

【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24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24年6月27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

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(1)ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの基本的性格

(以下略)

< 属性区分表 >

(以下略)

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表の各項目の定義について

(以下略)

(3)ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成24年4月末現在）

(以下略)

< 訂正後 >

(1)ファンドの目的及び基本的性格

(以下略)

ファンドの基本的性格

(以下略)

< 属性区分表 >

(以下略)

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有

無を記載しております。
属性区分表の各項目の定義について

（以下略）

(3)ファンドの仕組み

（以下略）

委託会社等の概況（平成24年10月末現在）

（以下略）

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

< 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24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)

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

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	<p>バークレイズ米国総合インデックスは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーの投資銀行部門であるバークレイズ・キャピタルが開発、算出、公表を行うインデックスであり、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はバークレイズ・キャピタルに帰属します。</p>
------------	--

(以下略)

(3) 運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成24年4月末現在で約100名です。

(以下略)

< 訂正後 >

(2) 投資対象

(以下略)

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要

当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券の概要は以下の通りです。

指定投資信託証券の概要は、平成24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）

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

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	バークレイズ米国総合インデックスは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーの投資銀行部門であるバークレイズが開発、算出、公表を行うインデックスであり、米ドル建て投資適格債券市場のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はバークレイズに帰属します。
------------	---

(以下略)

(3)運用体制

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成24年10月末現在で約100名です。

(以下略)

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 投資状況

（平成24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	2,835,796,480	15.40%
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	2,678,266,586	14.55%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,886,380,961	10.25%
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	1,830,821,874	9.95%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,781,515,838	9.68%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	1,763,176,739	9.58%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	932,709,220	5.07%
投資証券	ルクセンブルグ	4,462,850,984	24.24%
純資産総額		18,408,936,836	-

（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24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	22,926,215,300	95.16%
純資産総額		24,091,097,488	-

（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	708,854,811	24.72%
	オーストラリア	590,700,081	20.60%
	イギリス	411,959,094	14.36%
	フランス	255,292,332	8.90%
	日本	221,948,500	7.74%
	カナダ	189,947,067	6.62%
	シンガポール	184,745,498	6.44%
	オランダ	106,966,097	3.73%
	ベルギー	86,618,673	3.02%
	ドイツ	26,495,585	0.92%
純資産総額		2,867,874,791	-

（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	35,177,631,518	28.39%
	香港	14,549,654,748	11.74%
	オーストラリア	11,485,563,158	9.27%
	イギリス	10,352,528,598	8.35%
	フランス	6,640,826,862	5.36%
	シンガポール	5,720,466,688	4.62%
	台湾	4,985,161,075	4.02%
	スウェーデン	4,517,875,321	3.65%
	ドイツ	4,181,383,197	3.37%
	スイス	3,340,087,258	2.70%
	ノルウェー	3,301,462,273	2.66%
	オランダ	3,152,892,131	2.54%
	カナダ	2,582,667,537	2.08%
	韓国	1,965,770,112	1.59%
	イタリア	1,659,431,317	1.34%
	パナマ	1,365,552,829	1.10%
	フィンランド	1,320,217,764	1.07%
	バミューダ	1,200,707,691	0.97%
ベルギー	778,504,476	0.63%	
純資産総額		123,928,454,246	-

（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	トルコ	1,053,759,646	7.99%
	ロシア	831,480,145	6.31%
	ブラジル	700,643,455	5.32%
	ハンガリー	542,843,070	4.12%
	ウクライナ	403,352,017	3.06%
	インドネシア	401,038,312	3.04%
	ヴェネズエラ	331,799,593	2.52%
	メキシコ	316,010,956	2.40%
	ペルー	245,019,622	1.86%
	リトアニア	236,131,007	1.79%
	フィリピン	210,302,400	1.60%
	アイスランド	180,344,544	1.37%
	イラク	176,707,989	1.34%
	アルゼンチン	140,510,282	1.07%
	ガボン	126,858,550	0.96%
	セルビア	124,277,282	0.94%
	ドミニカ共和国	124,105,059	0.94%
	コロンビア	87,148,040	0.66%
	南アフリカ	84,515,436	0.64%
	ナイジェリア	69,044,309	0.52%
	ジャマイカ	61,296,179	0.47%
	エジプト	58,623,387	0.44%
	ベトナム	30,756,726	0.23%
	スリランカ	27,411,006	0.21%
	マレーシア	22,937,300	0.17%
	グルジア	18,257,275	0.14%
	ナミビア	17,943,415	0.14%
	ザンビア	16,131,150	0.12%
	グレナダ	11,432,803	0.09%

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	666,489,330	5.06%
	ジャマイカ	176,579,666	1.34%
	ロシア	103,558,000	0.79%
	インドネシア	69,862,815	0.53%
	南アフリカ	60,696,937	0.46%
	レバノン	30,034,600	0.23%
	ルクセンブルグ	15,976,609	0.12%
社債券	フィリピン	1,016,944,976	7.72%
	オランダ	611,064,132	4.64%
	ヴェネズエラ	412,650,878	3.13%
	ケイマン諸島	385,361,742	2.92%
	ブラジル	381,850,608	2.90%
	アイルランド	351,908,804	2.67%
	ルクセンブルグ	194,810,601	1.48%
	トルコ	166,674,828	1.26%
	チリ	132,672,375	1.01%
	イギリス領バージン諸島	130,831,751	0.99%
	アメリカ	118,044,011	0.90%
	カザフスタン	107,227,936	0.81%
	メキシコ	105,634,776	0.80%
	香港	90,894,035	0.69%
	コロンビア	89,896,310	0.68%
	ペルー	88,500,268	0.67%
	バミューダ	77,256,179	0.59%
	ゲルジア	70,668,377	0.54%
	アルゼンチン	49,697,882	0.38%
	キプロス	43,374,870	0.33%
	イギリス	41,881,245	0.32%
	インドネシア	40,083,318	0.30%
	パナマ	23,149,275	0.18%
	タイ	16,418,881	0.12%
カナダ	16,310,385	0.12%	
純資産総額		13,181,360,362	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	イギリス	287,905,276	16.33%
	イタリア	251,180,205	14.25%
	ドイツ	240,713,434	13.65%
	フランス	163,238,956	9.26%
	スペイン	140,939,291	7.99%
	ベルギー	71,856,345	4.08%
	ポーランド	68,151,576	3.87%
	オーストリア	56,347,702	3.20%
	オランダ	46,221,799	2.62%
	アイルランド	24,633,952	1.40%
	スウェーデン	22,310,107	1.27%
	チェコ	13,812,837	0.78%
	ブラジル	9,316,923	0.53%
	ノルウェー	8,428,347	0.48%
特殊債券	スウェーデン	23,859,990	1.35%
	ルクセンブルグ	18,082,463	1.03%
	メキシコ	5,888,666	0.33%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
社債券	オランダ	51,045,835	2.90%
	アメリカ	39,915,000	2.26%
	イギリス	35,089,182	1.99%
	フランス	27,182,708	1.54%
	ルクセンブルグ	25,399,197	1.44%
	イタリア	17,947,436	1.02%
	アイルランド	17,603,043	1.00%
	ケイマン諸島	11,198,185	0.64%
	ドイツ	7,882,927	0.45%
	ノルウェー	5,806,912	0.33%
	スウェーデン	5,629,305	0.32%
	デンマーク	5,474,886	0.31%
	韓国	5,315,819	0.30%
	スペイン	5,169,302	0.29%
	オーストラリア	1,697,839	0.10%
	ガンジー	1,063,060	0.06%
ベルギー	629,562	0.04%	
純資産総額		1,763,157,408	-

（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	韓国	281,973,308	15.40%
	マレーシア	66,073,567	3.61%
	シンガポール	43,424,310	2.37%
	香港	39,123,449	2.14%
特殊債券	国際機関	1,289,900,515	70.45%
純資産総額		1,830,861,988	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

コモディティ・マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
社債券	イギリス	931,656,201	99.89%
純資産総額		932,660,529	-

（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24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 -	4,736,590,080	0.5691 2,696,067,073	0.5987 2,835,796,480	- -	15.40%
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 -	2,772,245,716	0.9436 2,616,168,282	0.9661 2,678,266,586	- -	14.55%
3	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,443,401,149	1.2570 1,814,499,584	1.3069 1,886,380,961	- -	10.25%
4	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 -	1,786,690,616	0.9900 1,769,002,378	1.0247 1,830,821,874	- -	9.95%
5	T.Rowe Price Funds SICAV-U. S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	2,050,665	890 1,826,315,933	891 1,827,954,167	- -	9.93%
6	T.Rowe Price Funds SICAV-Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	2,253,523	796 1,795,178,038	797 1,796,952,327	- -	9.76%
7	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	2,649,094,184	0.6733 1,783,900,023	0.6725 1,781,515,838	- -	9.68%
8	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	2,125,589,801	0.7967 1,693,669,953	0.8295 1,763,176,739	- -	9.58%

	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
9	コモディティ・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,544,987,942	0.6063 936,880,688	0.6037 932,709,220	- -	5.07%
10	T.Rowe Price Funds SICAV-Global Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,473,250	560 826,208,572	568 837,944,489	- -	4.55%

（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	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	2,509,700	359 900,982,300	361 906,001,700	- -	3.76%
2	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	6,913,600	125 864,200,000	125 864,200,000	- -	3.59%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	213,800	3,825 817,785,000	3,635 777,163,000	- -	3.23%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	316,900	2,361 748,200,900	2,390 757,391,000	- -	3.14%
5	住友商事 日本	株式 卸売業	594,900	1,053 626,429,700	1,088 647,251,200	- -	2.69%
6	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	162,200	3,885 630,147,000	3,965 643,123,000	- -	2.67%
7	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	1,335,000	424 566,040,000	425 567,375,000	- -	2.36%
8	大東建託 日本	株式 建設業	70,000	8,000 560,000,000	8,060 564,200,000	- -	2.34%
9	キヤノン 日本	株式 電気機器	185,400	2,425 449,595,000	2,578 477,961,200	- -	1.98%
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	565,000	770 435,050,000	799 451,435,000	- -	1.87%
11	ローソン 日本	株式 小売業	74,200	5,810 431,102,000	5,870 435,554,000	- -	1.81%
12	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	204,900	2,016 413,078,400	2,113 432,953,700	- -	1.80%
13	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	3,538	124,500 440,481,000	117,300 415,007,400	- -	1.72%
14	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	111,600	3,580 399,528,000	3,710 414,036,000	- -	1.72%
15	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	614,000	656 402,784,000	668 410,152,000	- -	1.70%
16	三井物産 日本	株式 卸売業	359,000	1,091 391,669,000	1,125 403,875,000	- -	1.68%
17	イオンクレジットサービス 日本	株式 その他金融業	218,000	1,716 374,088,000	1,694 369,292,000	- -	1.53%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	65,500	5,180 339,290,000	5,480 358,940,000	- -	1.49%
19	H O Y A 日本	株式 精密機器	199,600	1,673 333,930,800	1,616 322,553,600	- -	1.34%
20	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	899,000	339 305,184,906	345 310,155,000	- -	1.29%
21	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	138,800	2,238 310,634,400	2,206 306,192,800	- -	1.27%
22	日立キャピタル 日本	株式 その他金融業	194,500	1,489 289,610,500	1,532 297,974,000	- -	1.24%
23	三井住友トラスト・ホール ディングス 日本	株式 銀行業	1,219,000	224 273,056,000	242 294,998,000	- -	1.22%
24	アズビル 日本	株式 電気機器	174,900	1,537 268,821,300	1,633 285,611,700	- -	1.19%
25	東芝 日本	株式 電気機器	960,000	262 251,964,286	296 284,160,000	- -	1.18%
26	T & Dホールディングス 日本	株式 保険業	317,500	839 266,606,532	872 276,860,000	- -	1.15%
27	科研製薬 日本	株式 医薬品	216,000	1,179 254,664,000	1,237 267,192,000	- -	1.11%
28	信越化学工業 日本	株式 化学	58,900	4,435 261,221,500	4,500 265,050,000	- -	1.10%

	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
29	MS & ADインシュアランス グループホールディングス 日本	株式 保険業	194,000	1,352 262,288,000	1,353 262,482,000	- -	1.09%
30	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	85,400	3,000 256,200,000	3,065 261,751,000	- -	1.09%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

[次へ](#)

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 -	183,392	721 132,363,982	882 161,811,933	- -	5.64%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	8,460	15,402 130,308,137	17,884 151,304,253	- -	5.28%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	10,652	11,514 122,647,728	11,972 127,535,309	- -	4.45%
4	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資証券 -	440,792	211 93,399,945	259 114,196,027	- -	3.98%
5	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券 -	160,415	638 102,500,292	685 109,895,103	- -	3.83%
6	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券 -	22,531	4,336 97,709,971	4,640 104,566,181	- -	3.65%
7	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券 -	82,186	927 76,245,780	1,036 85,191,110	- -	2.97%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	16,896	4,856 82,062,446	4,465 75,453,136	- -	2.63%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	118,500	536 63,563,571	608 72,076,143	- -	2.51%
10	CAPITAMALL TRUST シンガポール	投資証券 -	507,356	116 59,339,647	137 69,616,346	- -	2.43%
11	SEGRE PLC イギリス	投資証券 -	213,798	298 63,903,316	306 65,622,270	- -	2.29%
12	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	210,500	256 54,011,563	294 62,026,182	- -	2.16%
13	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	206,838	259 53,756,741	287 59,406,334	- -	2.07%
14	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	463,300	100 46,592,019	124 57,904,484	- -	2.02%
15	CORIO NV オランダ	投資証券 -	16,003	4,134 66,171,963	3,558 56,952,387	- -	1.99%
16	VENTAS INC アメリカ	投資証券 -	11,300	4,519 51,074,964	5,021 56,745,960	- -	1.98%
17	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資証券 -	176,400	256 45,261,946	298 52,708,267	- -	1.84%
18	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	614,600	69 42,985,524	81 50,361,737	- -	1.76%
19	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	317,205	129 41,018,276	155 49,328,295	- -	1.72%
20	DERWENT LONDON PLC イギリス	投資証券 -	18,378	2,247 41,300,465	2,650 48,713,370	- -	1.70%
21	ICADE フランス	投資証券 -	6,100	7,009 42,756,482	7,136 43,531,467	- -	1.52%
22	WAREHOUSES DE PAUW SCA ベルギー	投資証券 -	9,942	4,249 42,247,043	4,369 43,438,258	- -	1.51%
23	GLIMCHER REALTY TRUST - G アメリカ	投資証券 -	21,314	1,989 42,412,873	2,012 42,888,278	- -	1.50%
24	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ	投資証券 -	17,167	2,062 35,404,829	2,491 42,764,875	- -	1.49%
25	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	49	777,000 38,073,000	857,000 41,993,000	- -	1.46%
26	CAPITACOMMERCIAL TRUST シンガポール	投資証券 -	376,500	78 29,700,274	101 38,376,795	- -	1.34%
27	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D アメリカ	投資証券 -	18,025	1,971 35,537,819	2,023 36,471,136	- -	1.27%
28	MACK-CALI REALTY CORP アメリカ	投資証券 -	17,500	2,272 39,772,246	2,076 36,342,883	- -	1.27%
29	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR カナダ	投資証券 -	16,863	2,151 36,282,936	2,144 36,161,993	- -	1.26%
30	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	5,333	6,534 34,847,847	6,356 33,896,928	- -	1.18%

（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	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイ オテクノロ ジー・ライフ サイエンス	594,100	3,588 2,131,884,727	3,676 2,184,095,176	- -	1.76%
2	WEIR GROUP PLC/THE イギリス	株式 資本財	944,300	2,149 2,029,950,024	2,258 2,132,986,728	- -	1.72%
3	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR 香港	株式 各種金融	1,570,000	1,207 1,896,383,229	1,291 2,027,133,760	- -	1.64%
4	CHEUNG KONG HOLDING 香港	株式 不動産	1,720,000	1,061 1,826,550,304	1,153 1,983,875,520	- -	1.60%
5	DR HORTON INC アメリカ	株式 耐久消費財・ アパレル	1,194,600	1,523 1,819,696,948	1,653 1,975,559,715	- -	1.59%
6	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST 香港	株式 不動産	9,230,000	197 1,821,567,064	205 1,895,790,312	- -	1.53%
7	COMMONWEALTH BK オーストラリア	株式 銀行	394,800	4,521 1,784,910,194	4,743 1,872,753,026	- -	1.51%
8	HANG SENG BANK LTD 香港	株式 銀行	1,497,900	1,157 1,734,043,741	1,224 1,833,950,869	- -	1.48%
9	AUST AND NZ BANKING GROUP LT オーストラリア	株式 銀行	870,300	1,911 1,663,427,962	2,100 1,828,241,472	- -	1.48%
10	NATIONAL AUSTRALIA BANK オーストラリア	株式 銀行	851,800	2,009 1,711,825,464	2,142 1,824,630,217	- -	1.47%
11	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 銀行	867,300	1,840 1,596,615,083	2,097 1,819,067,908	- -	1.47%
12	HARTFORD FINL SVCS GRP アメリカ	株式 保険	1,032,600	1,434 1,481,084,796	1,729 1,785,797,646	- -	1.44%
13	BNP PARIBAS フランス	株式 銀行	432,700	3,354 1,451,647,538	4,069 1,760,703,702	- -	1.42%
14	ELECTROLUX AB スウェーデン	株式 耐久消費財・ アパレル	848,300	2,026 1,718,671,847	2,060 1,748,275,042	- -	1.41%
15	FREEPORT-MCMORAN COPPER アメリカ	株式 素材	559,800	2,935 1,643,495,955	3,112 1,742,274,608	- -	1.41%
16	STATOIL ASA ノルウェー	株式 エネルギー	840,900	1,962 1,650,435,270	1,979 1,664,471,573	- -	1.34%
17	INTESA SANPAOLO SPA イタリア	株式 銀行	12,852,600	138 1,782,529,698	129 1,659,431,317	- -	1.34%
18	SWISS RE AG スイス	株式 保険	298,200	5,698 1,699,435,457	5,465 1,629,903,498	- -	1.32%
19	LEGAL & GENERAL GROUP PLC イギリス	株式 保険	9,067,800	162 1,471,153,977	170 1,547,788,676	- -	1.25%
20	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD 香港	株式 銀行	6,370,000	252 1,610,541,877	242 1,542,138,780	- -	1.24%
21	HANG LUNG PROPERTIES LTD 香港	株式 不動産	5,560,000	287 1,596,119,745	275 1,531,802,240	- -	1.24%
22	GEA GROUP AG ドイツ	株式 資本財	594,300	2,255 1,340,653,794	2,512 1,492,889,207	- -	1.20%
23	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	6,203,131	220 1,370,004,903	240 1,490,240,191	- -	1.20%
24	EATON CORP アメリカ	株式 資本財	410,800	3,409 1,400,451,079	3,594 1,476,521,679	- -	1.19%
25	CAPITALAND LTD シンガポール	株式 不動産	6,830,000	201 1,374,998,587	213 1,459,310,094	- -	1.18%
26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	162,000	8,369 1,355,919,944	8,856 1,434,769,005	- -	1.16%
27	TIFFANY & CO アメリカ	株式 小売	286,100	4,847 1,386,864,144	4,984 1,426,015,725	- -	1.15%

	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
28	DEERE & CO アメリカ	株式 資本財	209,200	6,548 1,369,942,204	6,808 1,424,346,609	- -	1.15%
29	GANNETT CO アメリカ	株式 メディア	1,057,300	1,442 1,524,934,288	1,334 1,410,760,676	- -	1.14%
30	US BANCORP アメリカ	株式 銀行	524,400	2,549 1,337,176,265	2,640 1,384,798,287	- -	1.12%

（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	NATIONAL POWER CORP フィリピン	社債券 -	9,020,000	9,200.73 829,905,846	9,439.71 851,461,842	6.8750 2016/11/02	6.46%
2	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券 -	8,238,250	9,638.86 794,073,383	10,092.92 831,480,145	7.5000 2030/03/31	6.31%
3	REPUBLIC OF HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	6,600,000	8,137.75 537,091,618	8,224.89 542,843,070	4.7500 2015/02/03	4.12%
4	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	3,580,000	11,351.94 406,399,749	11,987.63 429,157,336	7.1250 2037/01/20	3.26%
5	TURKEY REP OF トルコ	国債証券 -	3,650,000	10,173.37 371,328,318	11,416.87 416,715,798	8.0000 2034/02/14	3.16%
6	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	3,750,000	9,867.88 370,045,593	10,694.35 401,038,312	6.6250 2037/02/17	3.04%
7	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	5,650,000	6,253.31 353,312,015	6,352.88 358,938,002	5.2500 2017/04/12	2.72%
8	INTERGAS FINANCE BV オランダ	社債券 -	3,850,000	8,741.64 336,553,502	9,155.96 352,504,501	6.3750 2017/05/14	2.67%
9	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	3,500,000	8,702.85 304,599,925	8,563.45 299,720,750	4.8750 2015/03/15	2.27%
10	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	3,000,000	8,603.28 258,098,400	9,288.35 278,650,680	5.6250 2021/03/30	2.11%
11	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	2,900,000	9,220.64 267,398,705	9,549.64 276,939,583	6.0000 2020/03/05	2.10%
12	TRANSCAPIT (TRANSNEFT) アイルランド	社債券 -	2,550,000	9,890.98 252,220,089	10,331.10 263,443,187	8.7000 2018/08/07	2.00%
13	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	2,085,000	11,400.54 237,701,277	11,542.33 240,657,699	8.8750 2019/10/14	1.83%
14	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券 -	1,900,000	9,390.32 178,416,095	10,363.36 196,903,986	5.6250 2050/11/18	1.49%
15	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券 -	2,000,000	9,371.99 187,439,980	9,559.20 191,184,000	5.1250 2020/01/15	1.45%
16	REPUBLIC OF ICELAND アイスランド	国債証券 -	2,150,000	8,052.51 173,128,981	8,388.11 180,344,544	4.8750 2016/06/16	1.37%
17	REPUBLIC OF IRAQ イラク	国債証券 -	2,361,000	6,721.31 158,690,188	7,484.45 176,707,989	5.8000 2028/01/15	1.34%
18	CLARENDON ALUMINA PROD ジャマイカ	特殊債券 -	2,261,904	8,005.75 181,082,447	7,806.68 176,579,666	8.5000 2021/11/16	1.34%
19	REPUBLIC OF LITHUANIA リトアニア	国債証券 -	1,700,000	8,709.22 148,056,872	9,489.89 161,328,228	6.1250 2021/03/09	1.22%
20	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	1,547,000	9,356.86 144,750,679	9,989.36 154,535,461	7.0000 2020/06/05	1.17%
21	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券 -	1,300,000	10,007.28 130,094,737	11,072.74 143,945,620	6.3750 2034/10/23	1.09%
22	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	5,150,000	2,620.81 134,971,921	2,728.35 140,510,282	2.5000 2038/12/31	1.07%
23	MAJAPAHIT HOLDING BV オランダ	社債券 -	1,300,000	9,618.94 125,046,285	10,104.07 131,352,967	7.7500 2020/01/20	1.00%
24	REPUBLIC OF VENEZUELA	国債証券	1,580,000	8,085.49	8,097.43	11.7500	0.97%

	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
	ヴェネズエラ	-		127,750,742	127,939,536	2026/10/21	
25	GABONESE REPUBLIC ガボン	国債証券 -	1,300,000	9,559.20 124,269,600	9,758.35 126,858,550	8.2000 2017/12/12	0.96%
26	NATIONAL POWER CORP フィリピン	社債券 -	1,000,000	11,232.06 112,320,600	12,665.94 126,659,400	9.6250 2028/05/15	0.96%
27	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	1,567,936	7,906.23 123,964,641	7,926.17 124,277,282	6.7500 2024/11/01	0.94%
28	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	1,560,000	7,498.25 116,972,853	7,883.95 122,989,623	6.5800 2016/11/21	0.93%
29	GENERAL SHOPPING FINANCE ブラジル	社債券 -	1,500,000	7,955.48 119,332,273	7,975.95 119,639,362	10.0000 2099/12/31	0.91%
30	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	13,600,000	803.30 109,248,804	865.31 117,683,048	10.0000 2036/11/20	0.89%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数・口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	UK GILT イギリス	国債証券 -	592,000	15,006.95 88,841,175	15,747.58 93,225,726	4.2500 2046/12/07	5.29%
2	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	484,000	13,532.43 65,496,990	14,653.95 70,925,160	5.7500 2032/10/25	4.02%
3	UK GILT イギリス	国債証券 -	540,000	13,295.43 71,795,330	12,995.79 70,177,290	4.5000 2013/03/07	3.98%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	640,000	9,610.19 61,505,228	9,809.45 62,780,488	3.7500 2021/03/01	3.56%
5	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	637,000	9,357.04 59,604,351	9,561.55 60,907,107	5.0000 2040/09/01	3.45%
6	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	530,000	11,089.25 58,773,058	11,399.08 60,415,147	2.5000 2021/01/04	3.43%
7	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	545,000	10,892.18 59,362,415	10,986.95 59,878,917	5.2500 2017/08/01	3.40%
8	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	530,000	11,313.86 59,963,506	11,163.06 59,164,253	3.7500 2015/01/04	3.36%
9	UK GILT イギリス	国債証券 -	375,000	14,554.05 54,577,702	14,418.43 54,069,112	4.7500 2015/09/07	3.07%
10	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	431,000	10,828.20 46,669,544	10,609.74 45,727,988	4.4000 2015/01/31	2.59%
11	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	327,000	13,397.78 43,810,761	13,635.31 44,587,473	4.0000 2037/01/04	2.53%
12	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	430,000	10,105.36 43,453,070	10,145.55 43,625,894	4.6000 2019/07/30	2.47%
13	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	338,000	12,336.49 41,697,359	12,393.56 41,890,234	4.2500 2018/07/04	2.38%
14	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	265,000	12,125.39 32,132,309	13,152.94 34,855,313	4.7500 2035/04/25	1.98%
15	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券 -	223,000	13,894.88 30,985,583	15,090.87 33,652,652	6.2500 2027/07/15	1.91%
16	UK GILT イギリス	国債証券 -	184,000	15,531.49 28,577,945	15,573.44 28,655,131	5.0000 2018/03/07	1.63%
17	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	284,000	10,009.22 28,426,204	9,775.98 27,763,798	5.7500 2032/07/30	1.57%
18	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	213,000	11,320.52 24,112,718	12,032.76 25,629,797	4.2500 2021/09/28	1.45%
19	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	227,000	9,919.97 22,518,335	10,529.38 23,901,698	4.0000 2017/02/01	1.36%
20	SWEDISH EXPORT CREDIT スウェーデン	特殊債券 -	220,000	10,787.60 23,732,736	10,845.45 23,859,990	3.6250 2014/05/27	1.35%
21	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	153,000	13,815.03 21,137,007	14,608.30 22,350,706	5.5000 2028/01/15	1.27%
22	SWEDISH GOVERNMENT スウェーデン	国債証券 -	1,455,000	1,493.92 21,736,592	1,533.34 22,310,107	5.0000 2020/12/01	1.27%
23	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	194,000	10,461.62 20,295,551	10,365.66 20,109,395	1.7500 2013/01/15	1.14%
24	IRISH GOVT TREASURY アイルランド	国債証券 -	172,000	10,443.70 17,963,174	11,269.45 19,383,463	5.5000 2017/10/18	1.10%
25	BUNDESobligation ドイツ	国債証券 -	180,000	10,758.22 19,364,803	10,727.69 19,309,858	1.2500 2016/10/14	1.10%
26	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券 -	677,000	2,623.97 17,764,341	2,684.71 18,175,539	5.5000 2019/10/25	1.03%
27	GAZ CAPITAL (GAZPROM) ルクセンブルグ	特殊債券 -	150,000	11,557.63 17,336,451	12,054.97 18,082,463	6.6050 2018/02/13	1.03%
28	UK GILT イギリス	国債証券 -	117,000	14,466.77 16,926,122	15,090.69 17,656,110	3.7500 2021/09/07	1.00%
29	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	145,000	12,096.91 17,540,521	12,097.32 17,541,120	4.2500 2018/10/25	0.99%
30	UK GILT イギリス	国債証券 -	111,000	14,752.64 16,375,430	15,688.68 17,414,441	4.2500 2039/09/07	0.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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 -	7,357,000	8,380.29 616,538,447	8,521.41 626,920,855	5.3750 2014/05/20	34.24%
2	INTER-AMERICAN DEVEL BK 国際機関	特殊債券 -	5,500,000	7,352.13 404,367,499	7,447.22 409,597,230	6.2500 2017/12/15	22.37%
3	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	3,000,000,000	7.29 218,986,401	7.39 221,918,442	3.5000 2014/06/10	12.12%
4	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	2,902,000	7,422.25 215,393,853	7,517.07 218,145,584	7.5000 2017/12/15	11.91%
5	MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	2,490,000	2,651.78 66,029,340	2,653.55 66,073,567	3.7410 2015/02/27	3.61%
6	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	800,000,000	7.47 59,791,121	7.50 60,054,866	4.7500 2014/03/10	3.28%
7	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	600,000	7,105.72 42,634,350	7,237.38 43,424,310	2.5000 2019/06/01	2.37%
8	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	3,700,000	1,063.15 39,336,831	1,057.39 39,123,449	1.6900 2014/09/29	2.14%
9	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	400,000	8,593.76 34,375,043	8,809.21 35,236,844	6.2500 2015/04/15	1.92%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

コモディティ・マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	DJUBS/BARCLAYS 10/18/13 イギリス	社債券 -	12,200,000	7,965.30 971,766,763	7,636.52 931,656,201	0.5500 2013/10/18	99.89%

（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	74.47%
投資証券	24.24%
合計	98.71%

（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	95.16%
合計	95.16%

（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	97.06%
合計	97.06%

（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	95.44%
合計	95.44%

（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	50.46%
社債券	36.14%
特殊債券	8.52%
合計	95.12%

（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。

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

種類別	投資比率
国債証券	79.69%
社債券	14.98%
特殊債券	2.71%
合計	97.38%

（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。

アジア・オセアニア債券マザーファンド

種類別	投資比率
特殊債券	70.45%
国債証券	23.52%
合計	93.97%

（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	99.89%
合計	99.89%

（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	12.81%
卸売業	9.74%
情報・通信業	8.93%
医薬品	8.11%
化学	7.56%
電気機器	7.52%
輸送用機器	6.48%
保険業	4.04%
陸運業	3.74%
小売業	3.25%
建設業	3.06%
機械	2.92%
石油・石炭製品	2.81%
その他金融業	2.77%
サービス業	2.17%
精密機器	1.34%
食料品	1.27%
その他製品	1.22%
ガラス・土石製品	1.12%
不動産業	0.84%

業種別	投資比率
ゴム製品	0.80%
非鉄金属	0.51%
空運業	0.49%
証券、商品先物取引業	0.48%
鉄鋼	0.44%
電気・ガス業	0.43%
金属製品	0.20%
繊維製品	0.11%
小計	95.16%
合計	95.16%

（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)	
銀行	15.63%
資本財	11.72%
食品・飲料・タバコ	8.41%
エネルギー	7.06%
素材	6.96%
保険	6.05%
不動産	5.93%
電気通信サービス	5.63%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.45%
耐久消費財・アパレル	3.50%
小売	3.11%
公益事業	2.79%
半導体・半導体製造装置	2.23%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.05%
ソフトウェア・サービス	1.97%
家庭用品・パーソナル用品	1.73%
各種金融	1.64%
メディア	1.14%
消費者サービス	1.10%
自動車・自動車部品	1.01%
食品・生活必需品小売り	0.87%
運輸	0.47%
小計	95.44%
合計	95.44%

(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。

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。

コモディティ・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24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。

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。

コモディティ・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24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 2412月	買建	119	865,725,000	881,790,000	3.66%

(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。

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。

コモディティ・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
第8特定期間末 （平成23年3月28日）	30,336	30,802	0.6301	0.6391
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11月末日	21,441	-	0.5584	-
平成23年12月末日	21,069	-	0.5627	-
平成24年1月末日	21,038	-	0.5728	-
平成24年2月末日	22,012	-	0.6211	-
第10特定期間末 （平成24年3月27日）	21,940	22,270	0.6349	0.6439
平成24年3月末日	21,582	-	0.6251	-
平成24年4月末日	20,904	-	0.6156	-
平成24年5月末日	18,918	-	0.5672	-
平成24年6月末日	18,918	-	0.5816	-
平成24年7月末日	18,863	-	0.5913	-
平成24年8月末日	18,477	-	0.5963	-
第11特定期間末 （平成24年9月27日）	18,250	18,537	0.6003	0.6093
平成24年9月末日	18,307	-	0.6017	-
平成24年10月末日	18,408	-	0.6177	-

