

【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25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 多田 正己
【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 植松 克彦
【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25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】

第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、3.15%（税抜3.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

ファンドの申込手数料については、お申込みの各販売会社までお問い合わせください。

申込手数料には、消費税等相当額がかかります。

分配金自動再投資型において収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

(6) 申込単位

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、3.15%^{*}（税抜3.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

ファンドの申込手数料については、お申込みの各販売会社までお問い合わせください。

申込手数料には、消費税等相当額がかかります。

分配金自動再投資型において収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、3.24%となります。

(6) 申込単位

(以下略)

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>

(3)ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成25年4月末現在）

(以下略)

<訂正後>

(3)ファンドの仕組み

(以下略)

委託会社等の概況（平成25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

(以下略)

指定投資信託証券の概要は、平成25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。

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)

10. コモディティ・マザーファンド

(以下略)

< DJ - UBS コモディティ・インデックスについて >

Dow Jones-UBS Commodity IndexSMは、CME Group Index Services LLC（以下「CME Indexes」といいます。）の許諾商標であるDow Jones IndexesとUBS Securities LLC（以下「UBS Securities」といいます。）の共同商品であり、使用ライセンスが供与されています。「Dow Jones」、「UBS」および「Dow Jones-UBS Commodity IndexSM」および「DJ-UBS商品指数SM」は、Dow Jones Trademark Holdings, LLC（以下「ダウジョーンズ」といいます。）、およびUBS AG（場合によります。）の登録商標またはサービスマークであり、大和住銀投信投資顧問株式会社による一定の目的のための利用を許諾されています。

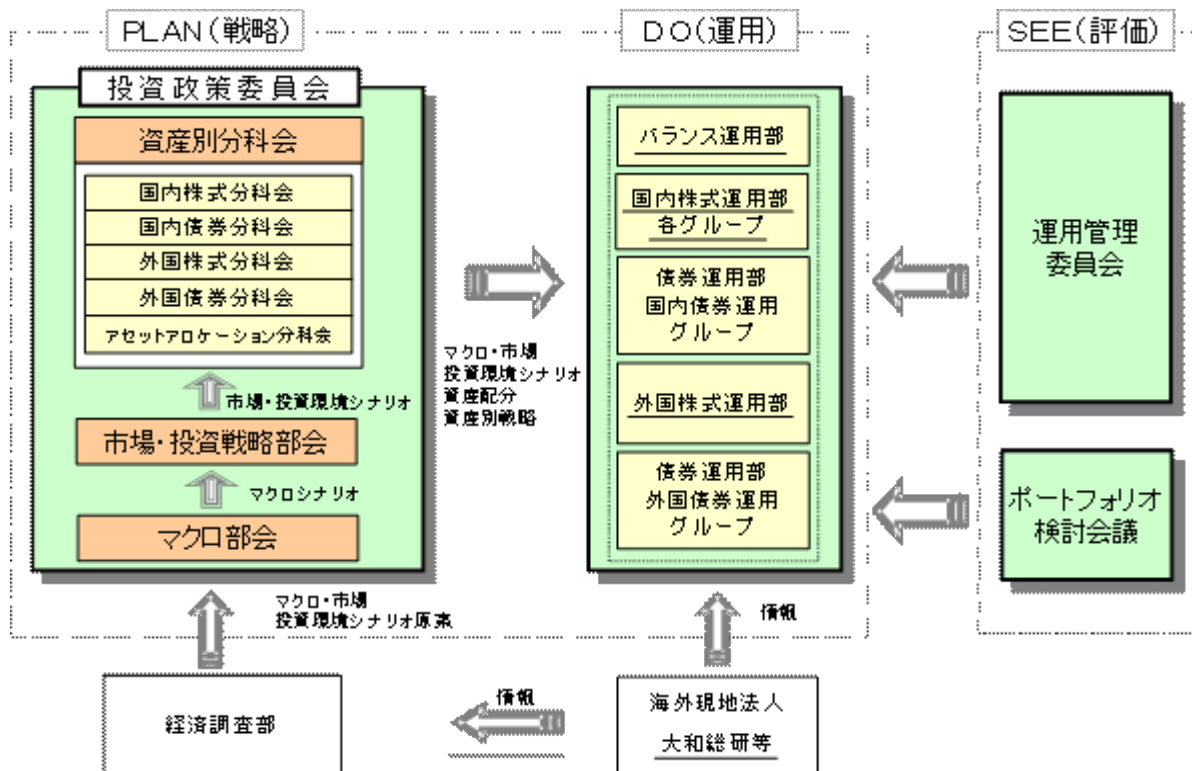
当ファンドは、ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社により後援、是認、販売または宣伝されていません。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の関係会社のいずれも、当ファンドの受益者または公衆に対し、証券もしくは商品全般または特に当ファンドへの投資の適否について明示的または暗示的ないかなる表明または保証も行っておりません。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、当ファンドの設定の時期、価格もしくはその数量の決定についてまたは当ファンドが現金に換金される際の等式の決定もしくは計算について責任を負わず、またはこれらに参加していません。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、当ファンドの管理、販売または取引に関連し受益者等に対しいかなる義務または責任を負うものではありません。上記にかかわらずUBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.またはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、大和住銀投信投資顧問株式会社によって設定された当ファンドと無関係であるが、これらに類似しておりかつこれらと競合し得る金融商品を独自に発行し、または支援することがあります。さらに、UBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.またはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、商品、商品指数および商品先物（Dow Jones-UBS Commodity IndexおよびDow Jones-UBS

Commodity Total Return Indexを含みます。)ならびに当該商品、商品指数および商品先物のパフォーマンスに連動するスワップ、オプションおよび派生商品の取引を積極的に行っています。かかる取引がDow Jones-UBS Commodity Indexおよび当ファンドの評価に影響を及ぼす可能性があります。

本書は当ファンドのみに関係するものであり、Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成商品の裏付けとなる取引所で取引される現物商品に関するものではありません。当ファンドの受益者は、Dow Jones-UBS Commodity Indexに先物契約を組入れることが、ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社による先物契約または裏付けとなる取引所で取引される現物商品に対する投資を推奨するものであると結論づけるべきではありません。Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成商品を含む現物商品に係る取引所で取引される先物契約に関する本書の情報は、一般に提供される文書のみをその出典としています。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、当ファンドに関連しDow Jones-UBS Commodity Indexを含む取引所で取引される先物契約についてデューディリジェンスを行っていません。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity Indexを含む取引所で取引される先物契約に関するこれらの一般に提供されている文書またはその他の一般に提供されている情報(当該取引所で取引されている先物契約の価格に影響を及ぼす要因の記載を含みます。)が正確または完全であるとのいかなる表明も行っていません。

ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity Indexまたはこれに含まれるデータの正確性および完全性を保証しておらず、またダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、かかる指数に関する誤り、不作為または障害について責任を負わないものとします。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity Indexまたはこれに含まれるデータの利用により大和住銀投信投資顧問株式会社、当ファンドの受益者またはその他の者もしくは機関が得る結果について明示的または暗示的ないかなる表明または保証も行いません。ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity Indexまたはこれに含まれるデータについて特定の目的または利用のために明示的または暗示的な保証を行わず、また市場商品性または適性に関する一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合も、ダウジョーンズ、UBS AG、UBS Securities、CME Indexesまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、その可能性につき通知されていたとしても喪失利益または間接的、懲罰的、特別もしくは拡大損害もしくは損失について責任を負わないものとします。UBS Securities、CME Indexesおよび大和住銀投信投資顧問株式会社との間の契約の取決めについて、UBS AG、CME Indexesの許諾者およびその関係会社以外の第三者の受益者は存在しません。

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成25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

(以下略)

指定投資信託証券の概要は、平成25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)

10. コモディティ・マザーファンド

(以下略)

<DJ-UBSコモディティ・インデックスについて>

Dow Jones-UBS Commodity IndexesSMは、S&P Dow Jones Indices LLCの子会社であるDJI Opco, LLC（「DJI Opco」）とUBS Securities LLC（「UBS Securities」）の共同商品であり、それを利用するライセンスが供与されています。Dow Jones およびDJ はDow Jones Trademark Holdings, LLC（「Dow Jones」）の商標で、「UBS」はUBS AG（「UBS AG」）の登録商標で、S&P はStandard & Poor's Financial Services LLCの登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがDJI Opcoに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和住銀投信投資顧問株式会社にそれぞれ付与されています。

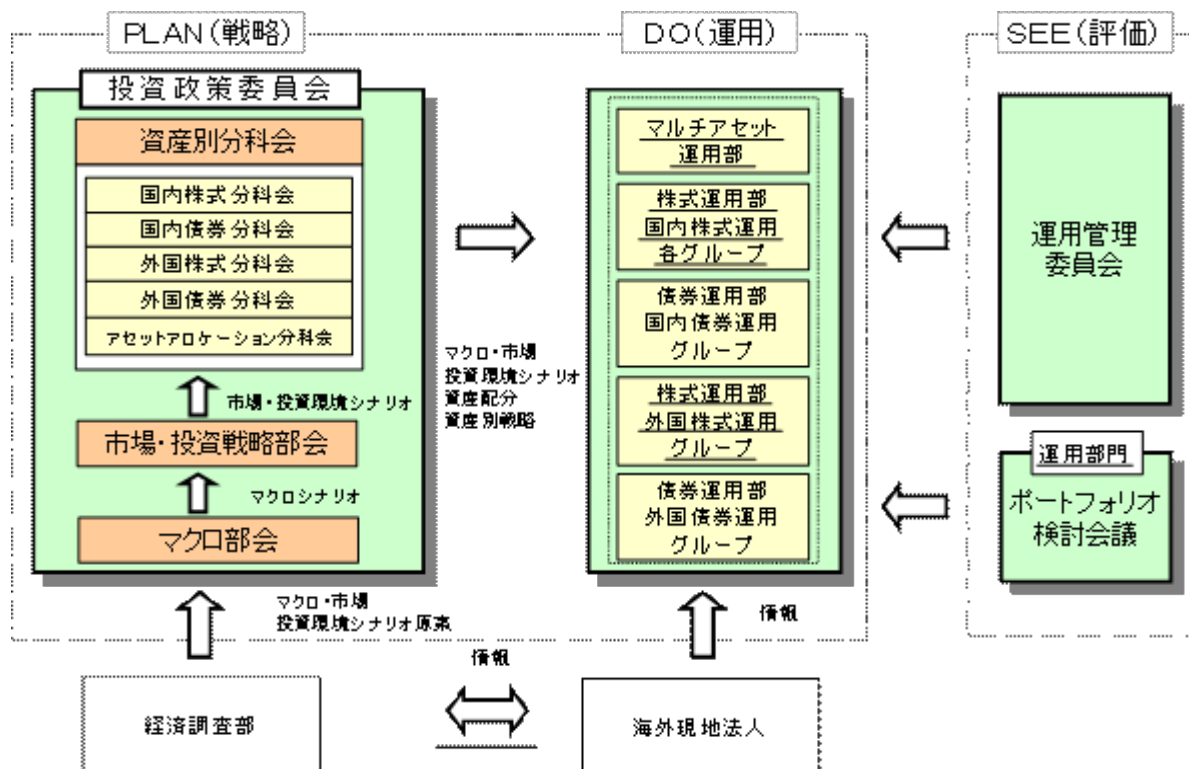
当ファンドは、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それぞれの子会社または関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、当ファンドの所有者または対応する者またはいかなる一般人に対しても、株式または商品全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。Dow Jones、UBS AG、UBS 証券、DJI Opco、それらの子会社または関連会社と、ライセンシーとの間にある唯一の関係は、特定の商標、商標名、サービスマークおよびDJ-UBSCISMのライセンス供与であり、これは大和住銀投信投資顧問株式会社または当ファンドには関係なく、UBS Securitiesと協力してDJI Opcoにより決定、構成および計算されます。UBS SecuritiesおよびDJI Opcoは、DJ-UBSCIの決定、構成または計算において、大和住銀投信投資顧問株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それぞれの子会社または関連会社のいずれも、将来発行される当ファンドのタイミング、価格または数量の決定、あるいは当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、いかなる義務または責任も負わないものとし、これには当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関する顧客に対してのものが含まれますがこれに限定されません。上記にかかわらず、UBS AG、UBS Securities、S&P Dow Jones Indices LLCの関連会社であるCME Group Inc.、それぞれの子会社および関連会社は、ライセンシーにより現在発行されている当ファンドに関連しないが、これに類似または競合する金融商品を独自に発行またはスポンサーできるものとし、さらに、UBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.、それらの子会社および関連会社は、商品、商品指数および商品先物（Dow Jones-UBS Commodity IndexおよびDow Jones-UBS Commodity Index Total ReturnSMを含む）に加えて、かかる商品、商品指数および商品先物のパフォーマンスに関連するスワップ、オプションおよびデリバティブを

積極的に取引します。この取引活動がDow Jones-UBS Commodity Indexと当ファンドの価値に影響を及ぼす可能性があります。

当ファンドの購入者は、Dow Jones-UBS Commodity Indexに先物契約が含まれることにより、Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社が当該先物契約または取引所で取引された対象の現物商品に対して、投資を推奨しているものと見なしてはなりません。Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素に関する本書の情報は、公的に入手可能な文書からのみ得られています。DOW JONES、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、当ファンドに関連するDow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素について、適正評価のためのいかなる照会も行なっていません。Dow Jones、UBS AG、UBS Securities、DJI Opco、それらの子会社または関連会社のいずれも、これらの公的に入手可能な文書または、Dow Jones-UBS Commodity Indexの構成要素の価格に影響する要因の説明を含め、かかる構成要素に関する入手可能なその他の情報の正確性や完全性について、いかなる表明もしていません。

DOW JONES、UBS AG、UBS SECURITIES、DJI OPCO、それらの子会社または関連会社のいずれも、DOW JONES-UBS COMMODITY INDEXまたはそれに関するデータの正確性および完全性を保証せず、DOW JONES、UBS AG、UBS SECURITIES、DJI OPCO、それらの子会社または関連会社のいずれも、その中の誤り、欠落または中断に対する責任を負わないものとします。DOW JONES、UBS AG、UBS SECURITIES、DJI OPCO、それらの子会社または関連会社は、DOW JONES-UBS COMMODITY INDEXSMまたはそれに関連するデータを使用することによって大和住銀投信投資顧問株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もしません。DOW JONES、UBS AG、UBS SECURITIES、DJI OPCO、それらの子会社または関連会社は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、DOW JONES-UBS COMMODITY INDEXSMまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、DOW JONES、UBS AG、UBS SECURITIES、DJI OPCO、それらの子会社または関連会社は、利益の逸失または間接的、懲罰的、特別または派生的な損害または損失に対して、その可能性を知らされていたとしても、責任を負わないものとします。UBS AGとDJI OPCOのライセンサーを除き、UBS SECURITIES、DJI OPCO、および大和住銀投信投資顧問株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

(3)運用体制



* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成25年10月末現在で約100名です。

（以下略）

3 投資リスク

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

< 基準価額の変動要因 >

(以下略)

(4)不動産投資信託（REIT）固有のリスク

< 価格変動リスク >

(以下略)

上記などにより、不動産価格が下落した場合、不動産投資信託の価格も下がり、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。

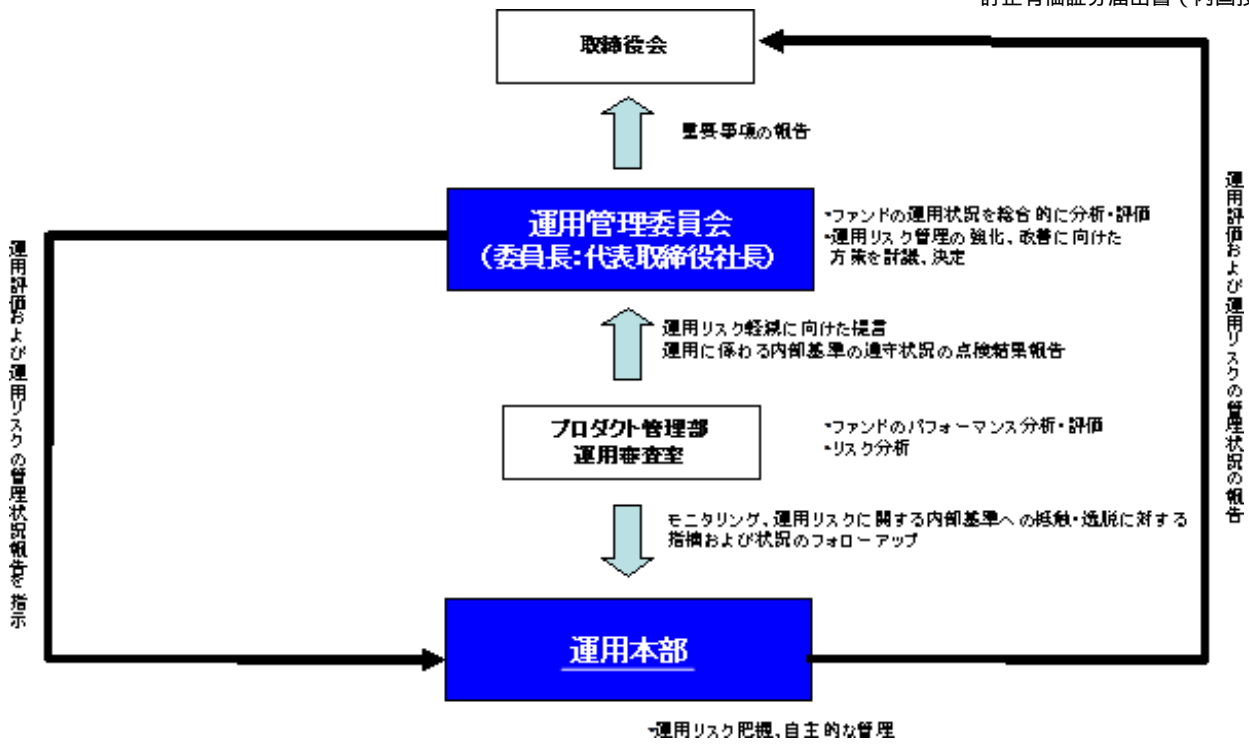
(以下略)

< リスクの管理体制 >

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。

名称および人員数	内容
運用管理委員会 (24名程度)	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・決定します。
リスク管理委員会 (20名程度)	運用リスクを除く経営リスクを適時、的確に把握し、適切な具体的措置を講じ、リスクの軽減・管理に努めます。
監査部 (6名程度)	取締役会直轄として、各部室の業務が適正な内部管理態勢のもと、法令等に従って行われているかを点検します。
コンプライアンス・オフィサー (1名)	コンプライアンスの観点から各部室の指導・監督を行うと同時に、法令等の遵守体制の維持・強化に向けた役職員の啓蒙・教化に努めます。
法務コンプライアンス部 (5名程度)	社内規則の制定・改廃の点検を行うほか、インサイダー情報の管理や広報内容のチェック等、法令違反等を未然に防止するために日常的な活動を行います。
プロダクト管理部 (10名程度)	約定内容と取引報告書を照合する等、発注業務の監視および約定価格の妥当性を点検します。
運用審査室 (3名程度)	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います。
トレーディング部 (20名程度)	有価証券の売買発注は、トレーディング部が最良執行の観点を踏まえて行います。

運用リスクの管理は、以下の体制で行います。



* リスクの管理体制は、今後変更になる場合があります。

< 訂正後 >

< 基準価額の変動要因 >

(以下略)

(4)不動産投資信託（REIT）固有のリスク

< 価格変動リスク >

(以下略)

上記などにより、不動産価格が下落した場合、不動産投資信託の価格も下がり、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。

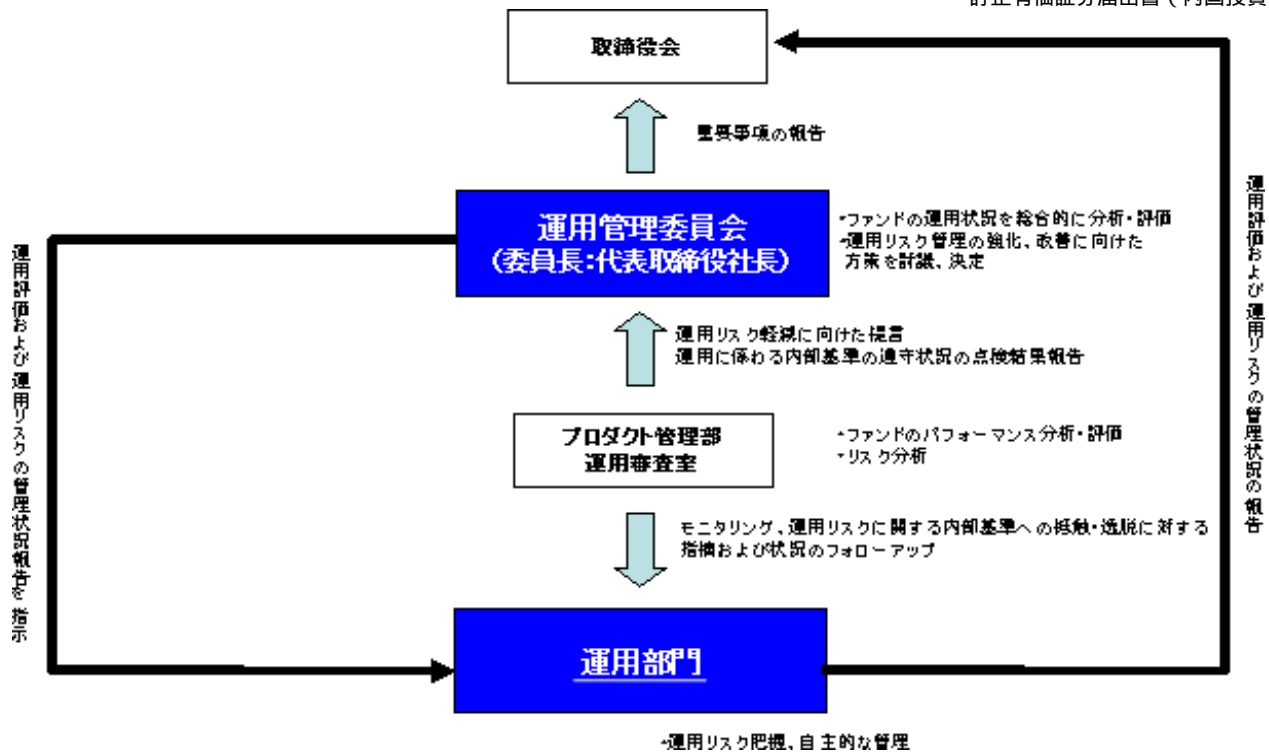
(以下略)

