pool	949782	VR 5.763%/2037	アメリカ・ドル	224,341	239,024	0.14
FNMA Pool	952354	6.5%/2037	アメリカ・ドル	73,350	83,120	0.05
FNMA Pool	952502	6.5%/2037	アメリカ・ドル	116,609	132,286	0.07
FNMA Pool	953221	6%/2037	アメリカ・ドル	31,305	34,447	0.02
FNMA Pool	964926	6%/2038	アメリカ・ドル	145,711	161,020	0.09
FNMA Pool	965014	6%/2038	アメリカ・ドル	35,903	39,654	0.02
FNMA Pool	965051	6%/2038	アメリカ・ドル	43,769	48,368	0.03
FNMA Pool	969705	6%/2038	アメリカ・ドル	125,193	137,642	0.08
FNMA Pool	983288	6%/2038	アメリカ・ドル	56,624	62,254	0.04
FNMA Pool	985153	6%/2038	アメリカ・ドル	434,927	480,623	0.27
FNMA Pool	AA5588	4.5%/2039	アメリカ・ドル	2,029,295	2,109,495	1.19
FNMA Pool	AA9346	4.5%/2039	アメリカ・ドル	115,466	119,525	0.07
FNMA Pool	AB1424	5%/2040	アメリカ・ドル	593,750	632,161	0.36
FNMA Pool	AB1461	4%/2040	アメリカ・ドル	48,518	48,648	0.03
FNMA Pool	AB1479	5%/2040	アメリカ・ドル	127,623	135,879	0.08
FNMA Pool	AB1963	4%/2040	アメリカ・ドル	42,262	42,374	0.02
FNMA Pool	AB3030	4.5%/2041	アメリカ・ドル	3,989,045	4,134,542	2.33
FNMA Pool	AD0527	5.5%/2039	アメリカ・ドル	887,184	960,238	0.54
FNMA Pool	AD0527	5.5%/2040	アメリカ・ドル	473,066	512,020	0.29
FNMA Pool	AD3685	4.5%/2040	アメリカ・ドル	82,168	85,416	0.05
FNMA Pool	AD5001	5%/2040	アメリカ・ドル	89,813	95,623	0.05
FNMA Pool	AD5995	5%/2040	アメリカ・ドル	472,845	503,435	0.28
FNMA Pool	AD6374	5%/2040	アメリカ・ドル	1,192,508	1,267,226	0.71
FNMA Pool	AD7136	5%/2040	アメリカ・ドル	510,044	543,040	0.31
FNMA Pool	AD7406	5%/2040	アメリカ・ドル	93,100	99,123	0.06

FNMA Pool AD7859 5%/2040	アメリカ・ドル	172,189	183,328	0.10
FNMA Pool AD7997 5%/2040	アメリカ・ドル	621,134	660,052	0.37
FNMA Pool AE0392 5.5%/2039	アメリカ・ドル	1,124,198	1,218,457	0.69
FNMA Pool AE0548 4.5%/2040	アメリカ・ドル	2,501,203	2,589,136	1.46
FNMA Pool AE1592 5.5%/2040	アメリカ・ドル	254,767	275,794	0.16
FNMA Pool AE1761 4%/2040	アメリカ・ドル	1,237,944	1,240,078	0.70
FNMA Pool AE1790 4.5%/2040	アメリカ・ドル	44,997	46,578	0.03
FNMA Pool AE2592 4.5%/2040	アメリカ・ドル	675,610	700,200	0.39
FNMA Pool AE3385 4.5%/2040	アメリカ・ドル	146,204	151,525	0.09
FNMA Pool AE3716 4.5%/2040	アメリカ・ドル	508,532	527,041	0.30
FNMA Pool AE3884 4.5%/2040	アメリカ・ドル	2,579,619	2,673,507	1.51
FNMA Pool AE4438 4%/2040	アメリカ・ドル	55,316	55,463	0.03
FNMA Pool AE4629 4%/2040	アメリカ・ドル	682,366	683,542	0.39
FNMA Pool AE4834 5%/2040	アメリカ・ドル	445,209	474,011	0.27
FNMA Pool AE4889 4%/2040	アメリカ・ドル	21,498	21,535	0.01
FNMA Pool AE5112 4%/2040	アメリカ・ドル	227,443	227,835	0.13
FNMA Pool AE6438 5%/2040	アメリカ・ドル	311,728	331,894	0.19
FNMA Pool AE6443 4%/2040	アメリカ・ドル	172,407	172,704	0.10
FNMA Pool AE7537 5%/2040	アメリカ・ドル	418,938	446,040	0.25
FNMA Pool AE7658 4%/2040	アメリカ・ドル	123,507	123,720	0.07
FNMA Pool AE7763 4%/2025	アメリカ・ドル	529,840	553,216	0.31
FNMA Pool AE7909 4.5%/2040	アメリカ・ドル	40,379	41,849	0.02
FNMA Pool AE7996 4.5%/2040	アメリカ・ドル	56,296	58,345	0.03
FNMA Pool AE8002 4.5%/2040	アメリカ・ドル	28,725	29,771	0.02
FNMA Pool AE8031 4.5%/2040	アメリカ・ドル	33,666	34,892	0.02
FNMA Pool AE8283 4%/2040	アメリカ・ドル	66,158	66,334	0.04
FNMA Pool AE9254 4.5%/2040	アメリカ・ドル	303,345	314,386	0.18
FNMA Pool AE9739 4%/2040	アメリカ・ドル	61,938	62,102	0.03
FNMA Pool AH0774 4%/2025	アメリカ・ドル	591,912	618,026	0.35
FNMA Pool AH0798 4%/2025	アメリカ・ドル	299,240	312,442	0.18
FNMA Pool AH0943 4%/2040	アメリカ・ドル	91,486	91,730	0.05
FNMA Pool AH1059 4%/2025	アメリカ・ドル	602,010	628,570	0.35
FNMA Pool AH1111 4%/2040	アメリカ・ドル	2,875,423	2,875,872	1.62
FNMA Pool AH3526 4.5%/2041	アメリカ・ドル	536,640	556,172	0.31
FNMA Pool AH9055 4.5%/2041	アメリカ・ドル	248,763	257,836	0.15
Freeport-McMoRan Copper & Gold 8.375%/2017	アメリカ・ドル	200,000	218,750	0.12
GATX 3.5%/2016	アメリカ・ドル	110,000	112,847	0.06
GATX 4.85%/2021	アメリカ・ドル	150,000	149,130	0.08
General Electric Capital 2.1%/2014	アメリカ・ドル	1,000,000	1,014,808	0.57
General Electric Capital 5.3%/2021	アメリカ・ドル	220,000	229,350	0.13
Georgia Power Ser10-C 4.75%/2040	アメリカ・ドル	265,000	243,111	0.14
GNMA I Pool 605561 5.5%/2034	アメリカ・ドル	336,717	372,651	0.21
GNMA I Pool 615278 5%/2033	アメリカ・ドル	141,921	154,790	0.09
GNMA I Pool 616826 5.5%/2035	アメリカ・ドル	29,123	32,185	0.02
GNMA II Pool 3306 5.5%/2032	アメリカ・ドル	380,945	421,896	0.24
GNMA II Pool 3490 6.5%/2033	アメリカ・ドル	698,318	791,209	0.45