（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
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	0.0090
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24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%
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	18.2%
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	4.0%

（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）

2012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

2012年9月	30円
2012年7月	30円
2012年5月	30円
2012年3月	30円
2012年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	1,130円

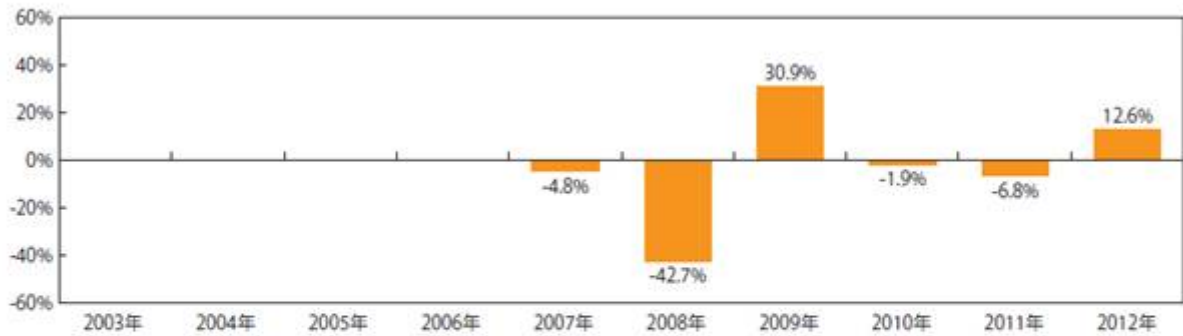
* 分配金は1万口当たり、税引前

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	15.4%
グローバル好配当株マザーファンド	14.5%
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	9.9%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.9%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.8%
日本好配当株マザーファンド	9.7%
欧州債券マザーファンド	9.6%
コモディティ・マザーファンド	5.1%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	4.6%

* 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、2012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の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
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	219,834,307	6,245,534,761
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	180,413,715	4,336,327,069

（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、当特定期間（平成24年3月28日から平成24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24年3月27日現在 金 額（円）	当 期 平成24年9月27日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,371,176	1,284,671
コール・ローン	336,089,009	383,911,900
投資証券	5,461,448,392	4,465,707,930
親投資信託受益証券	16,176,690,315	13,454,187,981
未収入金	200,000,000	150,000,000
流動資産合計	22,175,598,892	18,455,092,482
資産合計	22,175,598,892	18,455,092,482
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	103,676,119	91,208,378
未払解約金	76,440,264	65,102,567
未払受託者報酬	1,498,811	1,334,170
未払委託者報酬	52,459,031	46,696,277
その他未払費用	644,691	620,928
流動負債合計	234,718,916	204,962,320
負債合計	234,718,916	204,962,320
純資産の部		
元本等		
元本	34,558,706,344	30,402,792,990
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,617,826,368	12,152,662,828
（分配準備積立金）	596,427,201	613,601,230
元本等合計	21,940,879,976	18,250,130,162
純資産合計	21,940,879,976	18,250,130,162
負債純資産合計	22,175,598,892	18,455,092,482

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期 自 平成23年 9月28日 至 平成24年 3月27日 金 額 (円)	当 期 自 平成24年 3月28日 至 平成24年 9月27日 金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	132,899,040	112,533,773
受取利息	144,207	149,105
有価証券売買等損益	3,253,972,810	579,882,249
為替差損益	440,798,172	313,405,728
営業収益合計	3,827,814,229	780,605,099
営業費用		
受託者報酬	4,541,421	4,120,011
委託者報酬	158,951,331	144,201,672
その他費用	786,132	766,017
営業費用合計	164,278,884	149,087,700
営業利益又は営業損失()	3,663,535,345	929,692,799
経常利益又は経常損失()	3,663,535,345	929,692,799
当期純利益又は当期純損失()	3,663,535,345	929,692,799
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()	136,214,701	3,615,021
期首剰余金又は期首欠損金()	18,478,542,555	12,617,826,368
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,760,115,469	1,750,701,700
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減 少額	2,760,115,469	1,750,701,700
剰余金減少額又は欠損金増加額	97,247,196	72,519,012
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	97,247,196	72,519,012
分配金	329,472,730	286,941,370
期末剰余金又は期末欠損金()	12,617,826,368	12,152,662,828

[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	当期
	自 平成24年 3月28日 至 平成24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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	(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。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成24年 3月27日現在	平成24年 9月27日現在
1. 元本状況		
期首元本額	40,584,406,798円	34,558,706,344円
期中追加設定元本額	219,834,307円	180,413,715円
期中一部解約元本額	6,245,534,761円	4,336,327,069円
2. 受益権の総数	34,558,706,344口	30,402,792,990口
3. 元本の欠損	12,617,826,368円	12,152,662,828円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																	
	自 平成23年 9月28日 至 平成24年 3月27日	自 平成24年 3月28日 至 平成24年 9月27日																																
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	14,405,736円	12,976,734円																																
2. 分配金の計算過程 第27期計算期間末（平成23年11月28日）に、投資信託約款に基づき計算した863,792,709円（1万口当たり224.58円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い115,387,399円（1万口当たり30円）を分配しております。		2. 分配金の計算過程 第30期計算期間末（平成24年 5月28日）に、投資信託約款に基づき計算した826,062,160円（1万口当たり247.77円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い100,020,235円（1万口当たり30円）を分配しております。																																
<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>119,961,344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>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>131,192,871円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>612,638,494円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>863,792,709円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（224.58円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>115,387,399円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（30円）</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	119,961,344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	131,192,871円	分配準備積立金	612,638,494円	分配可能額	863,792,709円	（1万口当たり分配可能額）	（224.58円）	収益分配金	115,387,399円	（1万口当たり収益分配金）	（30円）		<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 （費用控除後）</td> <td>134,826,384円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>116,847,009円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>574,388,767円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>826,062,160円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり分配可能額）</td> <td>（247.77円）</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>100,020,235円</td> </tr> <tr> <td>（1万口当たり収益分配金）</td> <td>（30円）</td> </tr> </table>	配当等収益 （費用控除後）	134,826,384円	有価証券売買等損益	0円	収益調整金	116,847,009円	分配準備積立金	574,388,767円	分配可能額	826,062,160円	（1万口当たり分配可能額）	（247.77円）	収益分配金	100,020,235円	（1万口当たり収益分配金）	（30円）
配当等収益 （費用控除後）	119,961,344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	131,192,871円																																	
分配準備積立金	612,638,494円																																	
分配可能額	863,792,709円																																	
（1万口当たり分配可能額）	（224.58円）																																	
収益分配金	115,387,399円																																	
（1万口当たり収益分配金）	（30円）																																	
配当等収益 （費用控除後）	134,826,384円																																	
有価証券売買等損益	0円																																	
収益調整金	116,847,009円																																	
分配準備積立金	574,388,767円																																	
分配可能額	826,062,160円																																	
（1万口当たり分配可能額）	（247.77円）																																	
収益分配金	100,020,235円																																	
（1万口当たり収益分配金）	（30円）																																	

第28期計算期間末（平成24年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した842,283,637円（1万口当たり228.86円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1110,409,212円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	126,149,631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	126,705,105円
分配準備積立金	589,428,901円
分配可能額	842,283,637円
（1万口当たり分配可能額）	(228.86円)
収益分配金	110,409,212円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第29期計算期間末（平成24年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した820,112,095円（1万口当たり237.31円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い1103,676,119円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	132,851,778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	120,008,775円
分配準備積立金	567,251,542円
分配可能額	820,112,095円
（1万口当たり分配可能額）	(237.31円)
収益分配金	103,676,119円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第31期計算期間末（平成24年7月27日）に、投資信託約款に基づき計算した805,188,886円（1万口当たり252.38円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い95,712,757円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	110,399,307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	112,906,220円
分配準備積立金	581,883,359円
分配可能額	805,188,886円
（1万口当たり分配可能額）	(252.38円)
収益分配金	95,712,757円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第32期計算期間末（平成24年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した813,462,824円（1万口当たり267.56円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い91,208,378円（1万口当たり30円）を分配しております。

配当等収益 （費用控除後）	137,358,423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	108,653,216円
分配準備積立金	567,451,185円
分配可能額	813,462,824円
（1万口当たり分配可能額）	(267.56円)
収益分配金	91,208,378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	当期 自 平成24年3月28日 至 平成24年9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは投資証券、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。
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、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期 平成24年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) 金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成24年3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	1,565,242,381
投資証券	41,154,508
合計	1,606,396,889

当期（平成24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	445,783,207
投資証券	115,856,736
合計	561,639,943

（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24年3月27日現在）

該当事項はありません。

当期（平成24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）

当期（自平成24年3月28日至平成24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24年3月27日現在	当期 平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.6349円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,349円）」	1口当たり純資産額 0.6003円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,003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	2,649,094,184	1,783,900,023	
	親投資信託受益証券	世界REITマザーファンド	4,736,590,080	2,696,067,073	
	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	2,772,245,716	2,616,168,282	
	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	1,443,401,149	1,814,499,584	
	親投資信託受益証券	欧州債券マザーファンド	2,306,312,693	1,837,669,953	
	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	1,786,690,616	1,769,002,378	
	親投資信託受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,544,987,942	936,880,688	
		小計（日本）7銘柄	17,239,322,380	13,454,187,981	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	1,737,342.760	12,230,893.030	

投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	2,240,426.390	22,404,263.900	
投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	2,044,790.770	22,860,760.800	
小計（アメリカ・ドル）3 銘柄		6,022,559.920	57,495,917.730 (4,465,707,930)	
合計			17,919,895,911 (4,465,707,930)	

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

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 3 銘柄	24.46%	24.92%

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 >

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24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,175,764,820	911,002,923
株式	28,889,891,000	23,281,331,200
派生商品評価勘定	73,259,369	27,340,940
未収入金	160,625,667	303,577,221
未収配当金	53,612,600	358,902,360
差入委託証拠金	21,285,000	24,990,000
流動資産合計	30,374,438,456	24,907,144,644
資産合計	30,374,438,456	24,907,144,644
負債の部		
流動負債		
前受金	48,246,000	22,134,000
未払金	88,326,144	32,560,151
未払解約金	26,280,112	158,302,108
流動負債合計	162,852,256	212,996,259
負債合計	162,852,256	212,996,259
純資産の部		
元本等		
元本	40,755,204,549	36,672,675,024
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,543,618,349	11,978,526,639
元本等合計	30,211,586,200	24,694,148,385
純資産合計	30,211,586,200	24,694,148,385
負債純資産合計	30,374,438,456	24,907,144,644

[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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	47,605,062,079円	40,755,204,549円
期中追加設定元本額	260,914,111円	324,915,560円
期中一部解約元本額	7,110,771,641円	4,407,445,085円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	37,882,329,968円	34,023,580,840円
グローバル資産分散オープン	2,872,874,581円	2,649,094,184円
合計	40,755,204,549円	36,672,675,024円
2. 受益権の総数	40,755,204,549口	36,672,675,024口
3. 元本の欠損	10,543,618,349円	11,978,526,639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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年 9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成24年 3月27日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	4,044,208,227
合計	4,044,208,227

「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10月12日から平成24年 3月27日まで）を指しております。

（平成24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	600,881,920
合計	600,881,920

「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24年 4月10日から平成24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24年3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	1,041,945,631	-	1,115,205,000	73,259,369
合計		-	-	1,115,205,000	73,259,369

区分	種類	平成24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	862,779,060	-	890,120,000	27,340,940
合計		-	-	890,120,000	27,340,940

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24年3月28日至平成24年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年3月27日現在		平成24年9月27日現在	
1口当たり純資産額	0.7413円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,413円）」	1口当たり純資産額	0.6734円 「1口 = 1円（10,000口 = 6,734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	コムシスホールディングス	155,000	1,091	169,105,000	
	大東建託	70,000	7,970	557,900,000	
	積水ハウス	198,000	785	155,430,000	
	協和エクシオ	54,000	918	49,572,000	
	高砂熱学工業	20,000	630	12,600,000	
	日本たばこ産業	138,800	2,304	319,795,200	
	オンワードホールディングス	220,000	628	138,160,000	
	クラレ	59,500	895	53,252,500	
	旭化成	165,000	408	67,320,000	
	日産化学工業	300,000	864	259,200,000	
	電気化学工業	90,000	246	22,140,000	
	信越化学工業	58,900	4,455	262,399,500	
	日本触媒	32,000	871	27,872,000	
	三井化学	235,000	153	35,955,000	
	日本合成化学工業	263,000	522	137,286,000	
	住友ベークライト	98,000	277	27,146,000	
	日立化成工業	88,900	1,075	95,567,500	
	ADEKA	36,000	585	21,060,000	
	日油	167,000	373	62,291,000	
	花王	20,000	2,354	47,080,000	

太陽ホールディングス	50,800	2,187	111,099,600
東洋インキSCホールディングス	305,000	276	84,180,000
日東電工	86,000	3,685	316,910,000
エフピコ	6,000	5,980	35,880,000
日本バルカー工業	143,000	217	31,031,000
武田薬品工業	111,600	3,640	406,224,000
アステラス製薬	164,800	4,045	666,616,000
科研製薬	216,000	1,177	254,232,000
エーザイ	86,000	3,545	304,870,000
小野薬品工業	44,200	4,745	209,729,000
第一三共	72,000	1,310	94,320,000
東燃ゼネラル石油	153,000	680	104,040,000
JXホールディングス	1,335,000	421	562,035,000
横浜ゴム	265,000	577	152,905,000
住友ゴム工業	48,200	941	45,356,200
旭硝子	166,000	521	86,486,000
ニチアス	155,000	415	64,325,000
丸一鋼管	53,800	1,671	89,899,800
山陽特殊製鋼	75,000	246	18,450,000
愛知製鋼	116,000	313	36,308,000
住友金属鉱山	67,000	976	65,392,000
古河スカイ	50,000	200	10,000,000
アサヒホールディングス	32,000	1,349	43,168,000
LIXILグループ	27,000	1,858	50,166,000
アマダ	55,000	350	19,250,000
オイレス工業	105,000	1,633	171,465,000
サトーホールディングス	89,000	1,174	104,486,000
小松製作所	49,700	1,542	76,637,400
ダイフク	200,000	394	78,800,000
マックス	172,000	938	161,336,000
日本トムソン	485,000	265	128,525,000
キッツ	173,000	343	59,339,000
コニカミノルタホールディングス	48,000	620	29,760,000
ブラザー工業	116,400	746	86,834,400
東芝	500,000	249	124,500,000
マブチモーター	22,500	3,575	80,437,500
TDK	25,500	2,935	74,842,500
アズビル	174,900	1,587	277,566,300
村田製作所	23,500	4,220	99,170,000
スター精密	35,000	774	27,090,000
キヤノン電子	121,000	1,721	208,241,000
キヤノン	212,400	2,558	543,319,200
リコー	489,000	673	329,097,000
日産自動車	714,000	663	473,382,000
トヨタ自動車	85,400	3,115	266,021,000
ティラド	248,000	184	45,632,000
プレス工業	150,000	319	47,850,000
アイシン精機	16,000	2,274	36,384,000
本田技研工業	316,900	2,463	780,524,700
豊田合成	14,600	1,616	23,593,600
タムロン	17,600	2,415	42,504,000
HOYA	199,600	1,767	352,693,200
トッパン・フォームズ	133,000	757	100,681,000
ビジョン	53,000	3,645	193,185,000
電源開発	20,700	2,049	42,414,300
東日本旅客鉄道	65,500	5,250	343,875,000
西日本旅客鉄道	45,500	3,370	153,335,000
日本通運	250,000	302	75,500,000
山九	478,000	296	141,488,000
センコー	429,000	341	146,289,000
NECネットエスアイ	21,000	1,317	27,657,000
新日鉄ソリューションズ	60,000	1,666	99,960,000
1stホールディングス	99,000	500	49,500,000
ティーガイア	38,000	740	28,120,000

野村総合研究所	29,000	1,627	47,183,000	
オービック	4,100	16,400	67,240,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	46,500	4,070	189,255,000	
日本電信電話	213,800	3,785	809,233,000	
KDDI	36,000	6,030	217,080,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	3,538	127,400	450,741,200	
ゼンリン	60,000	1,041	62,460,000	
ナガイレーベン	79,300	1,243	98,569,900	
第一興商	53,000	1,874	99,322,000	
シークス	45,500	1,137	51,733,500	
伊藤忠商事	565,000	798	450,870,000	
丸紅	426,000	507	215,982,000	
三井物産	359,000	1,116	400,644,000	
住友商事	594,900	1,069	635,948,100	
三菱商事	102,000	1,452	148,104,000	
東陽テクニカ	173,500	853	147,995,500	
オートバックスセブン	35,000	3,595	125,825,000	
ローソン	74,200	5,990	444,458,000	
セブン&アイ・ホールディングス	110,000	2,425	266,750,000	
良品計画	23,000	4,930	113,390,000	
アークス	56,000	1,807	101,192,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,509,700	371	931,098,700	
りそなホールディングス	184,000	327	60,168,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,282,000	234	533,988,000	
千葉銀行	409,000	467	191,003,000	
横浜銀行	592,000	377	223,184,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	571,000	320	182,720,000	
セブン銀行	550,000	238	130,900,000	
みずほフィナンシャルグループ	6,913,600	128	884,940,800	
野村ホールディングス	735,000	284	208,740,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	194,000	1,371	265,974,000	
東京海上ホールディングス	204,900	2,018	413,488,200	
T&Dホールディングス	287,500	857	246,387,500	
イオンクレジットサービス	218,000	1,632	355,776,000	
日立キャピタル	194,500	1,420	276,190,000	
パーク24	147,100	1,286	189,170,600	
リロ・ホールディング	43,600	2,738	119,376,800	
NECフィールディング	63,500	986	62,611,000	
もしもしホットライン	71,000	1,166	82,786,000	
リソー教育	14,720	6,150	90,528,000	
ユー・エス・エス	14,800	8,270	122,396,000	
セコム	7,000	4,115	28,805,000	
ベネッセホールディングス	5,600	3,765	21,084,000	
合計 127銘柄	32,151,058	-	23,281,331,200	

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)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

世界REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	51,439,758	47,416,163
コール・ローン	10,854,562	20,666,088
投資証券	3,170,345,816	2,650,087,599
未収配当金	9,167,331	8,635,509
流動資産合計	3,241,807,467	2,726,805,359
資産合計	3,241,807,467	2,726,805,359
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	5,831,334,119	4,790,376,198
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,589,526,652	2,063,570,839
元本等合計	3,241,807,467	2,726,805,359
純資産合計	3,241,807,467	2,726,805,359
負債純資産合計	3,241,807,467	2,726,805,359

[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24年 3月28日 至 平成24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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	<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>
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	7,348,838,907円	5,831,334,119円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	1,517,504,788円	1,040,957,921円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	5,774,313,528円	4,736,590,080円
グローバル・リート・インカム・ファンド	57,020,591円	53,786,118円
合計	5,831,334,119円	4,790,376,198円
2. 受益権の総数	5,831,334,119口	4,790,376,198口
3. 元本の欠損		
	2,589,526,652円	2,063,570,839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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年 9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成24年 3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	14,950,467
合計	14,950,467

「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24年3月27日まで）を指しております。

（平成24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	151,428,519
合計	151,428,519

「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24年3月28日から平成24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24年 3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成24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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年 3月27日現在	平成24年 9月27日現在
1口当たり純資産額 0.5559円 「1口 = 1円 (10,000口 = 5,559円)」	1口当たり純資産額 0.5692円 「1口 = 1円 (10,000口 = 5,692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	47	24,957,000	
	投資証券	産業ファンド投資法人	33	19,569,000	
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	60	9,792,000	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	49	41,258,000	
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	30	23,610,000	
	投資証券	日本リテールファンド投資法人	135	18,616,500	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	293	25,930,500	
	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	20	14,020,000	
	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	60	16,914,000	
	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	45	18,900,000	
		小計(日本)10銘柄		772	213,567,000
アメリカ・ドル	投資証券	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,700.000	160,506.000	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	18,025.000	457,294.250	
	投資証券	COUSINS PROPERTIES INC-A	13,775.000	349,196.250	
	投資証券	COUSINS PROPERTIES INC-B	13,829.000	351,256.600	
	投資証券	DUKE REALTY CORP	12,500.000	183,750.000	
	投資証券	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	5,700.000	253,707.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,896.000	969,492.480	
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	7,900.000	152,154.000	
	投資証券	GLIMCHER REALTY TRUST - G	21,314.000	536,686.520	
	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	22,531.000	1,299,588.080	
	投資証券	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	14,700.000	346,920.000	
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,100.000	406,371.000	
	投資証券	LTC PROPERTIES INC	8,400.000	267,288.000	
	投資証券	MACK-CALI REALTY CORP	17,500.000	466,375.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	10,652.000	1,609,943.280	
	投資証券	VENTAS INC	11,300.000	703,312.000	
投資証券	VORNADO REALTY TRUST	5,333.000	431,493.030		
	小計(アメリカ・ドル)17銘柄		215,155.000	8,945,333.490 (694,784,052)	
カナダ・ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	17,167.000	543,163.880	
	投資証券	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	11,600.000	344,056.000	
	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,505.000	333,303.400	
	投資証券	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	16,900.000	173,056.000	
	投資証券	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	9,600.000	362,688.000	
	投資証券	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	8,700.000	214,107.000	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,863.000	466,093.320	
		小計(カナダ・ドル)7銘柄		94,335.000	2,436,467.600 (192,115,470)
オーストラリア・ドル	投資証券	CHARTER HALL RETAIL REIT	176,400.000	601,524.000	
	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	614,600.000	593,089.000	
	投資証券	GPT GROUP	210,500.000	736,750.000	
	投資証券	INVESTA OFFICE FUND	130,892.000	379,586.800	
	投資証券	MIRVAC GROUP	463,300.000	653,253.000	
	投資証券	STOCKLAND	206,838.000	688,770.540	
	投資証券	WESTFIELD GROUP	183,392.000	1,857,760.960	
	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	440,792.000	1,287,112.640	
	小計(オーストラリア・ドル)8銘柄		2,426,714.000	6,797,846.940 (547,566,571)	
シンガポール・ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	317,205.000	764,464.050	
	投資証券	CAPITACOMMERCIAL TRUST	376,500.000	551,572.500	
	投資証券	CAPITAMALL TRUST	507,356.000	1,004,564.880	
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	378,120.000	423,494.400	
		小計(シンガポール・ドル)4銘柄		1,579,181.000	2,744,095.830 (173,152,446)

イギリス・ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	160,415.000	843,782.900	
	投資証券	DERWENT LONDON PLC	18,378.000	359,289.900	
	投資証券	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	50,700.000	230,178.000	
	投資証券	HAMMERSON PLC	118,500.000	534,672.000	
	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	82,186.000	631,188.480	
	投資証券	SEGRO PLC	213,798.000	488,100.830	
	小計（イギリス・ポンド）6銘柄			643,977.000	3,087,212.110 (387,939,073)
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,624.000	253,892.180	
	投資証券	BEFIMMO S.C.A.	4,047.000	188,994.900	
	投資証券	COFINIMMO	2,595.000	225,687.150	
	投資証券	CORIO NV	16,003.000	544,582.090	
	投資証券	EUROCOMMERCIAL	10,755.000	322,166.020	
	投資証券	ICADE	6,100.000	392,718.000	
	投資証券	KLEPIERRE	10,933.000	304,484.050	
	投資証券	SILIC	3,199.000	259,119.000	
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,460.000	1,360,368.000	
	投資証券	VASTNED RETAIL NV	4,484.000	150,214.000	
	投資証券	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,942.000	409,610.400	
	小計（ユーロ）11銘柄			104,142.000	4,411,835.790 (440,962,987)
合計				2,650,087,599 (2,436,520,599)	

- (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 17銘柄	25.48%	26.22%
カナダ・ドル	投資証券 7銘柄	7.04%	7.25%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	20.08%	20.66%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	6.35%	6.53%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	14.23%	14.64%
ユーロ	投資証券 11銘柄	16.17%	16.64%

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24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,358,077,559	2,987,111,644
コール・ローン	4,836,846,661	2,332,136,779
株式	161,328,876,566	117,445,828,803
派生商品評価勘定	20,112,081	2,500,000
未収入金	4,004,377,452	2,457,193,767
未収配当金	258,832,252	335,274,054
流動資産合計	173,807,122,571	125,560,045,047
資産合計	173,807,122,571	125,560,045,047
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,961,254	-
未払金	896,048,070	-
未払解約金	903,138,493	270,590,136
流動負債合計	1,825,147,817	270,590,136
負債合計	1,825,147,817	270,590,136
純資産の部		
元本等		
元本	167,442,477,024	132,763,011,558
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,539,497,730	7,473,556,647
元本等合計	171,981,974,754	125,289,454,911
純資産合計	171,981,974,754	125,289,454,911
負債純資産合計	173,807,122,571	125,560,045,047

[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24年 3月28日 至 平成24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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	(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。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	261,851,572,335円	167,442,477,024円
期中追加設定元本額	2,377,805,939円	748,815,519円
期中一部解約元本額	96,786,901,250円	35,428,280,985円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	164,338,124,196円	129,990,765,842円
グローバル資産分散オープン	3,104,352,828円	2,772,245,716円
合計	167,442,477,024円	132,763,011,558円
2. 受益権の総数	167,442,477,024口	132,763,011,558口
3. 元本の欠損	-	7,473,556,647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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年3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	9,960,194,892
合計	9,960,194,892

「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24年1月11日から平成24年3月27日まで）を指しております。

(平成24年9月27日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	4,825,516,418
合計	4,825,516,418

「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24年7月10日から平成24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24年3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	2,819,496,939	-	2,837,277,814	17,780,875
	オーストラリア・ドル	431,554,945	-	432,272,079	717,134
	イギリス・ポンド	462,027,818	-	463,641,890	1,614,072
	売建				
	アメリカ・ドル	4,209,182,763	-	4,210,802,746	1,619,983
	オーストラリア・ドル	42,512,082	-	42,796,509	284,427
	イギリス・ポンド	1,323,132,268	-	1,333,612,523	10,480,255
	ノルウェー・クローネ	41,612,073	-	42,248,697	636,624
	スウェーデン・クローナ	322,116,859	-	325,521,346	3,404,487
ユーロ	1,090,123,657	-	1,099,659,135	9,535,478	
合計	-	-	10,787,832,739	5,849,173	

区分	種類	平成24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	1,944,000,000	-	1,941,500,000	2,500,000
合計		-	-	1,941,500,000	2,500,000

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24年3月28日至平成24年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年3月27日現在	平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.0271円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,271円）」	1口当たり純資産額 0.9437円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,437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	AGRIUM INC	164,000	102.490	16,808,360.000	
	AT&T INC	282,200	38.080	10,746,176.000	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	233,300	33.660	7,852,878.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	211,050	64.450	13,602,172.500	
	CAMPBELL SOUP CO	306,000	34.860	10,667,160.000	
	CARNIVAL CORP	452,900	36.760	16,648,604.000	
	CHEVRON CORP	162,000	116.300	18,840,600.000	
	CHUBB CORP	194,500	75.520	14,688,640.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	182,700	60.090	10,978,443.000	
	DEERE & CO	111,900	81.410	9,109,779.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	249,600	65.440	16,333,824.000	
	DR HORTON INC	1,537,000	20.900	32,123,300.000	
	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	162,000	50.500	8,181,000.000	
	EATON CORP	410,800	46.280	19,011,824.000	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER	559,800	39.280	21,988,944.000	
	GENERAL MILLS INC	168,800	39.950	6,743,560.000	
	HARTFORD FINL SVCS GRP	1,182,100	18.680	22,081,628.000	
	HERSHEY CO/THE	235,300	70.670	16,628,651.000	
	HJ HEINZ CO	238,400	55.850	13,314,640.000	
	HOME DEPOT INC	391,000	59.170	23,135,470.000	
	KIMBERLY CLARK CORP	99,500	85.360	8,493,320.000	
	KLA-TENCOR CORPORATION	137,200	46.840	6,426,448.000	
	LIMITED BRANDS INC	283,200	49.270	13,953,264.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	487,400	39.010	19,013,474.000		
MERCK & CO INC	186,800	45.010	8,407,868.000		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	235,600	78.380	18,466,328.000		

	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	243,200	63.510	15,445,632.000	
	PPG INDUSTRIES INC	144,200	114.600	16,525,320.000	
	SCHLUMBERGER LTD	195,600	72.050	14,092,980.000	
	STARWOOD HOTELS&RESORTS	277,700	57.000	15,828,900.000	
	TIFFANY & CO	362,300	61.180	22,165,514.000	
	US BANCORP	524,400	33.950	17,803,380.000	
	VERIZON COMM	296,900	45.590	13,535,671.000	
	WELLS FARGO & COMPANY	482,500	34.420	16,607,650.000	
	小計（アメリカ・ドル）34銘柄	11,391,850	-	516,251,402.500 (40,097,246,432)	
オーストラリア・ドル	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	1,034,100	24.500	25,335,450.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	932,400	13.620	12,699,288.000	
	COMMONWEALTH BK	458,700	55.370	25,398,219.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	994,400	25.420	25,277,648.000	
	ORICA LTD	315,100	24.790	7,811,329.000	
	SANTOS LTD	686,200	11.210	7,692,302.000	
	TELSTRA CORP	2,079,800	3.900	8,111,220.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,036,200	24.520	25,407,624.000	
	WOOLWORTHS LIMITED	447,000	29.280	13,088,160.000	
小計（オーストラリア・ドル）9銘柄	7,983,900	-	150,821,240.000 (12,148,650,882)		
香港・ドル	CHEUNG KONG HOLDING	1,720,000	113.600	195,392,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	770,000	85.350	65,719,500.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	7,330,000	19.200	140,736,000.000	
	CNOOC LTD	4,220,000	15.560	65,663,200.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,360,000	26.800	197,248,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	847,900	117.300	99,458,670.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	2,044,500	64.300	131,461,350.000	
	小計（香港・ドル）7銘柄	24,292,400	-	895,678,720.000 (8,974,700,774)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND LTD	10,200,000	3.190	32,538,000.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,640,000	14.260	23,386,400.000	
	KEPPEL CORP LTD	2,148,000	11.390	24,465,720.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	4,850,000	5.000	24,250,000.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	2,579,000	4.040	10,419,160.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,085,000	3.200	9,872,000.000	
	小計（シンガポール・ドル）6銘柄	24,502,000	-	124,931,280.000 (7,883,163,768)	
台湾・ドル	COMPAL ELECTRONICS	14,020,000	25.850	362,417,000.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	690,000	596.000	411,240,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	5,100,000	77.400	394,740,000.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	4,974,000	79.700	396,427,800.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	6,203,131	86.400	535,950,518.400	
	小計（台湾・ドル）5銘柄	30,987,131	-	2,100,775,318.400 (5,546,046,841)	
イギリス・ポンド	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,600	32.050	5,211,330.000	
	BT GROUP PLC	3,871,800	2.309	8,939,986.200	
	CENTRICA	4,005,100	3.295	13,196,804.500	
	DIAGEO PLC	434,000	17.450	7,573,300.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	740,300	14.445	10,693,633.500	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	9,067,800	1.327	12,032,970.600	
	VODAFONE GROUP PLC	2,383,700	1.774	4,228,683.800	
	WEIR GROUP PLC/THE	605,900	17.540	10,627,486.000	
	小計（イギリス・ポンド）8銘柄	21,271,200	-	72,504,194.600 (9,110,877,093)	
スイス・フラン	NESTLE SA (REGD)	267,000	59.800	15,966,600.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	50,500	177.100	8,943,550.000	
	小計（スイス・フラン）2銘柄	317,500	-	24,910,150.000 (2,060,069,405)	
ノルウェー・クローネ	STATOIL ASA	840,900	149.200	125,462,280.000	
	TELENOR ASA	621,600	111.700	69,432,720.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	338,800	282.300	95,643,240.000	
	小計（ノルウェー・クローネ）3銘柄	1,801,300	-	290,538,240.000 (3,925,171,622)	
スウェー	ALFA LAVAL AB	702,900	120.400	84,629,160.000	