< リスクの管理体制 >

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。

名称および人員数	内容
運用管理委員会 (24名程度)	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・決定します。
リスク管理委員会 (18名程度)	運用リスクを除く経営リスクを適時、的確に把握し、適切な具体的措置を講じ、リスクの軽減・管理に努めます。
監査部 (6名程度)	取締役会直轄として、各部室の業務が適正な内部管理態勢のもと、法令等に従って行われているかを点検します。
コンプライアンス・オフィサー (1名)	コンプライアンスの観点から各部室の指導・監督を行うと同時に、法令等の遵守体制の維持・強化に向けた役職員の啓蒙・教化に努めます。
法務コンプライアンス部 (4名程度)	社内規則の制定・改廃の点検を行うほか、インサイダー情報の管理や広報内容のチェック等、法令違反等を未然に防止するために日常的な活動を行います。
プロダクト管理部 (12名程度)	約定内容と取引報告書を照合する等、発注業務の監視および約定価格の妥当性を点検します。
運用審査室 (5名程度)	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、運用部門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います。
トレーディング部 (19名程度)	有価証券の売買発注は、トレーディング部が最良執行の観点を踏まえて行います。

運用リスクの管理は、以下の体制で行います。



* リスクの管理体制は、今後変更になる場合があります。

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(1) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、3.15%（税抜3.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

ファンドの申込手数料については、お申込みの各販売会社までお問い合わせください。

申込手数料には、消費税等相当額がかかります。

分配金自動再投資型において収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

(2) 換金（解約）手数料

（以下略）

(3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.512%（税抜1.44%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社との間の配分は以下の表のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.735%	年率0.735%	年率0.042%
（税抜0.70%）	（税抜0.70%）	（税抜0.04%）

ファンド・オブ・ファンズは他のファンドを投資対象としており、実質的な信託報酬は当ファンドの報酬に投資対象ファンドの報酬を加算したものとなります。ただし、当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券では、信託報酬は収受されませんので、当ファンドにおける実質的な信託報酬は上記と同じです。なお、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示していません。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

(4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.0084%（税抜0.0080%）以内の率を乗じて得た額とし、各特定期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

指定投資信託証券のうち外国籍のものについては、当ファンドと同様に、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸経費、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等相当額、組入有価証券の売買の際に発生する売

買委託手数料等の費用、組入有価証券等の資産の保管等に要する費用、設定費用等の諸経費等が支弁されます。

(以下略)

(5)課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

(以下略)

< 損益通算について >

解約時および償還時の譲渡損失(または譲渡益)については、上場株式等の譲渡益(または譲渡損失)との相殺が可能です。当該相殺後の譲渡損失については、確定申告により、申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

また、源泉徴収選択口座内においても、解約時および償還時の譲渡損失(または譲渡益)については、上場株式等の譲渡益(または譲渡損失)と相殺され、当該相殺後の譲渡損失については、上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

法人の受益者に対する課税

(以下略)

<訂正後>

(1) 申込手数料

申込手数料は、申込価額（発行価格）に申込手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料率は、

3.15%^{*}（税抜3.0%）を上限とし、販売会社毎に定めた率とします。

ファンドの申込手数料については、お申込みの各販売会社までお問い合わせください。

申込手数料には、消費税等相当額がかかります。

分配金自動再投資型において収益分配金を再投資する場合は、手数料はかかりません。

* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、3.24%となります。

(2) 換金（解約）手数料

（以下略）

(3) 信託報酬等

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.512%^{*}（税抜1.44%）を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間の配分は以下の表のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.70%（税抜）	年率0.70%（税抜）	年率0.04%（税抜）

ファンド・オブ・ファンズは他のファンドを投資対象としており、実質的な信託報酬は当ファンドの報酬に投資対象ファンドの報酬を加算したものとなります。ただし、当ファンドが投資対象とする指定投資信託証券では、信託報酬は収受されませんので、当ファンドにおける実質的な信託報酬は上記と同じです。なお、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示していません。

* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率1.5552%となります。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

（以下略）

(4) その他の手数料等

（以下略）

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.0084%^{*}（税抜0.0080%）以内の率を乗じて得た額とし、各特定期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.00864%となります。

指定投資信託証券のうち外国籍のものについては、当ファンドと同様に、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸経費、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等相当額、組入有価証券の売買の際に発生する売

買委託手数料等の費用、組入有価証券等の資産の保管等に要する費用、設定費用等の諸経費等が支弁されます。

(以下略)

(5)課税上の取扱い

(以下略)

個人の受益者に対する課税

(以下略)

< 損益通算について >

解約時および償還時の譲渡損失(または譲渡益)については、上場株式等の譲渡益(または譲渡損失)との相殺が可能です。当該相殺後の譲渡損失については、確定申告により、申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

また、源泉徴収選択口座内においても、解約時および償還時の譲渡損失(または譲渡益)については、上場株式等の譲渡益(または譲渡損失)と相殺され、当該相殺後の譲渡損失については、上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

< 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」について >

公募株式投資信託は税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

(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25年10月末現在）

グローバル資産分散オープン

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド）	日本	3,048,289,503	15.51%
親投資信託受益証券 （グローバル好配当株マザーファンド）	日本	3,005,833,238	15.29%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	2,005,334,814	10.20%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,951,263,597	9.93%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,917,068,891	9.75%
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	1,870,271,933	9.51%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	879,777,140	4.48%
投資証券	ルクセンブルグ	4,720,622,069	24.01%
純資産総額		19,658,919,313	-

（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25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	29,961,872,000	93.50%
純資産総額		32,044,247,121	-

（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	724,416,717	23.77%
	イギリス	558,709,735	18.33%
	オーストラリア	491,790,392	16.13%
	日本	294,909,400	9.68%
	フランス	288,054,096	9.45%
	シンガポール	168,478,333	5.53%
	カナダ	164,574,958	5.40%
	オランダ	101,882,893	3.34%
	ベルギー	100,135,216	3.29%
	ドイツ	30,351,129	1.00%
純資産総額		3,048,105,233	-

（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	34,752,497,487	27.31%
	オーストラリア	19,010,353,435	14.94%
	イギリス	15,634,326,553	12.29%
	台湾	8,287,713,773	6.51%
	香港	7,074,625,202	5.56%
	シンガポール	5,294,021,815	4.16%
	スイス	5,078,938,580	3.99%
	ドイツ	4,918,583,379	3.87%
	フランス	4,336,829,786	3.41%
	ノルウェー	3,692,663,334	2.90%
	オランダ	2,702,079,895	2.12%
	アイルランド	2,498,382,938	1.96%
	スウェーデン	2,339,077,048	1.84%
	ベルギー	1,783,525,886	1.40%
	韓国	1,404,688,032	1.10%
	イタリア	1,313,759,311	1.03%
	フィンランド	1,272,760,840	1.00%
カナダ	1,022,944,544	0.80%	

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
純資産総額		127,253,318,860	-

(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	1,052,991,368	7.64%
	ロシア	1,049,897,989	7.62%
	ウクライナ	483,218,935	3.51%
	インドネシア	453,343,020	3.29%
	ハンガリー	451,920,850	3.28%
	メキシコ	417,243,415	3.03%
	セルビア	375,805,427	2.73%
	ブラジル	276,389,319	2.01%
	コロンビア	230,710,420	1.67%
	ペルー	230,193,794	1.67%
	ルーマニア	223,851,168	1.62%
	アイスランド	221,952,142	1.61%
	リトアニア	192,268,862	1.40%
	南アフリカ	190,593,453	1.38%
	ジャマイカ	157,898,991	1.15%
	クロアチア	149,882,965	1.09%
	ドミニカ共和国	149,207,210	1.08%
	スリランカ	147,619,205	1.07%
バミューダ	127,944,911	0.93%	

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
	イラク	100,028,098	0.73%
	フィリピン	84,127,540	0.61%
	ナミビア	82,882,373	0.60%
	マレーシア	79,200,562	0.57%
	アルメニア	68,008,841	0.49%
	ヴェネズエラ	66,494,250	0.48%
	モロッコ	56,893,342	0.41%
	カタール	43,371,982	0.31%
	エルサルバドル	33,431,831	0.24%
	エジプト	27,688,205	0.20%
	パナマ	23,227,475	0.17%
	グルジア	21,598,317	0.16%
特殊債券	メキシコ	306,004,635	2.22%
	南アフリカ	69,577,613	0.51%
	インドネシア	67,026,942	0.49%
	レバノン	34,994,534	0.25%
	ルクセンブルグ	18,596,717	0.13%
	ロシア	10,983,865	0.08%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
社債券	フィリピン	1,052,160,682	7.64%
	ヴェネズエラ	638,105,836	4.63%
	ケイマン諸島	510,005,233	3.70%
	オランダ	389,203,149	2.83%
	チリ	352,691,511	2.56%
	ルクセンブルグ	315,801,634	2.29%
	アイルランド	188,159,764	1.37%
	ブラジル	149,565,762	1.09%
	カザフスタン	124,458,026	0.90%
	メキシコ	119,753,139	0.87%
	トルコ	109,065,715	0.79%
	インドネシア	103,217,054	0.75%
	クロアチア	102,371,592	0.74%
	アメリカ	80,661,465	0.59%
	ペルー	78,384,407	0.57%
	イスラエル	60,993,106	0.44%
	イギリス	59,858,616	0.43%
	香港	59,388,920	0.43%
	イギリス領バージン諸島	58,797,959	0.43%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
	アラブ首長国連邦	46,634,634	0.34%
	キプロス	45,428,871	0.33%
	スリランカ	38,566,665	0.28%
	コロンビア	27,616,662	0.20%
	グルジア	20,785,610	0.15%
	バミューダ	19,647,819	0.14%
	タイ	19,319,978	0.14%
	インド	19,123,746	0.14%
純資産総額		13,776,127,333	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	イタリア	429,156,027	21.40%
	イギリス	324,075,865	16.16%
	フランス	244,627,064	12.20%
	スペイン	135,359,034	6.75%
	ベルギー	92,154,033	4.60%
	オランダ	64,246,486	3.20%
	ドイツ	63,931,717	3.19%
	アイルランド	50,121,309	2.50%
	オーストリア	50,105,460	2.50%
	チェコ	30,840,261	1.54%
	ポーランド	28,548,493	1.42%
	スウェーデン	26,969,737	1.34%
	スロヴェニア	24,342,107	1.21%
	ルーマニア	20,297,195	1.01%
	フィンランド	16,283,126	0.81%
	ロシア	13,412,807	0.67%
	ハンガリー	9,986,497	0.50%
	ノルウェー	9,736,283	0.49%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
特殊債券	ルクセンブルグ	15,578,369	0.78%
	メキシコ	7,578,434	0.38%
社債券	オランダ	54,306,671	2.71%
	アメリカ	43,035,237	2.15%
	イギリス	37,816,757	1.89%
	アイルランド	23,437,083	1.17%
	ルクセンブルグ	21,583,884	1.08%
	韓国	21,128,091	1.05%
	イタリア	14,749,705	0.74%
	ケイマン諸島	14,638,581	0.73%
	フランス	9,534,676	0.48%
	ノルウェー	7,541,775	0.38%
	ブラジル	7,497,001	0.37%
	スペイン	7,171,271	0.36%
	ドイツ	4,924,030	0.25%
	オーストラリア	2,203,365	0.11%
ベルギー	827,121	0.04%	
純資産総額		2,005,366,247	-

（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	234,241,890	12.52%
	シンガポール	42,544,573	2.27%
	香港	14,173,238	0.76%
	マレーシア	9,662,438	0.52%
特殊債券	国際機関	1,281,976,675	68.54%
純資産総額		1,870,318,540	-

（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	876,584,831	99.64%
純資産総額		879,746,350	-

（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25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 -	3,716,972,934	0.7972 2,963,542,520	0.8201 3,048,289,503	- -	15.51%
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 -	2,090,578,132	1.3915 2,909,248,528	1.4378 3,005,833,238	- -	15.29%
3	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,789,998,049	1.0911 1,953,245,871	1.1203 2,005,334,814	- -	10.20%
4	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,222,136,789	1.5775 1,928,042,998	1.5966 1,951,263,597	- -	9.93%
5	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,847,777,245	1.0561 1,951,622,326	1.0375 1,917,068,891	- -	9.75%
6	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,876,619	1,000 1,878,393,241	1,017 1,909,663,649	- -	9.71%
7	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,783,265	1,052 1,876,194,978	1,057 1,886,689,965	- -	9.60%
8	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 -	1,485,875,851	1.2491 1,856,156,113	1.2587 1,870,271,933	- -	9.51%
9	T.Rowe Price Funds SICAV- Global Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,254,342	707 887,198,862	736 924,268,453	- -	4.70%
10	コモディティ・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,316,440,432	0.6826 898,733,882	0.6683 879,777,140	- -	4.48%

(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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	262,300	6,050 1,586,915,000	6,360 1,668,228,000	- -	5.21%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	2,409,700	609 1,467,507,300	620 1,494,014,000	- -	4.66%
3	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	6,773,600	206 1,395,361,600	205 1,388,588,000	- -	4.33%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	256,900	3,720 955,668,000	3,915 1,005,763,500	- -	3.14%
5	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	276,800	3,400 941,120,000	3,550 982,640,000	- -	3.07%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	167,600	5,060 848,056,000	5,090 853,084,000	- -	2.66%
7	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	846,000	956 808,776,000	982 830,772,000	- -	2.59%
8	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	126,000	4,780 602,280,000	5,460 687,960,000	- -	2.15%
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	305,000	1,908 581,940,000	1,982 604,510,000	- -	1.89%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	110,000	5,230 575,300,000	5,310 584,100,000	- -	1.82%
11	三井住友トラスト・ホール ディングス 日本	株式 銀行業	1,158,000	464 537,312,000	482 558,156,000	- -	1.74%
12	西日本旅客鉄道	株式	119,500	4,075	4,395	-	1.64%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
	日本	陸運業		486,962,500	525,202,500	-	
13	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	199,000	2,394	2,525	-	1.57%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	156,700	3,075	3,090	-	1.51%
15	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	399,000	1,139	1,178	-	1.47%
16	三井物産 日本	株式 卸売業	332,000	1,372	1,400	-	1.45%
17	J Xホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	957,000	471	485	-	1.45%
18	イオンフィナンシャルサー ビス 日本	株式 その他金融業	152,500	2,864	3,005	-	1.43%
19	リコー 日本	株式 電気機器	411,000	1,044	1,033	-	1.32%
20	アズビル 日本	株式 電気機器	174,900	2,170	2,366	-	1.29%
21	大東建託 日本	株式 建設業	39,900	9,580	10,010	-	1.25%
22	D I C 日本	株式 化学	1,380,000	275	283	-	1.22%
23	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	83,600	4,485	4,665	-	1.22%
24	住友ゴム工業 日本	株式 ゴム製品	280,000	1,360	1,362	-	1.19%
25	日本航空 日本	株式 空運業	65,800	5,700	5,730	-	1.18%
26	ローソン 日本	株式 小売業	46,200	7,390	7,870	-	1.13%
27	三和ホールディングス 日本	株式 金属製品	540,000	571	628	-	1.06%
28	東洋インキ S C ホールディ ングス 日本	株式 化学	673,000	472	499	-	1.05%
29	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	91,500	3,485	3,620	-	1.03%
30	住友商事 日本	株式 卸売業	255,400	1,280	1,275	-	1.02%

(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	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	6,277	24,695 155,011,953	26,039 163,449,784	- -	5.36%
2	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券 -	140,915	868 122,320,581	993 140,017,554	- -	4.59%
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	8,852	15,695 138,937,436	15,353 135,911,559	- -	4.46%
4	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券 -	76,286	1,294 98,757,120	1,571 119,906,449	- -	3.93%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券 -	17,731	6,593 116,905,346	6,365 112,870,513	- -	3.70%
6	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資証券 -	104,792	1,016 106,532,029	1,012 106,139,646	- -	3.48%
7	SEGRO PLC イギリス	投資証券 -	189,998	395 75,185,030	519 98,746,007	- -	3.24%
8	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資証券 -	327,792	286 93,894,903	288 94,508,596	- -	3.10%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	109,400	766 83,851,866	856 93,667,995	- -	3.07%
10	ICADE フランス	投資証券 -	9,720	9,126 88,706,841	9,160 89,039,908	- -	2.92%
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	16,496	5,456 90,009,910	5,235 86,369,864	- -	2.83%
12	DERWENT LONDON PLC イギリス	投資証券 -	16,378	3,382 55,392,651	4,009 65,663,964	- -	2.15%
13	CAPITAMALL TRUST シンガポール	投資証券 -	398,356	167 66,847,443	160 63,996,130	- -	2.10%
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券 -	9,100	7,091 64,534,787	6,483 59,003,746	- -	1.94%
15	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	157,638	343 54,156,329	372 58,730,842	- -	1.93%
16	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	44	1,356,000 59,664,000	1,217,000 53,548,000	- -	1.76%
17	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	505,900	99 50,198,736	101 51,382,669	- -	1.69%
18	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	148,900	344 51,293,786	344 51,293,786	- -	1.68%
19	WAREHOUSES DE PAUW SCA ベルギー	投資証券 -	6,842	6,628 45,350,349	7,414 50,727,605	- -	1.66%
20	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資証券 -	133,400	366 48,951,290	377 50,324,923	- -	1.65%
21	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	298,500	151 45,266,987	160 47,781,820	- -	1.57%
22	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	248,205	204 50,725,219	187 46,585,795	- -	1.53%
23	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ	投資証券 -	14,567	3,108 45,284,185	3,167 46,133,691	- -	1.51%
24	EUROCOMMERCIAL オランダ	投資証券 -	10,755	3,916 42,117,295	4,261 45,827,108	- -	1.50%
25	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券 -	293	160,500 47,026,500	150,100 43,979,300	- -	1.44%
26	GREAT PORTLAND ESTATES PLC イギリス	投資証券 -	43,900	774 34,015,601	927 40,707,763	- -	1.34%
27	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券 -	14,100	2,643 37,266,628	2,878 40,586,317	- -	1.33%
28	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	4,533	8,110 36,764,118	8,786 39,827,422	- -	1.31%
29	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR カナダ	投資証券 -	15,863	2,569 40,763,455	2,392 37,958,356	- -	1.25%
30	KLEPIERRE フランス	投資証券 -	7,933	4,145 32,885,054	4,478 35,530,238	- -	1.17%

(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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	4,293,131	365 1,567,636,784	368 1,582,018,773	- -	1.24%
2	KLA-TENCOR CORPORATION アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	242,800	5,562 1,350,662,335	6,483 1,574,297,766	- -	1.24%
3	LARGAN PRECISION CO LTD 台湾	株式 テクノロ ジー・ハード ウェアおよび 機器	460,000	3,165 1,456,245,000	3,350 1,541,000,000	- -	1.21%
4	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT オーストラリア	株式 保険	2,648,300	514 1,363,490,496	571 1,514,713,987	- -	1.19%
5	MACQUARIE GROUP LIMITED オーストラリア	株式 各種金融	310,400	4,063 1,261,212,007	4,848 1,505,128,979	- -	1.18%
6	NATIONAL AUSTRALIA BANK オーストラリア	株式 銀行	435,300	2,768 1,205,244,826	3,391 1,476,315,727	- -	1.16%
7	SANTOS LTD オーストラリア	株式 エネルギー	1,033,800	1,237 1,279,352,517	1,422 1,470,965,073	- -	1.16%
8	SJM HOLDINGS LIMITED 香港	株式 消費者サービ ス	4,520,000	294 1,331,880,784	323 1,462,082,140	- -	1.15%
9	NEXT PLC イギリス	株式 小売	167,400	7,487 1,253,454,037	8,609 1,441,207,701	- -	1.13%
10	AUST AND NZ BANKING GROUP LT オーストラリア	株式 銀行	456,800	2,680 1,224,291,699	3,154 1,441,047,317	- -	1.13%
11	WESTPAC BANKING CORPORATION オーストラリア	株式 銀行	440,100	2,709 1,192,373,103	3,266 1,437,801,858	- -	1.13%
12	AMCOR LTD オーストラリア	株式 素材	1,414,900	989 1,399,983,699	1,010 1,430,446,921	- -	1.12%
13	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS シンガポール	株式 電気通信サー ビス	4,685,000	292 1,371,160,824	304 1,427,050,531	- -	1.12%
14	DNB ASA ノルウェー	株式 銀行	796,200	1,542 1,228,529,036	1,782 1,419,220,130	- -	1.12%
15	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD 台湾	株式 テクノロ ジー・ハード ウェアおよび 機器	2,450,000	509 1,247,540,000	576 1,411,690,000	- -	1.11%
16	LYONDELLBASELL INDU-CL A オランダ	株式 素材	189,700	6,667 1,264,759,644	7,417 1,407,157,229	- -	1.11%
17	KT&G CORP 韓国	株式 食品・飲料・ タバコ	190,300	7,101 1,351,480,152	7,381 1,404,688,032	- -	1.10%
18	AMERIPRISE FINANCIAL INC アメリカ	株式 各種金融	140,300	8,186 1,148,521,194	9,928 1,393,013,852	- -	1.09%
19	AVIVA PLC イギリス	株式 保険	1,980,600	619 1,226,338,638	702 1,391,356,823	- -	1.09%
20	KIMBERLY CLARK CORP アメリカ	株式 家庭用品・ パーソナル用 品	130,600	9,959 1,300,715,393	10,629 1,388,177,307	- -	1.09%
21	BRISTOL MYERS-SQUIBB アメリカ	株式 医薬品・バイ オテクノロ ジー・ライフ サイエンス	262,400	4,352 1,142,009,880	5,233 1,373,358,645	- -	1.08%
22	DOW CHEMICAL アメリカ	株式 素材	351,400	3,220 1,131,610,573	3,867 1,359,040,413	- -	1.07%
23	LEGAL & GENERAL GROUP PLC イギリス	株式 保険	3,991,500	287 1,147,577,804	340 1,358,177,247	- -	1.07%
24	HARTFORD FINL SVCS GRP アメリカ	株式 保険	398,900	3,089 1,232,311,239	3,368 1,343,517,897	- -	1.06%
25	SYNGENTA AG-REG スイス	株式 素材	33,200	41,463 1,376,600,251	40,390 1,340,976,585	- -	1.05%
26	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	株式	1,600,000	787	835	-	1.05%