GNMA II Pool 3611 6%/2034	アメリカ・ドル	224,897	249,445	0.14
GNMA II Pool 4060 6%/2037	アメリカ・ドル	39,111	43,270	0.03
GNMA II Pool 4222 6%/2038	アメリカ・ドル	119,858	132,605	0.07
GNMA II Pool 4498 6%/2039	アメリカ・ドル	30,009	33,568	0.02
GNMA II Pool 4854 4.5%/2040	アメリカ・ドル	172,134	181,593	0.10
Goldman Sachs Capital I 6.345%/2034	アメリカ・ドル	265,000	251,330	0.14
Goldman Sachs Group 3.625%/2016	アメリカ・ドル	385,000	389,589	0.22
Goldman Sachs Group 6.25%/2041	アメリカ・ドル	155,000	156,794	0.09
Goldman Sachs Group 6.75%/2037	アメリカ・ドル	640,000	641,949	0.36
Goldman Sachs Group 7.5%/2019	アメリカ・ドル	200,000	233,054	0.13
Hess 6%/2040	アメリカ・ドル	130,000	135,013	0.08
Hess 8.125%/2019	アメリカ・ドル	85,000	107,710	0.06
Historic TW 6.875%/2018	アメリカ・ドル	485,000	568,358	0.32
Home Depot 5.4%/2016	アメリカ・ドル	300,000	335,572	0.19
Hospitality Properties Trust 5.625%/2017	アメリカ・ドル	275,000	284,692	0.16
International Lease Finance SerMTN 6.625%/2013	アメリカ・ドル	290,000	301,600	0.17
Jefferies Group 6.25%/2036	アメリカ・ドル	260,000	243,219	0.14
JPMorgan Chase 3.4%/2015	アメリカ・ドル	350,000	359,660	0.20
JPMorgan Chase 4.65%/2014	アメリカ・ドル	540,000	580,548	0.33
KeyCorp SerMTN 3.75%/2015	アメリカ・ドル	250,000	258,393	0.15
KeyCorp SerMTN 5.1%/2021	アメリカ・ドル	70,000	71,430	0.04
Kilroy Realty 4.8%/2018	アメリカ・ドル	145,000	143,933	0.08
L-3 Communications 4.75%/2020	アメリカ・ドル	220,000	218,198	0.12
Macy 's Retail Holdings 5.35%/2012	アメリカ・ドル	235,000	241,542	0.14
Magellan Midstream Partners 6.55%/2019	アメリカ・ドル	125,000	145,455	0.08
Marathon Oil 6%/2017	アメリカ・ドル	110,000	126,530	0.07
MDC Holdings 5.5%/2013	アメリカ・ドル	160,000	168,454	0.09
Medco Health Solutions 2.75%/2015	アメリカ・ドル	95,000	95,927	0.05
Merrill Lynch 5.45%/2013	アメリカ・ドル	195,000	206,933	0.12
Merrill Lynch SerMTN 6.875%/2018	アメリカ・ドル	525,000	581,666	0.33
Morgan Stanley 4%/2015	アメリカ・ドル	430,000	438,014	0.25
Morgan Stanley 4.2%/2014	アメリカ・ドル	225,000	233,849	0.13
Morgan Stanley 7.3%/2019	アメリカ・ドル	395,000	448,622	0.25
Morgan Stanley SerGMTN 4.1%/2015	アメリカ・ドル	215,000	221,072	0.12
Morgan Stanley SerMTN 6%/2015	アメリカ・ドル	100,000	108,499	0.06
Nabors Industries 6.15%/2018	アメリカ・ドル	120,000	132,843	0.07
Nabors Industries 9.25%/2019	アメリカ・ドル	185,000	234,829	0.13
Nevada Power 5.45%/2041	アメリカ・ドル	40,000	39,915	0.02
Nisource Finance 5.95%/2041	アメリカ・ドル	205,000	201,499	0.11
Nisource Finance 6.25%/2040	アメリカ・ドル	90,000	92,532	0.05
Noble Energy 6%/2041	アメリカ・ドル	160,000	165,551	0.09
NuStar Logistics 4.8%/2020	アメリカ・ドル	200,000	202,011	0.11
Omnicom Group 4.45%/2020	アメリカ・ドル	280,000	278,270	0.16
ONEOK Partners 3.25%/2016	アメリカ・ドル	135,000	137,459	0.08
Pemex Project Funding Master Trust 5.75%/2018	アメリカ・ドル	680,000	749,024	0.42
Plains All American Pipeline/PAA Finance 5.75%/2020	アメリカ・ドル	250,000	271,478	0.15

PNC Funding 4.375%/2020	アメリカ・ドル	190,000	192,586	0.11
PNC Funding 5.625%/2017	アメリカ・ドル	115,000	126,780	0.07
PNC Funding 6.7%/2019	アメリカ・ドル	90,000	106,212	0.06
Principal Financial Group 6.05%/2036	アメリカ・ドル	180,000	187,770	0.11
Principal Financial Group 8.875%/2019	アメリカ・ドル	20,000	25,478	0.01
ProLogis 6.625%/2019	アメリカ・ドル	190,000	207,245	0.12
Provident 7%/2018	アメリカ・ドル	165,000	186,291	0.10
Public Service of Oklahoma 5.15%/2019	アメリカ・ドル	135,000	143,671	0.08
Reckson Operating Partnership 6%/2016	アメリカ・ドル	160,000	171,598	0.10
Regency Centers 5.875%/2017	アメリカ・ドル	130,000	144,282	0.08
Regions Financial 5.75%/2015	アメリカ・ドル	90,000	88,727	0.05
Reinsurance Group of America 5%/2021	アメリカ・ドル	155,000	153,643	0.09
Reinsurance Group of America 5.625%/2017	アメリカ・ドル	45,000	48,587	0.03
Reinsurance Group of America 6.45%/2019	アメリカ・ドル	150,000	163,172	0.09
Republic Services 5.7%/2041	アメリカ・ドル	290,000	284,104	0.16
Reynolds American 7.25%/2013	アメリカ・ドル	120,000	132,726	0.08
Roper Industries 6.25%/2019	アメリカ・ドル	210,000	238,160	0.13
SLM SerMTN 5.125%/2012	アメリカ・ドル	125,000	128,296	0.07
SLM SerMTN 8.45%/2018	アメリカ・ドル	200,000	219,814	0.12
Southwest Airlines 5.125%/2017	アメリカ・ドル	245,000	262,780	0.15
SunTrust Banks 3.6%/2016	アメリカ・ドル	140,000	141,512	0.08
Teco Finance 5.15%/2020	アメリカ・ドル	190,000	201,838	0.11
UnitedHealth Group 3.875%/2020	アメリカ・ドル	90,000	88,222	0.05
UnitedHealth Group 4.7%/2021	アメリカ・ドル	90,000	94,009	0.05
Unum Group 5.625%/2020	アメリカ・ドル	80,000	83,925	0.05
US Bancorp 3.442%/2016	アメリカ・ドル	240,000	244,084	0.14
US Treasury 1.25%/2014	アメリカ・ドル	1,060,000	1,075,568	0.61
US Treasury 1.75%/2012	アメリカ・ドル	6,745,000	6,858,822	3.86
US Treasury 2.625%/2014	アメリカ・ドル	485,000	511,334	0.29
US Treasury 2.625%/2016	アメリカ・ドル	6,655,000	6,954,994	3.92
US Treasury 2.625%/2020	アメリカ・ドル	1,305,000	1,263,403	0.71
US Treasury 4.625%/2040	アメリカ・ドル	4,560,000	4,755,227	2.68
US Treasury 6.75%/2026	アメリカ・ドル	1,185,000	1,581,605	0.89
Valmont Industries 6.625%/2020	アメリカ・ドル	260,000	285,192	0.16
Ventas Realty 3.125%/2015	アメリカ・ドル	55,000	54,514	0.03
Verisk Analytics 5.8%/2021	アメリカ・ドル	115,000	122,210	0.07
Waste Management 6.1%/2018	アメリカ・ドル	355,000	403,203	0.23
WellPoint 6%/2014	アメリカ・ドル	195,000	217,015	0.12
Wells Fargo SerMTN 4.6%/2021	アメリカ・ドル	590,000	594,432	0.34
Williams Partners 4.125%/2020	アメリカ・ドル	155,000	149,068	0.08
Williams Partners 6.3%/2040	アメリカ・ドル	240,000	249,648	0.14
Xerox 6.35%/2018	アメリカ・ドル	270,000	309,927	0.18
アメリカ 計			126,039,280	71.00
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			137,696,047	77.56