デン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	568,700	152.300	86,613,010.000	
	ELECTROLUX AB	848,300	162.700	138,018,410.000	
	SANDVIK AB	891,700	90.150	80,386,755.000	
	SKANSKA AB-B SHS	700,100	105.800	74,070,580.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	461,100	245.400	113,153,940.000	
	小計（スウェーデン・クローナ）6銘柄	4,172,800	-	576,871,855.000 (6,795,550,452)	
韓国・ ウォン	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	102,100	94,200.000	9,617,820,000.000	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	131,800	75,700.000	9,977,260,000.000	
	KT&G CORP	110,300	85,700.000	9,452,710,000.000	
	S-OIL CORPORATION	99,900	104,000.000	10,389,600,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	55,300	166,000.000	9,179,800,000.000	
	小計（韓国・ウォン）5銘柄	499,400	-	48,617,190,000.000 (3,383,756,424)	
ユーロ	ADIDAS AG	142,800	64.830	9,257,724.000	
	AKZO NOBEL NV	351,900	43.910	15,451,929.000	
	BELGACOM SA	331,300	23.645	7,833,588.500	
	BNP PARIBAS	432,700	37.335	16,154,854.500	
	CAPGEMINI SA	354,000	32.345	11,450,130.000	
	GEA GROUP AG	742,800	23.335	17,333,238.000	
	INTESA SANPAOLO SPA	9,489,400	1.221	11,586,557.400	
	LINDE AG	64,400	132.950	8,561,980.000	
	MICHELIN (CGDE)-B	236,000	60.920	14,377,120.000	
	PHILIPS ELECTRONICS	690,300	18.650	12,874,095.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	529,700	23.760	12,585,672.000	
	SANOFI	134,800	67.600	9,112,480.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC	269,500	46.875	12,632,812.500	
	TECHNIP SA	78,700	86.860	6,835,882.000	
	UNILEVER NV-CVA	331,500	27.890	9,245,535.000	
	小計（ユーロ）15銘柄	14,179,800	-	175,293,597.900 (17,520,595,110)	
合計	141,399,281	-	117,445,828,803 (117,445,828,803)		

- (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 34銘柄	32.00%	34.14%
オーストラリア・ドル	外国株式 9銘柄	9.70%	10.34%
香港・ドル	外国株式 7銘柄	7.16%	7.64%
シンガポール・ドル	外国株式 6銘柄	6.29%	6.71%
台湾・ドル	外国株式 5銘柄	4.43%	4.72%
イギリス・ポンド	外国株式 8銘柄	7.27%	7.76%
スイス・フラン	外国株式 2銘柄	1.65%	1.76%
ノルウェー・クローネ	外国株式 3銘柄	3.13%	3.34%
スウェーデン・クローナ	外国株式 6銘柄	5.42%	5.79%
韓国・ウォン	外国株式 5銘柄	2.70%	2.88%
ユーロ	外国株式 15銘柄	13.98%	14.92%

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24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	965,107,040	518,197,941
コール・ローン	203,005,393	200,015,313
国債証券	9,631,294,665	6,387,182,540
特殊債券	933,757,126	1,162,128,273
社債券	6,155,309,797	4,633,692,697
派生商品評価勘定	4,003,606	4,041,673
未収入金	69,014,250	30,310,718
未収利息	317,083,981	220,416,250
前払費用	2,173,374	3,548,241
流動資産合計	18,280,749,232	13,159,533,646
資産合計	18,280,749,232	13,159,533,646
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,518,898	1,263,150
未払金	16,580,000	-
未払解約金	2,999,999	-
流動負債合計	23,098,897	1,263,150
負債合計	23,098,897	1,263,150
純資産の部		
元本等		
元本	14,707,184,515	10,467,045,187
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,550,465,820	2,691,225,309
元本等合計	18,257,650,335	13,158,270,496
純資産合計	18,257,650,335	13,158,270,496
負債純資産合計	18,280,749,232	13,159,533,646

[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24年 3月28日 至 平成24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。</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。
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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	17,649,465,267円	14,707,184,515円
期中追加設定元本額	796,874,277円	273,928,053円
期中一部解約元本額	3,739,155,029円	4,514,067,381円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,754,766,019円	1,443,401,149円
大和住銀/T・ロウ・プライスF0Fs用新興国債券ファンド（適格機関投資家専用）	10,303,301,019円	6,934,505,340円
T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	2,649,117,477円	2,089,138,698円
合計	14,707,184,515円	10,467,045,187円
2. 受益権の総数	14,707,184,515口	10,467,045,187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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年3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	82,276,034
特殊債券	12,167,168
社債券	216,720,776
合計	311,163,978

「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11月8日から平成24年3月27日まで）を指しております。

(平成24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	329,029,898
特殊債券	25,549,380
社債券	115,215,708
合計	469,794,986

「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24年5月8日から平成24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24年3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 メキシコ・ペソ	52,639,476	-	56,643,082	4,003,606
	売建 アメリカ・ドル	60,639,476	-	64,158,374	3,518,898
合計		-	-	120,801,456	484,708

区分	種類	平成24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	168,654,920	-	167,391,770	1,263,150
	メキシコ・ペソ	110,369,615	-	111,639,203	1,269,588
	売建				
	アメリカ・ドル	110,369,615	-	108,993,680	1,375,935
	メキシコ・ペソ	168,654,920	-	167,258,770	1,396,150
合計		-	-	555,283,423	2,778,523

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

（注）時価の算定方法

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

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

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

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成24年3月28日 至 平成24年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年3月27日現在	平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.2414円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,414円）」	1口当たり純資産額 1.2571円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,571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	ARGENT 8.28 12/31/33	945,384.440	739,763.310	
	国債証券	ARGENT FL 12/31/38	5,150,000.000	1,879,750.000	
	国債証券	BRAZIL 5.625 01/07/41	300,000.000	386,250.000	
	国債証券	BRAZIL 7.125 01/20/37	3,580,000.000	5,405,979.000	
	国債証券	BRAZIL 8.875 10/14/19	2,085,000.000	3,030,234.750	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	300,000.000	408,000.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	700,000.000	796,250.000	
	国債証券	DOMREP 8.625 04/20/27	160,000.000	182,000.000	
	国債証券	DOMREP 9.04 01/23/18	475,444.950	534,875.560	
	国債証券	EGYPT 5.75 04/29/20	400,000.000	400,440.000	
	国債証券	EGYPT 6.875 04/30/40	320,000.000	316,208.000	
	国債証券	GABON 8.2 12/12/17	1,300,000.000	1,605,500.000	
	国債証券	GEORG 6.875 04/12/21	800,000.000	916,040.000	
	国債証券	GRENAD FL 09/15/25	299,000.000	161,460.000	
	国債証券	ICELND 4.875 06/16/16	2,150,000.000	2,250,555.500	
	国債証券	INDON 6.625 02/17/37	3,750,000.000	4,940,625.000	
	国債証券	IRAQ 5.8 01/15/28	2,361,000.000	2,185,105.500	
	国債証券	JAMAN 10.625 06/20/17	745,000.000	837,193.750	
	国債証券	JAMAN 8.5 02/28/36	820,000.000	820,000.000	
	国債証券	LITHUN 6.125 03/09/21	1,700,000.000	2,024,190.000	
国債証券	LITHUN 7.375 02/11/20	736,000.000	934,683.200		
国債証券	MALAYS 4.646 07/06/21	250,000.000	288,522.500		

国債証券	MEX 4.75 03/08/44	80,000.000	89,400.000	
国債証券	MEX 5.125 01/15/20	2,000,000.000	2,400,000.000	
国債証券	NGERIA 6.75 01/28/21	750,000.000	855,000.000	
国債証券	PERU 5.625 11/18/50	1,900,000.000	2,478,645.000	
国債証券	PERU 6.55 03/14/37	813,000.000	1,195,272.600	
国債証券	PHILIP 5 01/13/37	700,000.000	829,500.000	
国債証券	PHILIP 6.375 10/23/34	1,300,000.000	1,787,500.000	
国債証券	REPHUN 4.75 02/03/15	1,600,000.000	1,609,728.000	
国債証券	REPHUN 6.375 03/29/21	1,000,000.000	1,097,500.000	
国債証券	REPNAM 5.5 11/03/21	200,000.000	225,250.000	
国債証券	RUSSIA FL 03/31/30	8,557,150.000	10,713,551.800	
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	300,000.000	324,015.000	
国債証券	SERBIA FL 11/01/24	1,567,936.140	1,560,096.440	
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	548,000.000	617,870.000	
国債証券	SOAF 6.25 03/08/41	352,000.000	466,537.280	
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	310,000.000	334,025.000	
国債証券	TURKEY 5.625 03/30/21	3,000,000.000	3,397,500.000	
国債証券	TURKEY 6 01/14/41	450,000.000	515,812.500	
国債証券	TURKEY 6.75 04/03/18	1,000,000.000	1,181,250.000	
国債証券	TURKEY 7 06/05/20	1,547,000.000	1,889,969.900	
国債証券	TURKEY 7.5 11/07/19	655,000.000	820,780.500	
国債証券	TURKEY 8 02/14/34	3,650,000.000	5,110,730.000	
国債証券	UKRAIN 6.58 11/21/16	1,060,000.000	1,024,384.000	
国債証券	UKRAIN 6.75 11/14/17	665,000.000	640,129.000	
国債証券	UKRAIN 7.75 09/23/20	1,350,000.000	1,345,410.000	
国債証券	UKRAIN 7.95 02/23/21	1,000,000.000	1,005,150.000	
国債証券	VENZ 11.75 10/21/26	1,580,000.000	1,568,150.000	
国債証券	VENZ 7 03/31/38	1,200,000.000	855,000.000	
国債証券	VENZ 7.65 04/21/25	835,000.000	638,775.000	
国債証券	VENZ 9.25 09/15/27	1,147,000.000	1,015,095.000	
国債証券	VIETNM 6.75 01/29/20	880,000.000	985,600.000	
国債証券	ZAMBIN 5.375 09/20/22	200,000.000	203,000.000	
特殊債券	CAPJAM 8.5 11/16/21	2,261,904.760	2,239,285.710	
特殊債券	ESKOM 5.75 01/26/21	1,500,000.000	1,685,250.000	
特殊債券	GAZPRU 7.288 08/16/37	1,000,000.000	1,261,250.000	
特殊債券	LIBAN 10 04/25/15	330,000.000	377,064.600	
特殊債券	PEMEX 4.875 03/15/15	3,500,000.000	3,762,500.000	
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	520,000.000	566,800.000	
特殊債券	PEMEX 6 03/05/20	2,900,000.000	3,480,000.000	
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	450,000.000	556,875.000	
特殊債券	PERTIJ 6 05/03/42	771,000.000	834,607.500	
特殊債券	SIBNEF 4.375 09/19/22	200,000.000	198,750.000	
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	250,000.000	273,750.000	
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	200,000.000	220,340.000	
社債券	AKBNK 5.125 07/22/15	800,000.000	831,000.000	
社債券	ALFARU 7.5 09/26/19	200,000.000	201,750.000	
社債券	ALFARU 7.875 09/25/17	250,000.000	270,687.500	
社債券	ALRSRU 7.75 11/03/20	200,000.000	226,500.000	
社債券	AVINPU 10 10/29/15	750,000.000	640,312.500	
社債券	BANCO 3.875 02/08/22	200,000.000	214,870.000	
社債券	BANCOL 5.95 06/03/21	800,000.000	900,000.000	
社債券	BANGRA 7.375 02/02/22	200,000.000	222,000.000	
社債券	BCP 4.75 03/16/16	270,000.000	286,632.000	
社債券	BCP 5.375 09/16/20	500,000.000	542,500.000	
社債券	BEIENT 4.5 04/25/22	400,000.000	431,200.000	
社債券	BRFSBZ 5.875 06/06/22	200,000.000	218,500.000	
社債券	BRPRSA 9 PERPETUAL	500,000.000	547,500.000	
社債券	CDEL 3 07/17/22	200,000.000	202,222.000	
社債券	CDEL 6.15 10/24/36	100,000.000	129,685.000	
社債券	CEELET 10.5 06/03/16	300,000.000	64,125.000	
社債券	CEMEX 9 01/11/18	150,000.000	150,036.000	
社債券	CEMEX 9.5 12/14/16	300,000.000	309,000.000	
社債券	CENCHI 12.25 10/20/15	300,000.000	328,500.000	
社債券	CFELEC 5.75 02/14/42	300,000.000	337,500.000	

社債券	CFGSP 9.75 07/30/19	500,000.000	382,500.000	
社債券	CHINAM 5 05/04/22	200,000.000	217,252.000	
社債券	CHIRES 4.5 04/05/22	200,000.000	217,020.000	
社債券	CNOOC 3.25 09/06/22	200,000.000	199,440.000	
社債券	CNOOC 3.875 05/02/22	200,000.000	212,542.000	
社債券	COGARD 10.5 08/11/15	100,000.000	108,450.000	
社債券	COGARD 11.125 02/23/18	800,000.000	860,000.000	
社債券	COLTEL 5.375 09/27/22	200,000.000	201,750.000	
社債券	CORJRL 6.75 11/23/21	100,000.000	112,880.000	
社債券	DLLTD 10.5 04/15/18	700,000.000	768,250.000	
社債券	DLLTD 8.25 09/30/20	400,000.000	423,000.000	
社債券	DTEKUA 9.5 04/28/15	700,000.000	703,500.000	
社債券	ELEBRA 5.75 10/27/21	200,000.000	221,000.000	
社債券	EMBRA 5.15 06/15/22	200,000.000	214,500.000	
社債券	FXPOLN 7.875 04/07/16	200,000.000	191,000.000	
社債券	GARAN 6.25 04/20/21	500,000.000	539,400.000	
社債券	GEBGG 7.75 07/05/17	400,000.000	413,000.000	
社債券	GRAIL 7.75 07/11/22	425,000.000	478,125.000	
社債券	GRTBNL 7.5 05/19/16	300,000.000	330,750.000	
社債券	GSHBPR 10 PERPETUAL	1,000,000.000	1,020,000.000	
社債券	HALKBK 4.875 07/19/17	375,000.000	383,441.250	
社債券	HALYK 7.25 05/03/17	525,000.000	548,205.000	
社債券	INTERG 6.375 05/14/17	3,850,000.000	4,389,000.000	
社債券	IRSAAR 11.5 07/20/20	700,000.000	671,125.000	
社債券	ITAU 5.65 03/19/22	200,000.000	208,500.000	
社債券	KAISAG 12.875 09/18/17	500,000.000	506,765.000	
社債券	KWGPPO 12.5 08/18/17	100,000.000	107,415.000	
社債券	KWGPPO 12.75 03/30/16	650,000.000	705,867.500	
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	1,100,000.000	1,339,250.000	
社債券	LIHKK 5.25 01/26/17	200,000.000	214,950.000	
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	283,750.000	
社債券	METINR 6.5 07/21/16	400,000.000	409,160.000	
社債券	MHPSA 10.25 04/29/15	200,000.000	202,534.000	
社債券	NAELN 10.25 04/01/17	200,000.000	217,000.000	
社債券	NAFTO 9.5 09/30/14	400,000.000	405,680.000	
社債券	NATPOW 6.875 11/02/16	9,020,000.000	10,598,500.000	
社債券	NATPOW 9.625 05/15/28	1,000,000.000	1,542,500.000	
社債券	NETBZ 7.5 01/27/20	700,000.000	812,000.000	
社債券	NIHD 10 08/15/16	550,000.000	552,750.000	
社債券	NIHD 8.875 12/15/19	100,000.000	86,250.000	
社債券	ODBR 7.125 06/26/42	200,000.000	222,300.000	
社債券	PCU 7.5 07/27/35	200,000.000	248,714.000	
社債券	PDVSA 4.9 10/28/14	784,642.000	704,216.190	
社債券	PDVSA 5 10/28/15	290,237.000	243,073.480	
社債券	PDVSA 5.125 10/28/16	435,356.000	339,577.680	
社債券	PDVSA 5.25 04/12/17	5,650,000.000	4,378,750.000	
社債券	PDVSA 5.375 04/12/27	500,000.000	305,000.000	
社債券	PETBRA 5.375 01/27/21	475,000.000	532,522.500	
社債券	PLNIJ 7.75 01/20/20	1,300,000.000	1,627,145.000	
社債券	PTTGC 4.25 09/19/22	200,000.000	202,392.000	
社債券	RILIN 5.4 02/14/22	250,000.000	267,170.000	
社債券	ROADKG 9.5 09/21/15	300,000.000	309,000.000	
社債券	ROADKG 9.875 09/18/17	300,000.000	305,010.000	
社債券	SABESP 6.25 12/16/20	700,000.000	756,000.000	
社債券	SATMEX 9.5 05/15/17	500,000.000	527,500.000	
社債券	SHASHU 10.5 04/27/17	294,000.000	311,640.000	
社債券	SHASHU 8.5 05/25/16	500,000.000	506,875.000	
社債券	SLACP 4.75 04/10/17	250,000.000	263,037.500	
社債券	STABAN 8.125 12/02/19	307,000.000	347,217.000	
社債券	SUNHUN 4.5 02/14/22	200,000.000	216,690.000	
社債券	SWIPRO 4.375 06/18/22	200,000.000	214,784.000	
社債券	TENCNT 4.625 12/12/16	500,000.000	532,805.000	
社債券	TINGYI 3.875 06/20/17	430,000.000	450,102.500	
社債券	TMENRU 7.25 02/02/20	400,000.000	483,640.000	

	社債券	TNEFT 8.7 08/07/18	2,550,000.000	3,324,817.500	
	社債券	TRUBRU 7.75 01/27/18	500,000.000	511,000.000	
	社債券	VIP 7.748 02/02/21	200,000.000	212,270.000	
	社債券	XINAOG 6 05/13/21	650,000.000	725,822.500	
	社債券	YASAR 9.625 10/07/15	725,000.000	725,000.000	
	社債券	YZCOAL 5.73 05/16/22	305,000.000	317,035.300	
	小計(アメリカ・ドル) 156銘柄		140,968,055.290	154,445,354.800 (11,995,770,707)	
メキシコ・ペソ	国債証券	MBONO 10 11/20/36	21,600,000.000	31,050,216.000	
	小計(メキシコ・ペソ) 1銘柄		21,600,000.000	31,050,216.000 (187,232,803)	
合計				12,183,003,510 (12,183,003,510)	

- (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	54銘柄	91.16%	98.46%
	特殊債券	10銘柄		
	社債券	92銘柄		
メキシコ・ペソ	国債証券	1銘柄	1.42%	1.54%

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△](#) [次△](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	190,259,351	27,991,466
コール・ローン	554,376	554,955
国債証券	1,544,792,985	1,463,056,385
特殊債券	50,148,576	46,114,131
社債券	310,626,777	278,589,856
派生商品評価勘定	10,964,059	4,358,269
未収入金	11,750,160	23,516,570
未収利息	28,435,390	24,380,919
前払費用	4,245,608	4,383,759
流動資産合計	2,151,777,282	1,872,946,310
資産合計	2,151,777,282	1,872,946,310
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,845,503	4,001,183
未払金	-	31,246,796
流動負債合計	11,845,503	35,247,979
負債合計	11,845,503	35,247,979
純資産の部		
元本等		
元本	2,540,170,041	2,306,312,693
剰余金		
剰余金又は欠損金()	400,238,262	468,614,362
元本等合計	2,139,931,779	1,837,698,331
純資産合計	2,139,931,779	1,837,698,331
負債純資産合計	2,151,777,282	1,872,946,310

[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24年 3月28日 至 平成24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。</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。
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。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	3,037,728,729円	2,540,170,041円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	497,558,688円	233,857,348円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	2,540,170,041円	2,306,312,693円
合計	2,540,170,041円	2,306,312,693円
2. 受益権の総数	2,540,170,041口	2,306,312,693口
3. 元本の欠損	400,238,262円	468,614,362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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年3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	48,149,907
特殊債券	1,299,798
社債券	4,850,933
合計	54,300,638

「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24年3月27日まで）を指しております。

(平成24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	25,477,878
特殊債券	843,628
社債券	6,440,648
合計	32,762,154

「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24年3月28日から平成24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24年3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	34,958,687	-	36,037,313	1,078,626
	スイス・フラン	18,408,312	-	19,790,730	1,382,418
	デンマーク・クローネ	33,742,062	-	36,181,202	2,439,140
	ノルウェー・クローネ	24,050,282	-	26,031,551	1,981,269
	スウェーデン・クローナ	3,820,958	-	4,066,345	245,387
	ユーロ	102,873,922	-	106,711,141	3,837,219
	売建				
	イギリス・ポンド	47,550,812	-	48,997,513	1,446,701
	スイス・フラン	3,786,331	-	3,870,253	83,922
	ノルウェー・クローネ	1,623,638	-	1,625,869	2,231
	スウェーデン・クローナ	1,733,390	-	1,760,363	26,973
	ポーランド・ズロチ	48,179,751	-	51,508,058	3,328,307
	ユーロ	114,980,301	-	121,937,670	6,957,369
合計	-	-	458,518,008	881,444	

区分	種類	平成24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	12,132,199	-	12,150,527	18,328
	スイス・フラン	14,072,468	-	14,450,714	378,246
	デンマーク・クローネ	31,107,266	-	32,086,874	979,608
	ノルウェー・クローネ	36,098,981	-	36,372,680	273,699
	ポーランド・ズロチ	12,787,354	-	12,864,871	77,517
	ユーロ	106,611,782	-	108,668,503	2,056,721
	売建				
	イギリス・ポンド	48,612,684	-	49,433,023	820,339
	ノルウェー・クローネ	8,361,524	-	8,330,601	30,923
	スウェーデン・クローナ	620,994	-	620,994	0
	ポーランド・ズロチ	49,016,580	-	49,233,936	217,356
	ユーロ	106,198,268	-	108,618,529	2,420,261
	合計	-	-	432,831,252	357,086

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24年3月28日 至 平成24年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年3月27日現在	平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.8424円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,424円）」	1口当たり純資産額 0.7968円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,968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 09/07/21	137,000.000	163,810.900	
	国債証券	UKT 4.25 09/07/39	184,000.000	228,252.000	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/46	592,000.000	737,040.000	
	国債証券	UKT 4.5 03/07/13	540,000.000	550,206.000	
	国債証券	UKT 4.5 12/07/42	41,000.000	52,976.100	
	国債証券	UKT 4.75 09/07/15	375,000.000	424,425.000	
	国債証券	UKT 5 03/07/18	184,000.000	225,694.400	
	社債券	MANUTD 8.75 02/01/17	50,000.000	53,060.000	
	社債券	VMED 8.875 10/15/19	50,000.000	56,120.000	
		小計（イギリス・ポンド）9銘柄		2,153,000.000	2,491,584.400 (313,092,496)
ノルウェー・クローネ	国債証券	NGB 4.25 05/19/17	541,000.000	607,759.400	
		小計（ノルウェー・クローネ）1銘柄	541,000.000	607,759.400 (8,210,829)	
スウェー	国債証券	SGB 5 12/01/20	1,455,000.000	1,862,618.250	

デン・ク ローナ	小計(スウェーデン・クローナ) 1 銘柄		1,455,000.000	1,862,618.250 (21,941,643)
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 5 10/24/13	63,000.000	63,472.500
	国債証券	POLGB 5.25 10/25/17	393,000.000	410,130.870
	国債証券	POLGB 5.5 04/25/15	524,000.000	540,694.640
	国債証券	POLGB 5.5 10/25/19	823,000.000	868,923.400
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	627,000.000	672,457.500
	小計(ポーランド・ズロチ) 5 銘柄		2,430,000.000	2,555,678.910 (61,642,975)
ユーロ	国債証券	BGB 2.75 03/28/16	120,000.000	128,248.800
	国債証券	BGB 3.25 09/28/16	58,000.000	63,266.980
	国債証券	BGB 4 03/28/18	119,000.000	135,223.270
	国債証券	BGB 4.25 09/28/21	213,000.000	245,727.450
	国債証券	BGB 5 03/28/35	103,000.000	130,236.290
	国債証券	BRAZIL 11 06/26/17	64,000.000	90,166.400
	国債証券	BTPS 3.75 03/01/21	735,000.000	683,035.500
	国債証券	BTPS 4 02/01/17	227,000.000	229,224.600
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	159,000.000	126,071.100
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	163,000.000	168,201.330
	国債証券	BTPS 4.75 06/01/17	86,000.000	88,451.000
	国債証券	BTPS 4.75 09/15/16	99,000.000	103,039.200
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	637,000.000	567,821.800
	国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	545,000.000	573,885.000
	国債証券	CZECH 3.875 05/24/22	82,000.000	89,708.000
	国債証券	DBR 2.5 01/04/21	665,000.000	731,633.000
	国債証券	DBR 3.25 07/04/15	137,000.000	148,823.100
	国債証券	DBR 3.75 01/04/15	530,000.000	574,281.500
	国債証券	DBR 4 01/04/37	352,000.000	462,880.000
	国債証券	DBR 4.25 07/04/18	382,000.000	457,922.500
	国債証券	FRTR 3.75 04/25/21	131,000.000	149,284.980
	国債証券	FRTR 4 04/25/13	635,000.000	648,716.000
	国債証券	FRTR 4.75 04/25/35	314,000.000	398,246.200
	国債証券	FRTR 5 10/25/16	115,000.000	134,868.550
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	511,000.000	722,283.170
	国債証券	FRTR OAT 6 10/25/25	6,000.000	8,246.280
	国債証券	IRISH 5 04/18/13	50,000.000	50,912.500
	国債証券	IRISH 5.5 10/18/17	172,000.000	184,848.400
	国債証券	NETHER 1.75 01/15/13	194,000.000	194,921.500
	国債証券	NETHER 4.5 07/15/17	31,000.000	36,521.100
	国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	153,000.000	216,036.000
	国債証券	OBL 1.25 10/14/16	180,000.000	186,642.000
	国債証券	RAGB 3.4 11/22/22	95,000.000	106,749.600
	国債証券	RAGB 4.65 01/15/18	64,000.000	76,038.400
	国債証券	RAGB 4.85 03/15/26	70,000.000	89,383.700
	国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	223,000.000	325,885.510
	国債証券	SPGB 3.8 01/31/17	136,000.000	130,519.200
	国債証券	SPGB 4 07/30/15	70,000.000	70,229.600
	国債証券	SPGB 4.1 07/30/18	48,000.000	45,513.600
	国債証券	SPGB 4.25 10/31/16	26,000.000	25,547.340
	国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	431,000.000	439,206.240
	国債証券	SPGB 4.6 07/30/19	430,000.000	409,274.000
国債証券	SPGB 5.75 07/30/32	304,000.000	276,521.440	
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	150,000.000	173,685.000	
特殊債券	PEMEX 5.5 01/09/17	50,000.000	56,775.000	
特殊債券	SEK 3.625 05/27/14	220,000.000	230,912.000	
社債券	ABIBB 2 12/16/19	6,000.000	6,011.340	
社債券	ABNANV 4.125 03/28/22	20,000.000	21,993.800	
社債券	ALVGR FL 01/13/25	20,000.000	21,463.000	
社債券	BAC 7 06/15/16	50,000.000	58,510.000	
社債券	BNP 2.5 08/23/19	7,000.000	7,052.710	
社債券	BNP 2.875 11/27/17	20,000.000	21,056.000	
社債券	C 5 08/02/19	15,000.000	16,839.000	
社債券	C FL 02/10/19	10,000.000	9,146.500	
社債券	CIRSA 8.75 05/15/18	50,000.000	47,377.500	
社債券	COFP 4.875 04/10/14	50,000.000	52,876.000	

社債券	CONGR 7.5 09/15/17	50,000.000	53,777.000	
社債券	CS 6.125 08/05/13	50,000.000	52,365.000	
社債券	CS 6.375 06/07/13	10,000.000	10,329.000	
社債券	DANBNK 4.75 06/04/14	50,000.000	52,855.000	
社債券	DNBOR 3.875 06/29/20	50,000.000	56,045.500	
社債券	DPW 1.875 06/27/17	10,000.000	10,183.500	
社債券	DT 6 01/20/17	15,000.000	17,864.250	
社債券	EIBKOR 5.75 05/22/13	50,000.000	51,625.000	
社債券	EOANGR 5.5 01/19/16	20,000.000	22,899.000	
社債券	EUTELS 4.125 03/27/17	50,000.000	54,869.000	
社債券	GE 4.625 02/22/27	50,000.000	58,090.500	
社債券	GMAC 7.5 04/21/15	50,000.000	54,027.500	
社債券	GS 5.125 10/16/14	50,000.000	53,430.000	
社債券	GSZFP 5.625 01/18/16	20,000.000	22,935.000	
社債券	HEIANA 3.5 03/19/24	8,000.000	8,504.800	
社債券	HEIGR 7.5 04/03/20	50,000.000	55,809.500	
社債券	HSBC 4.875 05/30/17	50,000.000	56,280.500	
社債券	IMTLN 8.375 02/17/16	50,000.000	61,095.000	
社債券	ISPIM 4.125 04/14/20	50,000.000	47,838.000	
社債券	JPM FL 11/12/19	50,000.000	48,930.000	
社債券	LGEN FL 06/08/25	50,000.000	48,210.000	
社債券	LGFP 5.5 12/16/19	50,000.000	53,470.000	
社債券	LLOYDS 6.5 03/24/20	50,000.000	50,332.500	
社債券	MANAG 7.25 05/20/16	10,000.000	12,127.500	
社債券	MDPAC 7.25 11/15/17	50,000.000	53,400.000	
社債券	MET 4.625 05/16/17	50,000.000	56,565.000	
社債券	MRKGR 4.875 09/27/13	8,000.000	8,352.000	
社債券	MS 5 05/02/19	50,000.000	53,005.000	
社債券	NAB 3.75 01/06/17	15,000.000	16,445.700	
社債券	NGGLN 5 07/02/18	40,000.000	47,346.000	
社債券	NWIDE 3.75 01/20/15	50,000.000	52,721.000	
社債券	NWORLD 7.875 05/01/18	50,000.000	49,312.500	
社債券	OI 6.75 09/15/20	50,000.000	55,945.000	
社債券	OXEACY 9.625 07/15/17	42,868.750	47,691.480	
社債券	PEMEX 6.375 08/05/16	75,000.000	87,232.500	
社債券	P RTP 8.625 04/03/14	10,000.000	11,152.500	
社債券	RABOBK 4 01/11/22	30,000.000	33,298.500	
社債券	RBS 5.375 09/30/19	50,000.000	58,272.500	
社債券	RBS 5.75 05/21/14	50,000.000	53,685.000	
社債券	RENAUL 4.25 04/27/17	10,000.000	10,168.500	
社債券	RENAUL 4.375 01/27/15	10,000.000	10,388.500	
社債券	REPSM 4.625 10/08/14	26,000.000	27,050.400	
社債券	RIFP 7 01/15/15	50,000.000	56,220.000	
社債券	SOCGEN 3.125 09/21/17	50,000.000	52,803.500	
社債券	TELEFO 3.661 09/18/17	50,000.000	47,959.000	
社債券	TITIM 8.25 03/21/16	50,000.000	57,912.500	
社債券	TVNPW 10.75 11/15/17	50,000.000	54,000.000	
社債券	UBS 6.25 09/03/13	15,000.000	15,791.250	
社債券	UNITY 9.625 12/01/19	50,000.000	55,640.000	
社債券	UPCB 7.625 01/15/20	50,000.000	54,125.000	
社債券	VIEFP 5.125 05/24/22	11,000.000	12,865.050	
社債券	VIEFP 5.375 05/28/18	1,000.000	1,164.700	
社債券	VOTORA 5.25 04/28/17	50,000.000	54,000.000	
社債券	VW 3.25 01/21/19	20,000.000	21,488.000	
社債券	WINDIM 11.75 07/15/17	50,000.000	45,635.500	
社債券	ZIGGO 8 05/15/18	50,000.000	54,812.500	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	57,360.000	
	小計（ユーロ）113銘柄	12,739,868.750	13,835,642.110 (1,382,872,429)	
	合計		1,787,760,372 (1,787,760,372)	

(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	7 銘柄	17.04%
	社債券	2 銘柄	
ノルウェー・クローネ	国債証券	1 銘柄	0.45%
スウェーデン・クローナ	国債証券	1 銘柄	1.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5 銘柄	3.35%
ユーロ	国債証券	43銘柄	75.25%
	特殊債券	3 銘柄	
	社債券	67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)で記載しており、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24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	65,605	134,505
社債券	1,123,464,116	926,634,168
未収利息	5,725,167	10,101,482
流動資産合計	1,129,254,888	936,870,155
資産合計	1,129,254,888	936,870,155
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	1,764,774,532	1,544,987,942
剰余金		
剰余金又は欠損金()	635,519,644	608,117,787
元本等合計	1,129,254,888	936,870,155
純資産合計	1,129,254,888	936,870,155
負債純資産合計	1,129,254,888	936,870,155