	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
	シンガポール	銀行		1,259,755,200	1,336,104,000	-	
27	BORAL LIMITED オーストラリア	株式 素材	2,915,100	400 1,167,937,147	454 1,326,209,003	-	1.04%
28	COMMONWEALTH BK オーストラリア	株式 銀行	183,200	6,545 1,199,198,834	7,208 1,320,671,597	-	1.04%
29	INTESA SANPAOLO SPA イタリア	株式 銀行	5,377,700	228 1,226,347,266	244 1,313,759,311	-	1.03%
30	KONINKLIJKE PHILIPS NV オランダ	株式 資本財	368,400	2,908 1,071,668,729	3,514 1,294,922,665	-	1.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

新興国債券マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券 -	8,923,200	12,242.00 1,092,378,297	11,765.93 1,049,897,989	7.5000 2030/03/31	7.62%
2	POWER SECTOR ASSETS & LI フィリピン	社債券 -	9,020,000	11,525.67 1,039,615,434	11,156.25 1,006,294,426	6.8750 2016/11/02	7.30%
3	REPUBLIC OF HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	4,432,000	10,145.05 449,628,720	10,196.77 451,920,850	4.7500 2015/02/03	3.28%
4	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	5,190,000	8,619.62 447,358,537	7,954.68 412,848,021	5.2500 2017/04/12	3.00%
5	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	4,460,000	9,633.56 429,657,177	8,899.88 396,934,913	6.5800 2016/11/21	2.88%
6	TURKEY REP OF トルコ	国債証券 -	3,150,000	14,591.30 459,625,987	12,243.80 385,679,948	8.0000 2034/02/14	2.80%
7	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	3,000,000	11,710.37 351,311,287	10,540.57 316,217,100	5.6250 2021/03/30	2.30%
8	CODELCO INC チリ	社債券 -	3,400,000	9,643.95 327,894,573	9,111.28 309,783,805	3.0000 2022/07/17	2.25%
9	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	2,750,000	12,941.75 355,898,159	10,885.35 299,347,262	6.6250 2037/02/17	2.17%
10	INTERGAS FINANCE BV オランダ	社債券 -	2,450,000	11,131.63 272,724,935	10,860.72 266,087,823	6.3750 2017/05/14	1.93%
11	REPUBLIC OF ICELAND アイスランド	国債証券 -	2,150,000	10,516.23 226,099,117	10,323.35 221,952,142	4.8750 2016/06/16	1.61%
12	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	1,900,000	11,691.84 222,144,975	10,380.98 197,238,692	7.2500 2021/09/28	1.43%
13	PETROLEOS MEXICANOS メキシコ	特殊債券 -	1,825,000	10,401.00 189,818,426	10,565.19 192,814,854	6.5000 2041/06/02	1.40%
14	REPUBLIC OF LITHUANIA リトアニア	国債証券 -	1,700,000	12,185.68 207,156,679	11,309.93 192,268,862	6.1250 2021/03/09	1.40%
15	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券 -	1,740,000	12,845.21 223,506,679	10,430.23 181,486,155	5.6250 2050/11/18	1.32%
16	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,600,000	12,275.42 196,406,775	11,156.25 178,500,120	6.1250 2041/01/18	1.30%
17	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	1,547,000	12,473.82 192,970,130	11,328.65 175,254,215	7.0000 2020/06/05	1.27%
18	JAMAICA GOVERNMENT BOND ジャマイカ	国債証券 -	1,619,047	9,653.88 156,300,937	9,752.58 157,898,991	8.5000 2021/11/16	1.15%
19	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	1,191,000	14,566.67 173,489,083	12,009.35 143,031,407	7.1250 2037/01/20	1.04%
20	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	1,500,000	8,564.13 128,461,965	8,890.52 133,357,912	2.6250 2023/01/05	0.97%
21	GOVT OF BERMUDA バミューダ	国債証券 -	1,305,000	9,851.00 128,555,550	9,804.20 127,944,911	4.8540 2024/02/06	0.93%
22	KAZMUNAIGAZ NATIONAL カザフスタン	社債券 -	1,100,000	11,976.84 131,745,303	11,314.36 124,458,026	7.0000 2020/05/05	0.90%
23	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	15,400,000	882.69 135,934,555	804.69 123,922,537	7.7500 2042/11/13	0.90%
24	CROATIA クロアチア	国債証券 -	1,100,000	11,417.30 125,590,399	10,442.06 114,862,660	6.3750 2021/03/24	0.83%
25	ROMANIA ルーマニア	国債証券 -	1,000,000	12,188.64 121,886,423	11,390.21 113,902,187	6.7500 2022/02/07	0.83%
26	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	1,000,000	11,821.20	11,094.68	6.7500	0.81%

	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
	トルコ	-		118,212,000	110,946,887	2018/04/03	
27	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	11,046,000	1,226.11 135,437,100	998.36 110,279,489	10.0000 2036/11/20	0.80%
28	ODBRCHT OFFSHRE DRLL FIN ケイマン諸島	社債券 -	1,000,000	10,284.32 102,843,257	10,318.92 103,189,225	6.7500 2022/10/01	0.75%
29	REPUBLIC OF IRAQ イラク	国債証券 -	1,161,000	9,063.90 105,231,938	8,615.68 100,028,098	5.8000 2028/01/15	0.73%
30	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	1,175,356	8,553.15 100,529,969	8,003.93 94,074,758	5.1250 2016/10/28	0.68%

(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	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	663,000	16,008.29 106,135,014	15,643.84 103,718,660	4.2500 2018/10/25	5.17%
2	UK GILT イギリス	国債証券 -	556,000	19,193.67 106,716,859	18,457.21 102,622,114	4.2500 2046/12/07	5.12%
3	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	615,000	14,626.74 89,954,482	14,844.52 91,293,858	5.2500 2017/08/01	4.55%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	453,000	14,476.98 65,580,722	14,560.73 65,960,122	4.7500 2016/09/15	3.29%
5	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	350,000	18,518.46 64,814,612	18,356.13 64,246,486	5.5000 2028/01/15	3.20%
6	UK GILT イギリス	国債証券 -	405,000	15,508.07 62,807,695	15,695.89 63,568,391	1.2500 2018/07/22	3.17%
7	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	424,000	14,044.81 59,550,002	14,653.79 62,132,108	4.6000 2019/07/30	3.10%
8	UK GILT イギリス	国債証券 -	331,000	18,061.37 59,783,146	17,640.50 58,390,087	3.7500 2021/09/07	2.91%
9	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	373,000	15,671.56 58,454,925	15,508.70 57,847,471	3.7500 2021/04/25	2.88%
10	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	403,000	13,757.50 55,442,725	13,894.93 55,996,585	4.5000 2026/03/01	2.79%
11	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	384,000	13,301.23 51,076,757	13,763.72 52,852,694	5.0000 2040/09/01	2.64%
12	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	295,000	17,267.02 50,937,723	17,006.82 50,170,121	4.7500 2035/04/25	2.50%
13	UK GILT イギリス	国債証券 -	272,000	17,550.46 47,737,270	17,065.49 46,418,157	4.7500 2015/09/07	2.31%
14	BELGIUM KINGDOM ベルギー	国債証券 -	279,000	15,396.45 42,956,119	15,254.26 42,559,392	4.0000 2018/03/28	2.12%
15	UK GILT イギリス	国債証券 -	224,000	19,089.09 42,759,572	18,326.09 41,050,463	5.0000 2018/03/07	2.05%
16	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	270,000	13,496.80 36,441,361	13,789.42 37,231,444	3.7500 2021/03/01	1.86%
17	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	277,000	13,505.29 37,409,665	13,255.78 36,718,520	2.5000 2044/07/04	1.83%
18	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	235,000	14,267.71 33,529,131	14,533.40 34,153,510	4.5000 2018/08/01	1.70%
19	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	174,000	19,278.00 33,543,727	18,902.76 32,890,811	5.7500 2032/10/25	1.64%
20	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	227,000	14,027.49 31,842,422	14,262.86 32,376,712	4.0000 2017/02/01	1.61%
21	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	210,000	14,318.32 30,068,491	15,123.86 31,760,110	5.5000 2022/09/01	1.58%
22	CZECH REPUBLIC チェコ	国債証券 -	204,000	15,345.70 31,305,238	15,117.77 30,840,261	3.8750 2022/05/24	1.54%
23	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	189,000	14,290.07 27,008,239	15,257.10 28,835,925	5.7500 2032/07/30	1.44%
24	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ドイツ	国債証券 -	201,000	13,540.12 27,213,643	13,538.90 27,213,196	0.2500 2014/03/14	1.36%
25	SWEDISH GOVERNMENT スウェーデン	国債証券 -	1,455,000	1,913.83 27,846,299	1,853.59 26,969,737	5.0000 2020/12/01	1.34%

	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
26	REPUBLIC OF SLOVENIA スロヴェニア	国債証券 -	184,000	13,290.27 24,454,110	13,229.40 24,342,107	4.0000 2018/03/22	1.21%
27	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券 -	153,000	15,564.23 23,813,283	15,206.78 23,266,377	3.4000 2022/11/22	1.16%
28	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	152,000	14,099.19 21,430,771	14,131.65 21,480,118	4.4000 2015/01/31	1.07%
29	EXPORT-IMPORT BK KOREA 韓国	社債券 -	160,000	13,496.42 21,594,286	13,205.05 21,128,091	2.0000 2020/04/30	1.05%
30	IRISH GOVT TREASURY アイルランド	国債証券 -	128,000	14,640.94 18,740,414	14,990.62 19,187,995	5.0000 2020/10/18	0.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	ASIAN DEVELOPMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	6,400,000	9,330.70 597,165,336	9,244.92 591,675,110	3.5000 2018/07/25	31.63%
2	INTER-AMERICAN DEVEL BK 国際機関	特殊債券 -	5,200,000	9,041.04 470,134,571	8,749.23 454,960,345	6.2500 2017/12/15	24.33%
3	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	2,602,000	9,318.87 242,477,068	9,044.62 235,341,219	7.5000 2017/12/15	12.58%
4	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	2,500,000,000	9.42 235,588,630	9.36 234,241,890	3.5000 2014/06/10	12.52%
5	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	500,000	8,765.16 43,825,801	8,508.91 42,544,573	2.5000 2019/06/01	2.27%
6	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	1,100,000	1,300.51 14,305,638	1,288.47 14,173,238	1.6900 2014/09/29	0.76%
7	MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	300,000	3,244.89 9,734,696	3,220.81 9,662,438	4.2620 2016/09/15	0.52%

(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 10/20/14 イギリス	社債券 -	9,100,000	9,850.67 896,411,447	9,632.80 876,584,831	0.2600 2014/10/20	99.64%

(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	74.66%
投資証券	24.01%
合計	98.68%

（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	93.50%
合計	93.50%

（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	95.91%
合計	95.91%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

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	96.20%
合計	96.20%

（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	52.77%
社債券	34.77%
特殊債券	3.68%
合計	91.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

欧州債券マザーファンド

種類別	投資比率
国債証券	81.49%
社債券	13.48%
特殊債券	1.15%
合計	96.13%

（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	68.54%
国債証券	16.07%
合計	84.62%

（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	99.64%
合計	99.64%

（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	13.09%
輸送用機器	12.39%
情報・通信業	8.51%
卸売業	8.28%
化学	6.45%
電気機器	6.40%
医薬品	5.58%
小売業	3.47%
食料品	3.46%
機械	2.93%
保険業	2.85%
石油・石炭製品	2.81%
陸運業	2.65%
建設業	2.38%
サービス業	1.50%
その他金融業	1.43%
ゴム製品	1.28%
空運業	1.18%
その他製品	1.16%
鉄鋼	1.14%
金属製品	1.06%
精密機器	0.83%
証券、商品先物取引業	0.80%
電気・ガス業	0.55%
非鉄金属	0.51%
繊維製品	0.40%
不動産業	0.25%
ガラス・土石製品	0.18%
小計	93.50%
合計	93.50%

(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	13.36%
素材	11.39%
保険	9.19%
資本財	8.60%
電気通信サービス	7.56%
エネルギー	5.23%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.73%
半導体・半導体製造装置	4.48%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.33%
各種金融	4.14%
公益事業	3.23%
自動車・自動車部品	2.93%
食品・飲料・タバコ	2.87%
ソフトウェア・サービス	2.76%
食品・生活必需品小売り	2.70%
小売	2.04%
家庭用品・パーソナル用品	1.99%
消費者サービス	1.15%
商業・専門サービス	0.99%
運輸	0.98%
メディア	0.83%
不動産	0.71%

業種別	投資比率
小計	96.20%
合計	96.20%

（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25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25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 2512月	買建	138	1,589,760,000	1,655,310,000	5.17%

（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。

[前へ](#) [次へ](#)

(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
第10特定期間末 （平成24年3月27日）	21,940	22,270	0.6349	0.6439
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11月末日	18,720	-	0.6383	-
平成24年12月末日	19,424	-	0.6822	-
平成25年1月末日	20,446	-	0.7279	-
平成25年2月末日	20,301	-	0.7339	-
第12特定期間末 （平成25年3月27日）	20,561	20,815	0.7552	0.7642
平成25年3月末日	20,398	-	0.7500	-
平成25年4月末日	21,375	-	0.8019	-
平成25年5月末日	20,967	-	0.8038	-
平成25年6月末日	19,518	-	0.7549	-
平成25年7月末日	19,420	-	0.7613	-
平成25年8月末日	18,953	-	0.7485	-
第13特定期間末 （平成25年9月27日）	19,577	19,807	0.7823	0.7913
平成25年9月末日	19,313	-	0.7716	-
平成25年10月末日	19,658	-	0.7930	-

（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

期間	1口当りの分配金（円）
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
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	0.0090
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25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%
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	27.3%
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25年9月27日）	4.8%

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

(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

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
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
第12特定期間（平成24年9月28日～平成25年3月27日）	155,641,899	3,332,778,933
第13特定期間（平成25年3月28日～平成25年9月27日）	122,052,475	2,320,663,987

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考情報)

2013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ものとして計算しております。

分配の推移

2013年9月	30円
2013年7月	30円
2013年5月	30円
2013年3月	30円
2013年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	1,310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	15.5%
グローバル好配当株マザーファンド	15.3%
欧州債券マザーファンド	10.2%
新興国債券マザーファンド	9.9%
日本好配当株マザーファンド	9.8%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.7%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	9.6%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	9.5%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	4.7%
コモディティ・マザーファンド	4.5%

* 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、2013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。

[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25年3月28日から平成25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25年 3月27日現在 金 額（円）	当 期 平成25年 9月27日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,564,530	1,636,810
コール・ローン	458,208,777	370,629,005
投資証券	5,136,179,149	4,643,279,726
親投資信託受益証券	15,152,131,075	14,581,883,605
未収入金	-	151,012,037
流動資産合計	20,748,083,531	19,748,441,183
資産合計	20,748,083,531	19,748,441,183
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	996,776
未払収益分配金	81,676,967	75,081,133
未払解約金	54,741,755	46,159,203
未払受託者報酬	1,379,248	1,336,242
未払委託者報酬	48,273,981	46,769,086
その他未払費用	611,613	634,377
流動負債合計	186,683,564	170,976,817
負債合計	186,683,564	170,976,817
純資産の部		
元本等		
元本	27,225,655,956	25,027,044,444
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,664,255,989	5,449,580,078
（分配準備積立金）	626,725,223	674,368,069
元本等合計	20,561,399,967	19,577,464,366
純資産合計	20,561,399,967	19,577,464,366
負債純資産合計	20,748,083,531	19,748,441,183

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	前 期	当 期
	自 平成24年 9月28日 至 平成25年 3月27日 金 額（円）	自 平成25年 3月28日 至 平成25年 9月27日 金 額（円）
営業収益		
受取配当金	98,960,026	110,894,323
受取利息	118,338	110,910
有価証券売買等損益	3,839,118,809	789,376,752
為替差損益	916,439,029	236,669,573
営業収益合計	4,854,636,202	1,137,051,558
営業費用		
受託者報酬	4,058,612	4,282,925
委託者報酬	142,052,589	149,904,152
その他費用	766,230	811,545
営業費用合計	146,877,431	154,998,622
営業利益又は営業損失（ ）	4,707,758,771	982,052,936
経常利益又は経常損失（ ）	4,707,758,771	982,052,936
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,707,758,771	982,052,936
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（ ）	82,989,773	36,641,801
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,152,662,828	6,664,255,989
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,171,882,364	526,841,159
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,171,882,364	526,841,159
剰余金減少額又は欠損金増加額	54,092,930	27,447,356
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	54,092,930	27,447,356
分配金	254,151,593	230,129,027
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,664,255,989	5,449,580,078

[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25年 3月28日 至 平成25年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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25年 3月27日現在	平成25年 9月27日現在
1. 元本状況		
期首元本額	30,402,792,990円	27,225,655,956円
期中追加設定元本額	155,641,899円	122,052,475円
期中一部解約元本額	3,332,778,933円	2,320,663,987円
2. 受益権の総数	27,225,655,956口	25,027,044,444口
3. 元本の欠損	6,664,255,989円	5,449,580,078円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成24年 9月28日 至 平成25年 3月27日	自 平成25年 3月28日 至 平成25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	12,850,106円	13,459,565円
2. 分配金の計算過程 第33期計算期間末（平成24年11月27日）に、投資信託約款に基づき計算した791,639,821円（1万口当たり269.34円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い188,174,786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36期計算期間末（平成25年 5月27日）に、投資信託約款に基づき計算した844,860,081円（1万口当たり322.91円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い178,492,642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）	93,399,628円	146,150,835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	0円
収益調整金	106,143,028円	97,362,959円
分配準備積立金	592,097,165円	601,346,287円
分配可能額	791,639,821円	844,860,081円
（1万口当たり分配可能額）	(269.34円)	(322.91円)
収益分配金	88,174,786円	78,492,642円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)	(30円)

第34期計算期間末（平成25年1月28日）に、投資信託約款に基づき計算した779,651,116円（1万口当たり277.46円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い84,299,840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）	107,084,622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	102,528,874円
分配準備積立金	570,037,620円
分配可能額	779,651,116円
（1万口当たり分配可能額）	(277.46円)
収益分配金	84,299,840円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第35期計算期間末（平成25年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した808,715,761円（1万口当たり297.04円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い81,676,967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）	134,975,534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	100,313,571円
分配準備積立金	573,426,656円
分配可能額	808,715,761円
（1万口当たり分配可能額）	(297.04円)
収益分配金	81,676,967円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第37期計算期間末（平成25年7月29日）に、投資信託約款に基づき計算した805,043,326円（1万口当たり315.48円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い176,555,252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）	57,569,129円
有価証券売買等損益	0円
収益調整金	96,003,534円
分配準備積立金	651,470,663円
分配可能額	805,043,326円
（1万口当たり分配可能額）	(315.48円)
収益分配金	76,555,252円
（1万口当たり収益分配金）	(30円)

第38期計算期間末（平成25年9月27日）に、投資信託約款に基づき計算した844,560,917円（1万口当たり337.46円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い75,081,133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）	130,084,057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	95,111,715円
分配準備積立金	619,365,145円
分配可能額	844,560,917円
（1万口当たり分配可能額）	(337.46円)
収益分配金	75,081,133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25年3月28日 至 平成25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及び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。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	当期
	平成25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

前期（平成25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	769,592,639
投資証券	35,121,760
合計	734,470,879

当期（平成25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	455,452,458
投資証券	19,339,269
合計	474,791,727

（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25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	当期			
		平成25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	150,000,000	-	150,996,776	996,776
	合計	-	-	150,996,776	996,776

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自 平成25年3月28日 至 平成25年9月27日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期	当期
平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.7552円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,552円）」	1口当たり純資産額 0.7823円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,823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	1,847,777,245	1,951,622,326	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	3,716,972,934	2,963,542,520	
	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	2,090,578,132	2,909,248,528	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,222,136,789	1,928,042,998	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	1,789,998,049	1,953,245,871	
	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	1,582,971,086	1,977,447,480	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファン ド	1,316,440,432	898,733,882	
	小計（日本）7銘柄		13,566,874,667	14,581,883,605	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	1,254,342.720	9,006,180.720	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	1,865,252.220	18,950,962.550	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	1,775,620.790	18,963,630.030	
		小計（アメリカ・ドル）3銘柄		4,895,215.730	46,920,773.300 (4,643,279,726)
合計				19,225,163,331 (4,643,279,726)	

- (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、内数で表示してあります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 3銘柄	23.71%	24.15%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは、指定投資信託証券である、「日本好配当株マザーファンド」、「世界REITマザーファンド」、「グローバル好配当株マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「欧州債券マザーファンド」、「コモディティ・マザーファンド」、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」、「USアグリゲート・ボンド・ファンド」、「グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド」及び「グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」及び「投資証券」は指定投資信託証券に属するものを指します。

指定投資信託証券の状況は以下のとおりです。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本好配当株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,364,808,119	2,109,968,245
株式	29,246,253,500	30,513,644,900
派生商品評価勘定	68,614,811	57,774,269
未収入金	174,967,592	89,524,901
未収配当金	384,956,210	324,629,350
差入委託証拠金	35,700,000	64,170,000
流動資産合計	31,275,300,232	33,159,711,665
資産合計	31,275,300,232	33,159,711,665
負債の部		
流動負債		
前受金	50,337,000	73,830,000
未払金	109,106,340	278,398,903
未払解約金	29,240,477	7,904,640
流動負債合計	188,683,817	360,133,543
負債合計	188,683,817	360,133,543
純資産の部		
元本等		
元本	33,185,546,304	31,053,614,846
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,098,929,889	1,745,963,276
元本等合計	31,086,616,415	32,799,578,122
純資産合計	31,086,616,415	32,799,578,122
負債純資産合計	31,275,300,232	33,159,711,665