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

SMART Trust/Australia 2011-1USA A3A 1.77%/2014	アメリカ・ドル	230,000	231,294	0.13
--	---------	---------	---------	------

オーストラリア 計

			231,294	0.13
--	--	--	----------------	-------------

バミューダ

Bermuda Government International Bond Ser144A 5.603%/2020	アメリカ・ドル	100,000	110,262	0.06
---	---------	---------	---------	------

バミューダ 計

			110,262	0.06
--	--	--	----------------	-------------

ケイマン諸島

Vale Overseas 6.25%/2017	アメリカ・ドル	155,000	175,731	0.10
--------------------------	---------	---------	---------	------

ケイマン諸島 計

			175,731	0.10
--	--	--	----------------	-------------

チリ

Celulosa Arauco y Constitucion 5%/2021	アメリカ・ドル	60,000	59,814	0.03
--	---------	--------	--------	------

チリ 計

			59,814	0.03
--	--	--	---------------	-------------

フランス

Electricité de France Ser144A 6.95%/2039	アメリカ・ドル	210,000	246,452	0.14
--	---------	---------	---------	------

フランス 計

			246,452	0.14
--	--	--	----------------	-------------

イギリス

Fosse Master Issuer 2011-1A A2 VR 1.619%/2054	アメリカ・ドル	200,000	200,613	0.11
---	---------	---------	---------	------

イギリス 計

			200,613	0.11
--	--	--	----------------	-------------

アメリカ

Ally Auto Receivables Trust 2009-B C 4.06%/2016	アメリカ・ドル	575,000	606,938	0.34
American Tower Trust 2007-1A D 5.957%/2037	アメリカ・ドル	400,000	426,313	0.24
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2010-2 B 2.73%/2015	アメリカ・ドル	348,000	356,026	0.20
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage 2005-3 A2 4.501%/2043	アメリカ・ドル	468,622	468,598	0.26
Bank of America Mortgage Securities 2004-A 2A2 VR 2.848%/2034	アメリカ・ドル	28,976	25,367	0.01
Bank of America Mortgage Securities 2004-B 2A2 VR 2.868%/2034	アメリカ・ドル	203,249	195,030	0.11
Bank of America Mortgage Securities 2004-D 2A2 VR 2.881%/2034	アメリカ・ドル	468,088	437,423	0.25
Bank of America Mortgage Securities 2004-H 2A2 VR 3.165%/2034	アメリカ・ドル	181,133	165,031	0.09
Bank of America Mortgage Securities 2004-I 3A2 VR 4.808%/2034	アメリカ・ドル	106,848	102,733	0.06
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 2A1 VR 3.122%/2035	アメリカ・ドル	1,007,991	819,592	0.46
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 3A1 VR 5.24%/2035	アメリカ・ドル	267,296	247,688	0.14
Bay Area Toll Authority California 6.263%/2049	アメリカ・ドル	250,000	269,240	0.15
BB&T Capital Trust II 6.75%/2036	アメリカ・ドル	220,000	225,678	0.13
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2002-TOP8 A2 4.83%/2038	アメリカ・ドル	55,000	56,606	0.03
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2005-PWR9 AAB 4.804%/2042	アメリカ・ドル	1,156,658	1,204,824	0.68
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2007-PW17 A1 5.282%/2050	アメリカ・ドル	715,569	730,982	0.41
Burlington Northern Santa Fe 5.05%/2041	アメリカ・ドル	200,000	187,062	0.11
Burlington Northern Santa Fe 5.4%/2041	アメリカ・ドル	105,000	103,549	0.06

Cabela's Master Credit Card Trust 2011-2A A1 2.39%/2019	アメリカ・ドル	290,000	289,728	0.16
Carmax Auto Owner Trust 2010-2 B 3.96%/2016	アメリカ・ドル	380,000	398,366	0.22
Chicago Illinois Metropolitan Water Reclamation 5.72%/2038	アメリカ・ドル	350,000	363,832	0.20
Chicago Illinois O'Hare International Airport General Third Lien 6.395%/2040	アメリカ・ドル	170,000	176,877	0.10
Chicago Illinois Transit Authority Sales And Taxable-pension Funding Series A 6.899%/2040	アメリカ・ドル	320,000	341,187	0.19
Citigroup/Deutsche Bank Commercial Mortgage Trust 2006-CD3 A5 5.617%/2048	アメリカ・ドル	240,000	260,819	0.15
Citigroup/Deutsche Bank Commercial Mortgage Trust 2006-CD3 AAB 5.608%/2048	アメリカ・ドル	1,625,000	1,721,511	0.97
Commercial Mortgage Pass Through Certificates 2007-C9 A4 VR 5.815%/2049	アメリカ・ドル	325,000	357,460	0.20
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	95,192	102,569	0.06
Continental Airlines 2010-1 Class A Pass Through Trust SerA 4.75%/2021	アメリカ・ドル	70,000	68,250	0.04
Delta Air Lines 4.95%/2019	アメリカ・ドル	68,997	68,568	0.04
DIRECTV Holdings 3.55%/2015	アメリカ・ドル	235,000	245,742	0.14
DIRECTV Holdings 5.875%/2019	アメリカ・ドル	115,000	127,754	0.07
Discovery Communications 5.625%/2019	アメリカ・ドル	170,000	188,180	0.11
District Columbia Income Tax Secured Revenue 5.591%/2034	アメリカ・ドル	60,000	62,830	0.04
District of Columbia Income Tax Secured Revenue SerA 5.25%/2034	アメリカ・ドル	170,000	179,075	0.10
East Bay California Municipal Utility District Taxable Subordinated Series B-build America 5.874%/2040	アメリカ・ドル	370,000	387,205	0.22
Express Scripts 3.125%/2016	アメリカ・ドル	265,000	266,932	0.15
FHLMC REMICS 3195 PN 6.5%/2030	アメリカ・ドル	86,115	86,464	0.05
Fifth Third Bancorp 3.625%/2016	アメリカ・ドル	165,000	166,607	0.09
Fifth Third Bancorp 6.25%/2013	アメリカ・ドル	345,000	373,684	0.21
Fifth Third Bancorp 8.25%/2038	アメリカ・ドル	150,000	179,886	0.10
Fiserv 3.125%/2016	アメリカ・ドル	80,000	79,670	0.04
Florida State Board of Education Lottery Revenue Refunding Series E 5%/2020	アメリカ・ドル	440,000	494,842	0.28
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust 2010-3 C 4.99%/2017	アメリカ・ドル	590,000	641,323	0.36
GE Equipment Midticket 2010-1 A4 1.47%/2015	アメリカ・ドル	550,000	552,401	0.31
GE Equipment Small Ticket 2011-1A A3 1.45%/2018	アメリカ・ドル	240,000	241,573	0.14
GMAC Commercial Mortgage Securities 2001-C2 A2 6.7%/2034	アメリカ・ドル	35,771	35,728	0.02
Greenwich Capital Commercial Funding 2005-GG3 AAB 4.619%/2042	アメリカ・ドル	875,960	905,974	0.51
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2005-LDP4 ASB VR 4.824%/2042	アメリカ・ドル	1,019,830	1,068,531	0.60
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-CB15 A4 VR 5.814%/2043	アメリカ・ドル	1,560,000	1,712,056	0.96
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-LDP9 A3 5.336%/2047	アメリカ・ドル	160,000	170,586	0.10
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-C1 A4 5.716%/2051	アメリカ・ドル	475,000	513,822	0.29
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2010-CNTR A2 4.311%/2032	アメリカ・ドル	530,000	514,850	0.29
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2011-C3 B VR 5.013%/2046	アメリカ・ドル	185,000	181,791	0.10
JP Morgan Mortgage Acquisition 2007-CH1 AV2 VR 0.247%/2036	アメリカ・ドル	15,441	15,279	0.01
JPMorgan Chase Capital XXVII SerAA 7%/2039	アメリカ・ドル	340,000	340,621	0.19
Kansas Development Finance Authority Revenue Public Employees Retirement System C 5.501%/2034	アメリカ・ドル	200,000	197,650	0.11
Kilroy Realty 6.625%/2020	アメリカ・ドル	225,000	242,074	0.14
Life Technologies 3.5%/2016	アメリカ・ドル	190,000	194,532	0.11
Los Angeles California Department of Airports Taxable Subordinated Los Angeles International 7.053%/2040	アメリカ・ドル	185,000	196,450	0.11