[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24年 3月28日 至 平成24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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	1,773,804,286円	1,764,774,532円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	9,029,754円	219,786,590円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,764,774,532円	1,544,987,942円
合計	1,764,774,532円	1,544,987,942円
2. 受益権の総数	1,764,774,532口	1,544,987,942口
3. 元本の欠損		
	635,519,644円	608,117,787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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年3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	12,265,884
合計	12,265,884

「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24年3月27日まで）を指しております。

(平成24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	4,660,200
合計	4,660,200

「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24年3月28日から平成24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24年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成24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24年3月28日 至 平成24年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年3月27日現在	平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.6399円 「1口 = 1円(10,000口 = 6,399円)」	1口当たり純資産額 0.6064円 「1口 = 1円(10,000口 = 6,064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/GS 10/19/12	12,000,000.000	11,930,400.000	
	小計(アメリカ・ドル) 1銘柄		12,000,000.000	11,930,400.000 (926,634,168)	
合計				926,634,168 (926,634,168)	

(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	98.90%	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24年3月27日現在 金額(円)	平成24年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	15,309,953	73,968,306
コール・ローン	12,569,946	1,082,711
国債証券	1,370,929,619	412,268,195
特殊債券	768,900,599	1,256,520,100
未収利息	30,967,944	25,135,992
前払費用	2,495,397	136,103
流動資産合計	2,201,173,458	1,769,111,407
資産合計	2,201,173,458	1,769,111,407
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	172,132
流動負債合計	-	172,132
負債合計	-	172,132
純資産の部		
元本等		
元本	2,160,504,231	1,786,690,616
剰余金		
剰余金又は欠損金()	40,669,227	17,751,341
元本等合計	2,201,173,458	1,768,939,275
純資産合計	2,201,173,458	1,768,939,275
負債純資産合計	2,201,173,458	1,769,111,407

[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24年 3月28日 至 平成24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。</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。
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。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年 3月27日現在	平成24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	2,375,547,075円	2,160,504,231円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	215,042,844円	373,813,615円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	2,160,504,231円	1,786,690,616円
合計	2,160,504,231円	1,786,690,616円
2. 受益権の総数	2,160,504,231口	1,786,690,616口
3. 元本の欠損	-	17,751,341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24年 3月28日 至 平成24年 9月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成24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
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年3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	19,215,531
特殊債券	13,251,932
合計	32,467,463

「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24年3月27日まで）を指しております。

(平成24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	3,569,543
特殊債券	17,206,391
合計	20,775,934

「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24年3月28日から平成24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24年3月27日現在)

該当事項はありません。

(通貨関連)

区分	種類	平成24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 香港・ドル	29,159,004	-	29,119,496	39,508
	売建 ニュージーランド・ドル	29,159,004	-	29,291,628	132,624
	合計	-	-	58,411,124	172,132

評価損益は、「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24年3月28日 至 平成24年9月27日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年3月27日現在	平成24年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.0188円 「1口 = 1円（10,000口 = 10,188円）」	1口当たり純資産額 0.9901円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,901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	7,357,000.000	7,578,666.410	
	特殊債券	EIB 6.25 04/15/15	400,000.000	425,060.000	
	小計（オーストラリア・ドル）2銘柄		7,757,000.000	8,003,726.410 (644,700,162)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 1.69 09/29/14	3,700,000.000	3,807,707.000	
	小計（香港・ドル）1銘柄		3,700,000.000	3,807,707.000 (38,153,224)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	600,000.000	664,428.000	
	小計（シンガポール・ドル）1銘柄		600,000.000	664,428.000 (41,925,407)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	2,902,000.000	3,319,452.700	
	特殊債券	IADB 6.25 12/15/17	5,500,000.000	6,231,280.000	
	小計（ニュージーランド・ドル）2銘柄		8,402,000.000	9,550,732.700 (611,819,937)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 3.5 06/10/14	3,000,000,000.000	3,035,550,000.000	
	国債証券	NDFB 4.75 03/10/14	800,000,000.000	822,552,000.000	
	小計（韓国・ウォン）2銘柄		3,800,000,000.000	3,858,102,000.000 (268,523,899)	
マレーシア・リングgit	国債証券	MGS 3.741 02/27/15	2,490,000.000	2,524,411.800	
	小計（マレーシア・リングgit）1銘柄		2,490,000.000	2,524,411.800 (63,665,666)	
合計				1,668,788,295 (1,668,788,295)	

- （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 2銘柄	36.44%	38.63%
香港・ドル	国債証券 1銘柄	2.16%	2.29%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	2.37%	2.51%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 2銘柄	34.58%	36.66%
韓国・ウォン	国債証券 2銘柄	15.18%	16.09%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	3.60%	3.82%

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）

T.Rowe Price Funds SICAV（以下、同ファンド）は、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・エンド型の変動資本金会社型投資信託であり、「2010年12月17日の集団投資事業に関する法律のパート Ⅰ」に従って認可されています。

同ファンドの2012年6月30日現在の財務諸表は、ルクセンブルグ大公国において一般に認められる会計基準に準拠して作成されています。

同ファンドの「貸借対照表」、「損益および純資産変動計算書」、「投資証券口数変動計算書」、「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、2012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

2012年6月30日現在（未監査）

	グローバル・エマージ ング・マーケッツ・エ クイティ・ファンド 米ドル	グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド 米ドル	USアグリゲート・ ボンド・ファンド 米ドル
資 産			
有価証券、取得原価	803,461,014	1,823,993,679	117,792,065
評価（損）益	38,596,651	40,326,242	5,541,900
有価証券、時価	842,057,665	1,864,319,921	123,333,965
現金預金	20,915,391	106,390,965	1,283,539
未収配当金および利息	3,129,495	33,394,137	893,910
有価証券売却未収金	9,139,657	4,528,664	503,094
発行未収金	186,560	3,432,711	-
為替予約取引に係る評価益	-	3,180,830	261,544
スワップ契約、時価	-	1,139,140	-
委託証拠金	-	-	107,139
先物取引に係る評価益	-	-	-
その他の資産	61,183	34,240	3,777
資産合計	875,489,951	2,016,420,608	126,386,968
負 債			
有価証券購入未払金	1,140,358	18,179,540	1,146,407
買戻未払金	9,008,948	11,361,530	263,903
為替予約取引に係る評価損	-	18,116,301	513
運用報酬	743,985	1,259,606	7,712
スワップ契約、時価	-	1,842,251	-
当座借越	-	1,344,340	-
委託証拠金	-	-	-
オプション時価	-	48,431	-
先物取引に係る評価損	-	-	18,837
その他の負債	205,743	455,805	39,266
負債合計	11,099,034	52,607,804	1,476,638
純資産	864,390,917	1,963,812,804	124,910,330

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

2012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	119,118,928	229,411,602	-
発行済投資証券口数	5,675,925	10,765,353	-
一口当たり純資産額	20.99	21.31	-
クラスAd			
純資産	21,300,786	111,024,980	-
発行済投資証券口数	2,519,627	9,096,925	-
一口当たり純資産額	8.45	12.20	-
一口当たり公表配当金	0.0306	0.3897	-
クラスAh (EUR)			
純資産(基準通貨)	-	676,116,893	-
純資産(クラス通貨)	-	EUR 532,774,040	-
発行済投資証券口数	-	29,419,025	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	EUR 18.11	-
クラスAh (NOK)			
純資産(基準通貨)	-	112,491,876	-
純資産(クラス通貨)	-	NOK 668,702,331	-
発行済投資証券口数	-	4,181,658	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	NOK 159.91	-
クラスAh (SEK)			
純資産(基準通貨)	-	7,155,891	-
純資産(クラス通貨)	-	SEK 49,392,824	-
発行済投資証券口数	-	490,282	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	SEK 100.74	-
クラスI			
純資産	712,626,081	703,027,591	2,774,534
発行済投資証券口数	27,813,251	31,637,677	262,492
一口当たり純資産額	25.62	22.22	10.57
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)	-	-	16,589,293
純資産(クラス通貨)	-	-	EUR 13,072,214
発行済投資証券口数	-	-	1,208,038
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	-	EUR 10.82
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	11,345,122	106,979,102	105,546,503
発行済投資証券口数	1,726,274	10,993,288	9,583,437
一口当たり純資産額	6.57	9.73	11.01
一口当たり公表配当金	0.0575	0.3703	0.2072
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	-	-	-
クラスZ			
純資産	-	17,604,869	-
発行済投資証券口数	-	707,729	-
一口当たり純資産額	-	24.88	-

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

2012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）	502	74,242,730	2,671,723
受取配当金（源泉税控除後）	9,803,322	1,522,507	-
スワップに係る利息	-	1,695,292	-
収益合計	9,803,824	77,460,529	2,671,723
費用			
運用報酬	4,962,488	8,052,012	61,528
管理会社報酬	95,633	228,690	29,419
カスタディーフィー	159,559	272,226	19,182
年次税	72,164	310,652	6,605
専門家報酬	81,541	164,954	17,585
スワップに係る利息	-	-	-
その他の費用	35,507	8,315	-
費用合計	5,406,892	9,036,849	134,319
運用会社により免除または負担された費用控除前の純（損）益	4,396,932	68,423,680	2,537,404
運用会社により免除または負担された費用	3,642	80,218	23,250
純（損）益	4,400,574	68,503,898	2,560,654
以下に係る評価（損）益：			
スイング・プライシング	147,817	575,322	6,238
有価証券（外国税控除後）	1,926,896	(2,432,308)	1,702,812
為替予約取引	(138,899)	(16,388,515)	(709,515)
先物取引	-	4,567	(147,868)
オプション	-	105,672	-
スワップ	-	(2,749,117)	-
外貨取引	(110,647)	12,706,796	243,150
評価（損）益	1,825,167	(8,177,583)	1,094,817
以下に係る評価（損）益の変動：			
有価証券（外国税控除後）	25,017,101	55,650,786	30,733
為替予約取引	-	6,885,024	459,058
先物取引	-	-	(18,837)
オプション	-	(21,400)	-
スワップ	-	7,519,543	-
外貨建のその他の資産および負債	79,606	2,818,111	17,907
評価（損）益の変動	25,096,707	72,852,064	488,861
運用による純資産の増（減）額	31,322,448	133,178,379	4,144,332

分配金：			
分配による純資産の減少額	(175,737)	(7,921,719)	(2,157,158)
資本取引：			
投資証券発行受領額	123,964,786	473,308,342	8,627,727
投資証券買戻支払額	(112,288,239)	(576,967,509)	(36,156,597)
資本取引による純資産の増（減）額	11,676,547	(103,659,167)	(27,528,870)
純資産の増（減）額 合計	42,823,258	21,597,493	(25,541,696)
期首現在純資産	821,567,659	1,961,793,467	150,880,743
換算調整	-	(19,578,156)	(428,717)
期末現在純資産	864,390,917	1,963,812,804	124,910,330

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

2012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
クラスA			
期首現在発行済投資証券	5,922,524	10,182,061	-
発行投資証券口数	1,874,825	4,619,229	-
買戻投資証券口数	(2,121,424)	(4,035,937)	-
期末現在発行済投資証券	5,675,925	10,765,353	-
クラスAd			
期首現在発行済投資証券	2,708,832	8,384,016	-
発行投資証券口数	2,258,290	2,647,441	-
買戻投資証券口数	(2,447,495)	(1,934,532)	-
期末現在発行済投資証券	2,519,627	9,096,925	-
クラスAh（EUR）			
期首現在発行済投資証券	-	25,658,075	-
発行投資証券口数	-	9,004,233	-
買戻投資証券口数	-	(5,243,283)	-
期末現在発行済投資証券	-	29,419,025	-
クラスAh（NOK）			
期首現在発行済投資証券	-	3,041,741	-
発行投資証券口数	-	1,572,890	-
買戻投資証券口数	-	(432,973)	-
期末現在発行済投資証券	-	4,181,658	-
クラスAh（SEK）			
期首現在発行済投資証券	-	-	-
発行投資証券口数	-	490,282	-
買戻投資証券口数	-	-	-
期末現在発行済投資証券	-	* 490,282	-
クラスI			
期首現在発行済投資証券	27,019,564	33,919,527	305,144
発行投資証券口数	2,314,690	3,655,084	108,851
買戻投資証券口数	(1,521,003)	(5,936,934)	(151,503)
期末現在発行済投資証券	27,813,251	31,637,677	262,492

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	-	-	1,805,534
発行投資証券口数	-	-	385,270
買戻投資証券口数	-	-	(982,766)
期末現在発行済投資証券	-	-	1,208,038

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	2,504,309	12,996,852	11,293,945
発行投資証券口数	15,081	447,631	196,950
買戻投資証券口数	(343,116)	(2,451,195)	(1,907,458)
期末現在発行済投資証券	1,726,274	10,993,288	9,583,437

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	-	-	-
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Z

期首現在発行済投資証券	-	7,961,458	-
発行投資証券口数	-	112,787	-
買戻投資証券口数	-	(7,366,516)	-
期末現在発行済投資証券	-	707,729	-

*クラスは2012年6月26日に運用を開始された。
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

(特段の注記のない限り金額は米ドル)	グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド		グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド		USアグリゲート・ボンド・ファンド
	米ドル	米ドル	米ドル	米ドル	米ドル
以下の時点のクラスA証券一口当たり純資産額：					
2012年 6月30日	20.99	21.31			-
2011年12月31日	20.29	20.05			-
2010年12月31日	25.21	19.51			-

以下の時点のクラスAd証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	8.45	12.20	-
2011年12月31日	8.21	11.85	-
2010年12月31日	-	12.32	-
以下の時点のクラスAh（EUR）証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	- EUR 18.11		-
2011年12月31日	- EUR 17.03		-
2010年12月31日	- EUR 16.52		-
以下の時点のクラスAh（NOK）証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	- NOK 159.91		-
2011年12月31日	- NOK 149.57		-
2010年12月31日	- NOK 143.61		-
以下の時点のクラスAh（SEK）証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	-	SEK 100.74	-
2011年12月31日	-	-	-
2010年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスI証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	25.62	22.22	10.57
2011年12月31日	24.65	20.84	10.30
2010年12月31日	30.34	20.16	-
以下の時点のクラスId証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	- -		-
2011年12月31日	- -		-
2010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：			
2012年 6月30日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-
2010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：			
2012年 6月30日	-	-	EUR 10.82
2011年12月31日	-	-	EUR 10.55
2010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：			
2012年 6月30日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-
2010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：			
2012年 6月30日	6.57	9.73	11.01
2011年12月31日	6.35	9.45	10.89
2010年12月31日	7.88	9.81	10.66
以下の時点のクラスS証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	- -		-
2011年12月31日	- -		-
2010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：			
2012年 6月30日	- -		-
2011年12月31日	- -		-
2010年12月31日	- 13.50		-
以下の時点のクラスZ証券一口当たり純資産額：			
2012年 6月30日	- 24.88		-
2011年12月31日	- 23.25		-
2010年12月31日	44.25	22.34	-
以下の時点の純資産：			
2012年 6月30日	864,390,917	1,963,812,804	124,910,330
2011年12月31日	821,567,659	1,961,793,467	150,880,743
2010年12月31日	843,856,378	1,644,020,195	186,437,681

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

2012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	259,300	2,508,920	0.29
BM&F BOVESPA	ブラジル・レアル	1,299,262	6,597,852	0.76
BR Malls Participacoes	ブラジル・レアル	553,500	6,307,067	0.73
BRF - Brasil Foods	ブラジル・レアル	199,012	2,996,346	0.35
Lojas Renner	ブラジル・レアル	567,200	15,834,784	1.83
Natura Cosméticos	ブラジル・レアル	195,900	4,561,570	0.53
PDG Realty Empreendimentos e Participacoes	ブラジル・レアル	1,205,200	2,095,792	0.24
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	522,800	9,812,956	1.14
Raia Drogasil	ブラジル・レアル	403,000	4,043,078	0.47
Usinas Siderurgicas de Minas Gerais	ブラジル・レアル	348,600	1,333,296	0.15
Vale ADR	アメリカ・ドル	466,900	9,267,965	1.07
Weg	ブラジル・レアル	251,600	2,429,430	0.28
ブラジル 計			67,789,056	7.84
チリ				
Banco Santander (Chile) ADR	アメリカ・ドル	61,770	4,786,557	0.56
SACI Falabella	チリ・ペソ	499,263	4,612,940	0.53
Sociedad Quimica y Minera de Chile ADR	アメリカ・ドル	124,600	6,936,482	0.80
チリ 計			16,335,979	1.89
中国				
Baidu ADR	アメリカ・ドル	100,500	11,555,490	1.34
Bank of China H-shares	香港・ドル	31,596,100	11,975,549	1.39
China National Building Material H-shares	香港・ドル	7,168,000	7,660,677	0.89
China Shanshui Cement Group	香港・ドル	9,767,000	6,610,512	0.76
China Vanke A-shares ¹	中国・人民元	1,982,583	2,780,065	0.32
China Vanke Class B	香港・ドル	2,442,648	3,199,405	0.37
Industrial & Commercial Bank of China H-shares	香港・ドル	19,597,445	10,838,554	1.25
Parkson Retail Group	香港・ドル	5,854,500	5,177,600	0.60
Ping An Insurance Group of China A-shares ¹	中国・人民元	550,298	3,961,321	0.46
Ping An Insurance Group of China H-shares	香港・ドル	1,181,800	9,400,344	1.09
Shandong Weigao Group Medical Polymer H-shares	香港・ドル	3,588,000	3,950,253	0.46
Shanghai Pharmaceuticals Holding H-shares	香港・ドル	1,547,800	1,929,548	0.22
Shenzhen Development Bank A-shares ¹	中国・人民元	1,152,244	2,749,094	0.32
Shimao Property Holdings	香港・ドル	2,386,000	3,641,973	0.42
Sina	アメリカ・ドル	110,800	5,740,548	0.66
Tencent Holdings	香港・ドル	458,400	13,355,731	1.54
Want Want China Holdings	香港・ドル	6,111,000	7,484,288	0.87
Wumart Stores H-shares	香港・ドル	2,197,000	4,441,102	0.51
中国 計			116,452,054	13.47
香港				
AIA Group	香港・ドル	2,789,200	9,528,842	1.10
Beijing Enterprises Holdings	香港・ドル	2,167,500	12,993,515	1.50
Belle International Holdings	香港・ドル	2,667,000	4,510,986	0.52
C C Land	香港・ドル	586,250	120,170	0.01
C C Land Holdings	香港・ドル	11,725,000	2,796,399	0.32
China Taiping Insurance Holdings	香港・ドル	3,988,600	6,448,113	0.76
China Unicom	香港・ドル	6,212,000	7,816,204	0.90
CNOOC	香港・ドル	9,391,000	18,644,347	2.16
GOME Electrical Appliances Holdings	香港・ドル	24,402,900	3,208,900	0.37

Kingboard Chemical Holdings	香港・ドル	1,832,500	3,524,743	0.41
Kingboard Chemical Holdings warrants/31/10/2012	香港・ドル	95,600	123	0.00
Li & Fung	香港・ドル	4,580,000	8,750,408	1.01
Lifestyle International Holdings	香港・ドル	1,245,500	2,716,806	0.32
香港 計			81,059,556	9.38
インド				
Adani Ports and Special Economic Zone	インド・ルピー	2,451,747	5,319,766	0.62
Adani Power	インド・ルピー	1,734,061	1,551,291	0.18
Container of India	インド・ルピー	270,268	4,452,754	0.51
Housing Development Finance	インド・ルピー	973,920	11,393,652	1.32
ICICI Bank	インド・ルピー	585,128	9,426,393	1.09
Infosys	インド・ルピー	217,560	9,777,049	1.13
Jaiprakash Associates	インド・ルピー	3,740,096	4,923,382	0.57
Reliance Industries	インド・ルピー	376,838	4,979,850	0.58
Titan Industries	インド・ルピー	520,752	2,083,568	0.24
Zee Entertainment Enterprises	インド・ルピー	1,281,011	3,368,002	0.39
インド 計			57,275,707	6.63
インドネシア				
Astra International	インドネシア・ルピア	13,310,000	9,707,054	1.12
Bank Mandiri	インドネシア・ルピア	10,617,983	8,139,417	0.94
インドネシア 計			17,846,471	2.06
ルクセンブルグ				
MHP GDR	アメリカ・ドル	221,023	2,541,764	0.29
Tenaris ADR	アメリカ・ドル	258,700	9,046,739	1.05
ルクセンブルグ 計			11,588,503	1.34
マレーシア				
CIMB Group Holdings	マレーシア・リンギット	5,056,508	12,054,091	1.40
マレーシア 計			12,054,091	1.40
メキシコ				
America Movil (Series L) ADR	アメリカ・ドル	484,420	12,623,985	1.46
Fresnillo	イギリス・ポンド	264,010	6,033,240	0.70
Grupo Financiero Banorte Class O	メキシコ・ペソ	1,529,500	7,877,679	0.91
Wal-Mart de Mexico (Series V)	メキシコ・ペソ	6,687,540	17,807,339	2.06
メキシコ 計			44,342,243	5.13
オマーン				
Bank Muscat	オマーン・リアル	1,161,271	1,788,659	0.21
Bank Muscat GDR	アメリカ・ドル	528,230	3,253,897	0.37
オマーン 計			5,042,556	0.58
フィリピン				
Metro Pacific Investments	フィリピン・ペソ	63,973,000	6,331,255	0.73
SM Investments	フィリピン・ペソ	399,010	6,912,954	0.80
Universal Robina	フィリピン・ペソ	2,809,000	4,196,667	0.49
フィリピン 計			17,440,876	2.02
カタール				
Qatar National Bank	カタール・リヤル	278,831	10,053,689	1.16
カタール 計			10,053,689	1.16
ロシア				
CTC Media	アメリカ・ドル	210,900	1,699,854	0.20
Magnit GDR	アメリカ・ドル	428,559	12,891,055	1.49
NovaTek GDR	アメリカ・ドル	76,971	8,158,926	0.94

Sberbank of Russian Federation ADR	アメリカ・ドル	1,562,629	16,798,262	1.94
Uralkali GDR	アメリカ・ドル	174,230	6,669,524	0.77
X5 Retail Group GDR	アメリカ・ドル	325,253	7,399,506	0.86
ロシア 計			53,617,127	6.20
南アフリカ				
AngloGold Ashanti	南アフリカ・ランド	252,817	8,624,557	1.00
Shoprite Holdings	南アフリカ・ランド	644,358	11,870,810	1.37
Truworths International	南アフリカ・ランド	647,607	7,088,559	0.82
Woolworths Holdings	南アフリカ・ランド	1,361,952	8,366,384	0.97
南アフリカ 計			35,950,310	4.16
韓国				
Amorepacific	韓国・ウォン	5,550	5,155,804	0.60
Hyundai Glovis	韓国・ウォン	19,391	3,682,318	0.43
Hyundai Mobis	韓国・ウォン	50,680	12,146,209	1.41
Hyundai Motor	韓国・ウォン	50,492	10,249,609	1.18
LG	韓国・ウォン	56,213	2,699,363	0.31
LG Household & Health Care	韓国・ウォン	38,909	20,960,277	2.42
NHN	韓国・ウォン	16,973	3,704,763	0.43
Samsung Electronics	韓国・ウォン	39,822	41,756,862	4.83
Samsung Engineering	韓国・ウォン	23,567	3,693,436	0.43
Samsung Fire & Marine Insurance	韓国・ウォン	9,847	1,943,006	0.22
Shinhan Financial Group	韓国・ウォン	149,980	5,198,591	0.60
韓国 計			111,190,238	12.86
スイス				
Compagnie Financière Richemont	南アフリカ・ランド	1,081,447	5,929,215	0.69
スイス 計			5,929,215	0.69
台湾				
Far EastOne Telecommunications	台湾・ドル	2,527,000	5,470,868	0.63
Foxconn Technology	台湾・ドル	1,935,947	6,963,838	0.81
Pegatron	台湾・ドル	1,515,000	1,972,009	0.23
Quanta Computer	台湾・ドル	1,963,000	5,215,399	0.60
Siliconware Precision Industries	台湾・ドル	5,953,000	6,214,944	0.72
Synnex Technology International	台湾・ドル	1,041,000	2,528,914	0.29
Taiwan Semiconductor Manufacturing	台湾・ドル	5,152,050	14,015,783	1.62
Uni-President Enterprises	台湾・ドル	7,740,518	12,328,883	1.43
台湾 計			54,710,638	6.33
タイ				
Bangkok Bank	タイ・バーツ	1,103,000	6,650,645	0.77
CP ALL (Foreign)	タイ・バーツ	5,322,100	5,948,821	0.69
Kasikornbank	タイ・バーツ	2,400,300	12,243,344	1.42
Siam Cement	タイ・バーツ	419,500	4,173,866	0.48
タイ 計			29,016,676	3.36
トルコ				
BIM Birlesik Magazalar	トルコ・リラ	291,594	12,010,700	1.39
Turkiye Garanti Bankasi	トルコ・リラ	1,904,946	7,477,811	0.87
トルコ 計			19,488,511	2.26
アラブ首長国連邦				
DP World	アメリカ・ドル	468,283	4,916,972	0.57
アラブ首長国連邦 計			4,916,972	0.57
イギリス				
Antofagasta	イギリス・ポンド	595,928	10,169,354	1.18
SABMiller	南アフリカ・ランド	223,702	9,023,573	1.04
Standard Chartered	イギリス・ポンド	142,988	3,105,012	0.36
Tullow Oil	イギリス・ポンド	507,102	11,691,852	1.35
イギリス 計			33,989,791	3.93

優先株式				
ブラジル				
Banco Bradesco	ブラジル・リアル	817,790	12,130,413	1.40
Itau Unibanco Holding	ブラジル・リアル	1,234,800	17,306,593	2.00
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	360,000	6,530,400	0.76
ブラジル 計			35,967,406	4.16
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			842,057,665	97.42
有価証券 計			842,057,665	97.42
その他資産（負債控除後）			22,333,252	2.58
純資産			864,390,917	100.00

1. 中国A株は制限を受けることがある。2012年6月30日現在で保有する中国A株の評価額は9,490,480アメリカ・ドル、対純資産比率1.09%である（詳細は注記3 b 参照）。

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・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、当財務諸表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

2012年6月30日現在(未監査)

銘柄名	通貨	株数または 額面金額	評価額 (アメリカ・ドル)	対純資産比率 (%)
公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券				
ベルギー				
Barry Callebaut Services 5.375%/2021	ユーロ	2,400,000	3,349,683	0.17
ベルギー 計			3,349,683	0.17
バミューダ				
Aircastle 9.75%/2018	アメリカ・ドル	3,800,000	4,227,500	0.21
バミューダ 計			4,227,500	0.21
カナダ				
Kinder Morgan Finance 5.7%/2016	アメリカ・ドル	7,992,000	8,451,540	0.43
カナダ 計			8,451,540	0.43
ケイマン諸島				
Sable International Finance Ser144A 8.75%/2020	アメリカ・ドル	2,400,000	2,580,000	0.13
UPCB Finance SerRegS 7.625%/2020	ユーロ	425,000	571,707	0.03
ケイマン諸島 計			3,151,707	0.16
ドイツ				
Unitymedia SerRegS 9.5%/2021	ユーロ	3,450,000	4,772,262	0.24
Unitymedia SerRegS 9.625%/2019	ユーロ	2,225,000	3,082,663	0.16
ドイツ 計			7,854,925	0.40
アイルランド				
VimpelCom Via VIP Finance Ireland SerRegS 7.748%/2021	アメリカ・ドル	2,375,000	2,299,570	0.12
アイルランド 計			2,299,570	0.12
イタリア				
Fiat Industrial Finance Europe SerEMTN 6.25%/2018	ユーロ	1,850,000	2,375,328	0.12
イタリア 計			2,375,328	0.12
日本				
Tokyo Electric Power 4.5%/2014	ユーロ	7,250,000	9,158,520	0.47
日本 計			9,158,520	0.47
ルクセンブルグ				
ALROSA Finance SerRegS 7.75%/2020	アメリカ・ドル	2,375,000	2,499,141	0.13
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SerRegS 8%/2016	ユーロ	5,700,000	6,865,866	0.35
Gategroup Finance Luxembourg SerRegS 6.75%/2019	ユーロ	825,000	1,045,244	0.05
Matterhorn Mobile SerRegS 6.75%/2019	スイス・フラン	2,150,000	2,351,030	0.12
Sunrise Communications Holdings SerRegS 8.5%/2018	ユーロ	4,475,000	6,033,936	0.31
Sunrise Communications International SerRegS 7%/2017	ユーロ	800,000	1,086,307	0.06
Wind Acquisition Finance Ser144A 7.25%/2018	アメリカ・ドル	4,325,000	3,806,000	0.19
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.25%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,246,875	0.06
Wind Acquisition Holdings Finance SerRegS 12.25%/2017	アメリカ・ドル	350,000	241,500	0.01
ルクセンブルグ 計			25,175,899	1.28
オランダ				
O1 European Group SerRegS 6.75%/2020	ユーロ	1,225,000	1,651,748	0.08
Polish Television Holding SerRegS step coupon 11.25%/2017	ユーロ	2,475,000	3,201,267	0.16

Schaeffler Finance 6.75%/2017	ユーロ	4,000,000	5,024,473	0.26
Ziggo com stk	ユーロ	112,000	3,579,635	0.18
オランダ 計			13,457,123	0.68
スウェーデン				
Cyfrowy Polsat Finance SerRegS 7.125%/2018	ユーロ	782,000	1,014,274	0.05
スウェーデン 計			1,014,274	0.05
アラブ首長国連邦				
DP World SerRegS 6.85%/2037	アメリカ・ドル	2,730,000	2,684,914	0.14
アラブ首長国連邦 計			2,684,914	0.14
イギリス				
Crown Newco 3 SerRegS 7%/2018	イギリス・ポンド	900,000	1,369,257	0.07
INEOS Finance SerRegS 8.375%/2019	アメリカ・ドル	3,000,000	3,112,500	0.16
MU Finance Ser144A 8.375%/2017	アメリカ・ドル	2,700,000	2,929,500	0.15
イギリス 計			7,411,257	0.38
アメリカ				
Advanced Micro Devices 7.75%/2020	アメリカ・ドル	1,525,000	1,685,125	0.09
Advanced Micro Devices 8.125%/2017	アメリカ・ドル	3,275,000	3,569,750	0.18
AES com stk	アメリカ・ドル	154,725	1,985,122	0.10
AK Steel 7.625%/2020	アメリカ・ドル	2,055,000	1,746,750	0.09
Ally Financial 4.625%/2015	アメリカ・ドル	6,350,000	6,393,739	0.33
Ally Financial pref stk	アメリカ・ドル	6,225	5,462,438	0.28
Ally Financial pref stk	アメリカ・ドル	13,475	309,251	0.02
AmeriGas Finance 6.75%/2020	アメリカ・ドル	2,650,000	2,709,625	0.14
AmeriGas Finance 7%/2022	アメリカ・ドル	6,675,000	6,891,937	0.35
Amerigroup 7.5%/2019	アメリカ・ドル	3,825,000	4,131,000	0.21
Ameristar Casinos com stk	アメリカ・ドル	82,575	1,467,358	0.07
Anixter 5.625%/2019	アメリカ・ドル	1,800,000	1,867,500	0.09
Anixter 10%/2014	アメリカ・ドル	1,600,000	1,740,000	0.09
Atwood Oceanics 6.5%/2020	アメリカ・ドル	1,875,000	1,968,750	0.10
Belo 8%/2016	アメリカ・ドル	6,400,000	7,032,000	0.36
Berry Petroleum 6.375%/2022	アメリカ・ドル	6,425,000	6,649,875	0.34
Berry Petroleum 6.75%/2020	アメリカ・ドル	460,000	483,000	0.02
Berry Petroleum 10.25%/2014	アメリカ・ドル	3,175,000	3,571,875	0.18
Bill Barrett 7%/2022	アメリカ・ドル	7,575,000	7,253,062	0.37
Bill Barrett 7.625%/2019	アメリカ・ドル	6,400,000	6,432,000	0.33
Cablevision Systems 7.75%/2018	アメリカ・ドル	1,750,000	1,872,500	0.10
Cablevision Systems 8%/2020	アメリカ・ドル	700,000	759,500	0.04
Capsugel FinanceCo SerRegS 9.875%/2019	ユーロ	4,675,000	6,461,837	0.33
CB Richard Ellis Services 6.625%/2020	アメリカ・ドル	2,450,000	2,609,250	0.13
CB Richard Ellis Services 11.625%/2017	アメリカ・ドル	1,250,000	1,425,000	0.07
CEDC Finance International SerRegS 8.875%/2016	ユーロ	1,550,000	1,259,153	0.06
Charter Communications Class A com stk	アメリカ・ドル	67,800	4,804,986	0.24
Choice Hotels International 5.75%/2022	アメリカ・ドル	1,700,000	1,780,866	0.09
CIT Group 5.25%/2018	アメリカ・ドル	5,200,000	5,375,500	0.27
CIT Group 5.375%/2020	アメリカ・ドル	12,925,000	13,191,578	0.67
CMS Energy 5.05%/2022	アメリカ・ドル	1,875,000	1,954,196	0.10
Community Health Systems 8.875%/2015	アメリカ・ドル	2,951,000	3,032,152	0.15
Compass Minerals International 8%/2019	アメリカ・ドル	1,240,000	1,334,550	0.07
Concho Resources 7%/2021	アメリカ・ドル	1,275,000	1,370,625	0.07
Concho Resources 8.625%/2017	アメリカ・ドル	3,650,000	4,042,375	0.21
Constellation Brands 6%/2022	アメリカ・ドル	3,675,000	3,959,812	0.20
Constellation Brands 7.25%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,137,500	0.06
Crown Castle International 7.125%/2019	アメリカ・ドル	4,839,000	5,214,022	0.27
DaVita 6.375%/2018	アメリカ・ドル	6,000,000	6,210,000	0.32
DaVita 6.625%/2020	アメリカ・ドル	1,525,000	1,597,437	0.08
Denbury Resources 8.25%/2020	アメリカ・ドル	1,172,000	1,289,200	0.07
Discover Financial Services 10.25%/2019	アメリカ・ドル	3,700,000	4,804,639	0.24
Domtar 9.5%/2016	アメリカ・ドル	275,000	328,383	0.02
El Paso 8.25%/2016	アメリカ・ドル	165,000	181,737	0.01