[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25年 3月28日 至 平成25年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成25年 3月27日現在	平成25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	36,672,675,024円	33,185,546,304円
期中追加設定元本額	767,216,666円	1,300,397,641円
期中一部解約元本額	4,254,345,386円	3,432,329,099円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	30,982,783,447円	29,205,837,601円
グローバル資産分散オープン	2,202,762,857円	1,847,777,245円
合計	33,185,546,304円	31,053,614,846円
2. 受益権の総数	33,185,546,304口	31,053,614,846口
3. 元本の欠損	2,098,929,889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25年 3月28日 至 平成25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25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25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	7,961,334,298
合計	7,961,334,298

「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10月10日から平成25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	1,763,797,028
合計	1,763,797,028

「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25年4月9日から平成25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25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 T O P I X	1,180,885,189	-	1,249,500,000	68,614,811
合計		-	-	1,249,500,000	68,614,811

区分	種類	平成25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 T O P I X	1,622,375,731	-	1,680,150,000	57,774,269
合計		-	-	1,680,150,000	57,774,269

(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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.9368円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,368円)」	1口当たり純資産額 1.0562円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,562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	西松建設	482,000	287	138,334,000	
	奥村組	311,000	431	134,041,000	
	大東建託	39,900	10,070	401,793,000	
	積水ハウス	17,000	1,337	22,729,000	
	関電工	230,000	592	136,160,000	
	協和エクシオ	30,000	1,166	34,980,000	
	高砂熱学工業	20,000	843	16,860,000	
	キリンホールディングス	89,000	1,441	128,249,000	
	日本たばこ産業	254,800	3,565	908,362,000	
	グンゼ	145,000	269	39,005,000	
	オンワードホールディングス	112,000	867	97,104,000	
	クラレ	46,000	1,164	53,544,000	
	旭化成	45,000	746	33,570,000	
	住友化学	127,000	377	47,879,000	
	日産化学工業	71,200	1,489	106,016,800	
	J S R	46,900	1,862	87,327,800	
	住友ベークライト	148,000	364	53,872,000	
	日立化成	35,900	1,679	60,276,100	
	A D E K A	213,700	1,175	251,097,500	
	日油	217,000	643	139,531,000	
	花王	57,800	3,135	181,203,000	
	太陽ホールディングス	50,800	3,005	152,654,000	
	D I C	1,380,000	275	379,500,000	
	東洋インキ S C ホールディングス	673,000	513	345,249,000	
	日本バルカー工業	143,000	280	40,040,000	
	武田薬品工業	83,600	4,675	390,830,000	
	アステラス製薬	126,000	5,030	633,780,000	
	田辺三菱製薬	25,000	1,375	34,375,000	
	科研製薬	125,000	1,491	186,375,000	
	エーザイ	32,500	4,055	131,787,500	
	小野薬品工業	35,700	6,120	218,484,000	
	第一三共	50,000	1,808	90,400,000	
	昭和シェル石油	300,000	1,119	335,700,000	
	東燃ゼネラル石油	186,000	913	169,818,000	
	J X ホールディングス	957,000	522	499,554,000	
	横浜ゴム	29,000	995	28,855,000	
	住友ゴム工業	280,000	1,576	441,280,000	
	ニチアス	85,000	669	56,865,000	
	丸一鋼管	90,800	2,478	225,002,400	
	愛知製鋼	352,000	571	200,992,000	
	住友金属鉱山	105,000	1,428	149,940,000	
	古河スカイ	75,000	331	24,825,000	
	アサヒホールディングス	32,000	1,680	53,760,000	
	三和ホールディングス	540,000	613	331,020,000	
	アイダエンジニアリング	285,000	917	261,345,000	
	サトーホールディングス	135,000	2,012	271,620,000	
	小松製作所	80,300	2,456	197,216,800	
	マックス	170,000	1,153	196,010,000	
	キッツ	148,000	458	67,784,000	
	ブラザー工業	181,000	1,132	204,892,000	
	ミネベア	395,000	513	202,635,000	
	マブチモーター	50,800	5,220	265,176,000	
	アズビル	174,900	2,293	401,045,700	
スター精密	35,000	961	33,635,000		
キヤノン電子	36,000	1,842	66,312,000		
キヤノン	156,700	3,170	496,739,000		
リコー	411,000	1,155	474,705,000		
日産自動車	846,000	1,006	851,076,000		
トヨタ自動車	262,300	6,440	1,689,212,000		
日野自動車	72,000	1,452	104,544,000		
ケーヒン	26,000	1,617	42,042,000		
アイシン精機	42,000	4,365	183,330,000		
本田技研工業	256,900	3,840	986,496,000		
ショーワ	70,000	1,338	93,660,000		
豊田合成	25,000	2,497	62,425,000		
H O Y A	113,200	2,329	263,642,800		
トッパン・フォームズ	177,000	970	171,690,000		

リンテック	84,000	2,094	175,896,000
電源開発	26,700	3,265	87,175,500
大阪瓦斯	222,000	421	93,462,000
西日本旅客鉄道	119,500	4,280	511,460,000
日本通運	160,000	501	80,160,000
山九	72,000	327	23,544,000
センコー	396,000	498	197,208,000
日本航空	65,800	5,980	393,484,000
NEC ネットズエスアイ	99,000	2,388	236,412,000
新日鉄住金ソリューションズ	36,000	1,965	70,740,000
ティーガイア	129,400	1,020	131,988,000
野村総合研究所	31,000	3,460	107,260,000
フジ・メディア・ホールディングス	40,000	2,174	86,960,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,000	3,550	35,500,000
大塚商会	18,000	12,650	227,700,000
日本電信電話	167,600	5,170	866,492,000
KDDI	110,000	5,190	570,900,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	203,800	1,587	323,430,600
エヌ・ティ・ティ・データ	10,000	3,400	34,000,000
あい ホールディングス	142,800	1,142	163,077,600
ナガイレーベン	21,000	1,547	32,487,000
第一興商	23,600	2,653	62,610,800
伊藤忠商事	399,000	1,253	499,947,000
丸紅	393,000	796	312,828,000
三井物産	332,000	1,472	488,704,000
住友商事	255,400	1,363	348,110,200
三菱商事	305,000	2,030	619,150,000
稲畑産業	83,000	954	79,182,000
サンゲツ	2,100	2,625	5,512,500
東陽テクニカ	83,200	1,234	102,668,800
オートバックスセブン	21,000	1,507	31,647,000
ローソン	46,200	7,740	357,588,000
セブン&アイ・ホールディングス	91,500	3,650	333,975,000
良品計画	21,600	8,810	190,296,000
チヨダ	64,000	2,109	134,976,000
イオン	50,000	1,372	68,600,000
あおぞら銀行	905,000	294	266,070,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,409,700	644	1,551,846,800
りそなホールディングス	382,000	512	195,584,000
三井住友トラスト・ホールディングス	1,158,000	499	577,842,000
横浜銀行	299,000	570	170,430,000
ふくおかフィナンシャルグループ	256,000	449	114,944,000
セブン銀行	80,000	332	26,560,000
みずほフィナンシャルグループ	6,773,600	222	1,503,739,200
水戸証券	119,000	548	65,212,000
いちよし証券	91,000	1,480	134,680,000
極東証券	43,000	1,787	76,841,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	176,000	2,640	464,640,000
東京海上ホールディングス	69,400	3,295	228,673,000
T&Dホールディングス	161,500	1,258	203,167,000
イオンフィナンシャルサービス	152,500	3,170	483,425,000
パーク24	41,500	1,768	73,372,000
アコーディア・ゴルフ	184,000	1,233	226,872,000
NECフィールドینگ	36,500	1,165	42,522,500
ユー・エス・エス	169,000	1,431	241,839,000
合計 122銘柄	30,486,600	-	30,513,644,900

デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

世界REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	32,091,907	83,729,953
コール・ローン	6,578,405	26,756,147
投資証券	3,013,121,217	2,844,200,753
未収配当金	9,532,711	8,765,458
流動資産合計	3,061,324,240	2,963,452,311
資産合計	3,061,324,240	2,963,452,311
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	53,100	-
流動負債合計	53,100	-
負債合計	53,100	-
純資産の部		
元本等		
元本	4,000,575,866	3,716,972,934
剰余金		
剰余金又は欠損金()	939,304,726	753,520,623
元本等合計	3,061,271,140	2,963,452,311
純資産合計	3,061,271,140	2,963,452,311
負債純資産合計	3,061,324,240	2,963,452,311

[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25年 3月28日 至 平成25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	<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	<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25年 3月27日現在	平成25年 9月27日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	4,790,376,198円	4,000,575,866円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	789,800,332円	283,602,932円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	3,953,687,339円	3,716,972,934円
グローバル・リート・インカム・ファンド	46,888,527円	-
合計	4,000,575,866円	3,716,972,934円
2. 受益権の総数	4,000,575,866口	3,716,972,934口
3. 元本の欠損	939,304,726円	753,520,623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25年 3月28日 至 平成25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25年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成25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	454,771,339
合計	454,771,339

「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25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	55,582,119
合計	55,582,119

「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25年3月28日から平成25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25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 売建 アメリカ・ドル	9,404,900	-	9,458,000	53,100
	合計	-	-	9,458,000	53,100

(注)時価の算定方法

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

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

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

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

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

（平成25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25年3月28日 至 平成25年9月27日）

該当事項はありません

（1口当たり情報）

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.7652円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,652円）」	1口当たり純資産額 0.7973円 「1口 = 1円（10,000口 = 7,973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	34,122,000	
	投資証券	産業ファンド投資法人	27	25,380,000	
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	60	13,596,000	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	44	54,824,000	
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	30	34,740,000	
	投資証券	日本リテールファンド投資法人	107	21,592,600	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	293	44,330,900	
	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	20	18,500,000	
	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	60	29,010,000	
	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	45	28,350,000	
			小計（日本）10銘柄	733	304,445,500
アメリカ ・ドル	投資証券	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,700.000	129,019.000	
	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	13,825.000	347,145.750	
	投資証券	COUSINS PROPERTIES INC-B	9,929.000	248,225.000	
	投資証券	DUKE REALTY CORP	12,500.000	198,000.000	
	投資証券	EPR PROPERTIES	5,700.000	284,430.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,496.000	901,836.320	
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	7,000.000	136,220.000	
	投資証券	GLIMCHER REALTY TRUST - G	9,569.000	240,181.900	
	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	17,731.000	1,129,819.320	
	投資証券	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	14,100.000	399,735.000	
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,700.000	318,507.000	
	投資証券	LTC PROPERTIES INC	6,800.000	258,672.000	
	投資証券	MACK-CALI REALTY CORP	15,600.000	343,668.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	8,852.000	1,339,042.040	
	投資証券	VENTAS INC	9,100.000	575,848.000	
	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	4,533.000	386,211.600	
		小計（アメリカ・ドル）16銘柄	164,135.000	7,236,560.930 (716,130,069)	
カナダ ・ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,567.000	476,486.570	
	投資証券	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	7,800.000	189,930.000	
	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,405.000	253,930.350	
	投資証券	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES	12,800.000	129,920.000	
	投資証券	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	9,000.000	261,900.000	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,863.000	383,567.340	
			小計（カナダ・ドル）6銘柄	72,435.000	1,695,734.260 (162,790,489)
オースト ラリア・ ドル	投資証券	CHARTER HALL RETAIL REIT	133,400.000	501,584.000	
	投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	505,900.000	500,841.000	
	投資証券	GPT GROUP	148,900.000	525,617.000	
	投資証券	INVESTA OFFICE FUND	108,292.000	321,627.240	
	投資証券	MIRVAC GROUP	298,500.000	523,867.500	
	投資証券	STOCKLAND	157,638.000	613,211.820	
	投資証券	WESTFIELD GROUP	104,792.000	1,135,945.280	
	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	327,792.000	983,376.000	
		小計（オーストラリア・ドル）8銘柄	1,785,214.000	5,106,069.840 (473,536,917)	
シンガ ポール・ ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	248,205.000	583,281.750	
	投資証券	CAPITACOMMERCIAL TRUST	286,500.000	425,452.500	
	投資証券	CAPITAMALL TRUST	398,356.000	792,728.440	
	投資証券	MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	271,120.000	292,809.600	

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25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,880,179,494	1,318,880,357
コール・ローン	3,485,857,115	3,262,548,032
株式	127,434,776,960	121,614,708,434
派生商品評価勘定	6,255,952	-
未収入金	1,427,460,430	-
未収配当金	463,339,060	566,638,511
流動資産合計	134,697,869,011	126,762,775,334
資産合計	134,697,869,011	126,762,775,334
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,725,562	-
未払金	781,953,165	-
未払解約金	185,642,469	182,193,121
流動負債合計	974,321,196	182,193,121
負債合計	974,321,196	182,193,121
純資産の部		
元本等		
元本	106,727,643,008	90,957,290,100
剰余金		
剰余金又は欠損金()	26,995,904,807	35,623,292,113
元本等合計	133,723,547,815	126,580,582,213
純資産合計	133,723,547,815	126,580,582,213
負債純資産合計	134,697,869,011	126,762,775,334

[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25年 3月28日 至 平成25年 9月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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25年 3月27日現在	平成25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	132,763,011,558円	106,727,643,008円
期中追加設定元本額	694,964,659円	613,577,713円
期中一部解約元本額	26,730,333,209円	16,383,930,621円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	104,250,869,358円	88,866,711,968円
グローバル資産分散オープン	2,476,773,650円	2,090,578,132円
合計	106,727,643,008円	90,957,290,100円
2. 受益権の総数	106,727,643,008口	90,957,290,100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25年 3月28日 至 平成25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25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)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25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	6,185,077,934
合計	6,185,077,934

「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25年1月9日から平成25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	5,411,957,443
合計	5,411,957,443

「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25年7月9日から平成25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25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	764,842,980	-	768,752,400	3,909,420
	イギリス・ポンド	388,698,931	-	391,045,463	2,346,532
	売建				
	アメリカ・ドル	388,698,931	-	390,889,367	2,190,436
	イギリス・ポンド	345,234,677	-	347,097,802	1,863,125
	ユーロ	419,608,303	-	422,280,304	2,672,001
	合計	-	-	2,320,065,336	469,610

(注)時価の算定方法

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

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

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

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

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

(平成25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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
--------------	--------------

1口当たり純資産額 1.2529円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,529円)」	1口当たり純資産額 1.3916円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,916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	AMERIPRISE FINANCIAL INC	140,300	91.590	12,850,077.000	
	AT&T INC	203,500	34.230	6,965,805.000	
	BLACKROCK INC	38,000	272.680	10,361,840.000	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	262,400	46.930	12,314,432.000	
	CHEVRON CORP	82,400	123.490	10,175,576.000	
	CHUBB CORP	141,100	90.020	12,701,822.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	122,300	55.640	6,804,772.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	150,500	63.280	9,523,640.000	
	DOW CHEMICAL	351,400	39.990	14,052,486.000	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	214,700	59.510	12,776,797.000	
	EATON CORP PLC	177,100	70.510	12,487,321.000	
	FORD MOTOR CO	757,400	17.270	13,080,298.000	
	FREEMPORT-MCMORAN COPPER	329,000	33.870	11,143,230.000	
	GENERAL ELECTRIC CO	485,400	24.250	11,770,950.000	
	HALLIBURTON CO	222,800	48.710	10,852,588.000	
	HARTFORD FINL SVCS GRP	574,700	31.540	18,126,038.000	
	HERSHEY CO/THE	114,300	93.110	10,642,473.000	
	HOME DEPOT INC	150,800	76.070	11,471,356.000	
	INTEL CORP	517,300	23.410	12,109,993.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	237,000	51.890	12,297,930.000	
	KIMBERLY CLARK CORP	61,800	95.460	5,899,428.000	
	KLA-TENCOR CORPORATION	242,800	60.960	14,801,088.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	189,700	74.010	14,039,697.000	
	MERCK & CO INC	231,900	47.680	11,056,992.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	328,400	40.590	13,329,756.000	
	MICROSOFT CORP	339,400	32.770	11,122,138.000	
	NEXTERA ENERGY INC	134,300	80.440	10,803,092.000	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	142,400	72.440	10,315,456.000	
	PPG INDUSTRIES INC	52,900	166.650	8,815,785.000	
	SYMANTEC CORP	502,600	25.060	12,595,156.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	242,100	52.160	12,627,936.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	117,300	85.830	10,067,859.000	
	VERIZON COMM	161,100	47.670	7,679,637.000	
	XL GROUP PLC	409,000	30.960	12,662,640.000	
小計(アメリカ・ドル) 34銘柄	8,428,100	-	388,326,084.000 (38,428,749,273)		
カナダ ・ドル	HUSKY ENERGY INC	366,300	30.260	11,084,238.000	
	小計(カナダ・ドル) 1銘柄	366,300	-	11,084,238.000 (1,064,086,848)	
オースト ラリア ・ドル	AMCOR LTD	1,414,900	10.650	15,068,685.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	456,800	31.560	14,416,608.000	
	BORAL LIMITED	2,915,100	4.800	13,992,480.000	
	BRAMBLES LTD	1,450,600	9.070	13,156,942.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	932,400	12.440	11,599,056.000	
	COMMONWEALTH BK	183,200	73.210	13,412,072.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,648,300	5.920	15,677,936.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	310,400	48.830	15,156,832.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	435,300	35.330	15,379,149.000	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	859,600	14.740	12,670,504.000	
	SANTOS LTD	1,033,800	15.430	15,951,534.000	
	TELSTRA CORP	2,624,100	4.960	13,015,536.000	
	WESFARMERS LIMITED	310,100	41.810	12,965,281.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	440,100	33.370	14,686,137.000	
	WOOLWORTHS LIMITED	370,900	35.430	13,140,987.000	
小計(オーストラリア・ドル) 15銘柄	16,385,600	-	210,289,739.000 (19,502,270,395)		
香港 ・ドル	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,780,000	25.150	95,067,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	1,070,000	87.500	93,625,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	747,900	126.900	94,908,510.000	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,384,500	67.300	93,176,850.000	
	SJM HOLDINGS LIMITED	2,300,000	21.450	49,335,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	790,000	92.900	73,391,000.000	
	小計(香港・ドル) 6銘柄	10,072,400	-	499,503,360.000 (6,373,662,873)	
シンガ ポール・ ドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	930,000	16.500	15,345,000.000	
	KEPPEL CORP LTD	1,480,000	10.600	15,688,000.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,600,000	10.370	16,592,000.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,685,000	3.750	17,568,750.000	
	小計(シンガポール・ドル) 4銘柄	8,695,000	-	65,193,750.000 (5,143,134,937)	
台湾 ・ドル	ASIA CEMENT CORP	5,100,000	37.500	191,250,000.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,450,000	156.500	383,425,000.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	460,000	988.000	454,480,000.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	3,700,000	50.200	185,740,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	5,100,000	64.000	326,400,000.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	5,244,000	70.300	368,653,200.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	4,293,131	101.500	435,752,796.500	
	小計(台湾・ドル) 7銘柄	26,347,131	-	2,345,700,996.500 (7,858,098,338)	
イギリス ・ポンド	ANGLO AMERICAN PLC	458,600	15.695	7,197,727.000	
	AVIVA PLC	1,980,600	4.073	8,066,983.800	
	BHP BILLITON PLC	377,400	18.830	7,106,442.000	
	BT GROUP PLC	2,190,400	3.431	7,515,262.400	
	CENTRICA	1,995,400	3.669	7,321,122.600	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	463,000	15.965	7,391,795.000	
	ITV PLC	4,553,800	1.761	8,019,241.800	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,991,500	2.020	8,062,830.000	
	NEXT PLC	167,400	51.750	8,662,950.000	
	PERSIMMON PLC	555,500	11.090	6,160,495.000	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	151,400	45.450	6,881,130.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	777,400	11.290	8,776,846.000	
	VODAFONE GROUP PLC	2,889,200	2.185	6,312,902.000	
	WEIR GROUP PLC/THE	374,000	23.830	8,912,420.000	
	小計(イギリス・ポンド) 14銘柄	20,925,600	-	106,388,147.600 (16,885,926,787)	
スイス・ フラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	51,000	243.000	12,393,000.000	
	SWISS RE AG	156,600	76.000	11,901,600.000	
	SYNGENTA AG-REG	33,200	373.100	12,386,920.000	
	小計(スイス・フラン) 3銘柄	240,800	-	36,681,520.000 (3,987,648,039)	
ノルウェ ー・ クローネ	DNB ASA	796,200	94.000	74,842,800.000	
	STATOIL ASA	462,400	137.500	63,580,000.000	
	TELENOR ASA	477,900	138.600	66,236,940.000	
	小計(ノルウェー・クローネ) 3銘柄	1,736,500	-	204,659,740.000 (3,385,072,099)	
スウェー デン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	481,800	157.000	75,642,600.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	271,300	279.000	75,692,700.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 2銘柄	753,100	-	151,335,300.000 (2,333,590,326)	
韓国・ ウォン	KT&G CORP	190,300	77,200.000	14,691,160,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄	190,300	-	14,691,160,000.000 (1,353,055,836)	
ユーロ	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	125,500	79.720	10,004,860.000	
	BNP PARIBAS	180,000	50.840	9,151,200.000	
	CAPGEMINI SA	185,800	44.380	8,245,804.000	
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	189,500	57.730	10,939,835.000	
	DELHAIZE GROUP	156,200	47.155	7,365,611.000	
	DEUTSCHE POST AG-REG	445,400	24.110	10,738,594.000	
	GEA GROUP AG	292,900	30.625	8,970,062.500	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	436,200	24.435	10,658,547.000	
	LINDE AG	64,400	148.700	9,576,280.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	301,500	31.970	9,638,955.000	
	SANOFI	118,000	74.600	8,802,800.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC	162,200	65.060	10,552,732.000	
	小計(ユーロ) 12銘柄	2,657,600	-	114,645,280.500 (15,299,412,683)	
	合計	96,798,431	-	121,614,708,434 (121,614,708,434)	