[前](#) [次](#)

Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-1A A Ser144A 5.737%/2028	アメリカ・ドル	322,990	333,991	0.19
Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-2A A Ser144A 5.362%/2028	アメリカ・ドル	90,837	93,808	0.05
Maryland State Transportation Authority 5.888%/2043	アメリカ・ドル	165,000	175,230	0.10
Maryland State Transportation Authority Transportation Taxable Series B-build America 5.754%/2041	アメリカ・ドル	400,000	425,256	0.24
Metropolitan Transportation Authority New York Taxable Series C-build America Bds- 7.336%/2039	アメリカ・ドル	80,000	98,146	0.06
Navistar Financial Owner Trust 2010-A B 4.17%/2014	アメリカ・ドル	455,000	467,857	0.26
Nevada Power SerN 6.65%/2036	アメリカ・ドル	235,000	272,185	0.15
New York City Municipal Water Finance Taxable Series Dd 5.952%/2042	アメリカ・ドル	120,000	129,667	0.07
New York New York City Housing Development Corporation Taxable Series A 6.42%/2027	アメリカ・ドル	220,825	225,572	0.13
New York New York City Transitional Taxable-future Tax Secured 5.508%/2037	アメリカ・ドル	420,000	424,813	0.24
New York New York City Taxable Series H1-build America Bds-5.846%/2040	アメリカ・ドル	100,000	103,660	0.06
News America 6.15%/2037	アメリカ・ドル	360,000	365,852	0.21
O'Reilly Automotive 4.875%/2021	アメリカ・ドル	215,000	216,442	0.12
Partnerre Finance B 5.5%/2020	アメリカ・ドル	175,000	177,040	0.10
ProLogis 4.5%/2017	アメリカ・ドル	215,000	215,424	0.12
Prudential Financial SerMTN 4.75%/2015	アメリカ・ドル	250,000	269,226	0.15
PSE&G Transition Funding 2001-1 A6 6.61%/2015	アメリカ・ドル	685,676	730,260	0.41
Raymond James Financial 4.25%/2016	アメリカ・ドル	50,000	51,673	0.03
Regency Centers 6%/2020	アメリカ・ドル	105,000	115,819	0.07
Regional Transportation District 5%/2038	アメリカ・ドル	165,000	169,066	0.10
San Diego County California Water Authority Taxable Series B 6.138%/2049	アメリカ・ドル	125,000	132,963	0.07
Sequoia Mortgage Trust 2010-H1 A1 VR 3.75%/2040	アメリカ・ドル	62,502	63,308	0.04
Texas Transportation Commission St Highway Fund Taxable-first Tier Series B 5.178%/2030	アメリカ・ドル	130,000	133,276	0.08
Tompkins County Industrial Development Agency 5%/2037	アメリカ・ドル	170,000	175,464	0.10
University Virginia University Revenues Taxable General Pledge-build 5%/2040	アメリカ・ドル	400,000	389,204	0.22
Utah Transit Authority Sales Tax Revenue Series B 5.937%/2039	アメリカ・ドル	360,000	393,563	0.22
Valero Energy 6.125%/2017	アメリカ・ドル	410,000	464,643	0.26
Virginia Commonwealth Transportation Board Taxable Capital Projects Series A-2 5.35%/2035	アメリカ・ドル	45,000	46,086	0.03
Virginia State Public Building Authority Public Taxable-b-2-build America Bds 5.9%/2030	アメリカ・ドル	100,000	107,645	0.06
Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust 2005-AR2 2A2 VR 2.742%/2035	アメリカ・ドル	147,566	130,761	0.07
Westar Energy 5.1%/2020	アメリカ・ドル	80,000	86,090	0.05
WF-RBS Commercial Mortgage Trust 2011-C2 B VR 5.174%/2044	アメリカ・ドル	350,000	351,091	0.20
World Financial Network Credit Card Master Trust 2010-A A 3.96%/2019	アメリカ・ドル	285,000	301,752	0.17
アメリカ 計			29,178,792	16.44
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 計			30,202,958	17.01
直近に発行された取引可能な有価証券				

オーストラリア				
Wesfarmers Ser144A 2.983%/2016	アメリカ・ドル	130,000	130,531	0.07
オーストラリア 計			130,531	0.07
フランス				
Banque PSA Finance Ser144A 4.375%/2016	アメリカ・ドル	280,000	286,036	0.16
BPCE Ser144A 2.375%/2013	アメリカ・ドル	205,000	208,445	0.12
RCI Banque Ser144A 4.6%/2016	アメリカ・ドル	190,000	194,296	0.11
Soci�t� G�n�rale Ser144A 3.5%/2016	アメリカ・ドル	210,000	207,900	0.12
フランス 計			896,677	0.51
スウェーデン				
Nordea Bank Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	290,000	279,044	0.16
スウェーデン 計			279,044	0.16
イギリス				
PPL WEM Holdings Ser144A 3.9%/2016	アメリカ・ドル	240,000	246,553	0.14
イギリス 計			246,553	0.14
アメリカ				
Barrick North America Finance Ser144A 5.7%/2041	アメリカ・ドル	290,000	282,515	0.16
Broadcom Ser144A 2.375%/2015	アメリカ・ドル	65,000	64,423	0.03
CenterPoint Energy Resources Ser144A 5.85%/2041	アメリカ・ドル	65,000	66,440	0.04
ERAC USA Finance Ser144A 4.5%/2021	アメリカ・ドル	65,000	64,737	0.04
ERAC USA Finance Ser144A 5.25%/2020	アメリカ・ドル	190,000	201,901	0.11
GTP Acquisition Partners I Ser144A 4.347%/2016	アメリカ・ドル	45,000	45,160	0.03
LG&E and KU Energy Ser144A 2.125%/2015	アメリカ・ドル	185,000	180,711	0.10
NBC Universal Media Ser144A 5.95%/2041	アメリカ・ドル	170,000	173,478	0.10
Reliance Holdings USA Ser144A 4.5%/2020	アメリカ・ドル	250,000	234,014	0.13
アメリカ 計			1,313,379	0.74
直近に発行された取引可能な有価証券 計			2,866,184	1.62
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	282,583	0.16