El Paso SerGMTN 7.75%/2032	アメリカ・ドル	3,950,000	4,460,932	0.23
El Paso SerGMTN 7.8%/2031	アメリカ・ドル	1,075,000	1,211,929	0.06
EQT com stk	アメリカ・ドル	44,600	2,391,898	0.12
EQT 8.125%/2019	アメリカ・ドル	4,450,000	5,343,987	0.27
Esterline Technologies 7%/2020	アメリカ・ドル	3,500,000	3,867,500	0.20
EXCO Resources 7.5%/2018	アメリカ・ドル	6,025,000	5,241,750	0.27
Ferrellgas Finance 9.125%/2017	アメリカ・ドル	1,825,000	1,916,250	0.10
Fidelity National Information Services 7.625%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,938,125	0.10
Fidelity National Information Services 7.875%/2020	アメリカ・ドル	7,450,000	8,418,500	0.43
Ford Motor Credit 3.875%/2015	アメリカ・ドル	3,150,000	3,245,864	0.16
Ford Motor Credit 5%/2018	アメリカ・ドル	20,425,000	21,740,002	1.11
Ford Motor Credit 12%/2015	アメリカ・ドル	4,050,000	5,062,500	0.26
FTI Consulting 7.75%/2016	アメリカ・ドル	1,400,000	1,454,250	0.07
Gaylord Entertainment 6.75%/2014	アメリカ・ドル	450,000	454,500	0.02
General Motors CV 4.75%/2013	アメリカ・ドル	140,100	4,651,320	0.24
GenOn Energy 7.875%/2017	アメリカ・ドル	500,000	467,500	0.02
GMAC Capital Trust I VR 8.125%/2040	アメリカ・ドル	221,450	5,325,873	0.27
Goodyear Tire & Rubber 8.25%/2020	アメリカ・ドル	3,965,000	4,217,769	0.21
Goodyear Tire & Rubber 8.75%/2020	アメリカ・ドル	800,000	857,000	0.04
Graphic Packaging International 7.875%/2018	アメリカ・ドル	2,025,000	2,237,625	0.11
Graphic Packaging International 9.5%/2017	アメリカ・ドル	2,000,000	2,210,000	0.11
Greif 7.75%/2019	アメリカ・ドル	450,000	515,250	0.03
Hanesbrands 8%/2016	アメリカ・ドル	1,075,000	1,189,219	0.06
HCA 7.5%/2022	アメリカ・ドル	13,025,000	14,229,812	0.72
HCA 9.875%/2017	アメリカ・ドル	374,000	407,660	0.02
Host Hotels & Resorts SerQ 6.75%/2016	アメリカ・ドル	1,000,000	1,030,000	0.05
International Lease Finance 4.875%/2015	アメリカ・ドル	2,850,000	2,865,923	0.15
International Lease Finance 5.75%/2016	アメリカ・ドル	5,175,000	5,254,964	0.27
International Lease Finance 8.25%/2020	アメリカ・ドル	7,400,000	8,492,780	0.43
International Lease Finance 8.625%/2022	アメリカ・ドル	3,525,000	4,099,829	0.21
International Lease Finance 8.875%/2017	アメリカ・ドル	6,600,000	7,474,500	0.38
Jarden 8%/2016	アメリカ・ドル	1,175,000	1,286,625	0.07
JC Penney 7.125%/2023	アメリカ・ドル	350,000	326,812	0.02
KB Home 8%/2020	アメリカ・ドル	4,025,000	4,115,562	0.21
Lakes Entertainment com stk	アメリカ・ドル	102,025	295,873	0.01
Lender Processing Services 8.125%/2016	アメリカ・ドル	4,310,000	4,514,725	0.23
Levi Strauss 7.75%/2018	ユーロ	450,000	592,131	0.03
Lucent Technologies Capital Trust I CV 7.75%/2017	アメリカ・ドル	21,175	14,293,125	0.73
Manitowoc 8.5%/2020	アメリカ・ドル	3,750,000	4,068,750	0.21
Masco 5.85%/2017	アメリカ・ドル	3,000,000	3,147,936	0.16
Masco 6.125%/2016	アメリカ・ドル	1,625,000	1,735,822	0.09
MetroPCS Wireless 6.625%/2020	アメリカ・ドル	4,000,000	3,950,000	0.20
MetroPCS Wireless 7.875%/2018	アメリカ・ドル	8,175,000	8,522,438	0.43
MGM Resorts International 10.375%/2014	アメリカ・ドル	825,000	934,313	0.05
Moog 7.25%/2018	アメリカ・ドル	1,575,000	1,677,375	0.08
MPT Operating Partnership 6.375%/2022	アメリカ・ドル	2,325,000	2,342,438	0.12
Newfield Exploration 5.75%/2022	アメリカ・ドル	2,375,000	2,493,750	0.13
Newfield Exploration 6.875%/2020	アメリカ・ドル	4,075,000	4,360,250	0.22
Nextel Communications SerD 7.375%/2015	アメリカ・ドル	5,000,000	5,031,250	0.26
Oasis Petroleum 6.5%/2021	アメリカ・ドル	2,550,000	2,537,250	0.13
Owens Corning 9%/2019	アメリカ・ドル	1,150,000	1,435,806	0.07
Owens-Brockway Glass Container 7.375%/2016	アメリカ・ドル	3,500,000	3,920,000	0.20
Penn Virginia 7.25%/2019	アメリカ・ドル	450,000	373,500	0.02
Penn Virginia Resource Partners Finance 8.25%/2018	アメリカ・ドル	5,575,000	5,658,625	0.29
Plains Exploration & Production 6.125%/2019	アメリカ・ドル	4,225,000	4,267,250	0.22
Plains Exploration & Production 6.75%/2022	アメリカ・ドル	2,500,000	2,562,500	0.13
PNM Resources 9.25%/2015	アメリカ・ドル	1,771,000	2,030,009	0.10
PolyOne 7.375%/2020	アメリカ・ドル	5,105,000	5,436,825	0.28
PPL CV 8.75%/2014	アメリカ・ドル	13,938	745,265	0.04
Range Resources com stk	アメリカ・ドル	33,450	2,069,551	0.11
Range Resources 5%/2022	アメリカ・ドル	1,375,000	1,359,531	0.07
Range Resources 6.75%/2020	アメリカ・ドル	5,190,000	5,657,100	0.29
Reckson Operating Partnership 6%/2016	アメリカ・ドル	1,575,000	1,675,159	0.08
Regal Cinemas 8.625%/2019	アメリカ・ドル	4,725,000	5,232,938	0.27

Regal Entertainment Group 9.125%/2018	アメリカ・ドル	5,200,000	5,746,000	0.29
Regions Bank SerBKNT 7.5%/2018	アメリカ・ドル	10,400,000	11,726,000	0.60
Rite Aid 7.7%/2027	アメリカ・ドル	2,275,000	1,899,625	0.10
Rite Aid 9.5%/2017	アメリカ・ドル	6,975,000	7,166,813	0.36
Sheraton Holding 7.375%/2015	アメリカ・ドル	775,000	890,121	0.04
Spanish Broadcasting System SerB pref stk	アメリカ・ドル	1,823	1,093,800	0.06
Speedway Motorsports 8.75%/2016	アメリカ・ドル	3,470,000	3,790,975	0.19
Spirit Aerosystems 7.5%/2017	アメリカ・ドル	3,750,000	4,096,875	0.21
Springleaf Finance SerMTN 6.9%/2017	アメリカ・ドル	3,950,000	3,172,324	0.16
Standard Pacific 8.375%/2018	アメリカ・ドル	2,000,000	2,195,000	0.11
Standard Pacific 10.75%/2016	アメリカ・ドル	1,675,000	1,984,875	0.10
Starwood Hotels & Resorts Worldwide 7.15%/2019	アメリカ・ドル	4,300,000	5,074,469	0.26
Swift Energy 7.125%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,771,875	0.09
Swift Energy 8.875%/2020	アメリカ・ドル	3,650,000	3,850,750	0.20
Synovus Financial 5.125%/2017	アメリカ・ドル	5,475,000	5,064,375	0.26
Synovus Financial 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,150,000	1,216,125	0.06
Tenet Healthcare 8.875%/2019	アメリカ・ドル	275,000	310,062	0.02
Terex 6.5%/2020	アメリカ・ドル	2,000,000	2,030,000	0.10
Terex 8%/2017	アメリカ・ドル	5,600,000	5,838,000	0.30
Terex 10.875%/2016	アメリカ・ドル	125,000	140,781	0.01
Texas Industries 9.25%/2020	アメリカ・ドル	5,900,000	5,929,500	0.30
Ticketmaster Entertainment 10.75%/2016	アメリカ・ドル	3,175,000	3,373,438	0.17
Toll Brothers Finance 5.875%/2022	アメリカ・ドル	2,225,000	2,344,442	0.12
TreeHouse Foods 7.75%/2018	アメリカ・ドル	6,525,000	7,087,781	0.36
TRW Automotive Holdings com stk	アメリカ・ドル	68,025	2,500,599	0.13
Unit 6.625%/2021	アメリカ・ドル	2,039,000	2,039,000	0.10
United States Steel 7.5%/2022	アメリカ・ドル	3,025,000	2,919,125	0.15
US Treasury Bill 0%/2012	アメリカ・ドル	2,000,000	1,999,808	0.10
Weyerhaeuser 8.5%/2025	アメリカ・ドル	4,500,000	5,333,684	0.27
アメリカ 計			492,858,672	25.10
				0.15
ベネズエラ				
Petroleos de Venezuela SerRegS 8.5%/2017	アメリカ・ドル	3,600,000	2,934,000	0.15
ベネズエラ 計			2,934,000	0.15
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			586,404,912	29.86
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				
Aircastle 6.75%/2017	アメリカ・ドル	1,675,000	1,700,125	0.09
Aircastle 7.625%/2020	アメリカ・ドル	4,650,000	4,743,000	0.24
Intelsat Luxembourg 11.25%/2017	アメリカ・ドル	13,785,000	14,250,244	0.73
NCL 9.5%/2018	アメリカ・ドル	1,325,000	1,444,250	0.07
NCL 11.75%/2016	アメリカ・ドル	2,650,000	3,054,125	0.15
バミューダ 計			25,191,744	1.28
カナダ				
Cascades 7.75%/2017	アメリカ・ドル	3,850,000	3,898,125	0.20
Cascades 7.875%/2020	アメリカ・ドル	5,275,000	5,301,375	0.27
Novelis 8.75%/2020	アメリカ・ドル	3,975,000	4,302,937	0.22
Precision Drilling 6.5%/2021	アメリカ・ドル	875,000	896,875	0.05
Precision Drilling 6.625%/2020	アメリカ・ドル	4,625,000	4,786,875	0.24
Telesat Canada 12.5%/2017	アメリカ・ドル	5,350,000	5,992,000	0.30
Videotron 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,050,000	1,155,000	0.06
Videotron Ser144A 6.875%/2021	カナダ・ドル	750,000	790,868	0.04
カナダ 計			27,124,055	1.38
ケイマン諸島				
Seagate Technology HDD Holdings 6.8%/2016	アメリカ・ドル	3,850,000	4,297,563	0.22
ケイマン諸島 計			4,297,563	0.22
ルクセンブルグ				

Intelsat Jackson Holdings 7.25%/2019	アメリカ・ドル	1,425,000	1,503,375	0.08
Intelsat Jackson Holdings 7.25%/2020	アメリカ・ドル	2,525,000	2,663,875	0.13
ルクセンブルグ 計			4,167,250	0.21
メキシコ				
Kansas City Southern de Mexico 6.125%/2021	アメリカ・ドル	1,425,000	1,574,625	0.08
Kansas City Southern de Mexico 6.625%/2020	アメリカ・ドル	1,325,000	1,480,687	0.08
Kansas City Southern de Mexico 8%/2018	アメリカ・ドル	4,160,000	4,675,008	0.24
Satmex Escrow 9.5%/2017	アメリカ・ドル	625,000	659,375	0.03
メキシコ 計			8,389,695	0.43
アメリカ				
Accellent 8.375%/2017	アメリカ・ドル	475,000	483,312	0.02
Accellent 10%/2017	アメリカ・ドル	3,600,000	3,042,000	0.16
AEP Industries 8.25%/2019	アメリカ・ドル	2,075,000	2,168,375	0.11
Ally Financial 5.5%/2017	アメリカ・ドル	7,425,000	7,549,495	0.38
Ally Financial 6.25%/2017	アメリカ・ドル	8,050,000	8,509,341	0.43
Ally Financial 7.5%/2020	アメリカ・ドル	3,850,000	4,340,875	0.22
Ally Financial 8%/2020	アメリカ・ドル	3,850,000	4,446,750	0.23
Ally Financial 8%/2031	アメリカ・ドル	3,800,000	4,474,500	0.23
Alta Mesa Holdings 9.625%/2018	アメリカ・ドル	1,150,000	1,141,375	0.06
Altra Holdings 8.125%/2016	アメリカ・ドル	2,110,000	2,276,162	0.12
AMC Entertainment 8.75%/2019	アメリカ・ドル	7,061,000	7,608,227	0.39
Ameristar Casinos 7.5%/2021	アメリカ・ドル	800,000	860,000	0.04
Amsouth Bank Series AI 5.2%/2015	アメリカ・ドル	2,900,000	2,965,250	0.15
Antero Resources Finance 7.25%/2019	アメリカ・ドル	6,375,000	6,630,000	0.34
Antero Resources Finance 9.375%/2017	アメリカ・ドル	7,800,000	8,658,000	0.44
Arch Coal 7.25%/2021	アメリカ・ドル	7,225,000	6,087,062	0.31
Associated Materials 9.125%/2017	アメリカ・ドル	4,750,000	4,263,125	0.22
Avis Budget Car Rental 9.625%/2018	アメリカ・ドル	5,914,000	6,505,400	0.33
Aviv Healthcare Properties 7.75%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,397,250	0.07
BE Aerospace 8.5%/2018	アメリカ・ドル	3,175,000	3,488,531	0.18
Biomet 10.375%/2017	アメリカ・ドル	8,075,000	8,670,531	0.44
Biomet 11.625%/2017	アメリカ・ドル	7,175,000	7,775,906	0.40
Boise Paper Holdings 8%/2020	アメリカ・ドル	950,000	1,054,500	0.05
Boise Paper Holdings 9%/2017	アメリカ・ドル	2,400,000	2,664,000	0.14
Boyd Gaming 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,925,000	1,992,375	0.10
BWAY Holding 10%/2018	アメリカ・ドル	3,000,000	3,315,000	0.17
Caesars Entertainment Operating 5.625%/2015	アメリカ・ドル	2,700,000	2,198,475	0.11
Caesars Entertainment Operating 11.25%/2017	アメリカ・ドル	4,775,000	5,234,594	0.27
Capella Healthcare 9.25%/2017	アメリカ・ドル	4,900,000	5,096,000	0.26
Case New Holland 7.875%/2017	アメリカ・ドル	3,750,000	4,350,000	0.22
CCO Holdings 6.625%/2022	アメリカ・ドル	8,200,000	8,815,000	0.45
CCO Holdings 7%/2019	アメリカ・ドル	525,000	569,625	0.03
CCO Holdings 7.25%/2017	アメリカ・ドル	5,275,000	5,776,125	0.29
CCO Holdings 7.375%/2020	アメリカ・ドル	1,550,000	1,710,812	0.09
CCO Holdings 7.875%/2018	アメリカ・ドル	3,700,000	4,042,250	0.21
CDW Finance 8%/2018	アメリカ・ドル	900,000	981,000	0.05
CDW Finance 8.5%/2019	アメリカ・ドル	4,500,000	4,815,000	0.25
CDW Finance 12.535%/2017	アメリカ・ドル	14,850,000	16,186,500	0.82
Cedar Fair 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,775,000	1,979,125	0.10
Central Garden and Pet 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,375,000	3,400,312	0.17
Chrysler Group 8%/2019	アメリカ・ドル	3,250,000	3,355,625	0.17
Chrysler Group 8.25%/2021	アメリカ・ドル	7,300,000	7,537,250	0.38
Cinemark USA 7.375%/2021	アメリカ・ドル	1,125,000	1,226,250	0.06
CKE Restaurants 11.375%/2018	アメリカ・ドル	3,601,000	4,132,147	0.21
Claire 's Stores 8.875%/2019	アメリカ・ドル	2,150,000	1,849,000	0.09
Clayton Williams Energy 7.75%/2019	アメリカ・ドル	3,600,000	3,546,000	0.18
Clear Channel Communications 7.25%/2027	アメリカ・ドル	1,125,000	503,437	0.03
Clear Channel Communications 11%/2016	アメリカ・ドル	2,225,000	1,390,625	0.07
Clearwater Paper 7.125%/2018	アメリカ・ドル	1,625,000	1,722,500	0.09
Coleman Cable 9%/2018	アメリカ・ドル	2,050,000	2,121,750	0.11
Columbus McKinnon 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,875,000	4,126,875	0.21
Community Health Systems 8%/2019	アメリカ・ドル	6,725,000	7,195,750	0.37

Consol Energy 8%/2017	アメリカ・ドル	1,775,000	1,850,437	0.09
Consol Energy 8.25%/2020	アメリカ・ドル	7,850,000	8,281,750	0.42
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	631,222	711,703	0.04
Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust SerB 9.25%/2017	アメリカ・ドル	390,992	426,181	0.02
Cott Beverages 8.125%/2018	アメリカ・ドル	4,642,000	5,088,792	0.26
Cott Beverages 8.375%/2017	アメリカ・ドル	1,792,000	1,957,760	0.10
Cricket Communications 7.75%/2016	アメリカ・ドル	3,275,000	3,491,969	0.18
Cricket Communications 7.75%/2020	アメリカ・ドル	10,775,000	10,344,000	0.53
Cricket Communications 10%/2015	アメリカ・ドル	1,432,000	1,482,120	0.08
Crown Americas Capital II 7.625%/2017	アメリカ・ドル	2,625,000	2,848,125	0.15
Darling International 8.5%/2018	アメリカ・ドル	2,050,000	2,311,375	0.12
Del Monte 7.625%/2019	アメリカ・ドル	6,715,000	6,807,331	0.35
Delphi 5.875%/2019	アメリカ・ドル	850,000	911,625	0.05
Delphi 6.125%/2021	アメリカ・ドル	1,025,000	1,124,937	0.06
DineEquity 9.5%/2018	アメリカ・ドル	7,155,000	7,870,500	0.40
DISH DBS 6.75%/2021	アメリカ・ドル	3,615,000	3,922,275	0.20
DISH DBS 7.125%/2016	アメリカ・ドル	1,375,000	1,515,937	0.08
DISH DBS 7.875%/2019	アメリカ・ドル	2,875,000	3,327,812	0.17
Dollar General 4.125%/2017	アメリカ・ドル	3,160,000	3,219,250	0.16
Ducommun 9.75%/2018	アメリカ・ドル	2,525,000	2,670,187	0.14
Dycom Investments 7.125%/2021	アメリカ・ドル	3,300,000	3,399,000	0.17
E*Trade Financial 6.75%/2016	アメリカ・ドル	8,500,000	8,691,250	0.44
E*Trade Financial 7.875%/2015	アメリカ・ドル	2,000,000	2,040,000	0.10
E*Trade Financial 12.5%/2017	アメリカ・ドル	18,178,000	20,927,422	1.07
Earthlink 8.875%/2019	アメリカ・ドル	2,100,000	2,055,375	0.10
Easton-Bell Sports 9.75%/2016	アメリカ・ドル	3,820,000	4,197,225	0.21
Epicor Software 8.625%/2019	アメリカ・ドル	5,225,000	5,355,625	0.27
Equinix 7%/2021	アメリカ・ドル	5,275,000	5,815,687	0.30
Euramax International 9.5%/2016	アメリカ・ドル	3,475,000	3,084,062	0.16
Exopack Holding 10%/2018	アメリカ・ドル	1,875,000	1,889,062	0.10
Exterran Holdings 7.25%/2018	アメリカ・ドル	7,800,000	7,527,000	0.38
Ferrellgas Finance 6.5%/2021	アメリカ・ドル	5,350,000	4,908,625	0.25
First Data 12.625%/2021	アメリカ・ドル	20,400,000	20,527,500	1.05
Florida East Coast Holdings 10.5%/2017	アメリカ・ドル	37,396	31,974	0.00
Florida East Coast Railway 8.125%/2017	アメリカ・ドル	1,975,000	2,073,750	0.11
Freescale Semiconductor 8.05%/2020	アメリカ・ドル	675,000	669,937	0.03
Fresenius Medical Care US Finance 6.875%/2017	アメリカ・ドル	316,000	352,735	0.02
FTI Consulting 6.75%/2020	アメリカ・ドル	825,000	874,500	0.04
GCI 6.75%/2021	アメリカ・ドル	2,300,000	2,236,750	0.11
General Motors Financial 6.75%/2018	アメリカ・ドル	3,700,000	4,049,517	0.21
GenOn Energy 9.5%/2018	アメリカ・ドル	8,325,000	8,272,969	0.42
Goodyear Tire & Rubber 7%/2022	アメリカ・ドル	1,375,000	1,380,156	0.07
Hexion US Finance 6.625%/2020	アメリカ・ドル	2,125,000	2,188,750	0.11
Hexion US Finance 8.875%/2018	アメリカ・ドル	7,875,000	8,071,875	0.41
Hexion US Finance 9%/2020	アメリカ・ドル	3,200,000	2,776,000	0.14
Host Hotels & Resorts 5.875%/2019	アメリカ・ドル	1,000,000	1,085,000	0.06
Host Hotels & Resorts 6%/2021	アメリカ・ドル	3,050,000	3,362,625	0.17
Hughes Satellite Systems 6.5%/2019	アメリカ・ドル	4,920,000	5,252,100	0.27
Hughes Satellite Systems 7.625%/2021	アメリカ・ドル	6,150,000	6,718,875	0.34
Huntsman International 8.625%/2020	アメリカ・ドル	1,375,000	1,550,313	0.08
Huntsman International 8.625%/2021	アメリカ・ドル	2,300,000	2,604,750	0.13
IASIS Healthcare 8.375%/2019	アメリカ・ドル	5,375,000	5,348,125	0.27
Icahn Enterprises 8%/2018	アメリカ・ドル	9,200,000	9,821,000	0.50
iGATE 9%/2016	アメリカ・ドル	8,525,000	9,164,375	0.47
iPayment 10.25%/2018	アメリカ・ドル	5,450,000	4,986,750	0.25
ITC Deltacom 10.5%/2016	アメリカ・ドル	650,000	695,500	0.04
Kindred Healthcare 8.25%/2019	アメリカ・ドル	3,375,000	3,147,188	0.16
Koppers 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,425,000	3,707,563	0.19
Kratos Defense & Security Solutions 10%/2017	アメリカ・ドル	4,650,000	5,033,625	0.26
Level 3 Communications 11.875%/2019	アメリカ・ドル	6,050,000	6,730,625	0.34
Level 3 Financing 8.625%/2020	アメリカ・ドル	7,125,000	7,516,875	0.38
Level 3 Financing 8.75%/2017	アメリカ・ドル	1,200,000	1,254,000	0.06
Level 3 Financing 9.375%/2019	アメリカ・ドル	650,000	705,250	0.04

Levi Strauss 7.625%/2020	アメリカ・ドル	1,025,000	1,094,188	0.06
LifePoint Hospitals 6.625%/2020	アメリカ・ドル	3,525,000	3,762,938	0.19
LIN Television 8.375%/2018	アメリカ・ドル	3,475,000	3,570,563	0.18
MedAssets 8%/2018	アメリカ・ドル	3,350,000	3,551,000	0.18
Mediacom Broadband 8.5%/2015	アメリカ・ドル	1,250,000	1,290,625	0.07

[前へ](#) [次へ](#)

MEMC Electronic Materials 7.75%/2019	アメリカ・ドル	6,225,000	4,948,875	0.25
Mercer International 9.5%/2017	アメリカ・ドル	4,225,000	4,404,563	0.22
MGM Resorts International 9%/2020	アメリカ・ドル	3,850,000	4,292,750	0.22
Michael Foods Group 9.75%/2018	アメリカ・ドル	4,050,000	4,465,125	0.23
Mobile Mini 6.875%/2015	アメリカ・ドル	650,000	658,938	0.03
Momentive Performance Materials 9%/2021	アメリカ・ドル	1,525,000	1,162,813	0.06
Momentive Performance Materials 11.5%/2016	アメリカ・ドル	9,375,000	7,031,250	0.36
MPT Operating Partnership 6.875%/2021	アメリカ・ドル	2,775,000	2,906,813	0.15
Netflix 8.5%/2017	アメリカ・ドル	3,400,000	3,595,500	0.18
Nexstar Mission Broadcasting 8.875%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,857,188	0.09
Nielsen Finance 7.75%/2018	アメリカ・ドル	3,385,000	3,765,813	0.19
Nielsen Finance 11.5%/2016	アメリカ・ドル	1,136,000	1,297,880	0.07
Nielsen Finance 11.625%/2014	アメリカ・ドル	2,488,000	2,861,200	0.15
NII Capital 7.625%/2021	アメリカ・ドル	6,725,000	5,800,313	0.30
NII Capital 8.875%/2019	アメリカ・ドル	3,312,000	3,018,060	0.15
Nortek 8.5%/2021	アメリカ・ドル	7,200,000	7,074,000	0.36
Nortek 10%/2018	アメリカ・ドル	3,500,000	3,692,500	0.19
Northwest Airlines Ser992A 7.575%/2019	アメリカ・ドル	573,171	625,117	0.03
NRG Energy 7.625%/2018	アメリカ・ドル	2,250,000	2,340,000	0.12
Nuveen Investments 5.5%/2015	アメリカ・ドル	4,525,000	4,117,750	0.21
Nuveen Investments 10.5%/2015	アメリカ・ドル	14,725,000	15,019,500	0.76
Oasis Petroleum 7.25%/2019	アメリカ・ドル	700,000	721,000	0.04
Omega Healthcare Investors 6.75%/2022	アメリカ・ドル	3,625,000	3,887,813	0.20
Oshkosh 8.25%/2017	アメリカ・ドル	1,925,000	2,117,500	0.11
Oshkosh 8.5%/2020	アメリカ・ドル	1,925,000	2,146,375	0.11
PAETEC Holding 8.875%/2017	アメリカ・ドル	3,075,000	3,328,688	0.17
PAETEC Holding 9.875%/2018	アメリカ・ドル	1,475,000	1,655,688	0.08
Pinnacle Entertainment 7.75%/2022	アメリカ・ドル	1,925,000	2,062,156	0.11
Pinnacle Foods Finance 8.25%/2017	アメリカ・ドル	2,300,000	2,443,750	0.12
Pinnacle Foods Finance 9.25%/2015	アメリカ・ドル	3,800,000	3,923,500	0.20
Potlatch 7.5%/2019	アメリカ・ドル	1,925,000	2,050,125	0.10
Radiation Therapy Services 9.875%/2017	アメリカ・ドル	2,125,000	1,673,438	0.09
RadioShack 6.75%/2019	アメリカ・ドル	4,850,000	3,625,375	0.18
RBS Global & Rexnord 8.5%/2018	アメリカ・ドル	4,325,000	4,686,094	0.24
Regency Energy Partners 6.875%/2018	アメリカ・ドル	1,750,000	1,850,625	0.09
Rouse 6.75%/2015	アメリカ・ドル	5,050,000	5,302,500	0.27
Ryerson 12%/2015	アメリカ・ドル	5,025,000	5,075,250	0.26
Ryerson Holding 0%/2015	アメリカ・ドル	23,350,000	12,258,750	0.62
Sabine Pass LNG 7.5%/2016	アメリカ・ドル	5,050,000	5,327,750	0.27
SBA Telecommunications 8%/2016	アメリカ・ドル	292,000	312,440	0.02
SBA Telecommunications 8.25%/2019	アメリカ・ドル	2,305,000	2,535,500	0.13

ServiceMaster 8%/2020	アメリカ・ドル	1,875,000	2,050,781	0.10
SESI 6.375%/2019	アメリカ・ドル	4,000,000	4,210,000	0.21
Severstal Columbus 10.25%/2018	アメリカ・ドル	3,725,000	3,748,281	0.19
Shea Homes Funding 8.625%/2019	アメリカ・ドル	5,325,000	5,751,000	0.29
SLM SerMTN 5.05%/2014	アメリカ・ドル	175,000	181,117	0.01
SLM SerMTN 6%/2017	アメリカ・ドル	2,920,000	3,031,036	0.15
SLM SerMTN 6.25%/2016	アメリカ・ドル	8,125,000	8,571,875	0.44
SLM SerMTN 8.45%/2018	アメリカ・ドル	5,025,000	5,653,125	0.29
SM Energy 6.5%/2021	アメリカ・ドル	1,875,000	1,917,188	0.10
SM Energy 6.625%/2019	アメリカ・ドル	825,000	849,750	0.04
SPX 6.875%/2017	アメリカ・ドル	3,225,000	3,531,375	0.18
Steel Dynamics 7.75%/2016	アメリカ・ドル	4,275,000	4,424,625	0.23
Susser Holdings 8.5%/2016	アメリカ・ドル	2,525,000	2,758,563	0.14
Swift Energy 7.875%/2022	アメリカ・ドル	5,100,000	5,151,000	0.26
Syniverse Holdings 9.125%/2019	アメリカ・ドル	6,100,000	6,649,000	0.34
Tenet Healthcare 6.25%/2018	アメリカ・ドル	5,400,000	5,737,500	0.29
TransDigm 7.75%/2018	アメリカ・ドル	5,075,000	5,595,188	0.28
Universal Health Services 7%/2018	アメリカ・ドル	3,400,000	3,672,000	0.19
Universal Hospital Services 8.5%/2015	アメリカ・ドル	425,000	435,359	0.02
Vanguard Health Holding II 7.75%/2019	アメリカ・ドル	3,700,000	3,755,500	0.19
Vanguard Health Holding II 8%/2018	アメリカ・ドル	1,300,000	1,335,750	0.07
Vanguard Health Systems 0%/2016	アメリカ・ドル	86,000	57,620	0.00
Vulcan Materials 7.5%/2021	アメリカ・ドル	3,675,000	4,060,875	0.21
West 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,417,500	0.07
West 8.625%/2018	アメリカ・ドル	6,800,000	7,242,000	0.37
Windstream 7.875%/2017	アメリカ・ドル	11,925,000	13,057,875	0.66
WMG Acquisition 9.5%/2016	アメリカ・ドル	3,050,000	3,339,750	0.17
WPX Energy 6%/2022	アメリカ・ドル	7,525,000	7,525,000	0.38
Yankee Candle SerB 8.5%/2015	アメリカ・ドル	69,000	70,553	0.00
アメリカ 計			769,445,485	39.18
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			838,615,792	42.70
直近に発行された取引可能な有価証券				
オーストリア				
Sappi Papier Holding Ser144A 7.75%/2017	アメリカ・ドル	2,250,000	2,286,562	0.12
Sappi Papier Holding Ser144A 8.375%/2019	アメリカ・ドル	1,675,000	1,683,375	0.08
オーストリア 計			3,969,937	0.20
カナダ				