- (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	30.36%	31.60%
カナダ・ドル	外国株式 1銘柄	0.84%	0.88%
オーストラリア・ドル	外国株式 15銘柄	15.41%	16.04%
香港・ドル	外国株式 6銘柄	5.03%	5.24%
シンガポール・ドル	外国株式 4銘柄	4.06%	4.23%
台湾・ドル	外国株式 7銘柄	6.21%	6.46%
イギリス・ポンド	外国株式 14銘柄	13.34%	13.88%
スイス・フラン	外国株式 3銘柄	3.15%	3.28%
ノルウェー・クローネ	外国株式 3銘柄	2.67%	2.78%
スウェーデン・クローナ	外国株式 2銘柄	1.84%	1.92%
韓国・ウォン	外国株式 1銘柄	1.07%	1.11%
ユーロ	外国株式 12銘柄	12.09%	12.58%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[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25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	639,230,877	690,536,292
コール・ローン	150,065,582	161,050,159
国債証券	6,436,487,006	7,095,854,137
特殊債券	1,181,181,556	867,566,987
社債券	5,247,306,153	4,683,295,978
派生商品評価勘定	2,488,310	6,520,316
未収入金	97,813,287	152,608,690
未収利息	203,124,217	222,309,402
前払費用	10,453,019	15,752,055
流動資産合計	13,968,150,007	13,895,494,016
資産合計	13,968,150,007	13,895,494,016
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,191,343	1,745,558
未払金	162,946,069	201,587,952
流動負債合計	168,137,412	203,333,510
負債合計	168,137,412	203,333,510
純資産の部		
元本等		
元本	8,817,689,379	8,679,336,834
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,982,323,216	5,012,823,672
元本等合計	13,800,012,595	13,692,160,506
純資産合計	13,800,012,595	13,692,160,506
負債純資産合計	13,968,150,007	13,895,494,016

[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25年 3月28日 至 平成25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25年 3月27日現在	平成25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	10,467,045,187円	8,817,689,379円
期中追加設定元本額	96,055,594円	1,052,783,731円
期中一部解約元本額	1,745,411,402円	1,191,136,276円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,308,942,345円	1,222,136,789円
大和住銀/T・ロウ・プライスFOFs用新興国債券ファンド（適格機関投資家専用）	5,526,781,610円	4,633,611,397円
T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,981,965,424円	2,823,588,648円
合計	8,817,689,379円	8,679,336,834円
2. 受益権の総数	8,817,689,379口	8,679,336,834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25年 3月28日 至 平成25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25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25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	205,489,738
特殊債券	23,347,325
社債券	41,600,016
合計	187,237,047

「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11月8日から平成25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	649,556,894
特殊債券	49,202,568
社債券	293,283,750
合計	992,043,212

「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25年5月8日から平成25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25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	122,245,801	-	121,754,264	491,537
	メキシコ・ペソ	56,556,315	-	59,044,434	2,488,119
	売建				
	アメリカ・ドル	158,456,315	-	159,521,595	1,065,280
	メキシコ・ペソ	122,245,801	-	125,880,136	3,634,335
	合計	-	-	466,200,429	2,703,033

区分	種類	平成25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	236,219,929	-	237,277,349	1,057,420
	メキシコ・ペソ	76,698,899	-	75,874,945	823,954
	売建				
	アメリカ・ドル	76,698,899	-	77,003,414	304,515
	メキシコ・ペソ	225,219,929	-	220,374,122	4,845,807
	合計	-	-	610,529,830	4,774,758

(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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.5650円 「1口 = 1円(10,000口 = 15,650円)」	1口当たり純資産額 1.5776円 「1口 = 1円(10,000口 = 15,776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	ARMEN 6 09/30/20	700,000.000	684,670.000	
	国債証券	BERMUD 4.854 02/06/24	1,305,000.000	1,302,455.250	
	国債証券	BRAZIL 2.625 01/05/23	1,000,000.000	887,500.000	
	国債証券	BRAZIL 7.125 01/20/37	1,191,000.000	1,433,368.500	
	国債証券	COLOM 4.375 07/12/21	500,000.000	520,000.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	1,600,000.000	1,776,000.000	
	国債証券	CROATI 5.5 04/04/23	360,000.000	352,134.000	
	国債証券	CROATI 6.375 03/24/21	1,100,000.000	1,158,025.000	
	国債証券	DOMREP 5.875 04/18/24	150,000.000	140,250.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	550,000.000	591,250.000	
	国債証券	DOMREP 8.625 04/20/27	160,000.000	176,000.000	
	国債証券	DOMREP 9.04 01/23/18	427,900.450	467,481.240	
	国債証券	EGYPT 5.75 04/29/20	300,000.000	284,250.000	
	国債証券	ELSALV 7.75 01/24/23	300,000.000	329,250.000	
	国債証券	GEORG 6.875 04/12/21	200,000.000	214,500.000	
	国債証券	ICELND 4.875 06/16/16	2,150,000.000	2,253,307.500	
	国債証券	INDOIS 3.3 11/21/22	900,000.000	749,250.000	
	国債証券	INDOIS 6.125 03/15/19	200,000.000	209,000.000	
	国債証券	INDON 3.375 04/15/23	200,000.000	174,000.000	
	国債証券	INDON 4.625 04/15/43	200,000.000	165,500.000	
	国債証券	INDON 5.375 10/17/23	200,000.000	202,500.000	
	国債証券	INDON 6.625 02/17/37	2,750,000.000	2,853,125.000	
	国債証券	IRAQ 5.8 01/15/28	1,161,000.000	998,460.000	
	国債証券	JMGB 8.5 11/16/21	1,619,047.000	1,586,666.060	
	国債証券	LITHUN 6.125 03/09/21	1,700,000.000	1,945,140.000	
	国債証券	MALAYS 4.646 07/06/21	750,000.000	795,375.000	
	国債証券	MOROC 4.25 12/11/22	425,000.000	392,870.000	
	国債証券	MOROC 5.5 12/11/42	200,000.000	170,000.000	
	国債証券	PANAMA 6.7 01/26/36	200,000.000	230,686.000	
	国債証券	PERU 5.625 11/18/50	1,740,000.000	1,842,747.000	
	国債証券	PERU 6.55 03/14/37	413,000.000	491,986.250	
	国債証券	PHILIP 5 01/13/37	700,000.000	762,125.000	
	国債証券	QATAR 5.75 01/20/42	400,000.000	433,540.000	
	国債証券	REPHUN 4.75 02/03/15	5,600,000.000	5,782,000.000	
	国債証券	REPNAM 5.5 11/03/21	800,000.000	814,480.000	
	国債証券	ROMANI 4.375 08/22/23	336,000.000	322,980.000	
	国債証券	ROMANI 4.375 08/22/23	800,000.000	769,000.000	
	国債証券	ROMANI 6.75 02/07/22	1,000,000.000	1,143,950.000	
	国債証券	RUSSIA FL 03/31/30	9,297,600.000	11,060,517.920	
	国債証券	SERBIA 4.875 02/25/20	400,000.000	373,000.000	
	国債証券	SERBIA 5.25 11/21/17	200,000.000	200,016.000	
	国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	2,100,000.000	2,204,475.000	
	国債証券	SERBIA FL 11/01/24	742,802.280	726,089.220	
	国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	698,000.000	687,530.000	
国債証券	SOAF 5.875 05/30/22	600,000.000	653,640.000		

国債証券	SOAF 5.875 09/16/25	200,000.000	213,100.000
国債証券	SOAF 6.25 03/08/41	352,000.000	376,640.000
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	600,000.000	555,000.000
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	200,000.000	191,500.000
国債証券	SRILAN 6.25 10/04/20	400,000.000	389,200.000
国債証券	TURKEY 5.625 03/30/21	3,000,000.000	3,169,500.000
国債証券	TURKEY 6 01/14/41	450,000.000	443,812.500
国債証券	TURKEY 6.75 04/03/18	1,000,000.000	1,125,000.000
国債証券	TURKEY 7 06/05/20	1,547,000.000	1,765,900.500
国債証券	TURKEY 8 02/14/34	3,150,000.000	3,835,597.500
国債証券	UKRAIN 6.58 11/21/16	3,860,000.000	3,402,783.000
国債証券	UKRAIN 6.75 11/14/17	565,000.000	488,725.000
国債証券	UKRAIN 6.875 09/23/15	400,000.000	361,000.000
国債証券	VENZ 7 03/31/38	1,000,000.000	665,000.000
特殊債券	ESKOM 5.75 01/26/21	700,000.000	701,400.000
特殊債券	GAZPRU 7.288 08/16/37	100,000.000	109,000.000
特殊債券	LIBAN 10 04/25/15	330,000.000	356,918.100
特殊債券	PEMEX 3.5 01/30/23	90,000.000	82,665.000
特殊債券	PEMEX 3.5 07/18/18	275,000.000	281,875.000
特殊債券	PEMEX 4.875 03/15/15	3,500,000.000	3,697,750.000
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	720,000.000	671,040.000
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	1,825,000.000	1,925,375.000
特殊債券	PERTIJ 6 05/03/42	771,000.000	647,640.000
特殊債券	SIBNEF 4.375 09/19/22	200,000.000	186,010.000
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	200,000.000	210,250.000
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	250,000.000	262,812.500
社債券	AGIPM 6.5 08/18/17	100,000.000	105,750.000
社債券	AGROK 8.875 02/01/20	200,000.000	210,800.000
社債券	ALFARU 7.875 09/25/17	370,000.000	409,775.000
社債券	ALTICE 7.875 12/15/19	200,000.000	214,100.000
社債券	ALTICE 9.875 12/15/20	200,000.000	217,000.000
社債券	ARCO 6.625 09/27/23	100,000.000	99,125.000
社債券	AUTGIL 6.75 01/15/23	150,000.000	117,750.000
社債券	AVINPU 10 10/29/15	100,000.000	100,065.000
社債券	BAKCEY 5.325 04/16/18	400,000.000	377,000.000
社債券	BANBOG 5.375 02/19/23	200,000.000	190,250.000
社債券	BANCO 3.875 02/08/22	200,000.000	195,318.000
社債券	BANGRA 7.375 02/02/22	400,000.000	398,740.000
社債券	BCOCPE 2.25 07/29/16	165,000.000	161,865.000
社債券	BCOCPE 3.25 04/08/18	190,000.000	186,200.000
社債券	BCP 5.375 09/16/20	200,000.000	203,000.000
社債券	BHARTI 5.125 03/11/23	200,000.000	181,560.000
社債券	BNSCN FL 12/13/27	250,000.000	220,000.000
社債券	BRFSBZ 5.875 06/06/22	200,000.000	201,000.000
社債券	BRPRSA 9 PERPETUAL	500,000.000	490,000.000
社債券	CCOLAT 4.75 10/01/18	200,000.000	201,154.000
社債券	CDEL 3 07/17/22	3,400,000.000	3,105,628.000
社債券	CDEL 6.15 10/24/36	100,000.000	109,434.000
社債券	CEMEX 5.875 03/25/19	200,000.000	191,500.000
社債券	CEMEX 9.375 10/12/22	500,000.000	549,885.000
社債券	CENCHI 6.5 06/04/18	300,000.000	285,570.000
社債券	CFELEC 5.75 02/14/42	300,000.000	280,500.000
社債券	CHIOIL 5.25 04/25/18	200,000.000	193,370.000
社債券	COGARD 11.125 02/23/18	800,000.000	900,000.000
社債券	COSL 3.25 09/06/22	200,000.000	184,032.000
社債券	CSANBZ 5 03/14/23	200,000.000	179,700.000
社債券	DPWDU 6.85 07/02/37	250,000.000	254,325.000
社債券	DTEKUA 9.5 04/28/15	100,000.000	99,520.000
社債券	ECOPET 5.875 09/18/23	75,000.000	79,125.000
社債券	EMBRA 5.15 06/15/22	200,000.000	195,500.000
社債券	EUCHEM 5.125 12/12/17	200,000.000	200,330.000
社債券	EVRAZ 6.5 04/22/20	200,000.000	186,500.000
社債券	FXPOLN 7.875 04/07/16	200,000.000	185,000.000
社債券	GARAN 6.25 04/20/21	500,000.000	506,250.000
社債券	GCCAMM 8.125 02/08/20	200,000.000	208,000.000
社債券	GEBGG 7.75 07/05/17	200,000.000	211,200.000
社債券	GRTBNL 7.5 05/19/16	300,000.000	319,560.000

社債券	HALKBK 4.875 07/19/17	375,000.000	376,413.750	
社債券	HDFCB 3 03/06/18	200,000.000	191,330.000	
社債券	HRELEC 6 11/09/17	800,000.000	826,000.000	
社債券	INDYIJ 6.375 01/24/23	200,000.000	171,000.000	
社債券	INTERG 6.375 05/14/17	2,450,000.000	2,664,375.000	
社債券	ISRELE 6.875 06/21/23	350,000.000	364,472.500	
社債券	ISRELE 9.375 01/28/20	200,000.000	240,750.000	
社債券	ITAU 5.65 03/19/22	200,000.000	192,500.000	
社債券	JGSPM 4.375 01/23/23	400,000.000	381,000.000	
社債券	KSU 3 05/15/23	325,000.000	298,811.500	
社債券	KWGPRO 12.75 03/30/16	250,000.000	273,962.500	
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	1,100,000.000	1,256,750.000	
社債券	LNGFOR 6.75 01/29/23	200,000.000	189,722.000	
社債券	LNGFOR 6.875 10/18/19	500,000.000	505,950.000	
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	271,875.000	
社債券	METINR 6.5 07/21/16	400,000.000	422,260.000	
社債券	METLIG 5.25 01/17/18	200,000.000	198,630.000	
社債券	METLSA 4.9 04/24/23	150,000.000	137,205.000	
社債券	MHPSA 8.25 04/02/20	555,000.000	456,487.500	
社債券	MIICF 4.75 05/22/20	200,000.000	188,500.000	
社債券	MOBTEL 5 05/30/23	200,000.000	184,880.000	
社債券	MPEL 8.5 12/01/20	250,000.000	273,750.000	
社債券	MRIYA 9.45 04/19/18	200,000.000	169,500.000	
社債券	NAELN 10.25 04/01/17	200,000.000	224,000.000	
社債券	ODBR 7.125 06/26/42	400,000.000	385,600.000	
社債券	ODEBRE 6.75 10/01/22	200,000.000	206,200.000	
社債券	ODHGPR 8.375 09/20/20	200,000.000	203,408.000	
社債券	PDVSA 12.75 02/17/22	250,000.000	246,875.000	
社債券	PDVSA 4.9 10/28/14	4,642.000	4,398.290	
社債券	PDVSA 5.125 10/28/16	1,175,356.000	952,038.360	
社債券	PDVSA 5.25 04/12/17	5,190,000.000	4,177,950.000	
社債券	PDVSA 5.375 04/12/27	500,000.000	292,500.000	
社債券	PDVSA 8.5 11/02/17	860,000.000	789,136.000	
社債券	PETBRA 3 01/15/19	965,000.000	915,051.600	
社債券	PETBRA 5.625 05/20/43	138,000.000	117,783.000	
社債券	PLAYRE 8 08/15/20	150,000.000	159,750.000	
社債券	PLNIJ 5.25 10/24/42	200,000.000	153,500.000	
社債券	PSALM 6.875 11/02/16	9,020,000.000	10,102,400.000	
社債券	PTTGC 4.25 09/19/22	200,000.000	190,366.000	
社債券	RBNRL 6.5 11/01/17	200,000.000	199,428.000	
社債券	RILIN 5.4 02/14/22	250,000.000	250,522.500	
社債券	RPCUH 6 08/31/36	200,000.000	207,500.000	
社債券	SBERRU 5.125 10/29/22	400,000.000	377,080.000	
社債券	SHASHU 8.5 05/25/16	500,000.000	514,800.000	
社債券	SIBRSE 3.914 01/31/18	250,000.000	241,175.000	
社債券	SMPM 4.25 10/17/19	480,000.000	458,400.000	
社債券	SUNHUN 4.5 02/14/22	200,000.000	202,600.000	
社債券	SWIPRO 4.375 06/18/22	200,000.000	200,490.000	
社債券	TMENRU 7.25 02/02/20	100,000.000	114,145.000	
社債券	UKRLAN 10.875 03/26/18	200,000.000	183,000.000	
社債券	VEDLN 7.125 05/31/23	200,000.000	188,100.000	
社債券	VIP 7.748 02/02/21	200,000.000	216,730.000	
社債券	VTB 6.95 10/17/22	250,000.000	251,175.000	
社債券	XINAOG 6 05/13/21	250,000.000	264,002.500	
社債券	YASAR 9.625 10/07/15	725,000.000	720,468.750	
	小計(アメリカ・ドル) 167銘柄	121,374,347.730	124,278,662.790 (12,298,616,469)	
メキシコ ・ペソ	国債証券	MBONO 10 11/20/36	11,046,000.000	14,735,253.540
	国債証券	MBONO 6.5 06/09/22	6,000,000.000	6,247,980.000
	国債証券	MBONO 7.75 11/13/42	5,300,000.000	5,714,036.000
	国債証券	MBONO 8 06/11/20	8,000,000.000	9,150,480.000
	国債証券	MBONO 8.5 11/18/38	4,500,000.000	5,249,520.000
	国債証券	MBONO 8.5 12/13/18	3,000,000.000	3,485,940.000
	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,401,022.000
	小計(メキシコ・ペソ) 7銘柄	39,246,000.000	45,984,231.540 (348,100,633)	
合計			124,724,893.330 (12,646,717,102)	

- (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	59銘柄	89.82%
	特殊債券	10銘柄	
	社債券	98銘柄	
メキシコ・ペソ	国債証券	6銘柄	2.54%
	特殊債券	1銘柄	

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	13,364,089	33,193,312
コール・ローン	534,136	534,170
国債証券	1,540,731,013	1,596,139,265
特殊債券	48,488,537	22,697,910
社債券	292,004,434	273,328,915
派生商品評価勘定	6,109,153	5,747,275
未収利息	25,024,469	23,318,806
前払費用	5,641,702	4,582,058
流動資産合計	1,931,897,533	1,959,541,711
資産合計	1,931,897,533	1,959,541,711
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,325,146	6,375,263
流動負債合計	6,325,146	6,375,263
負債合計	6,325,146	6,375,263
純資産の部		
元本等		
元本	1,929,299,684	1,789,998,049
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,727,297	163,168,399
元本等合計	1,925,572,387	1,953,166,448
純資産合計	1,925,572,387	1,953,166,448
負債純資産合計	1,931,897,533	1,959,541,711

[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25年 3月28日 至 平成25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25年 3月27日現在	平成25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	2,306,312,693円	1,929,299,684円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	377,013,009円	139,301,635円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,929,299,684円	1,789,998,049円
合計	1,929,299,684円	1,789,998,049円
2. 受益権の総数	1,929,299,684口	1,789,998,049口
3. 元本の欠損	3,727,297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25年 3月28日 至 平成25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25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25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	49,776,558
特殊債券	996,885
社債証券	12,807,899
合計	63,581,342

「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25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	27,290,208
特殊債券	490,829
社債証券	3,424,434
合計	31,205,471

「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25年3月28日から平成25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25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	60,306,650	-	59,135,337	1,171,313
	スイス・フラン	7,970,479	-	7,830,468	140,011
	トルコ・リラ	9,793,541	-	9,654,810	138,731
	デンマーク・クローネ	35,123,281	-	34,126,114	997,167
	ノルウェー・クローネ	46,145,278	-	44,414,045	1,731,233
	ポーランド・ズロチ	2,625,619	-	2,554,803	70,816
	ユーロ	61,168,819	-	59,117,569	2,051,250
	売建				
	イギリス・ポンド	44,029,220	-	43,051,769	977,451
	スイス・フラン	3,199,538	-	3,157,000	42,538
	デンマーク・クローネ	3,557,400	-	3,429,300	128,100
	ノルウェー・クローネ	4,970,833	-	4,782,013	188,820
	スウェーデン・クローナ	2,704,448	-	2,673,897	30,551
	ポーランド・ズロチ	2,707,380	-	2,577,440	129,940
ユーロ	161,964,848	-	157,377,720	4,587,128	
合計	-	-	433,882,285	215,993	

区分	種類	平成25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	31,751,274	-	33,048,651	1,297,377
	スイス・フラン	13,369,919	-	13,806,170	436,251
	デンマーク・クローネ	30,776,685	-	31,672,793	896,108
	ノルウェー・クローネ	59,412,780	-	60,158,117	745,337
	ロシア・ルーブル	18,830,559	-	18,970,107	139,548
	ポーランド・ズロチ	29,365,526	-	29,521,277	155,751
	ユーロ	104,552,988	-	106,478,498	1,925,510
	売建				
	イギリス・ポンド	72,286,790	-	74,108,487	1,821,697
	スウェーデン・クローナ	7,461,611	-	7,691,506	229,895
	ロシア・ルーブル	22,746,969	-	22,596,743	150,226
	ポーランド・ズロチ	2,057,618	-	2,085,868	28,250
	ユーロ	183,506,743	-	187,800,997	4,294,254
合計	-	-	587,939,214	627,988	

(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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.9981円 「1口 = 1円 (10,000口 = 9,981円)」	1口当たり純資産額 1.0912円 「1口 = 1円 (10,000口 = 10,912円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
イギリス ・ポンド	国債証券	UKT 1.25 07/22/18	405,000.000	399,654.000	
	国債証券	UKT 3.75 09/07/21	331,000.000	366,019.800	
	国債証券	UKT 4.25 09/07/39	31,000.000	35,051.700	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/46	556,000.000	632,616.800	
	国債証券	UKT 4.75 09/07/15	272,000.000	294,630.400	
	国債証券	UKT 5 03/07/18	224,000.000	259,280.000	
	小計(イギリス・ポンド) 6銘柄			1,819,000.000	1,987,252.700 (315,416,749)
ノルウェー ・クローネ	国債証券	NGB 4.25 05/19/17	541,000.000	581,737.300	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1銘柄			541,000.000	581,737.300 (9,621,935)
スウェーデン ・クローナ	国債証券	SGB 5 12/01/20	1,455,000.000	1,730,766.150	
	小計(スウェーデン・クローナ) 1銘柄			1,455,000.000	1,730,766.150 (26,688,414)
ロシア・ ルーブル	国債証券	RFLB 7 01/25/23	1,521,000.000	1,508,117.130	
	国債証券	RFLB 7.6 04/14/21	1,422,000.000	1,471,329.180	
	国債証券	RFLB 7.6 07/20/22	1,312,000.000	1,353,157.440	
	小計(ロシア・ルーブル) 3銘柄			4,255,000.000	4,332,603.750 (13,301,093)
ポーランド ・ズロチ	国債証券	POLGB 5 10/24/13	63,000.000	63,098.280	
	国債証券	POLGB 5.25 10/25/17	238,000.000	252,496.580	
	国債証券	POLGB 5.5 04/25/15	250,000.000	259,435.000	
	国債証券	POLGB 5.5 10/25/19	78,000.000	84,121.440	
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	250,000.000	274,835.000	
	小計(ポーランド・ズロチ) 5銘柄			879,000.000	933,986.300 (29,476,608)
ユーロ	国債証券	BGB 4 03/28/18	279,000.000	313,010.100	