オーストラリア 計			282,583	0.16
ルクセンブルグ				
Enel Finance International Ser144A 5.125%/2019	アメリカ・ドル	180,000	182,306	0.10
Enel Finance International Ser144A 6%/2039	アメリカ・ドル	255,000	231,155	0.13
Holcim US Finance Ser144A 6%/2019	アメリカ・ドル	135,000	144,500	0.08
ルクセンブルグ 計			557,961	0.31
トリニダード・トバゴ				
National Gas of Trinidad & Tobago Ser144A 6.05%/2036	アメリカ・ドル	340,000	328,100	0.18
トリニダード・トバゴ 計			328,100	0.18
イギリス				
British Sky Broadcasting Group Ser144A 6.1%/2018	アメリカ・ドル	280,000	313,612	0.18
UnumProvident Finance Ser144A 6.85%/2015	アメリカ・ドル	35,000	39,216	0.02
イギリス 計			352,828	0.20
アメリカ				
Allegheny Energy Supply Ser144A 6.75%/2039	アメリカ・ドル	300,000	307,874	0.17
COX Communications Ser144A 8.375%/2039	アメリカ・ドル	200,000	262,343	0.15
West Penn Power Ser144A 5.95%/2017	アメリカ・ドル	120,000	136,881	0.08
TCM Sub Ser144A 3.55%/2015	アメリカ・ドル	245,000	256,226	0.14
Texas Gas Transmission Ser144A 5.5%/2013	アメリカ・ドル	221,000	238,396	0.13
Massachusetts Electric Ser144A 5.9%/2039	アメリカ・ドル	250,000	260,795	0.15
Enogex Ser144A 6.25%/2020	アメリカ・ドル	125,000	137,905	0.08
Crown Castle Towers Ser144A 6.113%/2020	アメリカ・ドル	398,000	434,997	0.25
NBC Universal Media Ser144A 5.15%/2020	アメリカ・ドル	575,000	608,222	0.34
Delta Air Lines 2011-1 Class A Pass Through Trust SerA 5.3%/2019	アメリカ・ドル	65,000	65,000	0.04
アメリカ 計			2,708,639	1.53
その他の取引可能な有価証券 計			4,230,111	2.38
有価証券 計			174,995,300	98.57
先物取引				
	満期日	契約額 (アメリカ・ドル)	未実現(損)益 (アメリカ・ドル)	
Short, 94 five-year US Treasury Note Contracts, \$79,760 pledged as initial margin	2011年9月	(11,230,063)	(85,922)	
Short, 61 ten-year US Treasury Note Contracts, \$53,140 pledged as initial margin	2011年9月	(7,482,031)	9,500	

先物取引に係る未実現（損）益 計	(76,422)	(0.04)
為替取引に係る未実現（損）益（詳細は 3aを参照）	249,640	0.14
その他資産（負債控除後）	2,358,291	1.33
純資産	177,526,809	100.00

144A: 1933年証券法規則144Aに基づき適格機関投資家のみを提供される証券である。

BKNT: Bank Notes

FHLMC: Federal Home Loan Mortgage Corporation

FNMA: Federal National Mortgage Association

GMTN: Global Medium Term Note

GNMA: Government National Mortgage Association

MTN: Medium Term Note

VR: variable rate, rate shown is effective rate at period-end

T・ロウ・プライス・インターナショナル・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

2011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part 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。2011年6月30日に終了した期間に、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・ファンド	I	2007年 8月 9日	米ドル
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	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・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	A	2011年 5月18日	米ドル
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・ファンド	I	2011年 5月18日	米ドル
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	I	2009年 6月25日	米ドル
	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・ファンド	I	2011年 6月 7日	米ドル
	Jd	2003年12月5日	米ドル
	Ih (ユーロ)	2011年 6月 1日	ユーロ
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	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・エクイティ・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	I	2007年 2月26日	ユーロ

ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	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・ファンド	I	2005年 1月 7日	ユーロ
グローバル・エマージング・マーケッツ・エクイティ・ファンド	A	2004年10月26日	米ドル
	Ad	2011年 3月 9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・ファンド	A	2003年 3月28日	米ドル
	I	2006年 1月12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・ファンド	A	2008年10月27日	米ドル
	I	2008年10月27日	米ドル
	I (英債券)	2009年 7月10日	英ポンド
	S	2011年3月11日	米ドル
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	A	2006年 4月11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・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	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スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	2001年7月31日	米ドル
	I	2001年9月28日	米ドル

* 証券は、2011年3月22日に全額償還された。

** 証券は、2011年3月1日に全額償還された。

*** 証券は、2011年4月18日に全額償還された。

****証券は、2011年2月18日に全額償還された。

2011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(英ボンド)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おり、Ih証券はUSアグリゲート・ボンド・ファンドの投資家
のみに販売されている。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、ヨーロッパ
・ハイイールド・ボンド・ファンド、グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・
ファンド、グローバル・インフラストラクチャー・エクイティ・ファンド及び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4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2011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、2011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	2011年6月30日現在	2011年6月30日に終了した期間の平均
ユーロ	0.6897	0.7122
ノルウェー・クローネ	5.3655	5.5815

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2011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期限として、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。スワップ契約に伴って必要とされる定期的な差額の支払いまたは受取りは、スワップ取引に係る受取利息または支払利息として日々計上される。

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。2011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）：					
2011年7月7日	140,977,942	ユーロ	199,918,000	米ドル	4,478,867
2011年7月7日	18,250,833	米ドル	12,500,040	ユーロ	127,651
2011年8月8日	120,771,751	ユーロ	178,587,000	米ドル	(3,642,647)
2011年9月8日	97,697,045	ユーロ	141,005,050	米ドル	387,204
2011年9月8日	19,929,357	米ドル	13,651,042	ユーロ	173,266
					1,524,341

クラスAh証券（ノルウェー・クローネ）：					
2011年7月7日	107,095,313	ノルウェー・クローネ	19,375,000	米ドル	585,173
2011年8月8日	121,101,229	ノルウェー・クローネ	22,805,000	米ドル	(278,300)
2011年9月8日	106,179,190	ノルウェー・クローネ	19,650,711	米ドル	58,730
2011年9月8日	1,667,787	米ドル	9,169,442	ノルウェー・クローネ	(34,403)
2011年8月8日	8,774,155	米ドル	48,283,812	ノルウェー・クローネ	(207,992)
					123,208
為替予約取引に係わる未実現純(損)益					1,647,549

b) 中国A株

2011年6月30日に終了した期間において、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・マーケット・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（TRPI）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効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最終的には行われないと信じているので、計算された税金を附属の財務諸表に反映させていない。

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、かかるモーゲージ担保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、2011年6月30日に終了した期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・マーケット・ボンド・ファンド	77.37
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	45.29
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	35.36
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	11.72
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	33.05*
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・ファンド	89.11
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	29.51
USアグリゲート・ボンド・ファンド	30.27
アジアンEx-ジャパン・エクイティ・ファンド	55.37
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	44.67
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	46.09
ヨーロッパEx-UK・エクイティ・ファンド	40.48
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	30.95
ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ・ファンド	28.91
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	2.29
グローバル・エクイティ・ファンド	62.39
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	119.78

グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	10.91
グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	21.87
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	54.47
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	19.06
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	82.56
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	25.21
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	57.31
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	28.99
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	(18.21)
USスモーカー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	(27.58)

*2011年6月30日に終了した期間において設定されたファンドのポートフォリオ回転率は、年率に換算されていない。

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。

2011年6月30日に終了した期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	権利落日
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	Sd	ユーロ	0.048218	2011年 1月24日
	Sd	ユーロ	0.051961	2011年 2月24日
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	Id	米ドル	0.037590	2011年 1月24日
	Id	米ドル	0.033315	2011年 2月24日
	Id	米ドル	0.028463	2011年 3月24日
	Id	米ドル	0.029166	2011年 4月26日
	Id	米ドル	0.033836	2011年 5月24日
	Id	米ドル	0.027669	2011年 6月24日
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	Id	米ドル	0.077660	2011年 1月24日
	Id	米ドル	0.070689	2011年 2月24日
	Id	米ドル	0.051704	2011年 3月24日
	Id	米ドル	0.060009	2011年 4月26日
	Id	米ドル	0.068182	2011年 5月24日
	Id	米ドル	0.047123	2011年 6月24日
	Sd	米ドル	0.108268	2011年 1月24日
	Sd	米ドル	0.100075	2011年 2月24日
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Ad	米ドル	0.199502	2011年3月24日
	Ad	米ドル	0.196886	2011年6月24日
	Jd	米ドル	0.061261	2011年 1月24日
	Jd	米ドル	0.067640	2011年 2月24日
	Jd	米ドル	0.060086	2011年 3月24日
	Jd	米ドル	0.058205	2011年 4月26日
	Jd	米ドル	0.066581	2011年 5月24日
	Jd	米ドル	0.062403	2011年 6月24日
	Sd	米ドル	0.080752	2011年 1月24日
	Sd	米ドル	0.092410	2011年 2月24日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.039331	2011年 1月24日
	Jd	米ドル	0.042331	2011年 2月24日
	Jd	米ドル	0.040349	2011年 3月24日
	Jd	米ドル	0.037777	2011年 4月26日
	Jd	米ドル	0.042244	2011年 5月24日
	Jd	米ドル	0.037635	2011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・	Ad	米ドル	0.000199	2011年3月24日