MPL 2 Acquisition Canco Ser144A 9.875%/2018	アメリカ・ドル	1,975,000	1,654,063	0.09
カナダ 計			1,654,063	0.09
ケイマン諸島				
UPCB Finance V SerRegS 7.25%/2021	アメリカ・ドル	4,525,000	4,751,250	0.24
UPCB Finance VI SerRegS 6.875%/2022	アメリカ・ドル	2,900,000	2,972,500	0.15
ケイマン諸島 計			7,723,750	0.39
ルクセンブルグ				
Aguila 3 SerRegS 7.875%/2018	アメリカ・ドル	1,350,000	1,395,562	0.07
Intelsat Jackson Holdings Ser144A 7.25%/2020	アメリカ・ドル	450,000	474,750	0.03
ルクセンブルグ 計			1,870,312	0.10
オランダ				
AerCap Aviation Solutions Ser144A 6.375%/2017	アメリカ・ドル	3,050,000	3,080,500	0.15
LyondellBasell Industries Ser144A 5%/2019	アメリカ・ドル	5,025,000	5,295,094	0.27
LyondellBasell Industries Ser144A 6%/2021	アメリカ・ドル	2,000,000	2,205,000	0.11
Schaeffler Finance Ser144A 7.75%/2017	アメリカ・ドル	900,000	942,750	0.05
Schaeffler Finance Ser144A 8.5%/2019	アメリカ・ドル	1,050,000	1,126,125	0.06
オランダ 計			12,649,469	0.64
ノルウェー				
Petroleum Geo-Services SerRegS 7.375%/2018	アメリカ・ドル	3,800,000	3,923,500	0.20
ノルウェー 計			3,923,500	0.20
アメリカ				
99 Cents Only Stores Ser144A 11%/2019	アメリカ・ドル	2,675,000	2,902,375	0.15
Academy Finance Ser144A 9.25%/2019	アメリカ・ドル	3,300,000	3,597,000	0.18
Air Lease Ser144A 5.625%/2017	アメリカ・ドル	5,300,000	5,247,000	0.27
Ameristar Casinos Ser144A 7.5%/2021	アメリカ・ドル	675,000	725,625	0.04
Block Communications Ser144A 7.25%/2020	アメリカ・ドル	3,900,000	3,978,000	0.20
Boyd Gaming Ser144A 9%/2020	アメリカ・ドル	2,675,000	2,695,062	0.14
CCM Merger Ser144A 9.125%/2019	アメリカ・ドル	1,150,000	1,165,812	0.06
Chesapeake Oilfield Finance Ser144A 6.625%/2019	アメリカ・ドル	1,925,000	1,742,125	0.09
CIT Group Ser144A 4.75%/2015	アメリカ・ドル	3,125,000	3,210,937	0.16
CIT Group Ser144A 5.5%/2019	アメリカ・ドル	22,125,000	22,788,750	1.16
Clear Channel Worldwide Holdings Ser144A 7.625%/2020	アメリカ・ドル	9,575,000	9,407,437	0.48
Clear Channel Worldwide Holdings SerA Ser144A 7.625%/2020	アメリカ・ドル	1,150,000	1,106,875	0.06
CNH Capital Ser144A 6.25%/2016	アメリカ・ドル	5,350,000	5,751,250	0.29

CSC Holdings Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	6,500,000	6,955,000	0.35
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma Ser144A 10.5%/2019	アメリカ・ドル	1,400,000	1,452,500	0.07
DPL Ser144A 6.5%/2016	アメリカ・ドル	3,625,000	3,933,125	0.20
DPL Ser144A 7.25%/2021	アメリカ・ドル	4,025,000	4,487,875	0.23
EP Energy Finance Ser144A 9.375%/2020	アメリカ・ドル	5,025,000	5,213,437	0.27
Fiesta Restaurant Group Ser144A 8.875%/2016	アメリカ・ドル	2,575,000	2,716,625	0.14
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.625%/2019	アメリカ・ドル	4,825,000	5,054,187	0.26
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.875%/2022	アメリカ・ドル	2,175,000	2,270,156	0.12
GTP Acquisition Partners I Ser144A 7.628%/2016	アメリカ・ドル	750,000	782,319	0.04
HD Supply Ser144A 8.125%/2019	アメリカ・ドル	4,675,000	5,060,687	0.26
HD Supply Ser144A 11%/2020	アメリカ・ドル	2,875,000	3,101,406	0.16
Health Management Associates Ser144A 7.375%/2020	アメリカ・ドル	8,275,000	8,843,906	0.45
Hercules Offshore Ser144A 7.125%/2017	アメリカ・ドル	2,625,000	2,549,531	0.13
inVentiv Health Ser144A 10%/2018	アメリカ・ドル	2,900,000	2,508,500	0.13
Lamar Media Ser144A 5.875%/2022	アメリカ・ドル	2,075,000	2,137,250	0.11
Laredo Petroleum Ser144A 7.375%/2022	アメリカ・ドル	3,425,000	3,570,562	0.18
Lawson Software Ser144A 9.375%/2019	アメリカ・ドル	4,200,000	4,504,500	0.23
Lawson Software Ser144A 11.5%/2018	アメリカ・ドル	1,175,000	1,333,625	0.07
Levi Strauss Ser144A 6.875%/2022	アメリカ・ドル	3,300,000	3,403,125	0.17
Mcron Finance Ser144A 8.375%/2019	アメリカ・ドル	2,400,000	2,388,000	0.12
Mead Products / ACCO Brands Ser144A 6.75%/2020	アメリカ・ドル	2,475,000	2,623,500	0.13
Meritage Homes Ser144A 7%/2022	アメリカ・ドル	1,525,000	1,574,562	0.08
National CineMedia Ser144A 6%/2022	アメリカ・ドル	2,225,000	2,275,063	0.12
Nationstar Mortgage/Nationstar Capital Ser144A 9.625%/2019	アメリカ・ドル	3,300,000	3,506,250	0.18
Parker Drilling Ser144A 9.125%/2018	アメリカ・ドル	1,200,000	1,275,000	0.06
Peabody Energy Ser144A 6%/2018	アメリカ・ドル	4,575,000	4,575,000	0.23
Peabody Energy Ser144A 6.25%/2021	アメリカ・ドル	3,500,000	3,482,500	0.18
Penn Virginia Resource Partners Finance II Ser144A 8.375%/2020	アメリカ・ドル	1,825,000	1,861,500	0.09
Prestige Brands Ser144A 8.125%/2020	アメリカ・ドル	1,800,000	1,984,500	0.10
Rite Aid Ser144A 9.25%/2020	アメリカ・ドル	5,275,000	5,301,375	0.27
Rock-Tenn Ser144A 4.9%/2022	アメリカ・ドル	1,815,000	1,873,385	0.09
SESI Ser144A 7.125%/2021	アメリカ・ドル	4,725,000	5,162,063	0.26
SM Energy Ser144A 6.5%/2023	アメリカ・ドル	3,050,000	3,076,688	0.16
Sonic Automotive Ser144A 7%/2022	アメリカ・ドル	1,925,000	2,002,000	0.10
Sprint Nextel Ser144A 7%/2020	アメリカ・ドル	1,675,000	1,746,188	0.09
Sprint Nextel Ser144A 9%/2018	アメリカ・ドル	9,500,000	10,640,000	0.54
Sprint Nextel Ser144A 9.125%/2017	アメリカ・ドル	5,225,000	5,499,313	0.28

Sprint Nextel Ser144A 11.5%/2021	アメリカ・ドル	2,750,000	3,073,125	0.16
Station Casinos Ser144A step coupon 3.66%/2018	アメリカ・ドル	6,475,000	4,937,188	0.25
Summit Materials Finance Ser144A 10.5%/2020	アメリカ・ドル	3,425,000	3,643,344	0.19
Targa Resources Partners Finance Ser144A 6.375%/2022	アメリカ・ドル	1,900,000	1,904,750	0.10
Taylor Morrison Communities/Monarch Communities Ser144A 7.75%/2020	アメリカ・ドル	3,025,000	3,168,688	0.16
Tekni-Plex Ser144A 9.75%/2019	アメリカ・ドル	2,175,000	2,202,188	0.11
Truven Health Analytics Ser144A 10.625%/2020	アメリカ・ドル	1,625,000	1,698,125	0.09
UR Financing Ser144A 5.75%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	2,423,813	0.12
ViaSat Ser144A 6.875%/2020	アメリカ・ドル	2,425,000	2,461,375	0.12
WMG Acquisition Ser144A 9.5%/2016	アメリカ・ドル	825,000	903,375	0.05
Wok Acquisition Ser144A 10.25%/2020	アメリカ・ドル	1,550,000	1,604,250	0.08
Zayo Escrow Ser144A 8.125%/2020	アメリカ・ドル	1,875,000	1,954,688	0.10

アメリカ計			225,018,360	11.46
--------------	--	--	--------------------	--------------

13.08

直近に発行された取引可能な有価証券計			256,809,391	13.08
---------------------------	--	--	--------------------	--------------

その他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	6,850,000	7,021,250	0.36
--	---------	-----------	-----------	------

オーストラリア計			7,021,250	0.36
-----------------	--	--	------------------	-------------

バミューダ

Digicel Group SerRegS 8.875%/2015	アメリカ・ドル	2,000,000	2,030,000	0.10
-----------------------------------	---------	-----------	-----------	------

Digicel Group SerRegS 10.5%/2018	アメリカ・ドル	1,600,000	1,688,000	0.09
----------------------------------	---------	-----------	-----------	------

Digicel Ser144A 12%/2014	アメリカ・ドル	400,000	446,000	0.02
--------------------------	---------	---------	---------	------

Digicel SerRegS 8.25%/2017	アメリカ・ドル	2,275,000	2,337,563	0.12
----------------------------	---------	-----------	-----------	------

Intelsat Luxembourg Ser144A 11.5%/2017	アメリカ・ドル	5,925,000	6,139,781	0.31
--	---------	-----------	-----------	------

バミューダ計			12,641,344	0.64
---------------	--	--	-------------------	-------------

カナダ

Connacher Oil and Gas SerRegS 8.5%/2019	アメリカ・ドル	3,325,000	2,842,875	0.15
---	---------	-----------	-----------	------

Connacher Oil and Gas SerRegS 8.75%/2018	カナダ・ドル	2,200,000	1,855,903	0.09
--	--------	-----------	-----------	------

Garda World Security Ser144A 9.75%/2017	アメリカ・ドル	1,225,000	1,307,687	0.07
---	---------	-----------	-----------	------

Reliance Intermediate Holdings Ser144A 9.5%/2019	アメリカ・ドル	2,500,000	2,762,500	0.14
--	---------	-----------	-----------	------

Videotron Series WI 5%/2022	アメリカ・ドル	3,625,000	3,697,500	0.19
-----------------------------	---------	-----------	-----------	------

カナダ計			12,466,465	0.64
-------------	--	--	-------------------	-------------

ルクセンブルグ

Aguila 3 Ser144A 7.875%/2018	アメリカ・ドル	675,000	698,625	0.04
Wind Acquisition Finance SerRegS 11.75%/2017	アメリカ・ドル	1,100,000	893,750	0.04
Wind Acquisition Holdings Finance Ser144A 12.25%/2017	アメリカ・ドル	2,179,593	1,503,919	0.08
ルクセンブルグ 計			3,096,294	0.16
オランダ				
Clondalkin Acquisition Ser144A VR 2.468%/2013	アメリカ・ドル	375,000	335,625	0.02
Sensata Technologies Ser144A 6.5%/2019	アメリカ・ドル	225,000	233,438	0.01
Sensata Technologies SerRegS 6.5%/2019	アメリカ・ドル	2,500,000	2,593,750	0.13
VimpelCom Holdings Ser144A 7.504%/2022	アメリカ・ドル	2,750,000	2,590,335	0.13
オランダ 計			5,753,148	0.29
イギリス				
INEOS Finance SerRegS 9%/2015	アメリカ・ドル	575,000	609,500	0.03
イギリス 計			609,500	0.03
アメリカ				
AES Ser144A 7.375%/2021	アメリカ・ドル	3,225,000	3,603,937	0.18
Allison Transmission Ser144A 7.125%/2019	アメリカ・ドル	2,275,000	2,383,062	0.12
Amsted Industries Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,514,062	0.08
Ashtead Capital 6.5%/2022	アメリカ・ドル	1,500,000	1,500,000	0.08
Assured Guaranty Municipal Holdings Ser144A VR 6.4%/2066	アメリカ・ドル	4,650,000	3,092,250	0.16
Bresnan Broadband Holdings Ser144A 8%/2018	アメリカ・ドル	750,000	787,500	0.04
Bumble Bee Acquisition Ser144A 9%/2017	アメリカ・ドル	1,782,000	1,786,455	0.09
Calpine Ser144A 7.875%/2020	アメリカ・ドル	5,000,000	5,537,500	0.28
CEDC Finance International Ser144A 9.125%/2016	アメリカ・ドル	425,000	270,937	0.01
CequeI Communications Holdings Ser144A 8.625%/2017	アメリカ・ドル	3,700,000	4,005,250	0.20
Claire's Stores 9.625%/2015	アメリカ・ドル	1,471,687	1,261,972	0.06
CommScope Ser144A 8.25%/2019	アメリカ・ドル	12,325,000	13,095,312	0.67
Continental Airlines Ser144A 6.75%/2015	アメリカ・ドル	1,925,000	1,987,563	0.10
Delta Air Lines Ser144A 12.25%/2015	アメリカ・ドル	3,600,000	3,933,000	0.20
First Data Ser144A 7.375%/2019	アメリカ・ドル	4,000,000	4,100,000	0.21
First Data Ser144A 8.875%/2020	アメリカ・ドル	1,800,000	1,957,500	0.10
Foresight Energy Ser144A 9.625%/2017	アメリカ・ドル	4,925,000	4,955,781	0.25
Frac Tech Services Ser144A 7.625%/2018	アメリカ・ドル	5,550,000	5,619,375	0.29
Freescale Semiconductor Ser144A 10.125%/2018	アメリカ・ドル	2,476,000	2,717,410	0.14
Goodman Networks Ser144A 12.125%/2018	アメリカ・ドル	2,575,000	2,658,688	0.14
Hercules Offshore Ser144A 10.5%/2017	アメリカ・ドル	1,050,000	1,055,250	0.05
HUB International Holdings Ser144A 9%/2014	アメリカ・ドル	1,908,000	1,943,775	0.10

HUB International Holdings Ser144A 10.25%/2015	アメリカ・ドル	6,685,000	6,843,769	0.35
inVentiv Health Ser144A 10%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	1,999,500	0.10
JMC Steel Group Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	6,100,000	6,084,750	0.31
Jo-Ann Stores Ser144A 8.125%/2019	アメリカ・ドル	125,000	125,000	0.01
Kinder Morgan Finance Ser144A 6%/2018	アメリカ・ドル	1,600,000	1,672,000	0.09
Land O'Lakes Capital Trust I Ser144A 7.45%/2028	アメリカ・ドル	2,050,000	1,968,000	0.10
MBIA Insurance Ser144A VR 14%/2033	アメリカ・ドル	3,400,000	1,870,000	0.10
Palace Entertainment Holdings Ser144A 8.875%/2017	アメリカ・ドル	1,000,000	1,050,000	0.05
Plastipak Holdings Ser144A 10.625%/2019	アメリカ・ドル	425,000	483,969	0.02
Provident Funding Associates Ser144A 10.125%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,192,125	0.06
Provident Funding Associates Ser144A 10.25%/2017	アメリカ・ドル	1,600,000	1,676,000	0.09
Reynolds Group Issuer Ser144A 7.125%/2019	アメリカ・ドル	1,025,000	1,078,813	0.06
Reynolds Group Issuer Ser144A 8.75%/2016	アメリカ・ドル	625,000	660,937	0.03
Seminole Indian Tribe of Florida Ser144A 7.75%/2017	アメリカ・ドル	3,750,000	4,106,250	0.21
Seneca Gaming Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,300,000	3,399,000	0.17
Sinclair Television Group Ser144A 9.25%/2017	アメリカ・ドル	2,875,000	3,191,250	0.16
Sirius XM Radio Ser144A 8.75%/2015	アメリカ・ドル	4,100,000	4,633,000	0.24
Smurfit-Stone Container pref stk	アメリカ・ドル	7,275	0	0.00
Spanish Broadcasting System pref stk	アメリカ・ドル	24,424	153	0.00
United Air Lines Ser144A 12%/2013	アメリカ・ドル	1,200,000	1,257,000	0.06
Univision Communications Ser144A 6.875%/2019	アメリカ・ドル	2,350,000	2,432,250	0.12
Univision Communications SerRegS 7.875%/2020	アメリカ・ドル	5,125,000	5,509,375	0.28
Univision Communications SerRegS 8.5%/2021	アメリカ・ドル	13,000,000	13,162,500	0.67
US Foods Ser144A 8.5%/2019	アメリカ・ドル	2,750,000	2,805,000	0.14
USG Ser144A 8.375%/2018	アメリカ・ドル	550,000	580,250	0.03
USG Ser144A 9.75%/2014	アメリカ・ドル	1,550,000	1,728,250	0.09
USI Holdings Ser144A 9.75%/2015	アメリカ・ドル	1,612,000	1,626,105	0.08
アメリカ 計			140,901,825	7.17
その他取引可能な有価証券 計			182,489,826	9.29
有価証券 計			1,864,319,921	94.93

為替予約取引

決済日	買い	売り	評価(損)益 (アメリカ・ドル)
2012年7月11日	イギリス・ポンド 782,000	アメリカ・ドル 1,230,318	(3,740)
2012年7月11日	アメリカ・ドル 2,661,852	イギリス・ポンド 1,668,000	45,570
2012年8月10日	スイス・フラン 58,000	アメリカ・ドル 61,002	176
2012年8月10日	アメリカ・ドル 2,486,779	スイス・フラン 2,295,000	66,017

2012年9月10日	ユーロ 11,777,844	アメリカ・ドル 14,798,389	133,378
2012年9月10日	アメリカ・ドル 70,897,854	ユーロ 56,745,803	(1,043,592)
為替予約取引に係る評価(損)益計			(802,191) (0.04)

ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価(損)益計 **(14,133,280) (0.72)**

オプション取引

証券名	満期日	契約枚数	通貨	評価額 (アメリカ・ドル)
Range Resources, Put Option, Strike Price 50	2013年1月19日	167	アメリカ・ドル	(48,431)
オプション取引評価額計				(48,431) (0.00)

クレジット・デフォルト・スワップ契約

銘柄名	満期日 通貨	想定元本	評価額 (アメリカ・ドル)
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	2,200,000	(54,256)
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	(307,654)
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	(63,212)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: Community Health Systems 8.875% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年9月 アメリカ・ドル	2,225,000	9,691
JP Morgan Chase,Protection sold (Relevant Credit: Goodyear Tire and Rubber 7% 2028), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2016年12月 アメリカ・ドル	925,000	(46,732)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: Alcatel-Lucent USA 6.5% 2028), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年3月 アメリカ・ドル	1,525,000	899
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: First Data Corp. 9.875% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2015年3月 アメリカ・ドル	3,275,000	(117,906)
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: First Data Corp. 9.875% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2015年3月 アメリカ・ドル	775,000	(27,901)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: Ford Motor 6.5% 2018), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年9月 アメリカ・ドル	5,400,000	260,679
Goldman Sachs,Protection sold (Relevant Credit:International Lease Finance Corp. 8.25% 2020), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年3月 アメリカ・ドル	2,400,000	49,162
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: Caesars Entertainment Operating 5.625% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	5,500,000	(179,748)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: AK Steel Corp. 7.625% 2020), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2017年3月 アメリカ・ドル	525,000	(102,845)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: AK Steel Corp. 7.625% 2020), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2017年6月 アメリカ・ドル	1,575,000	(323,883)
Goldman Sachs,Protection sold (Relevant Credit: Radioshack Corp. 6.75% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	2,900,000	(51,521)
Barclays,Protection sold (Relevant Credit: Radio Shack Corp. 6.75% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	3,850,000	(68,399)

JP Morgan Chase,Protection sold (Relevant Credit: Sprint Nextel Corporation 6% 2016), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	1,200,000	32,377
Goldman Sachs,Protection sold (Relevant Credit: International Lease Finance Corp. 8.25% 2020), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	2,400,000	64,780
JP Morgan Chase,Protection sold (Relevant Credit: Realogy Corp. 11.5% 2017), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	6,200,000	(21,338)
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: Univision Communications 8.5% 2021), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2017年6月 アメリカ・ドル	1,225,000	(93,369)
Barclays Bank,Protection sold (Relevant Credit: Cable and Wireless Ltd 8.625% 2019), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2017年6月 ユーロ	1,500,000	(115,863)
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: General Motors), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	6,000,000	216,215
JP Morgan Chase,Protection sold (Relevant Credit: Ford Motor 6.5% 2018), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2017年6月 アメリカ・ドル	1,525,000	151,578
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: Rite Aid Corp. 7.7% 2027), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2012年9月 アメリカ・ドル	3,000,000	16,543
Deutsche Bank,Protection bought (Relevant Credit: MGIC Investment Corp. 5.375% 2015), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2012年12月 アメリカ・ドル	1,200,000	69,613
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: Radian Group 5.375% 2015), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2012年12月 アメリカ・ドル	1,200,000	(109,834)
Deutsche Bank,Protection sold (Relevant Credit: MBIA Insurance Corp), Receive 5.00%, Payment upon credit default	2012年12月 アメリカ・ドル	2,275,000	(157,790)
Morgan Stanley,Protection sold (Relevant Credit: SLM Corp. 6.25% 2016), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年6月 アメリカ・ドル	1,350,000	41,555
Goldman Sachs,Protection bought (Relevant Credit: TRW Automotive 7.25% 2017), Pay 1.00%, Payment upon credit default	2017年9月 アメリカ・ドル	2,250,000	226,048
スワップ契約評価額 計			(703,111)
その他資産（負債控除後）			115,179,896 5.87
純資産			1,963,812,804 100.00

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。

com stk: common stock

CV: convertible bond

BKNT: Bank Notes

EMTN: Euro Medium Term Note

GMTN: Global Medium Term Note

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、当財務諸表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

2012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				
ベルギー				
Delhaize Group 6.5%/2017	アメリカ・ドル	140,000	155,716	0.12
ベルギー 計			155,716	0.12
バミューダ				
Weatherford International 4.5%/2022	アメリカ・ドル	30,000	30,807	0.02
Weatherford International 6.75%/2040	アメリカ・ドル	210,000	236,495	0.19
バミューダ 計			267,302	0.21
ブラジル				
Brazilian Government International Bond 11%/2040	アメリカ・ドル	230,000	297,276	0.24
Centrais Eletricas Brasileiras Ser144A 5.75%/2021	アメリカ・ドル	205,000	225,090	0.18
ブラジル 計			522,366	0.42
カナダ				
Canadian National Railway 2.85%/2021	アメリカ・ドル	60,000	62,192	0.05
Canadian Natural Resources 6.25%/2038	アメリカ・ドル	200,000	245,879	0.20
Province of Manitoba Canada 1.3%/2017	アメリカ・ドル	275,000	279,247	0.22
Province of Ontario Canada 1.6%/2016	アメリカ・ドル	415,000	422,907	0.34
Talisman Energy 3.75%/2021	アメリカ・ドル	200,000	200,798	0.16
カナダ 計			1,211,023	0.97
ケイマン諸島				
Noble Holding International 5.25%/2042	アメリカ・ドル	230,000	228,872	0.18
Petrobras International Finance 5.75%/2020	アメリカ・ドル	130,000	142,854	0.11
Petrobras International Finance 7.875%/2019	アメリカ・ドル	150,000	183,202	0.15
Transocean 5.05%/2016	アメリカ・ドル	100,000	108,573	0.09
ケイマン諸島 計			663,501	0.53
チリ				
Chilean Government International Bond 3.875%/2020	アメリカ・ドル	155,000	172,825	0.14
チリ 計			172,825	0.14
ジャージー				
BAA Funding Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	180,000	190,296	0.15
ジャージー 計			190,296	0.15
ルクセンブルグ				
ArcelorMittal 3.75%/2015	アメリカ・ドル	75,000	76,074	0.06
ArcelorMittal 3.75%/2016	アメリカ・ドル	75,000	74,547	0.06
ArcelorMittal 4.5%/2017	アメリカ・ドル	130,000	128,145	0.10
ArcelorMittal 5.375%/2013	アメリカ・ドル	260,000	267,460	0.21
Gazprom Via Gaz Capital Ser144A 4.95%/2016	アメリカ・ドル	200,000	208,098	0.17
Telecom Italia Capital 5.25%/2013	アメリカ・ドル	330,000	331,650	0.27
ルクセンブルグ 計			1,085,974	0.87
メキシコ				
America Movil 2.375%/2016	アメリカ・ドル	200,000	206,180	0.17
America Movil 5.625%/2017	アメリカ・ドル	130,000	153,489	0.12
メキシコ 計			359,669	0.29
オランダ				
EDP Finance Ser144A 5.375%/2012	アメリカ・ドル	145,000	145,457	0.12

オランダ 計			145,457	0.12
ペルー				
Peruvian Government International Bond 7.125%/2019	アメリカ・ドル	195,000	251,550	0.20
ペルー 計			251,550	0.20
ポーランド				
Polish Government International Bond 3.875%/2015	アメリカ・ドル	265,000	280,781	0.23
ポーランド 計			280,781	0.23
南アフリカ				
South African Government International Bond 5.5%/2020	アメリカ・ドル	295,000	341,463	0.28
South African Government International Bond 6.5%/2014	アメリカ・ドル	160,000	176,480	0.14
南アフリカ 計			517,943	0.42
韓国				
Korea Hydro & Nuclear Power Ser144A 3.125%/2015	アメリカ・ドル	200,000	204,852	0.16
韓国 計			204,852	0.16
スペイン				
Telefonica Emisiones 6.221%/2017	アメリカ・ドル	145,000	136,268	0.11
スペイン 計			136,268	0.11
スウェーデン				
Svensk Exportkredit 5.125%/2017	アメリカ・ドル	350,000	402,996	0.32
スウェーデン 計			402,996	0.32
イギリス				
Barclays Bank 6.75%/2019	アメリカ・ドル	255,000	297,887	0.24
HSBC Holdings 5.1%/2021	アメリカ・ドル	260,000	290,796	0.23
Royal Bank of Scotland Ser2 3.4%/2013	アメリカ・ドル	325,000	328,457	0.26
イギリス 計			917,140	0.73
アメリカ				
Advance Auto Parts 5.75%/2020	アメリカ・ドル	85,000	96,212	0.08
Allegheny Technologies 5.95%/2021	アメリカ・ドル	250,000	276,647	0.22
Altria Group 4.75%/2021	アメリカ・ドル	140,000	159,057	0.13
Altria Group 9.25%/2019	アメリカ・ドル	215,000	299,112	0.24
American International Group 4.875%/2022	アメリカ・ドル	50,000	51,261	0.04
American International Group 6.4%/2020	アメリカ・ドル	35,000	39,667	0.03
American International Group SerMTN 5.85%/2018	アメリカ・ドル	80,000	88,653	0.07
American Tower 4.7%/2022	アメリカ・ドル	240,000	246,859	0.20
Ameriprise Financial 7.3%/2019	アメリカ・ドル	140,000	175,042	0.14
Anadarko Petroleum 6.375%/2017	アメリカ・ドル	185,000	215,144	0.17
AT&T 5.55%/2041	アメリカ・ドル	170,000	203,425	0.16
Bank of America 5.75%/2016	アメリカ・ドル	145,000	150,920	0.12
Barrick North America Finance 5.7%/2041	アメリカ・ドル	230,000	260,909	0.21
Buckeye Partners 5.5%/2019	アメリカ・ドル	220,000	231,405	0.19
Buckeye Partners 6.05%/2018	アメリカ・ドル	165,000	179,526	0.14
Bunge Finance 3.2%/2017	アメリカ・ドル	65,000	65,218	0.05
Bunge NA Finance 5.9%/2017	アメリカ・ドル	205,000	229,568	0.18
Burlington Northern Santa Fe 5.4%/2041	アメリカ・ドル	105,000	120,529	0.10
Capital One Financial 2.15%/2015	アメリカ・ドル	125,000	126,057	0.10
Capital One Financial 7.375%/2014	アメリカ・ドル	155,000	170,346	0.14
Citigroup 4.587%/2015	アメリカ・ドル	360,000	376,887	0.30
CNA Financial 5.875%/2020	アメリカ・ドル	215,000	236,811	0.19
Dow Chemical 4.25%/2020	アメリカ・ドル	240,000	261,291	0.21
El Paso Natural Gas 5.95%/2017	アメリカ・ドル	110,000	124,737	0.10
Enbridge Energy Partners 5.2%/2020	アメリカ・ドル	55,000	62,427	0.05
Enbridge Energy Partners 5.5%/2040	アメリカ・ドル	70,000	76,015	0.06
Energizer Holdings 4.7%/2022	アメリカ・ドル	155,000	162,041	0.13