国債証券	BGB 4 03/28/22	88,000.000	99,259.600
国債証券	BGB 4.25 03/28/41	31,000.000	34,512.300
国債証券	BGB 4.25 09/28/21	77,000.000	88,649.330
国債証券	BGB 5 03/28/35	97,000.000	119,266.350
国債証券	BKO 0.25 03/14/14	201,000.000	201,186.930
国債証券	BTPS 3.75 03/01/21	270,000.000	270,594.000
国債証券	BTPS 4 02/01/17	227,000.000	237,283.100
国債証券	BTPS 4 02/01/37	50,000.000	44,770.000
国債証券	BTPS 4.5 03/01/26	403,000.000	404,974.700
国債証券	BTPS 4.5 08/01/18	235,000.000	248,747.500
国債証券	BTPS 4.75 06/01/17	86,000.000	91,624.400
国債証券	BTPS 4.75 09/15/16	453,000.000	484,288.710
国債証券	BTPS 5 09/01/40	364,000.000	363,818.000
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	615,000.000	667,582.500
国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	210,000.000	229,477.500
国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	58,000.000	63,950.800
国債証券	CZECH 3.875 05/24/22	204,000.000	226,929.600
国債証券	DBR 2.5 07/04/44	277,000.000	268,825.730
国債証券	FRTR 3.75 04/25/21	373,000.000	423,205.800
国債証券	FRTR 4.25 10/25/18	663,000.000	763,099.740
国債証券	FRTR 4.75 04/25/35	295,000.000	362,156.750
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	174,000.000	238,520.940
国債証券	IRISH 4.5 04/18/20	95,000.000	100,115.750
国債証券	IRISH 5 10/18/20	128,000.000	138,617.600
国債証券	IRISH 5.5 10/18/17	112,000.000	124,616.800
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	145,000.000	195,170.000
国債証券	POLAND 3.375 07/09/24	89,000.000	89,956.750
国債証券	RAGB 3.4 11/22/22	153,000.000	170,044.200
国債証券	RAGB 4.85 03/15/26	70,000.000	87,941.700
国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	247,000.000	352,555.450
国債証券	REPHUN 3.875 02/24/20	76,000.000	71,440.000
国債証券	RFGB 1.5 04/15/23	125,000.000	118,825.000
国債証券	ROMANI 4.625 09/18/20	70,000.000	70,843.500
国債証券	ROMANI 4.875 11/07/19	74,000.000	76,664.000
国債証券	SLOVEN 4 03/22/18	184,000.000	174,800.000
国債証券	SPGB 3.8 01/31/17	65,000.000	67,733.250
国債証券	SPGB 4 07/30/15	70,000.000	73,157.000
国債証券	SPGB 4.25 10/31/16	26,000.000	27,522.300
国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	152,000.000	158,397.680
国債証券	SPGB 4.6 07/30/19	424,000.000	450,775.600
国債証券	SPGB 5.75 07/30/32	189,000.000	209,468.700
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	100,000.000	114,285.000
特殊債券	PEMEX 5.5 01/09/17	50,000.000	55,800.500
社債券	ABIBB 2 12/16/19	6,000.000	6,056.400
社債券	ABNAV 4.125 03/28/22	20,000.000	22,106.400
社債券	ALVGR FL 01/13/25	20,000.000	21,312.000
社債券	BAC 7 06/15/16	50,000.000	57,672.500
社債券	BNP 2.5 08/23/19	7,000.000	7,162.400
社債券	BNP 2.875 11/27/17	20,000.000	21,066.000
社債券	C 5 08/02/19	15,000.000	17,278.500
社債券	C FL 02/10/19	5,000.000	4,927.250
社債券	CIRSA 8.75 05/15/18	50,000.000	52,295.000
社債券	DAIGR 2.375 03/08/23	25,000.000	24,377.500
社債券	DNBNOR 3.875 06/29/20	50,000.000	55,131.000
社債券	DPW 1.875 06/27/17	10,000.000	10,278.000
社債券	DT 4.25 03/16/20	30,000.000	33,834.000
社債券	EIBKOR 2 04/30/20	160,000.000	155,096.000
社債券	ENEL 4 09/14/16	50,000.000	53,030.000
社債券	EOANGR 5.5 01/19/16	20,000.000	22,117.000
社債券	GE 4.625 02/22/27	50,000.000	57,488.500
社債券	GMAC 7.5 04/21/15	50,000.000	53,672.500
社債券	GS 2.625 08/19/20	10,000.000	10,033.000
社債券	GSZFP 5.625 01/18/16	7,000.000	7,780.850
社債券	HEIANA 3.5 03/19/24	8,000.000	8,466.800
社債券	HEIGR 7.5 04/03/20	50,000.000	59,525.000
社債券	HSBC 4.875 05/30/17	50,000.000	56,435.000
社債券	IMTLN 8.375 02/17/16	50,000.000	58,397.500

社債券	ISPIM 4.125 04/14/20	50,000.000	51,634.000	
社債券	JPM FL 11/12/19	50,000.000	50,970.000	
社債券	LEVI 7.75 05/15/18	50,000.000	53,500.000	
社債券	LGEN FL 06/08/25	50,000.000	51,232.500	
社債券	LLOYDS 6.5 03/24/20	50,000.000	57,087.500	
社債券	MANAG 7.25 05/20/16	10,000.000	11,646.000	
社債券	MRKGR 4.875 09/27/13	8,000.000	8,000.800	
社債券	MS 5 05/02/19	50,000.000	56,617.500	
社債券	NAB 3.75 01/06/17	15,000.000	16,242.600	
社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	57,242.500	
社債券	OI 6.75 09/15/20	50,000.000	56,920.000	
社債券	RABOBK 4 01/11/22	30,000.000	33,184.500	
社債券	RBS 5.375 09/30/19	50,000.000	58,065.000	
社債券	RENAUL 4.25 04/27/17	10,000.000	10,742.500	
社債券	RENAUL 4.375 01/27/15	10,000.000	10,390.100	
社債券	REPSM 4.75 02/16/17	50,000.000	54,357.500	
社債券	REXLN FL 06/29/67	50,000.000	52,375.000	
社債券	RIFP 7 01/15/15	50,000.000	53,987.500	
社債券	TELEFO 3.661 09/18/17	50,000.000	51,994.500	
社債券	TITIM 8.25 03/21/16	50,000.000	55,995.000	
社債券	TOYOTA 2.375 02/01/23	10,000.000	10,014.500	
社債券	UPCB 7.625 01/15/20	50,000.000	54,072.500	
社債券	VALEBZ 4.375 03/24/18	50,000.000	54,720.000	
社債券	VIEFP 5.125 05/24/22	11,000.000	12,875.610	
社債券	VOTORA 5.25 04/28/17	50,000.000	53,470.000	
社債券	VW 3.25 01/21/19	20,000.000	21,521.000	
社債券	WINDIM 11.75 07/15/17	50,000.000	53,402.000	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	60,375.000	
小計(ユーロ)96銘柄		10,261,000.000	11,222,639.870 (1,497,661,291)	
合計			1,892,166,090 (1,892,166,090)	

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

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	16.15%	16.67%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.49%	0.51%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	1.36%	1.41%
ロシア・ルーブル	国債証券 3銘柄	0.68%	0.70%
ポーランド・ズロチ	国債証券 5銘柄	1.51%	1.56%
ユーロ	国債証券 42銘柄	76.68%	79.15%
	特殊債券 2銘柄		
	社債券 52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25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	285,452	120,511
社債券	919,173,406	893,290,544
未収利息	2,356,828	5,319,116
流動資産合計	921,815,686	898,730,171
資産合計	921,815,686	898,730,171
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	1,316,440,432	1,316,440,432
剰余金		
剰余金又は欠損金()	394,624,746	417,710,261
元本等合計	921,815,686	898,730,171
純資産合計	921,815,686	898,730,171
負債純資産合計	921,815,686	898,730,171

[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25年 3月28日 至 平成25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. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益による為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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25年 3月27日現在	平成25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	1,544,987,942円	1,316,440,432円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	228,547,510円	-
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,316,440,432円	1,316,440,432円
合計	1,316,440,432円	1,316,440,432円
2. 受益権の総数	1,316,440,432口	1,316,440,432口
3. 元本の欠損		
	394,624,746円	417,710,261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25年 3月28日 至 平成25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、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25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25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	64,461,382
合計	64,461,382

「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25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	68,348,109
合計	68,348,109

「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25年3月28日から平成25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25年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成25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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 0.7002円 「1口 = 1円(10,000口 = 7,002円)」	1口当たり純資産額 0.6827円 「1口 = 1円(10,000口 = 6,827円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ・ドル	社債券	DJUBS/BARCLAYS 10/18/13	10,400,000.000	9,026,784.000	
	小計(アメリカ・ドル) 1銘柄		10,400,000.000	9,026,784.000 (893,290,544)	
合計				893,290,544 (893,290,544)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	社債券 1銘柄	99.39%	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25年3月27日現在 金額(円)	平成25年9月27日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	155,430,657	381,570,186
コール・ローン	1,173,196	1,102,380
国債証券	419,145,461	296,941,235
特殊債券	1,459,948,403	1,279,485,184
未収利息	28,418,108	18,283,532
流動資産合計	2,064,115,825	1,977,382,517
資産合計	2,064,115,825	1,977,382,517
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	1,667,882,354	1,582,971,086
剰余金		
剰余金又は欠損金()	396,233,471	394,411,431
元本等合計	2,064,115,825	1,977,382,517
純資産合計	2,064,115,825	1,977,382,517
負債純資産合計	2,064,115,825	1,977,382,517

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成25年 3月28日 至 平成25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25年 3月27日現在	平成25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	1,786,690,616円	1,667,882,354円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	118,808,262円	84,911,268円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,667,882,354円	1,582,971,086円
合計	1,667,882,354円	1,582,971,086円
2. 受益権の総数	1,667,882,354口	1,582,971,086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25年 3月28日 至 平成25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25年9月27日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成25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	2,913,752
特殊債券	6,740,403
合計	9,654,155

「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25年3月27日まで）を指しております。

(平成25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	3,296,355
特殊債券	30,699,955
合計	33,996,310

「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25年3月28日から平成25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25年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成25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25年3月28日 至 平成25年9月27日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年3月27日現在	平成25年9月27日現在
1口当たり純資産額 1.2376円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,376円)」	1口当たり純資産額 1.2492円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,492円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリア・ドル	特殊債券	ASIA 3.5 07/25/18	6,400,000.000	6,327,680.000	
	小計(オーストラリア・ドル) 1銘柄		6,400,000.000	6,327,680.000 (586,829,044)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 1.69 09/29/14	1,100,000.000	1,116,258.000	
	小計(香港・ドル) 1銘柄		1,100,000.000	1,116,258.000 (14,243,452)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	500,000.000	527,595.000	
	小計(シンガポール・ドル) 1銘柄		500,000.000	527,595.000 (41,621,970)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	2,602,000.000	2,875,340.100	
	特殊債券	IADB 6.25 12/15/17	5,200,000.000	5,570,656.000	
	小計(ニュージーランド・ドル) 2銘柄		7,802,000.000	8,445,996.100 (692,656,140)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 3.5 06/10/14	2,500,000,000.000	2,514,875,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄		2,500,000,000.000	2,514,875,000.000 (231,619,988)	
マレーシア・リングgit	国債証券	MGS 4.262 09/15/16	300,000.000	307,107.000	
	小計(マレーシア・リングgit) 1銘柄		300,000.000	307,107.000 (9,455,825)	
合計				1,576,426,419 (1,576,426,419)	

(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、内数で表示してあります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
オーストラリア・ドル	特殊債券 1銘柄	29.68%	37.23%
香港・ドル	国債証券 1銘柄	0.72%	0.90%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	2.10%	2.64%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 2銘柄	35.03%	43.94%
韓国・ウォン	国債証券 1銘柄	11.71%	14.69%
マレーシア・リングgit	国債証券 1銘柄	0.48%	0.60%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

(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」に従って認可されています。

同ファンドの2013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、2013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

2013年6月30日現在(未監査)

	グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	USアグリゲート・ボンド・ファンド
	米ドル	米ドル	米ドル
資 産			
有価証券(取得原価)	1,309,807,939	1,846,997,382	116,912,704
評価(損)益	38,947,095	25,338,582	792,576
有価証券(時価)	1,348,755,034	1,872,335,964	117,705,280
現金預金	25,564,672	12,154,124	3,114,740
有価証券売却未収金	1,033,958	21,842,899	656,476
未収配当金および未収利息	6,491,530	32,481,625	815,542
発行未収金	446,409	3,335,906	58,765
為替予約取引に係る評価益	-	3,411,068	3,679
オプション(時価)	-	3,378,105	-
先物取引に係る評価益	-	-	277,094
スワップ契約(時価)	-	339,453	-
委託証拠金	-	-	-
その他の資産	3,858	14,762	10,262
資産合計	1,382,295,461	1,949,293,906	122,641,838
負 債			
外国税引当金	153,182	-	-
有価証券購入未払金	547,448	16,225,348	615,478
買戻未払金	427,428	1,076,264	326,469
為替予約取引に係る評価損	-	19,275,323	-
未払運用報酬	1,129,623	697,908	3,232
スワップ契約(時価)	-	900,516	-
委託証拠金	-	-	150,342
先物取引に係る評価損	-	-	-
その他の負債	292,809	1,168,282	43,667
負債合計	2,550,490	39,343,641	1,139,188
純資産	1,379,744,971	1,909,950,265	121,502,650

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

2013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	72,515,290	234,288,495	-
発行済投資証券口数	3,326,937	10,085,685	-
一口当たり純資産額	21.80	23.23	-
クラスA(EUR)			
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Ad			
純資産	25,992,205	75,919,569	-
発行済投資証券口数	2,975,323	6,029,890	-
一口当たり純資産額	8.74	12.59	-
一口当たり公表配当金	0.0428	0.3520	-
クラスAh(EUR)			
純資産(基準通貨)	-	681,092,827	-
純資産(クラス通貨)	-	EUR 523,978,020	-
発行済投資証券口数	-	26,657,053	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	EUR 19.66	-
クラスAh(NOK)			
純資産(基準通貨)	-	132,220,852	-
純資産(クラス通貨)	-	NOK 807,347,133	-
発行済投資証券口数	-	4,579,955	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	NOK 176.28	-
クラスAh(SEK)			
純資産(基準通貨)	-	75,561,152	-
純資産(クラス通貨)	-	SEK 509,996,217	-
発行済投資証券口数	-	4,624,048	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	SEK 110.29	-
クラスI			
純資産	1,264,920,541	579,332,559	10,583,402
発行済投資証券口数	47,085,853	23,774,287	1,002,902
一口当たり純資産額	26.86	24.37	10.55
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)	-	-	27,616,646
純資産(クラス通貨)	-	-	EUR 21,246,025
発行済投資証券口数	-	-	1,972,788
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	-	EUR 10.77
クラスIh(USD)			

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	10,190,305	84,501,558	83,302,602
発行済投資証券口数	1,489,569	8,417,482	7,776,237
一口当たり純資産額	6.84	10.04	10.71
一口当たり公表配当金	0.0653	0.3420	0.1713
クラスQ			
純資産	6,126,630	12,051,016	-
発行済投資証券口数	683,878	1,198,683	-
一口当たり純資産額	8.96	10.05	-
一口当たり公表配当金	-	-	-
クラスQ(EUR)			
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Q(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Sh(JPY)			
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Z			
純資産	-	34,982,237	-
発行済投資証券口数	-	1,274,123	-
一口当たり純資産額	-	27.46	-

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

2013年6月30日に終了した期間(未監査)

グローバル・エマージ ング・マーケット・エ クイティ・ファンド	グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド	USアグリゲート・ ボンド・ファンド
米ドル	米ドル	米ドル

収益			
受取利息（源泉税控除後）	4,461	66,973,520	1,902,497
スワップに係る利息	-	1,138,655	-
受取配当金（源泉税控除後）	16,599,401	141,532	-
収益合計	16,603,862	68,253,707	1,902,497
費用			
運用報酬	6,808,267	8,969,218	73,162
カスタディーフィー	168,629	1,461,155	5,468
管理会社報酬	132,954	234,862	30,222
年次税	93,944	453,580	6,610
専門家報酬	85,454	143,221	17,099
スワップに係る利息	-	5,625	-
その他の費用	16,685	32,160	7,372
費用合計	7,305,933	11,299,821	139,933
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	9,297,929	56,953,886	1,762,564
運用会社により免除または負担された費用	6,804	15,500	20,351
投資（損）益	9,304,733	56,969,386	1,782,915

実現（損）益の内訳：			
スイング・プライシング	972,990	180,555	-
有価証券（外国税控除後）	(6,737,889)	64,312,464	241,388
為替予約取引	(204,299)	(10,655,007)	7,141
先物取引	-	-	99,927
オプション	-	(665,418)	-
スワップ	-	1,242,374	-
外貨取引	(472,016)	28,021,581	64,660
外国税引当金の変動	55,024	-	-
実現（損）益計	(6,386,190)	82,436,549	413,116
評価（損）益の内訳：			
有価証券（外国税控除後）	(127,875,621)	(84,110,006)	(5,523,547)
為替予約取引	-	(35,494,539)	60,308
先物取引	-	-	255,571
オプション	-	(768,407)	-
スワップ	-	57,789	-
外貨建のその他の資産および負債	(22,200)	331,411	(4,322)
評価（損）益計	(127,897,821)	(119,983,752)	(5,211,990)

運用による純資産の純増（減）額	(124,979,278)	19,422,183	(3,015,959)
-----------------	---------------	------------	-------------

分配金：			
分配による純資産の減少額	(224,026)	(6,597,499)	(1,400,483)

資本取引:

投資証券発行受領額	436,161,662	1,313,306,412	46,169,222
投資証券買戻支払額	(54,455,466)	(1,517,558,351)	(39,541,369)
資本取引による純資産の純増(減)額	381,706,196	(204,251,939)	6,627,853
純資産の増(減)額 合計	256,502,892	(191,427,255)	2,211,411
期首現在純資産	1,123,242,079	2,124,827,368	119,737,685
換算調整	-	(23,449,848)	(446,446)
期末現在純資産	1,379,744,971	1,909,950,265	121,502,650

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

2013年6月30日に終了した期間（未監査）

	グローバル・エマージン グ・マーケット・エクイ ティ・ファンド	グローバル・ハイ・ イールド・ボンド・ ファンド	USアグリゲート・ ボンド・ファンド
クラスA			
期首現在発行済投資証券	2,887,877	9,778,607	-
発行投資証券口数	962,566	4,439,989	-
買戻投資証券口数	(523,506)	(4,132,911)	-
期末現在発行済投資証券	3,326,937	10,085,685	-
クラスA (EUR)			
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Ad

期首現在発行済投資証券	2,633,880	12,752,282	-
発行投資証券口数	387,573	2,012,962	-
買戻投資証券口数	(46,130)	(8,735,354)	-
期末現在発行済投資証券	2,975,323	6,029,890	-

クラスAh (EUR)

期首現在発行済投資証券	-	29,537,715	-
発行投資証券口数	-	1,273,207	-
買戻投資証券口数	-	(4,153,869)	-
期末現在発行済投資証券	-	26,657,053	-

クラスAh (NOK)

期首現在発行済投資証券	-	4,257,450	-
発行投資証券口数	-	849,623	-
買戻投資証券口数	-	(527,118)	-
期末現在発行済投資証券	-	4,579,955	-

クラスAh (SEK)

期首現在発行済投資証券	-	2,251,860	-
発行投資証券口数	-	4,294,107	-
買戻投資証券口数	-	(1,921,919)	-
期末現在発行済投資証券	-	4,624,048	-

クラスI

	29,046,286	485,145
期首現在発行済投資証券	34,580,113	
	816,373	663,167
発行投資証券口数	13,942,549	
	(6,088,372)	(145,410)
買戻投資証券口数	(1,436,809)	
	23,774,287	1,002,902
期末現在発行済投資証券	47,085,853	

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	- -	1,331,908
発行投資証券口数	- -	719,778

買戻投資証券口数	- -	(78,898)
<hr/>		
期末現在発行済投資証券	- -	1,972,788
<hr/>		
クラスIh (USD)		
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	- -	-
<hr/>		
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	- -	-
<hr/>		
クラスJd		
期首現在発行済投資証券	1,476,632 9,338,825	8,522,552
発行投資証券口数	12,937 324,261	141,573
買戻投資証券口数	- (1,245,604)	(887,888)
期末現在発行済投資証券	1,489,569 8,417,482	7,776,237

クラスQ

	-	-	-
期首現在発行済投資証券			
	684,379	1,219,933	-
発行投資証券口数			
	(501)	(21,250)	-
買戻投資証券口数			
期末現在発行済投資証券	*683,878	*1,198,683	-

クラスQ (EUR)

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Q (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Sh(JPY)

	-	-	-
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	- 967,636	-
発行投資証券口数	- 414,850	-
買戻投資証券口数	- (108,363)	-
期末現在発行済投資証券	- 1,274,123	-

* クラスは2013年1月14日に運用が開始された。
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（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
(特段の注記のない限り金額は米ドル)	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：			
2013年6月30日	21.80	23.23	-
2012年12月31日	23.99	22.86	-
2011年12月31日	20.29	20.05	-
以下の時点のクラスA（EUR）証券一口当たり純資産額：			
2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスAd証券一口当たり純資産額：			