ファンド	Ad	米ドル	0.023815	2011年6月24日
	Jd	米ドル	0.022062	2011年 2月24日
	Jd	米ドル	0.050307	2011年 5月24日

5. カストディーフィー

ファンドはカストディーに保管された資産価値に応じて、0.04%から0.0165%まで規模によって遞減する年間のカストディーフィーを負担する。この費用は日々計算されて積み上げられ、月次で支払われる。

6. 管理会社報酬

ファンドは、純資産額に応じて0.07%から0.01%まで規模によって遞減する年間の管理費用を負担する。しかしながら、サブファンドは年間40,000米ドルの管理費用のみ負担する。この費用は日々計算されて積み上げられ、月次で支払われる。

7. 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

2011年6月30日に終了した期間において、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（アドバイザーズクラス）については年率0.05%、クラスI、J、SおよびZ投資証券（インスティテューショナルクラス）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・ロスは、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。2011年6月30日に終了した期間においては、アジアン・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。

2011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。

アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	8,763,561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	4,622,953米ドル
グローバル・エクイティ・ファンド	29,208,611米ドル

繰り越しされたキャピタル・ロスは、当初発生した時から8年間、実現益と相殺することが認められている。

8. 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・インターナショナル・リミテッド（以前は、T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・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、下表の年間料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**
エマージング・ローカル・マーケット・ボンド・ファンド	1.30%	0.65%

ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	0.90%	0.50%
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	0.90%	0.55%
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	1.30%	0.65%
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	1.35%	0.70%
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・ファンド	0.90%	0.55%
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	1.15%	0.60%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	0.90%	0.50%
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.70%
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	1.50%	0.70%
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	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・ファンド	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・ファンド	1.90%	1.00%
グローバル・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	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・ファンド	1.60%	0.75%
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	2.00%	1.10%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%
USスモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.95%

* AdおよびAh投資証券を含む。

** Id, Ih（ユーロ）及びI（英ポンド）投資証券を含む。

J, Jd, S, Sd及びZ投資証券には投資運用報酬はない。

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、2011年6月30日に終了した期間において、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・ファンド	I	1.01	1.01
ユーロ・コーポレート・ファンド	A	1.22	1.25
	I	0.76	0.78
	Sd?	0.23	0.28
	Z	-	-
グローバル・アグリゲート・ファンド	A	1.14	1.25
	I	0.74	0.83
	Id	0.80	0.83
	Z	-	-
グローバル・エマージング・マーケット・ファンド	A	1.64	1.75
	I	1.01	1.01
	Id	1.00	1.01
	Sd?	0.31	0.36
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・ ファンド	A**	1.52	1.52
	I**	0.80	0.80
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・ファンド	I	0.91	0.91
グローバル・ハイ・イールド・ファンド	A	1.29	1.60
	Ad	1.28	1.60
	Ah (ユーロ)	1.27	1.60
	Ah (ノルウェー・ クローネ)	1.31	1.60
	I	0.68	0.96
	Jd	0.05	-
	Sd?	0.17	0.36
	Z	-	-
USアグリゲート・ファンド	I**	0.78	0.78
	Ih (ユーロ)**	0.65	0.78
	Jd	0.06	-
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	A	2.06	2.30
	I	1.10	1.20
	S	0.11	0.32
	Sd?	0.07	0.32
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	2.38	2.40
	I	1.39	1.40
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.85
	I	0.98	0.98
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	I	0.98	0.98
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	2.15	2.15
	I	1.23	1.23
ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ・ファンド	I	0.88	0.88
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	A	2.06	2.40
	Ad**	2.11	2.40
	I	1.09	1.40
	Jd	0.06	-
	Z?	-	-
グローバル・エクイティ・ファンド	A	1.77	2.00
	I	0.84	1.07
	J	0.06	-
	Sd?	0.32	0.32
	Z?	-	-
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	A	1.93	2.00
	I	0.98	1.07

	I(英ポンド)	1.01	1.07
	S**	0.18	0.32
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	A	1.79	2.00
	I	0.84	1.07
	Sd?	0.32	0.32
グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	A	2.00	2.00
	I	1.07	1.07
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.94	1.95
	I	1.03	1.03
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	A	2.32	2.40
	I	1.20	1.40
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	A	2.39	2.50
	I	1.29	1.30
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	A	1.71	1.85
	J	0.06	-
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	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・ファンド	A	1.63	1.85
	I	0.73	0.93
	J	0.05	-
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	A	1.64	1.85
	I	0.73	0.93
	J	0.05	-
	Sd?	0.01	0.28
USスモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.78	1.95
	I	1.07	1.23

* 総経費率は、2011年6月30日に終了した期間に、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。

**クラスは2011年6月30日に終了する期間に運用が開始された。総経費率は、年率換算されている。
?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。2011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・ファンド	100%	-
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	73%	-
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	49%	-
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	-	-
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	100%	-
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・ファンド	-	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	-	9%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	-	89%
アジアンEx-ジャパン・エクイティ・ファンド	-	-
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	51%	-

ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	95%	-
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	100%	-
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	98%	-
ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ・ファンド	100%	-
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	-	2%
グローバル・エクイティ・ファンド	-	-
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	10%	-
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	-	-
グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	65%	-
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	11%	-
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	18%	-
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	30%	-
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	-	5%
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	100%	-
USラージキャップ・グロス・エクイティ・ファンド	-	1%
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	-	-
USスモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	-	-

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成23年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	23,271,656,565 円
負債総額	88,915,042 円
純資産総額 (-)	23,182,741,523 円
発行済数量	39,410,455,112 口
1単位当り純資産額 (/)	0.5882 円

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>

(平成23年10月末現在)

日本好配当株マザーファンド

資産総額	30,495,454,694 円
負債総額	757,694,131 円
純資産総額 (-)	29,737,760,563 円
発行済数量	45,896,805,880 口
1単位当り純資産額 (/)	0.6479 円

世界REITマザーファンド

資産総額	3,482,991,182 円
負債総額	10,926 円
純資産総額 (-)	3,482,980,256 円
発行済数量	6,924,654,213 口
1単位当り純資産額 (/)	0.5030 円

グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	229,237,564,620 円
負債総額	293,967,753 円
純資産総額 (-)	228,943,596,867 円
発行済数量	250,089,125,298 口
1単位当り純資産額 (/)	0.9154 円

新興国債券マザーファンド

資産総額	18,948,585,463 円
負債総額	61,534,346 円
純資産総額 (-)	18,887,051,117 円
発行済数量	16,988,209,593 口
1単位当り純資産額 (/)	1.1118 円

欧州債券マザーファンド

資産総額	2,410,319,783 円
負債総額	11,403,855 円
純資産総額 (-)	2,398,915,928 円
発行済数量	3,037,728,729 口
1単位当り純資産額 (/)	0.7897 円

コモディティ・マザーファンド

資産総額	1,099,091,957 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	1,099,091,957 円
発行済数量	1,764,774,532 口
1単位当り純資産額 (/)	0.6228 円

アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	2,251,755,061 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	2,251,755,061 円
発行済数量	2,375,547,075 口
1単位当り純資産額 (/)	0.9479 円

[前へ](#)

第三部【委託会社等の情報】

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23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。