Energy Transfer Partners 5.2%/2022	アメリカ・ドル	185,000	198,487	0.16
Enterprise Products Operating 7.55%/2038	アメリカ・ドル	115,000	148,179	0.12
EQT 4.875%/2021	アメリカ・ドル	275,000	281,420	0.23
Exelon Generation 6.25%/2039	アメリカ・ドル	225,000	244,558	0.20
Federal National Mortgage Association 4.375%/2015	アメリカ・ドル	300,000	336,989	0.27
Federal Realty Investment Trust 5.9%/2020	アメリカ・ドル	30,000	34,328	0.03
FHLMC (Gold) Pool A27886 6%/2034	アメリカ・ドル	749,318	834,393	0.67
FHLMC (Gold) Pool A90053 4.5%/2039	アメリカ・ドル	137,536	149,700	0.12
FHLMC (Gold) Pool A91947 5%/2040	アメリカ・ドル	48,831	53,092	0.04
FHLMC (Gold) Pool A92240 4.5%/2040	アメリカ・ドル	9,158	9,799	0.01
FHLMC (Gold) Pool A93101 5%/2040	アメリカ・ドル	250,630	270,200	0.22
FHLMC (Gold) Pool A93451 4.5%/2040	アメリカ・ドル	552,282	590,945	0.47
FHLMC (Gold) Pool A94184 4%/2040	アメリカ・ドル	9,920	10,543	0.01
FHLMC (Gold) Pool A94185 4%/2040	アメリカ・ドル	4,113	4,372	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94250 4%/2040	アメリカ・ドル	1,815	1,929	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94251 4%/2040	アメリカ・ドル	4,504	4,788	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94381 4%/2040	アメリカ・ドル	6,107	6,491	0.01
FHLMC (Gold) Pool A94576 4%/2040	アメリカ・ドル	2,521	2,679	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94617 4%/2040	アメリカ・ドル	2,778	2,952	0.00
FHLMC (Gold) Pool A95734 4%/2040	アメリカ・ドル	31,034	33,421	0.03
FHLMC (Gold) Pool C01787 6%/2034	アメリカ・ドル	163,474	183,315	0.15
FHLMC (Gold) Pool E01341 5.5%/2018	アメリカ・ドル	40,917	44,288	0.04
FHLMC (Gold) Pool E01497 5.5%/2018	アメリカ・ドル	10,339	11,200	0.01
FHLMC (Gold) Pool G04814 5.5%/2038	アメリカ・ドル	2,752,720	2,995,748	2.40
FHLMC (Gold) Pool G05659 4.5%/2039	アメリカ・ドル	734,289	784,656	0.63
FHLMC (Gold) Pool G05695 4.5%/2039	アメリカ・ドル	985,709	1,053,482	0.84
FHLMC (Gold) Pool G05955 5%/2040	アメリカ・ドル	500,659	542,474	0.43
FHLMC (Gold) Pool G05958 5%/2040	アメリカ・ドル	1,271,171	1,382,110	1.11
FHLMC (Gold) Pool G06023 4%/2040	アメリカ・ドル	106,549	113,247	0.09
FHLMC (Gold) Pool G08016 6%/2034	アメリカ・ドル	1,072,439	1,188,194	0.95
FHLMC (Gold) Pool G08421 4%/2040	アメリカ・ドル	11,614	12,344	0.01
FHLMC (Gold) Pool G08477 3.5%/2042	アメリカ・ドル	823,478	865,113	0.69
FHLMC (Gold) Pool J03640 6%/2021	アメリカ・ドル	107,276	117,880	0.09
FHLMC (Gold) Pool J15840 4%/2026	アメリカ・ドル	202,682	214,634	0.17
FHLMC Pool 1B3203 VR 2.705%/2037	アメリカ・ドル	56,565	60,171	0.05
FHLMC Pool 1G1762 VR 4.996%/2035	アメリカ・ドル	120,504	128,522	0.10
FHLMC Pool 1H1218 VR 2.472%/2034	アメリカ・ドル	484	514	0.00
FHLMC Pool 1J0248 VR 2.784%/2037	アメリカ・ドル	94,601	101,226	0.08
FirstEnergy SerC 7.375% /2031	アメリカ・ドル	250,000	314,703	0.25
FNMA 7.125%/2030	アメリカ・ドル	100,000	157,186	0.13
FNMA Pool 190360 5%/2035	アメリカ・ドル	1,242,094	1,344,760	1.08
FNMA Pool 190370 6%/2036	アメリカ・ドル	367,687	405,248	0.32
FNMA Pool 190404 4.5%/2040	アメリカ・ドル	201,042	216,435	0.17
FNMA Pool 254140 5.5%/2017	アメリカ・ドル	36,069	39,201	0.03
FNMA Pool 256232 5.5%/2036	アメリカ・ドル	187,211	204,558	0.16
FNMA Pool 555526 5.5%/2018	アメリカ・ドル	31,783	34,642	0.03
FNMA Pool 569097 6.5%/2016	アメリカ・ドル	45,313	48,652	0.04
FNMA Pool 670373 6.5%/2017	アメリカ・ドル	89,449	96,041	0.08
FNMA Pool 725238 5%/2034	アメリカ・ドル	125,220	136,280	0.11
FNMA Pool 735318 4.5%/2019	アメリカ・ドル	112,105	120,677	0.10
FNMA Pool 735500 5.5%/2035	アメリカ・ドル	85,927	94,266	0.08
FNMA Pool 735575 5.5%/2018	アメリカ・ドル	37,374	40,620	0.03
FNMA Pool 735997 5.5%/2035	アメリカ・ドル	86,592	94,994	0.08
FNMA Pool 745336 5%/2036	アメリカ・ドル	249,758	271,656	0.22
FNMA Pool 745453 5.5%/2021	アメリカ・ドル	103,516	113,411	0.09
FNMA Pool 745458 6%/2036	アメリカ・ドル	1,682	1,854	0.00
FNMA Pool 745516 5.5%/2036	アメリカ・ドル	805,606	883,779	0.71
FNMA Pool 745947 6.5%/2036	アメリカ・ドル	29,704	33,541	0.03
FNMA Pool 750412 6.5%/2033	アメリカ・ドル	150,960	172,820	0.14
FNMA Pool 750911 5%/2018	アメリカ・ドル	360,214	390,073	0.31
FNMA Pool 763199 VR 2.111%/2033	アメリカ・ドル	35,742	37,476	0.03
FNMA Pool 764852 5%/2019	アメリカ・ドル	264,161	286,058	0.23
FNMA Pool 831811 6%/2036	アメリカ・ドル	123,666	137,172	0.11
FNMA Pool 842123 5.5%/2035	アメリカ・ドル	96,746	106,134	0.08

FNMA Pool 848522 VR 5.298%/2035	アメリカ・ドル	42,935	45,938	0.04
FNMA Pool 886923 6%/2036	アメリカ・ドル	10,711	11,805	0.01
FNMA Pool 888223 5.5%/2036	アメリカ・ドル	90,821	99,804	0.08
FNMA Pool 888485 4.5%/2037	アメリカ・ドル	115,801	124,450	0.10
FNMA Pool 888608 6%/2037	アメリカ・ドル	12,050	13,281	0.01
FNMA Pool 888893 5.5%/2037	アメリカ・ドル	274,072	300,667	0.24
FNMA Pool 889174 5.5%/2037	アメリカ・ドル	43,227	47,503	0.04
FNMA Pool 889307 5%/2037	アメリカ・ドル	369,421	402,049	0.32
FNMA Pool 889506 6%/2037	アメリカ・ドル	9,765	10,805	0.01
FNMA Pool 889829 5%/2035	アメリカ・ドル	713,325	787,252	0.63
FNMA Pool 900724 5.5%/2021	アメリカ・ドル	22,826	24,965	0.02
FNMA Pool 901646 6.5%/2036	アメリカ・ドル	14,240	16,080	0.01
FNMA Pool 902382 6.5%/2036	アメリカ・ドル	52,427	59,385	0.05
FNMA Pool 905743 6.5%/2036	アメリカ・ドル	52,629	59,806	0.05
FNMA Pool 906064 6%/2037	アメリカ・ドル	5,079	5,597	0.00
FNMA Pool 923129 5.5%/2034	アメリカ・ドル	46,262	50,838	0.04
FNMA Pool 929836 6%/2038	アメリカ・ドル	178,989	199,623	0.16
FNMA Pool 929848 6%/2038	アメリカ・ドル	162,704	181,460	0.15
FNMA Pool 933051 6.5%/2037	アメリカ・ドル	85,989	97,124	0.08
FNMA Pool 942477 6%/2022	アメリカ・ドル	9,738	10,708	0.01
FNMA Pool 948410 6%/2022	アメリカ・ドル	14,458	15,899	0.01
FNMA Pool 949782 VR 5.182%/2037	アメリカ・ドル	147,372	158,378	0.13
FNMA Pool 952354 6.5%/2037	アメリカ・ドル	41,000	46,297	0.04
FNMA Pool 952502 6.5%/2037	アメリカ・ドル	87,897	99,883	0.08
FNMA Pool 953221 6%/2037	アメリカ・ドル	30,833	33,983	0.03
FNMA Pool 965051 6%/2038	アメリカ・ドル	33,854	37,676	0.03
FNMA Pool 995051 6%/2037	アメリカ・ドル	1,081,655	1,196,884	0.96
FNMA Pool 995203 5%/2035	アメリカ・ドル	307,799	335,741	0.27
FNMA Pool 995388 5.5%/2037	アメリカ・ドル	56,497	61,979	0.05
FNMA Pool AB1479 5%/2040	アメリカ・ドル	121,973	132,670	0.11
FNMA Pool AB1545 4.5%/2040	アメリカ・ドル	569,791	613,419	0.49
FNMA Pool AB2071 3.5%/2041	アメリカ・ドル	346,650	364,578	0.29
FNMA Pool AB2527 4%/2041	アメリカ・ドル	592,730	631,350	0.51
FNMA Pool AB5256 3.5%/2042	アメリカ・ドル	369,072	388,160	0.31
FNMA Pool AC5413 4.5%/2024	アメリカ・ドル	581,487	623,372	0.50
FNMA Pool AC9582 5.5%/2040	アメリカ・ドル	207,955	229,234	0.18
FNMA Pool AD3125 4.5%/2040	アメリカ・ドル	1,987,878	2,140,085	1.71
FNMA Pool AD7151 4%/2025	アメリカ・ドル	184,921	196,681	0.16
FNMA Pool AE0949 4%/2041	アメリカ・ドル	457,123	487,430	0.39
FNMA Pool AE3884 4.5%/2040	アメリカ・ドル	809,449	871,426	0.70
FNMA Pool AE4629 4%/2040	アメリカ・ドル	368,522	392,955	0.32
FNMA Pool AE4834 5%/2040	アメリカ・ドル	236,050	257,510	0.21
FNMA Pool AE4889 4%/2040	アメリカ・ドル	17,474	18,632	0.01
FNMA Pool AE5471 4.5%/2040	アメリカ・ドル	430,434	463,391	0.37
FNMA Pool AE6438 5%/2040	アメリカ・ドル	293,154	318,864	0.26
FNMA Pool AE7909 4.5%/2040	アメリカ・ドル	34,300	36,926	0.03
FNMA Pool AE9765 4%/2040	アメリカ・ドル	344,043	366,852	0.29
FNMA Pool AH1059 4%/2025	アメリカ・ドル	446,026	474,768	0.38
FNMA Pool AH1111 4%/2040	アメリカ・ドル	1,804,266	1,923,886	1.54
FNMA Pool AH3623 4%/2026	アメリカ・ドル	383,153	407,519	0.33
FNMA Pool AI2346 4%/2026	アメリカ・ドル	124,523	132,442	0.11
FNMA Pool AJ2340 4%/2026	アメリカ・ドル	62,333	66,297	0.05
FNMA Pool AJ6089 3.5%/2041	アメリカ・ドル	138,332	145,590	0.12
FNMA Pool AJ6110 4%/2041	アメリカ・ドル	342,176	364,471	0.29
FNMA Pool AJ7680 3.5%/2041	アメリカ・ドル	1,209,326	1,271,871	1.02
FNMA Pool AJ8067 4%/2041	アメリカ・ドル	594,234	632,952	0.51
FNMA Pool AJ9774 4%/2042	アメリカ・ドル	86,592	92,234	0.07
FNMA Pool AK0685 4%/2042	アメリカ・ドル	447,458	476,612	0.38
FNMA Pool AL0160 4.5%/2041	アメリカ・ドル	1,096,085	1,176,408	0.94
FNMA Pool AL0546 5%/2041	アメリカ・ドル	552,693	603,069	0.48
FNMA Pool AL1105 4.5%/2040	アメリカ・ドル	1,097,424	1,181,451	0.95
FNMA Pool AL1408 3.5%/2027	アメリカ・ドル	137,066	144,883	0.12
FNMA Pool AL1524 4.5%/2040	アメリカ・ドル	288,106	310,165	0.25
FNMA Pool A07977 3%/2027	アメリカ・ドル	840,000	881,606	0.71

FNMA Pool MA0907 4%/2041	アメリカ・ドル	471,159	501,858	0.40
FNMA Pool MA0971 4%/2042	アメリカ・ドル	1,062,165	1,131,372	0.91
Ford Motor Credit 5.75%/2021	アメリカ・ドル	600,000	660,599	0.53
GATX 3.5%/2016	アメリカ・ドル	110,000	112,930	0.09
GATX 4.85%/2021	アメリカ・ドル	150,000	153,977	0.12
General Electric Capital 5.3%/2021	アメリカ・ドル	220,000	247,356	0.20
General Electric Capital SerMTN 5.875%/2038	アメリカ・ドル	285,000	328,328	0.26
GNMA 2010-92 PI 4.5%/2037	アメリカ・ドル	477,612	63,923	0.05
GNMA 2011-41 AI 4.5%/2039	アメリカ・ドル	638,581	105,613	0.08
GNMA 2011-88 EI 4.5%/2039	アメリカ・ドル	113,102	17,936	0.01
GNMA I Pool 605561 5.5%/2034	アメリカ・ドル	146,858	165,549	0.13
GNMA I Pool 616826 5.5%/2035	アメリカ・ドル	25,153	28,354	0.02
GNMA II Pool 3306 5.5%/2032	アメリカ・ドル	303,450	339,198	0.27
GNMA II Pool 3490 6.5%/2033	アメリカ・ドル	589,291	680,651	0.54
GNMA II Pool 3611 6%/2034	アメリカ・ドル	180,176	203,274	0.16
GNMA II Pool 4060 6%/2037	アメリカ・ドル	29,217	32,777	0.03
GNMA II Pool 4498 6%/2039	アメリカ・ドル	23,759	26,999	0.02
GNMA II Pool 4559 5%/2039	アメリカ・ドル	114,858	126,901	0.10
GNMA II Pool 4854 4.5%/2040	アメリカ・ドル	148,100	163,688	0.13
GNMA II Pool 5258 3.5%/2041	アメリカ・ドル	830,752	889,415	0.71
GNMA II Pool 5331 3.5%/2042	アメリカ・ドル	1,355,314	1,449,975	1.16
Goldman Sachs Group 3.625%/2016	アメリカ・ドル	60,000	60,057	0.05
Goldman Sachs Group 5.75%/2022	アメリカ・ドル	315,000	333,128	0.27
Goldman Sachs Group 7.5%/2019	アメリカ・ドル	200,000	228,383	0.18
Hess 6%/2040	アメリカ・ドル	205,000	228,148	0.18
Hess 8.125%/2019	アメリカ・ドル	85,000	109,557	0.09
Hewlett-Packard 3%/2016	アメリカ・ドル	260,000	267,695	0.21
Hospitality Properties Trust 5.625%/2017	アメリカ・ドル	275,000	293,137	0.23
Hyatt Hotels 3.875%/2016	アメリカ・ドル	290,000	307,519	0.25
International Lease Finance SerMTN 6.625%/2013	アメリカ・ドル	290,000	300,875	0.24
International Paper 4.75%/2022	アメリカ・ドル	330,000	360,894	0.29
Interpublic Group of Companies 4%/2022	アメリカ・ドル	65,000	66,122	0.05
Interpublic Group of Companies 10%/2017	アメリカ・ドル	235,000	266,725	0.21
Jefferies Group 3.875%/2015	アメリカ・ドル	220,000	217,250	0.17
JPMorgan Chase 3.4%/2015	アメリカ・ドル	155,000	160,866	0.13
JPMorgan Chase 4.5%/2022	アメリカ・ドル	270,000	291,417	0.23
JPMorgan Chase Capital XXVII SerAA 7%/2039	アメリカ・ドル	170,000	170,425	0.14
KeyCorp SerMTN 3.75%/2015	アメリカ・ドル	115,000	121,853	0.10
KeyCorp SerMTN 5.1%/2021	アメリカ・ドル	70,000	78,211	0.06
Kilroy Realty 4.8%/2018	アメリカ・ドル	145,000	152,590	0.12
Kinder Morgan Energy Partners 3.95%/2022	アメリカ・ドル	225,000	228,415	0.18
Kinder Morgan Energy Partners 4.15%/2022	アメリカ・ドル	50,000	51,503	0.04
Kroger 5%/2042	アメリカ・ドル	165,000	166,716	0.13
L-3 Communications 4.75%/2020	アメリカ・ドル	235,000	251,074	0.20
Lincoln National 4.85%/2021	アメリカ・ドル	130,000	136,408	0.11
Magellan Midstream Partners 4.25%/2021	アメリカ・ドル	25,000	26,964	0.02
Magellan Midstream Partners 6.55%/2019	アメリカ・ドル	125,000	149,994	0.12
Marriott International 3%/2019	アメリカ・ドル	110,000	111,379	0.09
Merrill Lynch SerMTN 6.875%/2018	アメリカ・ドル	400,000	448,116	0.36
Morgan Stanley 4%/2015	アメリカ・ドル	330,000	328,317	0.26
Morgan Stanley 4.2%/2014	アメリカ・ドル	225,000	224,784	0.18
Morgan Stanley 7.3%/2019	アメリカ・ドル	175,000	189,298	0.15
Murphy Oil 4%/2022	アメリカ・ドル	95,000	96,946	0.08
Nabors Industries 9.25%/2019	アメリカ・ドル	120,000	155,999	0.12
Nisource Finance 5.25%/2043	アメリカ・ドル	65,000	66,158	0.05
Nisource Finance 5.95%/2041	アメリカ・ドル	125,000	140,205	0.11
Nisource Finance 6.25%/2040	アメリカ・ドル	90,000	103,038	0.08
Noble Energy 6%/2041	アメリカ・ドル	120,000	137,518	0.11
NuStar Logistics 4.8%/2020	アメリカ・ドル	230,000	234,732	0.19
Omnicom Group 4.45%/2020	アメリカ・ドル	250,000	270,029	0.22
Omnicom Group 6.25%/2019	アメリカ・ドル	75,000	88,853	0.07
ONEOK 4.25%/2022	アメリカ・ドル	150,000	157,701	0.13
Pioneer Natural Resources 3.95%/2022	アメリカ・ドル	130,000	130,577	0.10
Plains All American Pipeline 5.75%/2020	アメリカ・ドル	250,000	293,532	0.23

PNC Funding 3.3%/2022	アメリカ・ドル	270,000	275,911	0.22
PNC Funding 5.625%/2017	アメリカ・ドル	115,000	128,086	0.10
Principal Financial Group 6.05%/2036	アメリカ・ドル	180,000	203,314	0.16
Principal Financial Group 8.875%/2019	アメリカ・ドル	20,000	25,959	0.02
ProLogis 6.625%/2019	アメリカ・ドル	190,000	221,885	0.18
Provident 7%/2018	アメリカ・ドル	165,000	189,753	0.15
Prudential Financial 5.375%/2020	アメリカ・ドル	175,000	193,969	0.16
Public Service of Oklahoma 5.15%/2019	アメリカ・ドル	135,000	156,425	0.13
Raymond James Financial 4.25%/2016	アメリカ・ドル	50,000	52,039	0.04
Regency Centers 5.875%/2017	アメリカ・ドル	130,000	145,809	0.12
Regions Financial 5.75%/2015	アメリカ・ドル	90,000	94,725	0.08
Reinsurance Group of America 5%/2021	アメリカ・ドル	105,000	109,714	0.09
Reinsurance Group of America 5.625%/2017	アメリカ・ドル	50,000	54,569	0.04
Reinsurance Group of America 6.45%/2019	アメリカ・ドル	70,000	79,477	0.06
Republic Services 3.55%/2022	アメリカ・ドル	105,000	106,356	0.09
Republic Services 5.7%/2041	アメリカ・ドル	215,000	247,563	0.20
Reynolds American 7.625%/2016	アメリカ・ドル	115,000	138,721	0.11
Roper Industries 6.25%/2019	アメリカ・ドル	135,000	160,902	0.13
Southwest Airlines 5.125%/2017	アメリカ・ドル	245,000	269,176	0.22
SunTrust Banks 3.6%/2016	アメリカ・ドル	140,000	145,500	0.12
Time Warner Cable 5.5%/2041	アメリカ・ドル	195,000	212,978	0.17
Tyson Foods 4.5%/2022	アメリカ・ドル	130,000	134,550	0.11
UnitedHealth Group 4.625%/2041	アメリカ・ドル	120,000	129,489	0.10
Unum Group 5.625%/2020	アメリカ・ドル	80,000	86,191	0.07
US Treasury 0.875%/2017	アメリカ・ドル	1,485,000	1,498,110	1.20
US Treasury 2.125%/2021	アメリカ・ドル	395,000	415,244	0.33
US Treasury 2.625%/2014	アメリカ・ドル	185,000	193,744	0.16
US Treasury 2.625%/2016	アメリカ・ドル	9,005,000	9,709,920	7.77
US Treasury 4.625%/2040	アメリカ・ドル	1,435,000	1,985,234	1.59
US Treasury 5.375%/2031	アメリカ・ドル	115,000	167,595	0.13
US Treasury 6.75%/2026	アメリカ・ドル	940,000	1,474,478	1.18
US Treasury Inflation Indexed 1.875%/2013	アメリカ・ドル	1,044,400	1,340,701	1.07
Valmont Industries 6.625%/2020	アメリカ・ドル	150,000	176,290	0.14
Ventas Realty 3.125%/2015	アメリカ・ドル	55,000	56,040	0.05
Ventas Realty 4%/2019	アメリカ・ドル	100,000	102,697	0.08
Western Gas Partners 4%/2022	アメリカ・ドル	145,000	145,297	0.12
Williams Partners 4.125%/2020	アメリカ・ドル	70,000	73,378	0.06
Williams Partners 6.3%/2040	アメリカ・ドル	180,000	213,935	0.17
Xerox 6.35%/2018	アメリカ・ドル	185,000	215,953	0.17
アメリカ 計			83,807,463	67.10
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			91,293,122	73.09
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 2011-1USA A3A Ser144A 1.77%/2014	アメリカ・ドル	226,986	227,828	0.18
SMART Trust 2011-2USA A3A Ser144A 1.54%/2015	アメリカ・ドル	135,000	135,779	0.11
オーストラリア 計			363,607	0.29
バミューダ				
Bermuda Government International Bond Ser 144A 5.603%/2020	アメリカ・ドル	100,000	114,588	0.09
バミューダ 計			114,588	0.09
チリ				
Celulosa Arauco y Constitucion 5%/2021	アメリカ・ドル	60,000	62,235	0.05
Corporación Nacional del Cobre de Chile Ser144A 7.5%/2019	アメリカ・ドル	155,000	197,160	0.16
チリ 計			259,395	0.21
イギリス				
Fosse Master Issuer 2011-1A A2 Ser144A VR 1.866%/2054	アメリカ・ドル	200,000	201,198	0.16

Holmes Master Issuer 2011-3A A2 Ser144A VR 2.017%/2054	アメリカ・ドル	250,000	251,966	0.20
Holmes Master Issuer 2012-1A A2 Ser144A VR 2.117%/2054	アメリカ・ドル	250,000	252,034	0.20
Silverstone Master Issuer 2011-1A 1ASer144A VR 2.016%/2055	アメリカ・ドル	250,000	251,746	0.20
WPP Finance 2010 4.75%/2021	アメリカ・ドル	125,000	131,417	0.11
イギリス 計			1,088,361	0.87
アメリカ				
Ally Auto Receivables Trust 2009-B C Ser144A 4.06%/2016	アメリカ・ドル	575,000	595,241	0.48
American International Group 4.25%/2014	アメリカ・ドル	70,000	72,619	0.06
American Tower Trust 2007-1A D Ser144A 5.957%/2037	アメリカ・ドル	400,000	419,554	0.33
Bank of America 3.875%/2017	アメリカ・ドル	190,000	193,760	0.15
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage 2005-3 A2 4.501%/2043	アメリカ・ドル	214,048	215,086	0.17
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage 2007-5 A4 5.492%/2051	アメリカ・ドル	230,000	263,815	0.21
Bank of America Mortgage Securities 2004-A 2A2 VR 2.966%/2034	アメリカ・ドル	25,272	23,494	0.02
Bank of America Mortgage Securities 2004-B 2A2 VR 3.045%/2034	アメリカ・ドル	175,908	170,572	0.14
Bank of America Mortgage Securities 2004-D 2A2 VR 3.117%/2034	アメリカ・ドル	402,262	372,685	0.30
Bank of America Mortgage Securities 2004-H 2A2 VR 2.763%/2034	アメリカ・ドル	156,533	143,259	0.11
Bank of America Mortgage Securities 2004-I 3A2 VR 2.756%/2034	アメリカ・ドル	76,438	77,544	0.06
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 2A1 VR 2.793%/2035	アメリカ・ドル	893,803	700,900	0.56
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 3A1 VR 5.163%/2035	アメリカ・ドル	194,488	171,473	0.14
Bay Area Toll Authority California 6.263%/2049	アメリカ・ドル	150,000	200,117	0.16
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2002-TOP8 A2 4.83%/2038	アメリカ・ドル	22,138	22,189	0.02
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities 2005-PWR9 AAB 4.804%/2042	アメリカ・ドル	752,600	784,400	0.63
Cabela's Master Credit Card Trust 2012-1A A1 Ser144A 1.63%/2020	アメリカ・ドル	100,000	101,063	0.08
CarMax Auto Owner Trust 2010-2 B 3.96%/2016	アメリカ・ドル	380,000	396,502	0.32
Chicago Illinois Metropolitan Water Reclamation 5.72%/2038	アメリカ・ドル	225,000	284,337	0.23
Chicago Illinois O'Hare International Airport General Third Lien 6.395%/2040	アメリカ・ドル	170,000	215,587	0.17
Chicago Illinois Transit Authority Sales And Taxable-pension Funding Series A 6.899%/2040	アメリカ・ドル	170,000	202,535	0.16
Citigroup/Deutsche Bank Commercial Mortgage Trust 2006-CD3 AAB 5.608%/2048	アメリカ・ドル	1,453,770	1,499,176	1.20
City of Houston Texas 5%/2023	アメリカ・ドル	105,000	128,807	0.10
City of Houston Texas 5%/2024	アメリカ・ドル	100,000	120,753	0.10
City of Los Angeles Department of Airports 7.053%/2040	アメリカ・ドル	185,000	244,457	0.19
City of San Antonio Texas 5%/2023	アメリカ・ドル	125,000	156,246	0.13
Comcast 3.125%/2022	アメリカ・ドル	95,000	95,652	0.08
Comcast 6.95%/2037	アメリカ・ドル	185,000	238,411	0.19
Commonwealth of Massachusetts 4.5%/2031	アメリカ・ドル	160,000	174,424	0.14
Commonwealth of Massachusetts 5%/2025	アメリカ・ドル	100,000	118,145	0.09
Commonwealth of Massachusetts 5.25%/2024	アメリカ・ドル	115,000	148,529	0.12
Commonwealth of Pennsylvania 5%/2024	アメリカ・ドル	240,000	293,059	0.23
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	90,175	101,672	0.08
Continental Airlines 2010-1 Class A Pass Through Trust SerA 4.75%/2021	アメリカ・ドル	68,652	71,913	0.06
Continental Airlines 2012-1 Class A Pass Thru Trust SerA 4.15%/2024	アメリカ・ドル	45,000	44,213	0.04

Delta Air Lines 2010-2 Class A Pass Through Trust Ser2A 4.95%/2019	アメリカ・ドル	64,135	68,144	0.05
Delta Air Lines 2011-1 Class A Pass Through Trust SerA 5.3%/2019	アメリカ・ドル	60,509	64,594	0.05
DIRECTV Holdings 2.4%/2017	アメリカ・ドル	135,000	136,039	0.11
DIRECTV Holdings 5.875%/2019	アメリカ・ドル	105,000	120,638	0.10
District of Columbia 5.25%/2034	アメリカ・ドル	170,000	195,469	0.16
District of Columbia 5.591%/2034	アメリカ・ドル	60,000	75,069	0.06
Dominos Pizza Master Issuer 2012-1A A2 Ser144A 5.216%/2042	アメリカ・ドル	597,750	624,632	0.50
East Bay Municipal Utility District 5.874%/2040	アメリカ・ドル	220,000	293,249	0.23
Express Scripts Holding 3.125%/2016	アメリカ・ドル	265,000	276,161	0.22
Fifth Third Bancorp 3.5%/2022	アメリカ・ドル	90,000	91,136	0.07
Fifth Third Bancorp 3.625%/2016	アメリカ・ドル	80,000	84,451	0.07
Fifth Third Bancorp 8.25%/2038	アメリカ・ドル	150,000	204,216	0.16
Fiserv 3.125%/2016	アメリカ・ドル	80,000	82,548	0.07
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust 2010-3 C Ser144A 4.99%/2017	アメリカ・ドル	590,000	632,548	0.51
Greenwich Capital Commercial Funding 2005-GG3 AAB 4.619%/2042	アメリカ・ドル	639,500	653,267	0.52
Huntington Auto Trust 2011-1A C Ser144A 2.53%/2017	アメリカ・ドル	155,000	158,113	0.13
Hyundai Auto Lease Securitization Trust 2011-A 2012-A A4 Ser144A 1.05%/2017	アメリカ・ドル	100,000	100,094	0.08
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2005-LDP4 ASB VR 4.824%/2042	アメリカ・ドル	736,441	765,433	0.61
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-CB15 A4 VR 5.814%/2043	アメリカ・ドル	760,000	851,061	0.68
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-LDP9 A3 5.336%/2047	アメリカ・ドル	160,000	177,698	0.14
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-C1 A4 5.716%/2051	アメリカ・ドル	370,000	420,462	0.34
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2011-C3 B Ser144A VR 5.013%/2046	アメリカ・ドル	185,000	197,526	0.16
Kansas Development Finance Authority 5.501%/2034	アメリカ・ドル	200,000	232,496	0.19
Kilroy Realty 6.625%/2020	アメリカ・ドル	90,000	102,696	0.08
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007-C2 A3 5.43%/2040	アメリカ・ドル	390,000	437,148	0.35
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008-C1 AM VR 6.314%/2041	アメリカ・ドル	40,000	42,266	0.03
Life Technologies 3.5%/2016	アメリカ・ドル	175,000	182,342	0.15
Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-1A A Ser144A 5.737%/2028	アメリカ・ドル	221,083	224,311	0.18
Marriott Vacation Club Owner Trust 2006-2A A Ser144A 5.362%/2028	アメリカ・ドル	62,049	62,912	0.05
Maryland State Transportation Authority 5.754%/2041	アメリカ・ドル	400,000	509,872	0.41
Maryland State Transportation Authority 5.888%/2043	アメリカ・ドル	165,000	214,376	0.17
Merrill Lynch Mortgage Trust 2006-C2 AM VR 5.782%/2043	アメリカ・ドル	135,000	140,938	0.11
Metropolitan Transportation Authority New York Taxable Series C-build America Bds- 7.336%/2039	アメリカ・ドル	80,000	117,163	0.09
NBCUniversal Media 5.15%/2020	アメリカ・ドル	115,000	132,244	0.11
Nevada Power SerN 6.65%/2036	アメリカ・ドル	135,000	182,338	0.15
New York City Housing Development Taxable Series A 6.42%/2027	アメリカ・ドル	122,825	129,910	0.10
New York City Municipal Water Finance Taxable Series Dd 5.952%/2042	アメリカ・ドル	120,000	157,900	0.13
New York City Taxable Series H1-build America Bds-5.846%/2040	アメリカ・ドル	100,000	123,892	0.10
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5%/2024	アメリカ・ドル	60,000	72,458	0.06
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5%/2025	アメリカ・ドル	60,000	70,849	0.06
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5.508%/2037	アメリカ・ドル	270,000	327,807	0.26
News America 6.15%/2037	アメリカ・ドル	260,000	295,578	0.24
Nordstrom Private Label Credit Card Master Note Trust 2011-1A A Ser144A 2.28%/2019	アメリカ・ドル	385,000	398,560	0.32

O'Reilly Automotive 4.875%/2021	アメリカ・ドル	175,000	188,449	0.15
PSE&G Transition Funding 2001-1 A6 6.61%/2015	アメリカ・ドル	235,452	243,635	0.20
Regional Transportation District 5%/2038	アメリカ・ドル	165,000	184,369	0.15
San Diego County Water Authority 6.138%/2049	アメリカ・ドル	125,000	165,605	0.13
Sequoia Mortgage Trust 2010-H1 A1 VR 3.75%/2040	アメリカ・ドル	29,124	29,658	0.02
SLM SerMTN 6%/2017	アメリカ・ドル	225,000	233,556	0.19
SLM SerMTN 8.45%/2018	アメリカ・ドル	200,000	225,000	0.18
State of Florida Lottery Revenue 5%/2020	アメリカ・ドル	440,000	537,011	0.43
State of Washington 5%/2025	アメリカ・ドル	90,000	108,630	0.09
Texas Transportation Commission St Highway Fund Taxable-first Tier Series B 5.178%/2030	アメリカ・ドル	130,000	157,261	0.13
Tompkins County Industrial Development Agency 5%/2037	アメリカ・ドル	170,000	192,702	0.15
UnionBanCal 3.5%/2022	アメリカ・ドル	20,000	20,243	0.02
University of Virginia 5%/2040	アメリカ・ドル	400,000	485,680	0.39
Utah Transit Authority Sales Tax Revenue Series B 5.937%/2039	アメリカ・ドル	360,000	471,874	0.38
Verisk Analytics 5.8%/2021	アメリカ・ドル	115,000	128,576	0.10
Virginia Commonwealth Transportation Board Taxable Capital Projects Series A-2 5.35%/2035	アメリカ・ドル	45,000	54,572	0.04
Virginia Public Building Authority 5.9%/2030	アメリカ・ドル	100,000	129,013	0.10
Virginia Public School Authority 5%/2023	アメリカ・ドル	150,000	185,464	0.15
Volkswagen Auto Lease Trust 2012-A A4 1.06%/2017	アメリカ・ドル	160,000	160,150	0.13
Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust 2005-AR2 2A2 VR 2.616%/2035	アメリカ・ドル	126,534	117,773	0.09
WF-RBS Commercial Mortgage Trust 2011-C2 B Ser144A VR 5.174%/2044	アメリカ・ドル	350,000	380,959	0.30
Xerox 2.95%/2017	アメリカ・ドル	30,000	30,373	0.02
アメリカ 計			23,923,346	19.15
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			25,749,297	20.61
直前に発行された取引可能な有価証券				
オーストラリア				
Newcrest Finance Pty Ser144A 4.45%/2021	アメリカ・ドル	240,000	246,747	0.20
オーストラリア 計			246,747	0.20
チリ				
Celulosa Arauco y Constitucion Ser144A 4.75%/2022	アメリカ・ドル	95,000	97,592	0.08
チリ 計			97,592	0.08
フランス				
Vivendi Ser144A 3.45%/2018	アメリカ・ドル	205,000	200,997	0.16
フランス 計			200,997	0.16
メキシコ				
Petroleos Mexicanos Ser144A 4.875%/2022	アメリカ・ドル	760,000	822,700	0.66
メキシコ 計			822,700	0.66
ノルウェー				
DNB Bank Ser144A 3.2%/2017	アメリカ・ドル	210,000	212,631	0.17
ノルウェー 計			212,631	0.17
スウェーデン				
Nordea Bank Ser144A 3.125%/2017	アメリカ・ドル	200,000	201,072	0.16
スウェーデン 計			201,072	0.16
アメリカ				
Express Scripts Holding Ser144A 3.9%/2022	アメリカ・ドル	100,000	103,859	0.08
Florida Gas Transmission Ser144A 3.875%/2022	アメリカ・ドル	85,000	85,619	0.07
GTP Acquisition Partners I Ser144A 4.347%/2016	アメリカ・ドル	70,000	73,501	0.06
Gulf South Pipeline Ser144A 4%/2022	アメリカ・ドル	120,000	119,656	0.10
Kraft Foods Group Ser144A 3.5%/2022	アメリカ・ドル	220,000	226,228	0.18