2013年6月30日	8.74	12.59	-
2012年12月31日	9.66	12.73	-
2011年12月31日	8.21	11.85	-

以下の時点のクラスAh (EUR) 証券一口当たり純資産額 :

	- EUR 19.66	
2013年6月30日		-
	- EUR 19.37	
2012年12月31日		-
	- EUR 17.03	
2011年12月31日		-

以下の時点のクラスAh (NOK) 証券一口当たり純資産額 :

	- NOK 176.28	
2013年6月30日		-
	- NOK 172.18	
2012年12月31日		-
	- NOK 149.57	
2011年12月31日		-

以下の時点のクラスAh (SEK) 証券一口当たり純資産額 :

2013年6月30日	-	SEK 110.29	-
2012年12月31日	-	SEK 108.21	-
2011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 :

	24.37	
2013年6月30日	26.86	10.55
	23.91	
2012年12月31日	29.42	10.84
	20.84	
2011年12月31日	24.65	10.30

以下の時点のクラスId証券一口当たり純資産額 :

	- -	
2013年6月30日		-
	- -	
2012年12月31日		-
	- -	
2011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 :

2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011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 :

2013年6月30日	-	-	EUR 10.77
2012年12月31日	-	-	EUR 11.08
2011年12月31日	-	-	EUR 10.55

以下の時点のクラスIh (USD) 証券一口当たり純資産額 :

2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011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：			
2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011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：			
2013年6月30日	6.84	10.04	10.71
2012年12月31日	7.52	10.15	11.15
2011年12月31日	6.35	9.45	10.89
以下の時点のクラスQ証券一口当たり純資産額：			
	10.05		-
2013年6月30日	8.96		
2012年12月31日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスQ (EUR) 証券一口当たり純資産額：			
2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスQ (GBP) 証券一口当たり純資産額：			
2013年6月30日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
2011年12月31日	-	-	-

以下の時点のクラスS証券一口当たり純資産額：

	-		
2013年6月30日	-		-
	-		
2012年12月31日	-		-
	-		
2011年12月31日	-		-

以下の時点のクラスSh (JPY) 証券一口当たり純資産額：

	-		
2013年6月30日	-		-
	-		
2012年12月31日	-		-
	-		
2011年12月31日	-		-

以下の時点のクラスZ証券一口当たり純資産額：

	27.46		
2013年6月30日	-		-
	26.85		
2012年12月31日	-		-
	23.25		
2011年12月31日	-		-

以下の時点の純資産：

2013年6月30日	1,379,744,971	1,909,950,265	121,502,650
2012年12月31日	1,117,874,698	2,124,827,368	119,737,685

2011年12月31日

821,567,659

1,961,793,467

150,880,743

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

2013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				
BM&F BOVESPA	ブラジル・レアル	1,993,762	11,155,428	0.81
BR Malls Participacoes	ブラジル・レアル	2,283,100	20,649,754	1.50
BRF - Brasil Foods	ブラジル・レアル	301,712	6,617,300	0.48
Companhia de Concessoes Rodoviaras	ブラジル・レアル	765,900	6,136,769	0.44
Lojas Renner	ブラジル・レアル	947,700	27,435,058	1.99
Natura Cosméticos	ブラジル・レアル	297,000	6,413,119	0.46
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	911,100	12,226,962	0.89
Petroleo Brasileiro ADR	アメリカ・ドル	1,093,700	16,033,642	1.16
Raia Drogasil	ブラジル・レアル	629,700	6,171,433	0.45
Usinas Siderurgicas de Minas Gerais	ブラジル・レアル	513,500	1,778,264	0.13
Vale ADR	アメリカ・ドル	274,200	3,605,730	0.26
ブラジル 計			118,223,459	8.57
チリ				
Banco Santander (Chile) ADR	アメリカ・ドル	240,943	5,891,056	0.43
SACI Falabella	チリ・ペソ	972,708	10,907,818	0.79
Sociedad Quimica y Minera de Chile ADR	アメリカ・ドル	281,800	11,384,720	0.82
チリ 計			28,183,594	2.04
中国				
Baidu ADR	アメリカ・ドル	206,500	19,520,445	1.41
Bank of China H-shares	香港・ドル	51,276,100	21,088,625	1.53
China Longyuan Power Group H-shares	香港・ドル	7,573,000	7,849,945	0.57
China National Building Material H-shares	香港・ドル	8,852,000	7,931,746	0.58
China Shanshui Cement Group	香港・ドル	15,090,000	6,789,804	0.49
China Vanke A-shares ¹	中国・人民元	2,619,883	4,204,550	0.30
China Vanke Class B	香港・ドル	2,689,819	4,820,371	0.35
Dongfeng Motor Group H-shares	香港・ドル	5,428,000	7,250,070	0.53
Industrial & Commercial Bank of China H-shares	香港・ドル	29,534,445	18,620,026	1.35
Parkson Retail Group	香港・ドル	9,303,500	3,838,300	0.28
Ping An Insurance Group of China A-shares ¹	中国・人民元	804,700	4,557,379	0.33
Ping An Insurance Group of China H-shares	香港・ドル	2,115,300	14,235,905	1.03
Shimao Property Holdings	香港・ドル	2,121,500	4,212,175	0.31
Sina	アメリカ・ドル	166,700	9,290,191	0.67
Tencent Holdings	香港・ドル	613,300	24,053,306	1.74
Want Want China Holdings	香港・ドル	8,874,000	12,493,516	0.91
Wumart Stores H-shares	香港・ドル	2,197,000	4,050,501	0.29
中国 計			174,806,855	12.67
香港				
AIA Group	香港・ドル	5,272,800	22,331,571	1.62
Beijing Enterprises Holdings	香港・ドル	3,180,000	22,897,755	1.66
Belle International Holdings	香港・ドル	3,607,000	4,957,309	0.36
C C Land Holdings	香港・ドル	17,785,000	5,090,371	0.37
China Taiping Insurance Holdings	香港・ドル	835,600	1,292,773	0.09
China Unicom	香港・ドル	9,670,000	12,841,220	0.93
CNOOC	香港・ドル	14,382,000	24,401,570	1.77
Li & Fung	香港・ドル	9,698,000	13,328,522	0.97

香港 計			107,141,091	7.77
インド				
Adani Ports and Special Economic Zone	インド・ルピー	3,534,550	8,939,720	0.65
Adani Power	インド・ルピー	2,728,581	1,903,234	0.14
Axis Bank	インド・ルピー	292,792	6,529,372	0.47
Bharti Airtel	インド・ルピー	1,280,603	6,287,184	0.45
Container of India	インド・ルピー	321,899	5,842,392	0.42
Housing Development Finance	インド・ルピー	1,648,450	24,384,854	1.77
ICICI Bank	インド・ルピー	916,813	16,519,605	1.20
Infosys	インド・ルピー	362,963	15,262,770	1.11
Jaiprakash Associates	インド・ルピー	6,001,326	5,413,060	0.39
Maruti Suzuki India	インド・ルピー	276,166	7,146,391	0.52
Tata Motors	インド・ルピー	1,534,886	7,265,687	0.53
Titan Industries	インド・ルピー	1,305,563	4,910,279	0.35
Zee Entertainment Enterprises	インド・ルピー	1,362,046	5,410,365	0.39
インド 計			115,814,913	8.39
インドネシア				
Astra International	インドネシア・ルピア	17,181,500	12,117,935	0.88
Bank Mandiri	インドネシア・ルピア	16,262,483	14,746,836	1.07
XL Axiata	インドネシア・ルピア	8,864,500	4,309,442	0.31
インドネシア 計			31,174,213	2.26
ルクセンブルグ				
MHP GDR	アメリカ・ドル	304,828	5,182,076	0.37
Tenaris ADR	アメリカ・ドル	341,800	13,764,286	1.00
ルクセンブルグ 計			18,946,362	1.37
マレーシア				
Astro Malaysia Holdings	マレーシア・リンギット	5,017,500	4,811,845	0.35
CIMB Group Holdings	マレーシア・リンギット	6,546,108	17,155,175	1.24
マレーシア 計			21,967,020	1.59
メキシコ				
Fresnillo	イギリス・ポンド	530,805	7,100,734	0.51
Grupo Financiero Banorte Class O	メキシコ・ペソ	1,216,400	7,164,385	0.52
Wal-Mart de Mexico (Series V)	メキシコ・ペソ	11,111,740	31,119,372	2.26
メキシコ 計			45,384,491	3.29
オランダ				
Yandex Class A	アメリカ・ドル	196,900	5,440,347	0.39
オランダ 計			5,440,347	0.39
オマーン				
Bank Muscat	オマーン・リアル	2,348,539	3,562,459	0.26
Bank Muscat GDR ²	アメリカ・ドル	615,814	4,125,954	0.30
オマーン 計			7,688,413	0.56
フィリピン				
GT Capital Holdings	フィリピン・ペソ	235,030	4,325,205	0.32
Metro Pacific Investments	フィリピン・ペソ	63,526,200	7,764,313	0.56
SM Investments	フィリピン・ペソ	591,850	14,659,248	1.06
Universal Robina	フィリピン・ペソ	4,477,180	12,954,803	0.94
フィリピン 計			39,703,569	2.88
カタール				
Qatar National Bank	カタール・リヤル	416,022	18,169,894	1.32

カタール 計			18,169,894	1.32
ロシア				
Lukoil ADR	アメリカ・ドル	137,261	7,878,781	0.57
Magnit GDR	アメリカ・ドル	654,986	37,465,199	2.72
NovaTek GDR	アメリカ・ドル	123,260	14,729,570	1.07
Sberbank of Russia ADR	アメリカ・ドル	2,636,165	30,025,919	2.18
Uralkali GDR	アメリカ・ドル	205,472	6,801,123	0.49
X5 Retail Group GDR	アメリカ・ドル	278,105	5,033,701	0.36
ロシア 計			101,934,293	7.39
南アフリカ				
Aspen Pharmacare Holdings	南アフリカ・ランド	301,377	6,893,553	0.50
FirstRand	南アフリカ・ランド	2,827,803	8,240,827	0.59
Life Healthcare Group Holdings	南アフリカ・ランド	73,679	278,322	0.02
Sanlam	南アフリカ・ランド	1,129,286	5,232,810	0.38
Shoprite Holdings	南アフリカ・ランド	1,469,423	27,457,689	1.99
Truworths International	南アフリカ・ランド	975,788	8,546,697	0.62
Woolworths Holdings	南アフリカ・ランド	2,505,417	16,255,733	1.18
南アフリカ 計			72,905,631	5.28
韓国				
Amorepacific	韓国・ウォン	9,719	7,786,774	0.56
Hyundai Glovis	韓国・ウォン	38,866	6,585,150	0.48
Hyundai Mobis	韓国・ウォン	57,746	13,803,825	1.00
Hyundai Motor	韓国・ウォン	111,682	22,051,829	1.60
LG Household & Health Care	韓国・ウォン	57,492	28,090,308	2.04
Samsung Electronics	韓国・ウォン	46,877	55,084,220	3.99
韓国 計			133,402,106	9.67
スイス				
Compagnie Financière Richemont	南アフリカ・ランド	1,921,944	17,042,946	1.24
スイス 計			17,042,946	1.24
台湾				
Catcher Technology	台湾・ドル	1,501,000	7,812,752	0.57
Far EasTone Telecommunications	台湾・ドル	3,785,000	10,166,244	0.74
Pegatron	台湾・ドル	695,000	1,147,860	0.08
Quanta Computer	台湾・ドル	4,894,000	10,613,927	0.77
Siliconware Precision Industries	台湾・ドル	5,590,000	7,031,564	0.51
Taiwan Semiconductor Manufacturing	台湾・ドル	12,594,050	46,643,073	3.38
Uni-President Enterprises	台湾・ドル	12,706,644	24,759,535	1.79
台湾 計			108,174,955	7.84
タイ				
Bangkok Bank	タイ・バーツ	1,843,100	12,122,921	0.88
CP ALL (Foreign)	タイ・バーツ	5,986,800	7,528,138	0.54
Kasikornbank	タイ・バーツ	4,038,600	24,870,953	1.80
Siam Cement	タイ・バーツ	805,700	11,586,078	0.85
タイ 計			56,108,090	4.07
トルコ				
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii	トルコ・リラ	352,777	5,119,467	0.37
BİM Birlesik Magazalar	トルコ・リラ	871,410	18,878,405	1.37
Turkiye Garanti Bankasi	トルコ・リラ	3,356,472	14,647,435	1.06
トルコ 計			38,645,307	2.80
アラブ首長国連邦				

DP World	アメリカ・ドル	694,754	10,768,687	0.78
アラブ首長国連邦 計			10,768,687	0.78
イギリス				
SABMiller	南アフリカ・ランド	456,333	22,064,614	1.60
Tullow Oil	イギリス・ポンド	782,655	11,882,399	0.86
イギリス 計			33,947,013	2.46
優先株				
ブラジル				
Banco Bradesco	ブラジル・レアル	1,366,099	17,810,213	1.29
Itau Unibanco Holding	ブラジル・レアル	2,127,840	27,712,346	2.00
ブラジル 計			45,522,559	3.29
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			1,351,095,808	97.92
価格調整 (注 2b参照)			(2,340,774)	(0.17)
有価証券 計			1,348,755,034	97.75
その他資産(負債控除後)			30,989,937	2.25
純資産			1,379,744,971	100.00

(1) 中国A株は制限を受けることがある。2013年6月30日現在で保有する中国A株の評価額は 8,761,929アメリカ・ドル、対純資産比率0.63%である(詳細は注記3b参照)。

(2) これらの証券は公正価値で評価されている。

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

2013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				
オーストリア				
ESAL SerRegS 6.25%/2023	アメリカ・ドル	4,130,000	3,784,236	0.20
オーストリア 計			3,784,236	0.20
バミューダ				
Central European Media Enterprises SerRegS 11.625%/2016	ユーロ	3,950,000	5,491,043	0.29
バミューダ 計			5,491,043	0.29
イギリス領バージン諸島				
Studio City Finance SerRegS 8.5%/2020	アメリカ・ドル	3,625,000	3,798,801	0.20
イギリス領バージン諸島 計			3,798,801	0.20
クロアチア				
Agrokor SerRegS 9.125%/2020	ユーロ	2,250,000	3,097,218	0.16
クロアチア 計			3,097,218	0.16
チェコ共和国				
RPG Byty SerRegS 6.75%/2020	ユーロ	2,475,000	2,967,801	0.16
チェコ共和国			2,967,801	0.16
フランス				
Europcar Groupe SerRegS 11.5%/2017	ユーロ	5,900,000	8,551,063	0.44
Holding Medi-Partenaires SAS SerRegS 7%/2020	ユーロ	3,350,000	4,180,318	0.22
Loxam SerRegS 7.375%/2020	ユーロ	400,000	517,340	0.03
Rexel SerRegS 5.125%/2020	ユーロ	2,875,000	3,746,411	0.20
フランス 計			16,995,132	0.89
ドイツ				
KM Germany Holdings SerRegS 8.75%/2020	ユーロ	2,975,000	3,986,932	0.21
Techem SerRegS 6.125%/2019	ユーロ	675,000	923,462	0.05
Trionista Holdco SerRegS 5%/2020	ユーロ	575,000	741,808	0.04
Unitymedia KabelBW SerRegS 9.5%/2021	ユーロ	4,525,000	6,558,231	0.34
Unitymedia KabelBW SerRegS 9.625%/2019	ユーロ	1,125,000	1,617,287	0.09
WEPA Hygieneprodukte SerRegS 6.5%/2020	ユーロ	925,000	1,236,027	0.06
ドイツ 計			15,063,747	0.79
ギリシャ				
Frigoglass Finance SerRegS 8.25%/2018	ユーロ	775,000	1,042,642	0.05
ギリシャ 計			1,042,642	0.05
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance SerRegS 9.25%/2020	ユーロ	5,450,000	7,456,102	0.39
Eircom Finance SerRegS 9.25%/2020	ユーロ	1,375,000	1,662,183	0.09
Nara Cable Funding SerRegS 8.875%/2018	アメリカ・ドル	3,225,000	3,370,125	0.18
Smurfit Kappa Group com stk	ユーロ	132,625	2,165,251	0.11
Vimpel Communications SerRegS 7.748%/2021	アメリカ・ドル	2,375,000	2,538,281	0.13
アイルランド 計			17,191,942	0.90
イスラエル				
Israel Electric SerRegS 5.625%/2018	アメリカ・ドル	4,050,000	4,162,307	0.22

イスラエル 計			4,162,307	0.22
イタリア				
Cerved Technologies SerRegS 6.375%/2020	ユーロ	1,100,000	1,408,387	0.07
UniCredit SerRegS VR 6.375%/2023	アメリカ・ドル	2,075,000	2,033,500	0.11
イタリア 計			3,441,887	0.18
日本				
Softbank SerRegS 4.5%/2020	アメリカ・ドル	5,900,000	5,687,600	0.30
日本 計			5,687,600	0.30
ルクセンブルグ				
Aguila 3 SerRegS 7.875%/2018	スイス・フラン	2,475,000	2,690,416	0.14
ALROSA Finance SerRegS 7.75%/2020	アメリカ・ドル	2,375,000	2,553,125	0.13
Altice Financing SerRegS 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,500,000	1,575,000	0.08
Altice Finco SerRegS 9%/2023	ユーロ	1,875,000	2,425,033	0.13
Altice Finco SerRegS 9.875%/2020	アメリカ・ドル	4,302,000	4,624,650	0.24
ArcelorMittal 6%/2021	アメリカ・ドル	3,675,000	3,668,826	0.19
ArcelorMittal 6.125%/2018	アメリカ・ドル	5,900,000	6,099,125	0.32
ArcelorMittal 6.75%/2022	アメリカ・ドル	1,625,000	1,673,750	0.09
ArcelorMittal 10.35%/2019	アメリカ・ドル	3,225,000	3,829,688	0.20
ArcelorMittal VR 5.75%/2020	アメリカ・ドル	1,700,000	1,687,250	0.09
Bormioli Rocco Holdings SerRegS 10%/2018	ユーロ	3,175,000	4,209,564	0.22
Cirsa Funding Luxembourg SerRegS 8.75%/2018	ユーロ	2,375,000	3,121,102	0.16
Elior Finance SerRegS 6.5%/2020	ユーロ	825,000	1,093,824	0.06
Fiat Industrial Finance Europe SerRegS 6.25%/2018	ユーロ	1,850,000	2,617,492	0.14
Gategroup Finance Luxembourg SerRegS 6.75%/2019	ユーロ	825,000	1,067,014	0.06
Gestamp Funding Luxembourg SerRegS 5.625%/2020	アメリカ・ドル	1,775,000	1,695,125	0.09
Gestamp Funding Luxembourg SerRegS 5.875%/2020	ユーロ	1,350,000	1,684,957	0.09
Matterhorn Financing & CY SerRegS 9%/2019	ユーロ	2,300,000	2,907,439	0.15
Matterhorn Midco & Cy SerRegS 7.75%/2020	ユーロ	4,225,000	5,409,488	0.28
Matterhorn Mobile SerRegS 6.75%/2019	スイス・フラン	2,150,000	2,329,176	0.12
MHP SerRegS 8.25%/2020	アメリカ・ドル	2,055,000	1,833,769	0.10
Mobile Challenger Intermediate Group SerRegS 8.75%/2019	スイス・フラン	2,950,000	3,039,951	0.16
Numericable Finance SerRegS 8.75%/2019	ユーロ	100,000	139,344	0.01
Numericable Finance SerRegS 12.375%/2019	ユーロ	4,775,000	7,277,454	0.38
Sunrise Communications Holdings SerRegS 8.5%/2018	ユーロ	4,475,000	6,165,838	0.32
Sunrise Communications International SerRegS 5.625%/2017	スイス・フラン	2,175,000	2,333,502	0.12
Sunrise Communications International SerRegS 7%/2017	ユーロ	800,000	1,099,673	0.06
Wind Acquisition Finance SerRegS 6.5%/2020	アメリカ・ドル	3,100,000	3,092,250	0.16
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.25%/2018	アメリカ・ドル	1,775,000	1,779,438	0.09
ルクセンブルグ 計			83,723,263	4.38
メキシコ				
Cemex SerRegS 5.875%/2019	アメリカ・ドル	5,752,000	5,593,820	0.29
Cemex SerRegS 9%/2018	アメリカ・ドル	4,625,000	4,879,375	0.25
メキシコ 計			10,473,195	0.54
オランダ				
Bite Finance International SerRegS VR 7.703%/2018	ユーロ	1,275,000	1,665,595	0.09
InterXion Holding SerRegS 6%/2020	ユーロ	1,050,000	1,358,018	0.07
OI European Group SerRegS 6.75%/2020	ユーロ	1,225,000	1,768,522	0.09