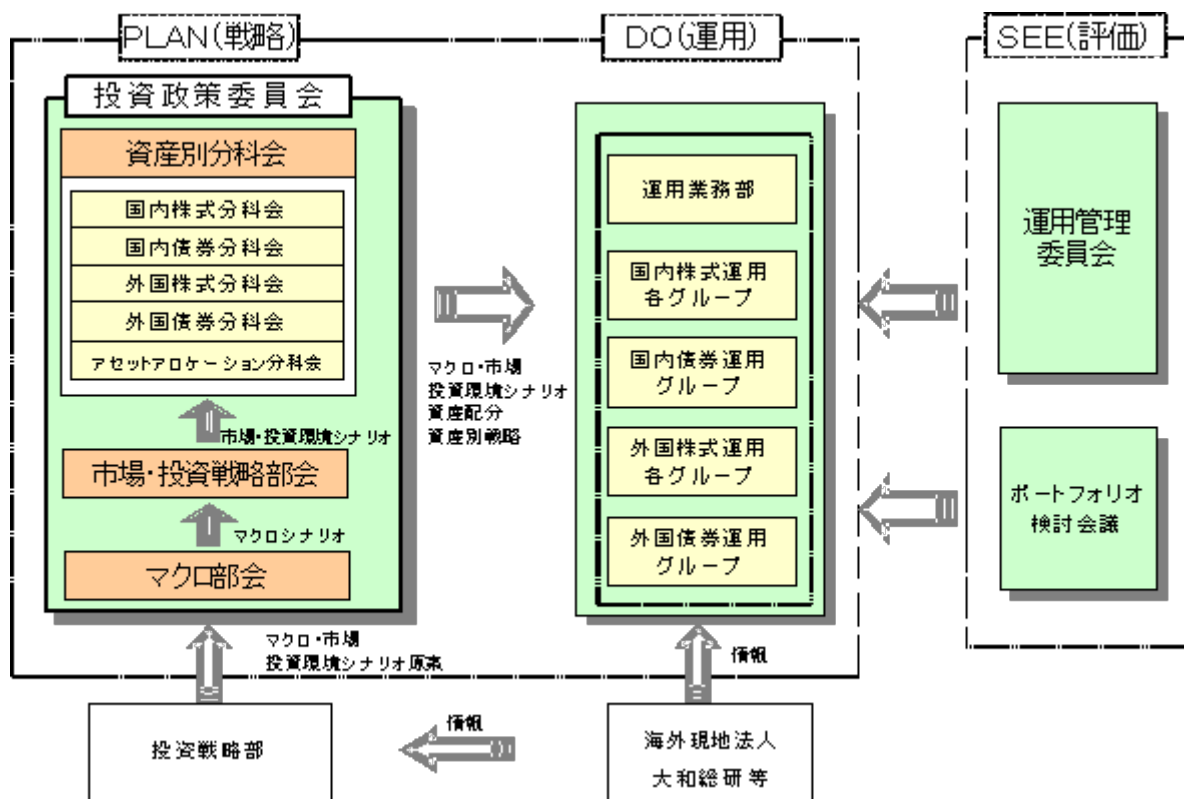
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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23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、149本であり、その純資産総額は、約2,739,690百万円です（なお、親投資信託50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	16,566百万円
追加型株式投資信託	145	2,721,302百万円
追加型公社債投資信託	1	1,821百万円
合計	149	2,739,690百万円

[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、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）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38期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31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、第39期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31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) 貸借対照表

(単位：千円)

		第38期 (平成22年3月31日)	第39期 (平成23年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		10,732,367	13,597,002
前払費用		158,204	167,271
未収委託者報酬		-	2,467,550
未収運用受託報酬		-	939,007
未収収益		3,018,894	32,023
繰延税金資産		401,279	503,471
その他		3	6,482
流動資産計		14,310,748	17,712,808
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	330,961	271,199
器具備品	1	66,930	47,723
土地		710	710
リース資産		-	10,015
建設仮勘定		-	35,928
有形固定資産計		398,601	365,576
無形固定資産			
ソフトウェア		561,554	455,655
ソフトウェア仮勘定		-	1,454
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		574,261	469,816
投資その他の資産			
投資有価証券		4,474,278	4,606,283
関係会社株式		1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金		5,277	3,331
長期差入保証金		743,958	743,455
出資金		161,517	161,517
繰延税金資産		536,417	545,849
その他		916	2,186

貸倒引当金	73,350	73,350
投資その他の資産計	7,018,789	7,159,048
固定資産計	7,991,652	7,994,441
資産合計	22,302,401	25,707,250

(単位：千円)

	第38期 (平成22年3月31日)	第39期 (平成23年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	-	2,841
未払金	183,571	305,187
未払手数料	-	1,159,542
未払費用	1,657,874	952,264
未払法人税等	915,515	1,586,776
前受収益	2,895	2,895
賞与引当金	715,800	831,200
役員賞与引当金	58,000	69,900
その他	18,976	18,208
流動負債計	3,552,633	4,928,817
固定負債		
リース債務	-	7,674
退職給付引当金	835,692	974,968
役員退職慰労引当金	173,442	132,000
固定負債計	1,009,135	1,114,643
負債合計	4,561,769	6,043,460

(単位：千円)

	第38期 (平成22年3月31日)	第39期 (平成23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	14,232,788	16,098,918
利益剰余金合計	15,676,519	17,542,649
株主資本合計	17,832,788	19,698,918
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	92,156	35,129
評価・換算差額等合計	92,156	35,129
純資産合計	17,740,631	19,663,789
負債純資産合計	22,302,401	25,707,250

(2) 損益計算書

(単位 : 千円)

	第38期	第39期
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	3,603,017	3,364,664
委託者報酬	16,956,717	24,069,333
その他営業収益	24,464	112,848
営業収益計	20,584,199	27,546,846
営業費用		
支払手数料	8,348,565	11,618,664
広告宣伝費	164,821	250,770
公告費	-	824
調査費		
調査費	1,113,852	1,159,953
委託調査費	1,923,670	3,031,399
委託計算費	118,521	126,495
営業雑経費		
通信費	29,464	29,827
印刷費	325,398	388,523
協会費	16,722	18,371
諸会費	6,036	5,711
その他	34,513	30,571
営業費用計	12,081,565	16,661,113
一般管理費		
給料		
役員報酬	205,410	208,730
給料・手当	2,717,562	2,738,220
賞与	40,152	34,776
退職金	4,038	814
福利厚生費	478,341	509,031
交際費	14,440	21,011
旅費交通費	129,350	142,945
租税公課	59,772	69,890

不動産賃借料	848,510	842,754
退職給付費用	190,115	194,442
固定資産減価償却費	119,125	91,811
賞与引当金繰入額	715,800	831,200
役員退職慰労引当金繰入額	39,640	39,130
役員賞与引当金繰入額	58,000	69,900
諸経費	233,998	255,110
一般管理費計	5,854,257	6,049,768
営業利益	2,648,375	4,835,964
営業外収益		
受取配当金	502,114	76,007
受取利息	14,130	6,368
その他	32,982	12,177
営業外収益計	549,227	94,553
営業外費用		
為替差損	8,094	11,583
その他	66	340
営業外費用計	8,160	11,923
経常利益	3,189,442	4,918,593
特別損失		
貸倒引当金繰入額	5,000	-
その他	169	340
特別損失計	5,169	340
税引前当期純利益	3,184,273	4,918,252
法人税、住民税及び事業税	1,378,026	2,240,224
法人税等調整額	168,517	150,601
法人税等合計	1,209,509	2,089,622
当期純利益	1,974,764	2,828,630

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第38期	第39期
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
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	13,220,524	14,232,788