Kraft Foods Group Ser144A 5%/2042	アメリカ・ドル	50,000	53,129	0.04
Oncor Electric Delivery Ser144A 4.55%/2041	アメリカ・ドル	110,000	105,153	0.08
Pernod-Ricard Ser144A 4.45%/2022	アメリカ・ドル	155,000	160,915	0.13
Phillips 66 Ser144A 4.3%/2022	アメリカ・ドル	95,000	100,136	0.08
Phillips 66 Ser144A 5.875%/2042	アメリカ・ドル	80,000	86,433	0.07
アメリカ 計			1,114,629	0.89
直前に発行された取引可能な有価証券 計			2,896,368	2.32
その他の取引可能な有価証券				
フランス				
Banque PSA Finance Ser144A 4.375%/2016	アメリカ・ドル	200,000	196,613	0.16
BPCE Ser144A 2.375%/2013	アメリカ・ドル	205,000	201,758	0.16
Electricité de France Ser144A 6.95%/2039	アメリカ・ドル	210,000	249,529	0.20
RCI Banque Ser144A 4.6%/2016	アメリカ・ドル	190,000	189,364	0.15
フランス 計			837,264	0.67
アイルランド				
Iberdrola Finance Ireland Ser144A 3.8%/2014	アメリカ・ドル	135,000	131,434	0.11
アイルランド 計			131,434	0.11
ルクセンブルグ				
Holcim US Finance Ser144A 6%/2019	アメリカ・ドル	135,000	141,754	0.11
ルクセンブルグ 計			141,754	0.11
スウェーデン				
Nordea Bank Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	290,000	283,059	0.23
スウェーデン 計			283,059	0.23
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	344,760	0.28
トリニダード・トバゴ 計			344,760	0.28
イギリス				
PPL WEM Holdings Ser144A 3.9%/2016	アメリカ・ドル	240,000	251,758	0.20
UnumProvident Finance Ser144A 6.85%/2015	アメリカ・ドル	35,000	39,123	0.03
イギリス 計			290,881	0.23
アメリカ				
Allegheny Energy Supply Ser144A 6.75%/2039	アメリカ・ドル	70,000	73,300	0.06
COX Communications Ser144A 8.375%/2039	アメリカ・ドル	200,000	282,367	0.23
Crown Castle Towers Ser144A 6.113%/2020	アメリカ・ドル	213,000	246,952	0.20
Enogex Ser144A 6.25%/2020	アメリカ・ドル	60,000	67,864	0.05
ERAC USA Finance Ser144A 4.5%/2021	アメリカ・ドル	65,000	69,275	0.05
ERAC USA Finance Ser144A 5.25%/2020	アメリカ・ドル	190,000	211,953	0.17
Massachusetts Electric Ser144A 5.9%/2039	アメリカ・ドル	140,000	178,971	0.14
Reliance Holdings USA Ser144A 4.5%/2020	アメリカ・ドル	250,000	235,344	0.19
アメリカ 計			1,366,026	1.09
その他の取引可能な有価証券 計			3,395,178	2.72
有価証券 計			123,333,965	98.74
為替予約取引				
ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価(損)益 計			261,031	0.21
先物取引				
銘柄名	満期日	契約額 (アメリカ・ドル)	評価(損)益 (アメリカ・ドル)	
Short, 12 five-year US Treasury Note Contracts,\$,773 pledged as initial margin	2012年9月	(1,487,063)	(1,500)	
Short, 41 ten-year US Treasury Note Contracts,\$32243 pledged as initial margin	2012年9月	(5,465,172)	(8,625)	
Long, 3 US Ultra Bond Note Contracts,\$259 pledged as initial margin	2012年9月	501,563	(8,712)	

ヘッジ証券に対する先物取引に係る評価（損）益 計	(18,837)	(0.02)
その他資産（負債控除後）	1,334,171	1.07
純資産	124,910,330	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。

FHLMC: Federal Home Loan Mortgage Corporation

FNMA: Federal National Mortgage Association

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、当財務諸表と不可分のものである。

[前へ](#) [次へ](#)

財務諸表に関する注記

2012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、自己管理型の変動資本投資会社(Soci t  d'Investissement   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成されたオープン・エンド型の投資法人であり、2011年6月30日までは、「2002年12月20日の集団投資事業に関する法律のパートI」に従って認可されており、2011年7月1日以降は、「2010年12月17日の集団投資事業に関する法律のパートII」に従って認可されている。当社は2001年6月5日に設立され、譲渡可能証券の集団投資事業(「UCITS」)としての適格性を有している。

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」)を選択できる仕組みになっている。2012年6月30日に終了した期間において、以下のファンドではそれぞれ下記のシェア・クラスが発行されている。

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
	Z	2001年 6月20日	ユーロ
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	A	2011年 9月20日	ユーロ
	I	2011年 9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
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
	I	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	2009年 6月25日	米ドル
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	A	2001年 8月17日	米ドル
	Ad	2009年 6月 2日	米ドル
	Ah(ユーロ)	2003年 4月 2日	ユーロ
	Ah(ノルウェー・クローネ)	2004年 7月15日	ノルウェー・ クローネ
	Ah(スウェーデン・クローナ)	2012年6月26日	スウェーデン・クローナ
	I	2002年 3月 4日	米ドル
	Jd	2003年12月5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
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

(旧称: エマージング・ヨーロッパ&地中海・エクイティ・ファンド)	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・スモーカー・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・マーケット・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
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
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 (英ポンド)	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
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
USスモーカー・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

2012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・ファンドの投資家にもみ販売されており、クラスI(英ポンド)証券は現在、グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンドの投資家にもみ販売されており、Ih証券はUSアグリゲート・ボンド・ファンドの投資家にもみ販売されている。クラスI、J、SおよびZ証券は、機関投資家向けの投資証券である。クラスId、JdおよびクラスSd証券は、それぞれクラスI証券、クラスJ証券およびクラスS証券の配当型投資証券であり、グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド、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・ファンド及びグローバル・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、2012年4月に新目論見書を承認している。

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、利息を考慮すると公正価値に近似するため、償却原価で評価される。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値に基づき評価される。

財務報告のため、有価証券は2012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、2012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ドルの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	2012年6月30日 現在のレート	2012年6月30日に終了した 期間の平均レート
----	----------------------	-----------------------------

ユーロ	0.7880	0.7707
ノルウェー・クローネ	5.9445	5.8411
スウェーデン・クローナ	6.9024	6.8455

d) 有価証券取引および収益について

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2012年6月30日における各ファンドの主要市場の終了時点を経済的期間として、約定日基準で計上されている。実現損益は、売却有価証券の平均原価に基づいて決定される。

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

現金預金は、一定の信用基準を充足する各種金融機関における翌日物から3カ月物の定期預金の現金残高を含んでいる。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、付随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。

キャッシュ・スイープ・プログラムは、2011年12月21日に終了した。

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、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期間において繰り延べ、償却される場合がある。

3. 投資に係わる取引

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取引は、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、信用力、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。

b) 中国A株

2012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）のみが投資できる株式（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想定しているため、未払税金を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」）取引を行う場合がある。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、2012年6月30日に終了した12ヶ月間におけるポートフォリオの回転率は以下のとおりである。

ファンド名	ポートフォリオ回転率
エマージング・ローカル・マーケット・ボンド・ファンド	142.58
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	108.08
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	122.47*
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	113.15
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	(5.65)
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	133.70
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	214.57
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	36.55
USアグリゲート・ボンド・ファンド	121.72
アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	62.85
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	44.38
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	124.54
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	104.61
ヨーロッパ・スモーカー・カンパニー・エクイティ・ファンド	53.70
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	50.35
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	71.80
グローバル・エクイティ・ファンド	138.61
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	247.78
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	48.59
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	31.70
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	66.34
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	44.97
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	144.01
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	31.28
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	118.48
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	75.61
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	5.25
USスモーカー・カンパニー・エクイティ・ファンド	(13.83)

*2012年6月30日に終了した12ヶ月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、取締役会が決議した頻度および間隔で、帰属する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。

2012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
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Ad	米ドル	0.198207	2012年 3月23日
	Ad	米ドル	0.191528	2012年 6月22日
	Jd	米ドル	0.067163	2012年 1月24日

	Jd	米ドル	0.057910	2012年 2月24日
	Jd	米ドル	0.062701	2012年 3月23日
	Jd	米ドル	0.061279	2012年 4月24日
	Jd	米ドル	0.059433	2012年 5月24日
	Jd	米ドル	0.061805	2012年 6月22日
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	Ad	米ドル	0.030642	2012年 6月22日
	Jd	米ドル	0.014280	2012年 2月24日
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.043216	2012年 5月24日
	Id	米ドル	0.038523	2012年 1月24日
	Id	米ドル	0.034059	2012年 2月24日
	Id	米ドル	0.027494	2012年 3月23日
	Id	米ドル	0.026991	2012年 4月24日
	Id	米ドル	0.025460	2012年 5月24日
	Id	米ドル	0.023883	2012年 6月22日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.037524	2012年 1月24日
	Jd	米ドル	0.034679	2012年 2月24日
	Jd	米ドル	0.033417	2012年 3月23日
	Jd	米ドル	0.036601	2012年 4月24日
	Jd	米ドル	0.033766	2012年 5月24日
	Jd	米ドル	0.031226	2012年 6月22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	0.096043	2012年 1月24日
	Id	米ドル	0.048223	2012年 2月24日
	Id	米ドル	0.056664	2012年 3月23日
	Id	米ドル	0.054349	2012年 4月24日
	Id	米ドル	0.051976	2012年 5月24日
	Id	米ドル	0.049388	2012年 6月22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%まで保管資産の価値によって逓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%までファンドの純資産価値によって逓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

2012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」）が課せられた。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課税対象となっている。外国法人税は収益の減少として計上される。諸外国によって発行された有価証券の処分によって実現したキャピタル・ゲインは、当該国のキャピタル・ゲイン税の課税対象となっている。税額はすべて、適用される外国税法に従って計算され、キャピタル・ロス、許容される最大範囲まで、キャピタル・ゲインを相殺するために使用される。保有期間に応じて税率が変わる場合、その範囲内において、各ファンドについて、適用最低税率を用いた繰延税金負債を計上している。

純キャピタル・ゲインに帰属する当期の税金費用および繰延税金費用は、それぞれ実現損益、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。2012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、インドのキャピタル・ゲインに起因する税額は無い。

2012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	11,885,463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	4,445,209米ドル
グローバル・エクイティ・ファンド	25,453,577米ドル
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	227,707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) 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（以下「運用会社」）及びT・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク、T・ロウ・プライス・ホンコン・リミテッド及びT・ロウ・プライス・シンガポール・プライベート・リミテッド（以下「副投資会社」）により運用されている。当社と運用会社との運用一任契約（「当契約」）においては、年間運用報酬額が定められている。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	1.25%	0.65%
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	0.90%	0.50%
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	1.15%	0.60%
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	1.25%	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・アブソルート・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、S及びZ投資証券には運用報酬はない。

運用会社は、ファンドの販売手数料にあたる報酬（トレイラー・フィー）を運用報酬の一部から支払うことがある。さらに、運用会社は、営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) 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、運用会社は、適切と判断した期間について、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減らすために、受領権限を持つ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運用会社のサービスに対する報酬に関しては、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、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投資可能である。

クラスS投資証券

クラスS投資証券に係わる運用会社のサービスに対する報酬に関しては、運用会社がそれを負担する。クラスS投資証券は、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投資可能である。運用会社は、適切と判断した期間について、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減らすために、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

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、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投資可能である。

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、2012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・債券・ファンド	I	0.75	0.75
ユーロ・コーポレート・債券・ファンド	A	1.07	1.07
	I	0.60	0.60
	Z	-	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・債券・ファンド	A**	1.32	1.32
	I**	0.70	0.70
グローバル・アグリゲート・債券・ファンド	A	1.07	1.07
	I	0.65	0.65
	Id	0.65	0.65
	Z	-	-
グローバル・エマージング・マーケット・債券・ファンド	A	1.42	1.42
	I	0.75	0.75
	Id	0.75	0.75
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・債券・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	0.65	0.65
グローバル・ハイ・イールド・債券・ファンド	A	1.27	1.60
	Ad	1.30	1.60
	Ah (ユーロ)	1.26	1.60
	Ah (ノルウェー・クローネ)	1.27	1.60
	Ah (スウェーデン・クローネ)**	1.40	1.60
	I	0.67	0.96
	Jd	0.04	-
	Z	-	-
USアグリゲート・債券・ファンド	I	0.78	0.78
	Ih (ユーロ)	0.64	0.78
	Jd	0.05	-
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	A	2.03	2.30
	I	1.09	1.20
	S	0.09	0.32
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	2.07	2.07
	I	1.10	1.10
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	1.67	1.67
	I	0.80	0.80
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	I	0.80	0.80
ヨーロッパ・スモーカー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.97	1.97
	I	1.05	1.05
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	0.70	0.70
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	2.04	2.40
	Ad	2.18	2.40
	I	1.09	1.40
	Jd	0.06	-
グローバル・エクイティ・ファンド	A	1.78	2.00
	I	0.85	1.07
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77

	I	0.84	0.85
	I(英ポンド)	0.85	0.85
	S	0.10	0.10
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	A	1.87	2.00
	I	0.84	1.07
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	1.77	1.77
	I	0.85	0.85
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77
	I	0.85	0.85
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	A	2.40	2.40
	I	1.20	1.20
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	A	2.49	2.50
	I	1.30	1.30
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	A	1.72	1.85
	J	0.04	-
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	A	1.67	1.67
	I	0.75	0.75
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	A	1.62	1.85
	I	0.72	0.93
	J	0.03	-
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	A	1.67	1.85
	I	0.74	0.93
	J	0.03	-
USスモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.75	1.95
	I	1.05	1.23

* 総経費率は、2012年6月30日に終了した12ヶ月間に、各クラスが負担した支払報酬および費用から権利放棄された費用を控除した額の当該クラスの平均純資産に対する比率を表す。

** 当該クラスは2012年6月30日に終了した12ヶ月の間に運用が開始された。総経費率は、年率換算されている。

c) 株主等による保有比率

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」)の目的で、ファンドが十分な純資産を有するまで投資を継続することがある。さらに、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。2012年6月30日現在、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	比率
運用会社による保有比率	
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	84%
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	99%
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	58%
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	100%
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	57%
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	92%
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	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	100%
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	1%
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	58%
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	98%
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	17%
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	24%
USラージキャップ・コア・エクイティ・ファンド	100%

関係会社による保有比率

グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	5%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	85%
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%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	6%
USラージキャップ・グロース・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	5%

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成24年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	18,481,696,735 円
負債総額	72,759,899 円
純資産総額 (-)	18,408,936,836 円
発行済数量	29,804,085,101 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.6177 円

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>

(平成24年10月末現在)

日本好配当株マザーファンド

資産総額	24,212,094,327 円
負債総額	120,996,839 円
純資産総額 (-)	24,091,097,488 円
発行済数量	35,822,861,791 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.6725 円

世界REITマザーファンド

資産総額	2,867,874,791 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	2,867,874,791 円
発行済数量	4,790,187,405 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.5987 円

グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	124,067,175,390 円
負債総額	138,721,144 円
純資産総額 (-)	123,928,454,246 円
発行済数量	128,283,666,231 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.9661 円

新興国債券マザーファンド

資産総額	13,184,928,874 円
負債総額	3,568,512 円
純資産総額 (-)	13,181,360,362 円
発行済数量	10,085,938,206 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.3069 円

欧州債券マザーファンド

資産総額	1,773,691,548 円
負債総額	10,534,140 円
純資産総額 (-)	1,763,157,408 円
発行済数量	2,125,589,801 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.8295 円

アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	1,830,861,988 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	1,830,861,988 円
発行済数量	1,786,690,616 口
1 単位当り純資産額 (/)	1.0247 円

コモディティ・マザーファンド

資産総額	932,660,529 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	932,660,529 円
発行済数量	1,544,987,942 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.6037 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24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。

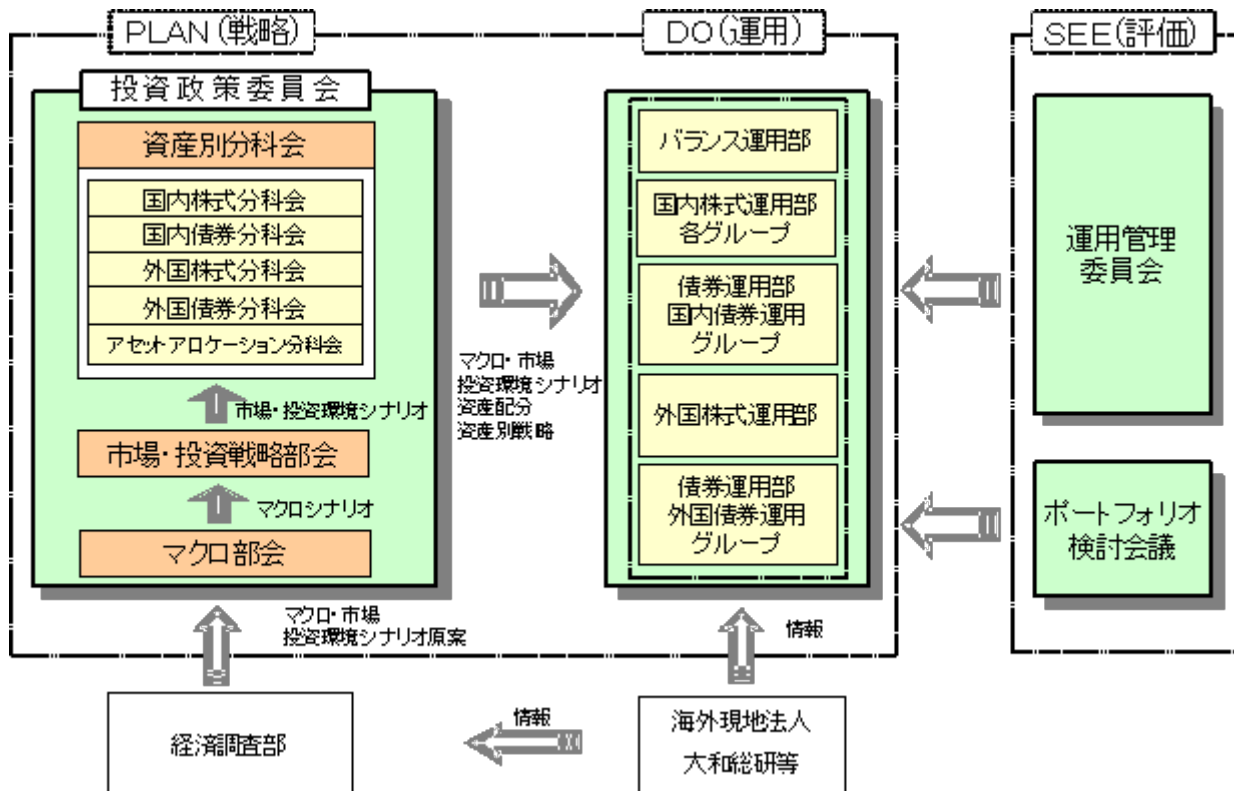
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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24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、158本であり、その純資産総額は、約2,608,553百万円です（なお、親投資信託53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	4	90,166百万円
追加型株式投資信託	152	2,514,969百万円
単位型公社債投資信託	1	2,500百万円
追加型公社債投資信託	1	917百万円
合計	158	2,608,553百万円

[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。）並びに同規則第2条の規定に基づいて、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）により作成しております。
- 2 . 財務諸表の記載金額は、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40期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31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△](#)

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

		第39期 (平成23年3月31日)	第40期 (平成24年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		13,597,002	15,886,867
前払費用		167,271	176,593
未収委託者報酬		2,467,550	2,348,724
未収運用受託報酬		939,007	830,844
未収収益		32,023	24,384
繰延税金資産		503,471	485,508
その他		6,482	5,956
流動資産計		17,712,808	19,758,878
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	271,199	225,511
器具備品	1	47,723	60,686
土地		710	710
リース資産	1	10,015	7,309
建設仮勘定		35,928	-
有形固定資産計		365,576	294,217
無形固定資産			
ソフトウェア		455,655	389,329
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		469,816	402,036
投資その他の資産			
投資有価証券		4,606,283	4,950,199
関係会社株式		1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金		3,331	2,534
長期差入保証金		743,455	741,014
出資金		161,517	157,660
繰延税金資産		545,849	543,639
その他		2,186	2,403

貸倒引当金	73,350	70,650
投資その他の資産計	7,159,048	7,496,574
固定資産計	7,994,441	8,192,828
資産合計	25,707,250	27,951,706

(単位：千円)

	第39期 (平成23年3月31日)	第40期 (平成24年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,841	2,841
未払金	305,187	222,814
未払手数料	1,159,542	1,094,446
未払費用	952,264	1,010,635
未払法人税等	1,586,776	1,570,446
前受収益	2,895	-
賞与引当金	831,200	874,000
役員賞与引当金	69,900	79,100
その他	18,208	18,977
流動負債計	4,928,817	4,873,261
固定負債		
リース債務	7,674	4,833
退職給付引当金	974,968	1,139,061
役員退職慰労引当金	132,000	144,730
固定負債計	1,114,643	1,288,624
負債合計	6,043,460	6,161,886

(単位：千円)

	第39期 (平成23年3月31日)	第40期 (平成24年3月31日)
純資産の部		
株主資本		

(単位：千円)

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	16,098,918	18,204,076
利益剰余金合計	17,542,649	19,647,807
株主資本合計	19,698,918	21,804,076
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	35,129	14,256
評価・換算差額等合計	35,129	14,256
純資産合計	19,663,789	21,789,820
負債純資産合計	25,707,250	27,951,706

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第39期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	3,364,664	3,091,311
委託者報酬	24,069,333	27,285,403
その他営業収益	112,848	131,340
営業収益計	27,546,846	30,508,054
営業費用		
支払手数料	11,618,664	12,829,874
広告宣伝費	250,770	131,967
公告費	824	2,247
調査費		
調査費	1,159,953	1,103,744
委託調査費	3,031,399	3,541,508
委託計算費	126,495	122,453
営業雑経費		
通信費	29,827	29,616
印刷費	388,523	350,466
協会費	18,371	23,131
諸会費	5,711	3,166
その他	30,571	29,989
営業費用計	16,661,113	18,168,165
一般管理費		
給料		
役員報酬	208,730	197,010
給料・手当	2,738,220	2,831,165
賞与	34,776	44,371
退職金	814	844
福利厚生費	509,031	544,128
交際費	21,011	19,828
旅費交通費	142,945	151,573
租税公課	69,890	74,062

不動産賃借料	842,754	841,453
退職給付費用	194,442	206,629
固定資産減価償却費	91,811	96,356
賞与引当金繰入額	831,200	874,000
役員退職慰労引当金繰入額	39,130	38,080
役員賞与引当金繰入額	69,900	79,100
諸経費	255,110	255,488
一般管理費計	6,049,768	6,254,092
営業利益	4,835,964	6,085,796
営業外収益		
受取配当金	76,007	149,045
受取利息	6,368	3,732
その他	12,177	11,769
営業外収益計	94,553	164,547
営業外費用		
投資有価証券売却損	-	4,016
為替差損	11,583	2,424
その他	340	957
営業外費用計	11,923	7,398
経常利益	4,918,593	6,242,945
特別損失		
投資有価証券評価損	-	50,687
その他	340	5,375
特別損失計	340	56,063
税引前当期純利益	4,918,252	6,186,881
法人税、住民税及び事業税	2,240,224	2,653,180
法人税等調整額	150,601	4,043
法人税等合計	2,089,622	2,657,223
当期純利益	2,828,630	3,529,657

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第39期	第40期
	(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		

当期首残高	14,232,788	16,098,918
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	1,424,500
当期純利益	2,828,630	3,529,657
当期変動額合計	1,866,130	2,105,157
当期末残高	16,098,918	18,204,076
利益剰余金合計		
当期首残高	15,676,519	17,542,649
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	1,424,500
当期純利益	2,828,630	3,529,657
当期変動額合計	1,866,130	2,105,157
当期末残高	17,542,649	19,647,807
株主資本合計		
当期首残高	17,832,788	19,698,918
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	1,424,500
当期純利益	2,828,630	3,529,657
当期変動額合計	1,866,130	2,105,157
当期末残高	19,698,918	21,804,076
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	92,156	35,129
当期変動額		
株主資本以外の項目	57,026	20,873
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	57,026	20,873
当期末残高	35,129	14,256
評価・換算差額等合計		
当期首残高	92,156	35,129
当期変動額		
株主資本以外の項目	57,026	20,873
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	57,026	20,873

当期末残高	35,129	14,256
純資産合計		
当期首残高	17,740,631	19,663,789
当期変動額		
剰余金の配当	962,500	1,424,500
当期純利益	2,828,630	3,529,657
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	57,026	20,873
当期変動額合計	1,923,157	2,126,030
当期末残高	19,663,789	21,789,820

[前へ](#) [次へ](#)

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

総平均法による原価法を採用しております。

(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。

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。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法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。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 15～30年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(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。

(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。

(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。

(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。

(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。

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) 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。

追加情報

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

注記事項

(貸借対照表関係)

第39期 (平成23年3月31日)		第40期 (平成24年3月31日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	268,368千円	建物	315,276千円
器具備品	248,865千円	器具備品	273,481千円
リース資産	1,006千円	リース資産	3,712千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員	被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン	被保証債務の内容	住宅ローン
金額	23,314千円	金額	19,359千円

(損益計算書関係)

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

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)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
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

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

第40期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
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23年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,424,500	370	平成23年3月31日	平成23年6月30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24年6月29日開催の第40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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,771,000	利益 剰余金	460	平成24年3月31日	平成24年6月29日

（リース取引関係）

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

（単位：千円）

	第39期（平成23年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	4,823	2,974	1,849
合計	4,823	2,974	1,849

（単位：千円）

	第40期（平成24年3月31日）		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	4,823	3,939	884
合計	4,823	3,939	884

(2) 未経過リース料期末残高相当額

（単位：千円）

	第39期(平成23年3月31日)	第40期（平成24年3月31日）
1年内	1,007	961
1年超	961	-
合計	1,968	961

(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（単位：千円）

	第39期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第40期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
支払リース料	1,070	1,070
減価償却費相当額	964	964
支払利息相当額	104	62

(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。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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（注2）を参照ください。

第39期（平成23年3月31日）

（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（*1）	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。

第40期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,886,867	15,886,867	-
(2) 未収委託者報酬	2,348,724	2,348,724	-
(3) 未収運用受託報酬	830,844	830,844	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	4,711,863	4,711,863	-
資産計	23,778,298	23,778,298	-
(1) 未払手数料	1,094,446	1,094,446	-
(2) 未払費用（*1）	823,266	823,266	-
負債計	1,917,712	1,917,712	-

（*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	第39期（平成23年3月31日）	第40期（平成24年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	291,423	238,335
(2) 子会社株式 非上場株式	1,169,774	1,169,774
(3) 長期差入保証金	743,455	741,014

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

第39期（平成23年3月31日）

（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	-

第40期（平成24年3月31日）

（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	15,886,867	-	-	-
未収委託者報酬	2,348,724	-	-	-
未収運用受託報酬	830,844	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券	-	1,067,561	4,004	-
合計	19,066,435	1,067,561	4,004	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第39期（平成23年3月31日）

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。

第40期（平成24年3月31日）

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

第39期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	933,950	915,000	18,950
小計	933,950	915,000	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	3,380,909	3,459,000	78,091
小計	3,380,909	3,459,000	78,091
合計	4,314,859	4,374,000	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「其他有価証券」には含めておりません。

第40期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	3,256,023	3,234,000	22,023
小計	3,256,023	3,234,000	22,023
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	1,455,840	1,500,000	44,160
小計	1,455,840	1,500,000	44,160
合計	4,711,863	4,734,000	22,136

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 238,335千円）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「其他有価証券」には含めておりません。

なお、非上場株式のうち一部を当期において減損処理を行い、投資有価証券評価損50,687千円を計上しております。

3. 当事業年度中に売却した其他有価証券

第39期（平成23年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	-	-	-

第40期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	23,383	-	4,016

（デリバティブ取引関係）

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。

（退職給付関係）

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。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

区分	第39期（平成23年3月31日）	第40期（平成24年3月31日）
退職給付引当金	974,968	1,139,061

（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。

3.退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

区分	第39期（平成23年3月31日）	第40期（平成24年3月31日）
勤務費用	143,190	151,221
確定拠出年金掛金	51,252	55,408
合計	194,442	206,629

(注) 退職給付費用の算定にあたり簡便法を採用しております。

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

(繰延税金資産)

(単位：千円)

	第39期 (平成23年3月31日)	第40期 (平成24年3月31日)
(1) 流動資産		
未払事業税	122,775	111,121
賞与引当金	337,467	332,120
社会保険料	29,423	29,079
未払事業所税	5,234	5,098
その他	8,570	8,088
繰延税金資産合計	503,471	485,508
(2) 固定資産		
退職給付引当金	395,837	408,872
投資有価証券	40,700	53,733
ゴルフ会員権	38,408	32,333
役員退職慰労引当金	53,592	54,186
その他有価証券評価差額金	24,010	7,880
その他	72,409	72,699
繰延税金資産小計	624,958	629,709
評価性引当額	79,108	86,067
繰延税金資産合計	545,849	543,639
繰延税金資産の純額	1,049,320	1,029,147

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

第39期
(平成23年3月31日)

第40期
(平成24年3月31日)

法定実効税率	-	40.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.7 "
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	1.0 "
過年度法人税等	-	0.8 "
評価性引当額	-	0.3 "
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	1.6 "
その他	-	0.1 "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	42.9%

(注) 第39期は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産の計算において使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更しております。

その結果、繰延税金資産の金額が98,432千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が97,325千円、その他有価証券評価差額金が1,106千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

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を省略しております。

(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。

第40期（自平成23年4月1日 至 平成24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	27,285,403	3,091,311	131,340	30,508,054

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を省略しております。

(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

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

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

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

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	17,709	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。

第40期（自平成23年4月1日 至 平成24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	3,883,039	未払手数料	448,037
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	17,709	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	2,570,671	未払手数料	193,755

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39期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	5,107円48銭	5,659円69銭
1株当たり当期純利益金額	734円71銭	916円79銭

(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たり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。

項目	第39期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益(千円)	2,828,630	3,529,657
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)	2,828,630	3,529,657
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)

該当事項はありません。

[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24年4月1日現在	事業の内容
三井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24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24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24年11月16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24年3月28日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル資産分散オープンの平成24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。

利害関係

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24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23年4月1日から平成24年3月31日までの第40期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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。