当期変動額		
剰余金の配当	962,500	962,500
当期純利益	1,974,764	2,828,630
当期変動額合計	1,012,264	1,866,130
当期末残高	14,232,788	16,098,918
利益剰余金合計		
前期末残高	14,664,255	15,676,519
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	962,500
当期純利益	1,974,764	2,828,630
当期変動額合計	1,012,264	1,866,130
当期末残高	15,676,519	17,542,649
株主資本合計		
前期末残高	16,820,524	17,832,788
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	962,500
当期純利益	1,974,764	2,828,630
当期変動額合計	1,012,264	1,866,130
当期末残高	17,832,788	19,698,918
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	225,466	92,156
当期変動額		
株主資本以外の項目	133,310	57,026
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	133,310	57,026
当期末残高	92,156	35,129
評価・換算差額等合計		
前期末残高	225,466	92,156
当期変動額		
株主資本以外の項目	133,310	57,026
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	133,310	57,026

当期末残高	92,156	35,129
純資産合計		
前期末残高	16,595,057	17,740,631
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	962,500
当期純利益	1,974,764	2,828,630
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	133,310	57,026
当期変動額合計	1,145,574	1,923,157
当期末残高	17,740,631	19,663,789

[前△](#) [次△](#)

重要な会計方針

	第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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）を採用しておりま 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。但し、 平成10年4月以降に取得した建物（建 物附属設備は除く）については、定額 法を採用しております。</p> <p>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。</p> <p>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おり ます。</p>	<p>(1) 有形固定資産（リース資産を除 く） 同左</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 同左</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース 取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価 額を零とする定額法を採用しており ま す。</p>
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>(1) 貸倒引当金 同左</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>(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>(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 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38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
-	(資産除去債務に関する会計基準等の適用) 当事業年度から、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。これによる当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。

表示方法の変更

第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

-	<p>（貸借対照表）</p> <p>前事業年度までは流動資産の「未収収益」に含めて表示していた「未収委託者報酬」、「未収運用受託報酬」及び流動負債の「未払費用」に含めて表示していた「未払手数料」は、表示をより明瞭にするために当事業年度より区分掲記いたしました。なお、前事業年度における「未収委託者報酬」、「未収運用受託報酬」及び「未払手数料」の金額は、それぞれ2,048,181千円、946,091千円、及び952,810千円であります。</p>
---	---

注記事項

（貸借対照表関係）

第38期 （平成22年3月31日）	第39期 （平成23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 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>	<p>1.有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 268,368千円</p> <p>器具備品 248,865千円</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 23,314千円</p>

（損益計算書関係）

第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	第39期 （自 平成22年4月1日 至 平成23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

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

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

(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22年6月28日 定時株主総会	普通株式	962,500	250	平成22年3月31日	平成22年6月29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23年6月30日開催の第39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23年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,424,500	利益 剰余金	370	平成23年3月31日	平成23年6月30日

（リース取引関係）

第38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）				第39期 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）			
1.ファイナンス・リース取引 リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権 移転外ファイナンス・リース取引 （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 リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権 移転外ファイナンス・リース取引 （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	2,009	2,813	器具備品	4,823	2,974	1,849
合計	4,823	2,009	2,813	合計	4,823	2,974	1,849
(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				(2) 未経過リース料期末残高相当額 1年以内 1,007千円 1年超 961千円 合計 1,968千円			
(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				(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 104千円			
(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 1,609千円 1年超 - 千円 合計 1,609千円				2.オペレーティング・リース取引 未経過リース料 -			

(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、金融商品で時価開示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、金融商品で時価開示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) その他有価証券	
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) その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
----	------------

(金融商品関係)

第39期（自平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

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。

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であり、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23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、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	13,597,002	13,597,002	-
(2) 未収委託者報酬	2,467,550	2,467,550	-
(3) 未収運用受託報酬	939,007	939,007	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	4,314,859	4,314,859	-
資産計	21,318,420	21,318,420	-
(1) 未払手数料	1,159,542	1,159,542	-
(2) 未払費用	725,141	725,141	-
負債計	1,884,684	1,884,684	-

(*1) 未払費用のうち、金融商品で時価開示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、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 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) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	
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	743,455

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) その他有価証券の非上場株式については2. (4) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	13,597,002	-	-	-
未収委託者報酬	2,467,550	-	-	-
未収運用受託報酬	939,007	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券	-	1,084,621	2,001	-
合計	17,003,560	1,084,621	2,001	-

(有価証券関係)

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

(単位：千円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
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

(単位：千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	-	-	-

第39期（平成23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

(単位：千円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
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	915,000	933,950	18,950
	小計	915,000	933,950	18,950
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	3,459,000	3,380,909	78,091
	小計	3,459,000	3,380,909	78,091
合計		4,374,000	4,314,859	59,140

(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

(単位：千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	-	-	-

(デリバティブ取引関係)

第38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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） 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 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） 974,968千円 (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 143,190千円 確定拠出年金掛金 51,252千円 合計 194,442千円 (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38期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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> <p>流動資産 (千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>(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>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">401,279</td></tr> </table> <p>固定資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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>(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>(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>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">536,417</td></tr> </table>	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	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>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> <p>流動資産 (千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">122,775</td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">337,467</td></tr> <tr><td>社会保険料</td><td style="text-align: right;">29,423</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,234</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">8,570</td></tr> <tr><td>(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">503,471</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">503,471</td></tr> </table> <p>固定資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">395,837</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;">53,592</td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">24,010</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">72,409</td></tr> <tr><td>(繰延税金資産の小計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">624,958</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">79,108</td></tr> <tr><td>(繰延税金資産の合計)</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">545,849</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">545,849</td></tr> </table>	未払事業税	122,775	賞与引当金	337,467	社会保険料	29,423	未払事業所税	5,234	その他	8,570	(繰延税金資産の小計)	503,471	繰延税金資産の純額	503,471	退職給付引当金	395,837	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	53,592	その他有価証券評価差額金	24,010	その他	72,409	(繰延税金資産の小計)	624,958	評価性引当額	79,108	(繰延税金資産の合計)	545,849	繰延税金資産の純額	545,849
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																																																																				
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																																																																				
未払事業税	122,775																																																																				
賞与引当金	337,467																																																																				
社会保険料	29,423																																																																				
未払事業所税	5,234																																																																				
その他	8,570																																																																				
(繰延税金資産の小計)	503,471																																																																				
繰延税金資産の純額	503,471																																																																				
退職給付引当金	395,837																																																																				
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	53,592																																																																				
その他有価証券評価差額金	24,010																																																																				
その他	72,409																																																																				
(繰延税金資産の小計)	624,958																																																																				
評価性引当額	79,108																																																																				
(繰延税金資産の合計)	545,849																																																																				
繰延税金資産の純額	545,849																																																																				

<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;"> <tr> <td style="width: 80%;">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> </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	<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> <p>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>との間の差異が法定実効税率の百分の五以下であるため注記を省略しております。</p>
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														

（セグメント情報等）

セグメント情報

第38期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客よりの営業収益	24,069,333	3,364,664	112,848	27,546,846

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客よりの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載は省略しております。

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客よりの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第39期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

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

（関連当事者との取引）

第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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

第39期（自平成22年4月1日至平成23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	3,310,157	未払手数料	486,916
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	3,038,329	未払手数料	232,560

取引条件及び取引条件の決定方針等

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38期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第39期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	4,607円96銭	1株当たり純資産額	5,107円48銭
1株当たり当期純利益	512円93銭	1株当たり当期純利益	734円71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。		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38期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第39期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
損益計算書上の当期純利益(千円)	1,974,764	2,828,630
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)	1,974,764	2,828,630
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38期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	第39期 （自 平成22年4月1日 至 平成23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

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 受託会社

名称	資本金の額（百万円） 平成23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23年3月末現在）
- ・事業の内容：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に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成23年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	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23年11月18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 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定有限責任社員 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23年3月29日から平成23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23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23年6月15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、「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22年4月1日から平成23年3月31日までの第39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23年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績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23年5月13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9月28日から平成23年3月28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23年3月28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 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。