Polish Television Holding SerRegS step coupon				
11.25%/2017	ユーロ	3,100,000	4,190,716	0.22
Schaeffler Finance SerRegS 6.75%/2017	ユーロ	4,000,000	5,537,361	0.29
UPC Holding SerRegS 6.75%/2023	ユーロ	4,100,000	5,196,150	0.27
UPC Holding SerRegS 6.75%/2023	スイス・フラン	2,150,000	2,215,785	0.12
VimpelCom Holdings SerRegS 5.2%/2019	アメリカ・ドル	1,885,000	1,847,300	0.10
オランダ 計			23,779,447	1.25
ポーランド				
Ciech Group Financing SerRegS 9.5%/2019	ユーロ	2,900,000	4,028,723	0.21
ポーランド 計			4,028,723	0.21
スウェーデン				
Verisure Holding SerRegS 8.75%/2018	ユーロ	3,250,000	4,562,473	0.24
スウェーデン 計			4,562,473	0.24
イギリス				
Arqiva Broadcast Finance SerRegS 9.5%/2020	イギリス・ポンド	3,075,000	4,827,087	0.25
Equiniti Newco 2 SerRegS 7.125%/2018	イギリス・ポンド	650,000	986,954	0.05
Infinis SerRegS 7%/2019	イギリス・ポンド	2,350,000	3,573,156	0.19
LBG Capital No.1 Series 1 7.588%/2020	イギリス・ポンド	2,000,000	3,061,004	0.16
Liberty Global com stk	アメリカ・ドル	52,300	3,874,384	0.20
New Look Bondco I SerRegS 8.375%/2018	アメリカ・ドル	2,050,000	1,998,750	0.10
Priory Group No 3 SerRegS 7%/2018	イギリス・ポンド	900,000	1,385,505	0.07
R&R Ice Cream SerRegS 8.375%/2017	ユーロ	2,350,000	3,226,624	0.17
R&R Pik SerRegS 9.25%/2018	ユーロ	2,875,000	3,652,985	0.19
Rexam SerRegS VR 6.75%/2067	ユーロ	4,375,000	5,857,449	0.31
Towergate Finance SerRegS 8.5%/2018	イギリス・ポンド	1,325,000	2,086,154	0.11
Towergate Finance SerRegS 10.5%/2019	イギリス・ポンド	1,300,000	2,030,861	0.11
Voyage Care Bondco SerRegS 6.5%/2018	イギリス・ポンド	600,000	919,120	0.05
イギリス 計			37,480,033	1.96
アメリカ				
Access Midstream Partners / ACPM Finance				
4.875%/2023	アメリカ・ドル	6,000,000	5,595,000	0.29
AK Steel 7.625%/2020	アメリカ・ドル	2,055,000	1,767,300	0.09
Ally Financial 5.5%/2017	アメリカ・ドル	3,850,000	4,038,954	0.21
Ally Financial pref stk 8.50%	アメリカ・ドル	13,475	348,464	0.02
American Axle & Manufacturing 6.25%/2021	アメリカ・ドル	150,000	153,188	0.01
American Axle & Manufacturing 6.625%/2022	アメリカ・ドル	4,825,000	4,921,500	0.26
American International Group warrants/19/01/2021	アメリカ・ドル	76,700	1,399,008	0.07
AmeriGas Finance 7%/2022	アメリカ・ドル	2,875,000	2,954,063	0.15
AMR com stk	アメリカ・ドル	240,100	967,603	0.05
Anixter 5.625%/2019	アメリカ・ドル	2,790,000	2,901,600	0.15
Ares Capital com stk	アメリカ・ドル	122,625	2,109,150	0.11
Atwood Oceanics 6.5%/2020	アメリカ・ドル	1,875,000	1,954,688	0.10
B&G Foods 4.625%/2021	アメリカ・ドル	4,250,000	4,069,375	0.21
Bank of America warrants/16/01/2019	アメリカ・ドル	288,400	1,574,664	0.08
Bill Barrett 7%/2022	アメリカ・ドル	5,700,000	5,728,500	0.30
Bill Barrett 7.625%/2019	アメリカ・ドル	7,450,000	7,748,000	0.42
CBRE Services 5%/2023	アメリカ・ドル	6,825,000	6,500,813	0.34
CEDC Finance International SerRegS 8.875%/2016	ユーロ	2,550,000	2,651,694	0.14
Celanese US Holdings 4.625%/2022	アメリカ・ドル	5,575,000	5,526,219	0.29
Cemex Finance SerRegS 9.375%/2022	アメリカ・ドル	7,250,000	7,938,750	0.42
Centene 5.75%/2017	アメリカ・ドル	2,850,000	2,999,625	0.16
CenturyLink 5.625%/2020	アメリカ・ドル	8,200,000	8,323,000	0.44
CenturyLink SerS 6.45%/2021	アメリカ・ドル	2,525,000	2,644,938	0.14
Charter Communications Class A com stk	アメリカ・ドル	34,800	4,309,980	0.23
Chesapeake Energy 3.25%/2016	アメリカ・ドル	1,925,000	1,920,188	0.10

Chesapeake Energy 5.375%/2021	アメリカ・ドル	2,025,000	2,019,938	0.11
Chesapeake Energy 5.75%/2023	アメリカ・ドル	5,275,000	5,354,125	0.28
Choice Hotels International 5.75%/2022	アメリカ・ドル	1,700,000	1,810,500	0.09
CIT Group 5%/2022	アメリカ・ドル	23,975,000	23,901,828	1.25
CIT Group 5.25%/2018	アメリカ・ドル	4,000,000	4,130,000	0.22
CIT Group 5.375%/2020	アメリカ・ドル	15,450,000	15,894,188	0.83
Citigroup warrants/04/01/2019	アメリカ・ドル	2,732,950	2,148,099	0.11
CMS Energy 5.05%/2022	アメリカ・ドル	1,875,000	2,029,343	0.11
Community Health Systems 7.125%/2020	アメリカ・ドル	3,925,000	4,047,656	0.21
Compass Minerals International 8%/2019	アメリカ・ドル	1,240,000	1,326,800	0.07
Concho Resources 5.5%/2023	アメリカ・ドル	8,000,000	7,920,000	0.41
Concho Resources 7%/2021	アメリカ・ドル	1,275,000	1,377,000	0.07
Constellation Brands 6%/2022	アメリカ・ドル	1,575,000	1,697,063	0.09
Delphi 5%/2023	アメリカ・ドル	2,225,000	2,297,313	0.12
Delta Air Lines com stk	アメリカ・ドル	124,900	2,336,879	0.12
Discover Financial Services 10.25%/2019	アメリカ・ドル	3,700,000	4,703,621	0.25
El Paso SerGMTN 7.75%/2032	アメリカ・ドル	3,950,000	4,216,345	0.22
El Paso SerGMTN 7.8%/2031	アメリカ・ドル	1,075,000	1,140,771	0.06
El Paso SerMTN 8.25%/2016	アメリカ・ドル	165,000	183,964	0.01
Esterline Technologies 7%/2020	アメリカ・ドル	3,500,000	3,771,250	0.20
General Motors CV 4.75%/2013	アメリカ・ドル	116,200	5,596,192	0.29
GenOn Energy 7.875%/2017	アメリカ・ドル	3,825,000	4,083,188	0.21
Graphic Packaging International 4.75%/2021	アメリカ・ドル	2,025,000	1,969,313	0.10
Greif 7.75%/2019	アメリカ・ドル	450,000	517,500	0.03
Hartford Financial Services Group warrants/26/06/2019	アメリカ・ドル	81,300	1,780,470	0.09
HCA Holdings 6.25%/2021	アメリカ・ドル	3,300,000	3,374,250	0.18
iStar Financial 7.125%/2018	アメリカ・ドル	3,300,000	3,440,250	0.18
JC Penney 7.65%/2016	アメリカ・ドル	2,025,000	1,984,500	0.10
JC Penney 7.95%/2017	アメリカ・ドル	4,250,000	4,111,875	0.22
JPMorgan Chase warrants/28/10/2018	アメリカ・ドル	93,050	1,451,580	0.08
KB Home 8%/2020	アメリカ・ドル	4,025,000	4,516,734	0.24
Manitowoc 5.875%/2022	アメリカ・ドル	1,400,000	1,414,000	0.07
Manitowoc 8.5%/2020	アメリカ・ドル	3,750,000	4,106,250	0.21
MarkWest Energy Partners 4.5%/2023	アメリカ・ドル	7,500,000	6,900,000	0.36
MGM Resorts International 6.625%/2021	アメリカ・ドル	11,400,000	11,770,500	0.62
Mohawk Industries 3.85%/2023	アメリカ・ドル	1,555,000	1,500,091	0.08
MPT Operating Partnership 6.375%/2022	アメリカ・ドル	2,325,000	2,452,875	0.13
Navistar International 8.25%/2021	アメリカ・ドル	2,100,000	2,073,750	0.11
Newfield Exploration 5.75%/2022	アメリカ・ドル	3,800,000	3,781,000	0.20
NII Holdings com stk	アメリカ・ドル	356,500	2,377,855	0.12
Penn Virginia Resource Partners Finance 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,075,000	3,221,063	0.17
PolyOne 7.375%/2020	アメリカ・ドル	5,105,000	5,538,925	0.29
Range Resources 5%/2022	アメリカ・ドル	1,375,000	1,350,938	0.07
Range Resources com stk	アメリカ・ドル	24,050	1,859,546	0.10
Reynolds Group Issuer 5.75%/2020	アメリカ・ドル	1,375,000	1,388,750	0.07
Reynolds Group Issuer 9%/2019	アメリカ・ドル	8,400,000	8,715,000	0.46
Reynolds Group Issuer 9.875%/2019	アメリカ・ドル	2,550,000	2,741,250	0.14
Rite Aid 7.7%/2027	アメリカ・ドル	4,125,000	4,145,625	0.22
Rite Aid com stk	アメリカ・ドル	910,400	2,603,744	0.14
Rockwood Specialties Group 4.625%/2020	アメリカ・ドル	3,825,000	3,858,469	0.20
Springleaf Finance SerMTN 6.9%/2017	アメリカ・ドル	3,950,000	3,895,688	0.20
Sprint Capital 6.875%/2028	アメリカ・ドル	9,000,000	8,685,000	0.45
Sprint Capital 8.75%/2032	アメリカ・ドル	3,675,000	4,060,875	0.21
Sprint Nextel 6%/2022	アメリカ・ドル	5,000,000	4,925,000	0.26
Suburban Propane Partners 7.375%/2020	アメリカ・ドル	750,000	783,750	0.04
Swift Energy 7.125%/2017	アメリカ・ドル	1,750,000	1,723,750	0.09
Swift Energy 8.875%/2020	アメリカ・ドル	3,650,000	3,800,563	0.20

Synovus Financial 5.125%/2017	アメリカ・ドル	8,825,000	8,714,688	0.46
Synovus Financial 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,100,000	3,448,750	0.18
Terex 6%/2021	アメリカ・ドル	6,350,000	6,365,875	0.33
Terex 6.5%/2020	アメリカ・ドル	2,000,000	2,050,000	0.11
Texas Industries 9.25%/2020	アメリカ・ドル	5,900,000	6,386,750	0.33
Toll Brothers Finance 5.875%/2022	アメリカ・ドル	2,225,000	2,336,250	0.12
TRW Automotive Holdings com stk	アメリカ・ドル	68,025	4,519,581	0.24
United Rentals North America 6.125%/2023	アメリカ・ドル	2,125,000	2,125,000	0.11
United States Steel 6.875%/2021	アメリカ・ドル	3,175,000	3,095,625	0.16
US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625%/2025	アメリカ・ドル	910,000	900,900	0.05
US Airways 2012-2 Class B Pass Through Trust 6.75%/2021	アメリカ・ドル	415,000	431,600	0.02
USG 9.75%/2018	アメリカ・ドル	4,050,000	4,617,000	0.24
Wells Fargo warrants 28/10/2018	アメリカ・ドル	109,750	1,500,283	0.08
WPX Energy com stk	アメリカ・ドル	100,600	1,905,364	0.10
アメリカ 計			364,250,722	19.07
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			611,022,212	31.99
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				
Bluescope Steel Finance Ser144A 7.125%/2018	アメリカ・ドル	1,925,000	1,963,500	0.10
オーストラリア 計			1,963,500	0.10
オーストリア				
OGX Austria SerRegS 8.5%/2018	アメリカ・ドル	6,875,000	2,234,375	0.12
Sappi Papier Holding Ser144A 7.75%/2017	アメリカ・ドル	2,250,000	2,385,000	0.13
Sappi Papier Holding Ser144A 8.375%/2019	アメリカ・ドル	1,675,000	1,773,406	0.09
Sappi Papier Holding SerRegS 6.625%/2021	アメリカ・ドル	3,400,000	3,315,000	0.17
オーストリア 計			9,707,781	0.51
ベルギー				
Barry Callebaut Services SerRegS 5.5%/2023	アメリカ・ドル	4,525,000	4,577,219	0.24
ベルギー 計			4,577,219	0.24
バミューダ				
Aircastle 6.25%/2019	アメリカ・ドル	4,100,000	4,279,375	0.23
Aircastle 6.75%/2017	アメリカ・ドル	1,150,000	1,213,250	0.06
Aircastle 7.625%/2020	アメリカ・ドル	4,875,000	5,386,875	0.28
Digicel Group SerRegS 8.25%/2020	アメリカ・ドル	4,225,000	4,394,000	0.23
Digicel SerRegS 6%/2021	アメリカ・ドル	3,525,000	3,339,938	0.18
バミューダ 計			18,613,438	0.98
カナダ				
Cascades 7.875%/2020	アメリカ・ドル	5,275,000	5,538,750	0.29
Cogeco Cable SerRegS 4.875%/2020	アメリカ・ドル	1,650,000	1,608,750	0.09
Eldorado Gold SerRegS 6.125%/2020	アメリカ・ドル	7,200,000	6,984,000	0.36
Great Canadian Gaming Ser144A 6.625%/2022	カナダ・ドル	1,875,000	1,843,985	0.10
MDC Partners Ser144A 6.75%/2020	アメリカ・ドル	1,325,000	1,328,312	0.07
MDC Partners SerRegS 6.75%/2020	アメリカ・ドル	2,100,000	2,105,250	0.11
MPL 2 Acquisition Canco Ser144A 9.875%/2018	アメリカ・ドル	1,975,000	1,970,062	0.10
Novelis 8.75%/2020	アメリカ・ドル	3,975,000	4,283,063	0.22
Pacific Rubiales Energy SerRegS 5.125%/2023	アメリカ・ドル	1,385,000	1,315,750	0.07
Precision Drilling 6.5%/2021	アメリカ・ドル	875,000	890,313	0.05
Precision Drilling 6.625%/2020	アメリカ・ドル	4,625,000	4,717,500	0.25
Seven Generations Energy SerRegS 8.25%/2020	アメリカ・ドル	2,250,000	2,250,000	0.12

Tervita Ser144A 9.75%/2019	アメリカ・ドル	3,600,000	3,366,000	0.18
Tervita SerRegS 8%/2018	アメリカ・ドル	2,900,000	2,919,938	0.15
Videotron 5%/2022	アメリカ・ドル	4,880,000	4,782,400	0.25
VPII Escrow SerRegS 6.75%/2018	アメリカ・ドル	4,650,000	4,772,063	0.25
カナダ 計			50,676,136	2.66
ケイマン諸島				
Global A&T Electronics SerRegS 10%/2019	アメリカ・ドル	3,250,000	3,323,125	0.17
Marfrig Overseas SerRegS 9.625%/2016	アメリカ・ドル	1,090,000	1,102,960	0.06
UPCB Finance V SerRegS 7.25%/2021	アメリカ・ドル	4,525,000	4,807,813	0.25
UPCB Finance VI SerRegS 6.875%/2022	アメリカ・ドル	2,900,000	3,016,000	0.16
ケイマン諸島 計			12,249,898	0.64
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance USA SerRegS 7%/2020	アメリカ・ドル	2,900,000	2,802,125	0.15
Nara Cable Funding SerRegS 8.875%/2018	アメリカ・ドル	800,000	824,000	0.04
アイルランド 計			3,626,125	0.19
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
Aguila 3 SerRegS 7.875%/2018	アメリカ・ドル	1,350,000	1,397,250	0.07
ARD Finance Ser144A 11.125%/2018	アメリカ・ドル	1,225,778	1,305,453	0.07
Boardriders SerRegS 8.875%/2017	ユーロ	2,375,000	3,071,708	0.16
Globe Luxembourg SerRegS 9.625%/2018	アメリカ・ドル	1,125,000	1,101,769	0.06
INEOS Group Holdings SerRegS 6.125%/2018	アメリカ・ドル	2,250,000	2,154,375	0.11
Millicom International Cellular SerRegS 4.75%/2020	アメリカ・ドル	1,600,000	1,524,416	0.08
Silver II Borrower Ser144A 7.75%/2020	アメリカ・ドル	2,725,000	2,752,250	0.14
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.25%/2018	アメリカ・ドル	2,225,000	2,252,813	0.12
Wind Acquisition Finance SerRegS 11.75%/2017	アメリカ・ドル	9,100,000	9,509,500	0.50
ルクセンブルグ 計			25,768,159	1.35
メキシコ				
Kansas City Southern de Mexico 6.125%/2021	アメリカ・ドル	477,000	542,588	0.03
メキシコ 計			542,588	0.03
オランダ				
AerCap Aviation Solutions 6.375%/2017	アメリカ・ドル	3,050,000	3,217,750	0.17
Schaeffler Finance SerRegS 4.75%/2021	アメリカ・ドル	2,225,000	2,124,875	0.11
Sensata Technologies Ser144A 4.875%/2023	アメリカ・ドル	4,250,000	4,111,875	0.21
VimpelCom Holdings Ser144A 7.504%/2022	アメリカ・ドル	2,750,000	2,853,125	0.15
オランダ 計			12,307,625	0.64
ノルウェー				
Petroleum Geo-Services SerRegS 7.375%/2018	アメリカ・ドル	5,250,000	5,735,625	0.30
ノルウェー 計			5,735,625	0.30
イギリス				
Algeco Scotsman Global Finance SerRegS 8.5%/2018	アメリカ・ドル	5,225,000	5,225,000	0.28
Jaguar Land Rover Automotive SerRegS 5.625%/2023	アメリカ・ドル	4,550,000	4,436,250	0.23
イギリス 計			9,661,250	0.51
アメリカ				
99 Cents Only Stores 11%/2019	アメリカ・ドル	2,675,000	3,036,125	0.16
ACCO Brands 6.75%/2020	アメリカ・ドル	2,475,000	2,502,844	0.13
AEP Industries 8.25%/2019	アメリカ・ドル	2,075,000	2,243,594	0.12
AES / VA 4.875%/2023	アメリカ・ドル	4,325,000	4,043,875	0.21
AGCO 5.875%/2021	アメリカ・ドル	3,450,000	3,675,499	0.19

Air Lease 5.625%/2017	アメリカ・ドル	2,300,000	2,392,000	0.13
Aleris International 7.875%/2020	アメリカ・ドル	2,700,000	2,781,000	0.15
Allison Transmission Ser144A 7.125%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,354,687	0.07
Ally Financial pref stk 7% ¹	アメリカ・ドル	6,225	5,867,063	0.31
AMC Networks 4.75%/2022	アメリカ・ドル	6,375,000	6,183,750	0.32
American Builders & Contractors Supply Ser144A 5.625%/2021	アメリカ・ドル	1,600,000	1,576,000	0.08
Amsted Industries Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,510,500	0.08
Antero Resources Finance 6%/2020	アメリカ・ドル	2,850,000	2,821,500	0.15
Antero Resources Finance 7.25%/2019	アメリカ・ドル	11,800,000	12,360,500	0.65
Approach Resources 7%/2021	アメリカ・ドル	2,575,000	2,607,188	0.14
A-S Co-Issuer Subsidiary Ser144A 7.875%/2020	アメリカ・ドル	1,650,000	1,666,500	0.09
Ashtead Capital SerRegS 6.5%/2022	アメリカ・ドル	1,500,000	1,571,250	0.08
Associated Materials 9.125%/2017	アメリカ・ドル	4,825,000	5,090,375	0.27
Aviv Healthcare Properties 7.75%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,447,875	0.08
BC Mountain Finance Ser144A 7%/2021	アメリカ・ドル	200,000	204,500	0.01
Biomet 6.5%/2020	アメリカ・ドル	6,975,000	7,223,484	0.38
Boise Cascade 6.375%/2020	アメリカ・ドル	2,700,000	2,747,250	0.14
Boise Paper Holdings 8%/2020	アメリカ・ドル	950,000	1,016,500	0.05
Builders FirstSource Ser144A 7.625%/2021	アメリカ・ドル	1,425,000	1,382,250	0.07
Case New Holland 7.875%/2017	アメリカ・ドル	3,750,000	4,265,625	0.22
CCO Holdings 5.125%/2023	アメリカ・ドル	12,150,000	11,451,375	0.60
CCO Holdings 6.625%/2022	アメリカ・ドル	3,050,000	3,194,875	0.17
CCO Holdings Capital 5.25%/2022	アメリカ・ドル	5,575,000	5,324,125	0.28
CDR DB Sub Ser144A 7.75%/2020	アメリカ・ドル	2,800,000	2,821,000	0.15
CDW Finance 8%/2018	アメリカ・ドル	316,000	345,230	0.02
CDW Finance 8.5%/2019	アメリカ・ドル	9,475,000	10,233,000	0.54
CEDC Finance International step coupon 8%/2018	アメリカ・ドル	273,262	241,837	0.01
CEDC Finance International 10%/2018	アメリカ・ドル	117,635	84,697	0.01
Cengage Learning Acquisitions Ser144A 11.5%/2020	アメリカ・ドル	1,250,000	925,000	0.05
Central Garden and Pet 8.25%/2018	アメリカ・ドル	3,375,000	3,434,063	0.18
Cequel Communications Holdings I / Cequel Capital Ser144A 5.125%/2021	アメリカ・ドル	5,125,000	4,843,125	0.25
Cequel Communications Holdings I Ser144A 6.375%/2020	アメリカ・ドル	5,175,000	5,291,437	0.28
Chrysler Group 8%/2019	アメリカ・ドル	4,500,000	4,933,125	0.26
Chrysler Group 8.25%/2021	アメリカ・ドル	6,050,000	6,707,938	0.35
Cinemark USA 5.125%/2022	アメリカ・ドル	1,625,000	1,576,250	0.08
CKE Restaurants 11.375%/2018	アメリカ・ドル	371,000	384,452	0.02
Claire's Stores Ser144A 6.125%/2020	アメリカ・ドル	1,600,000	1,580,000	0.08
Claire's Stores Ser144A 7.75%/2020	アメリカ・ドル	1,675,000	1,628,937	0.08
Clean Harbors 5.125%/2021	アメリカ・ドル	2,050,000	2,075,625	0.11
Clean Harbors 5.25%/2020	アメリカ・ドル	1,525,000	1,555,500	0.08
Clear Channel Worldwide Holdings SerA 7.625%/2020	アメリカ・ドル	1,150,000	1,190,250	0.06
Clear Channel Worldwide Holdings SerB 7.625%/2020	アメリカ・ドル	4,150,000	4,316,000	0.23
Clearwater Paper 7.125%/2018	アメリカ・ドル	1,625,000	1,746,875	0.09
Clearwire Communications Ser144A 12%/2017	アメリカ・ドル	2,600,000	3,022,500	0.16
Columbus McKinnon 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,875,000	4,126,875	0.22
Community Health Systems 5.125%/2018	アメリカ・ドル	3,900,000	3,968,250	0.21
Community Health Systems 8%/2019	アメリカ・ドル	2,875,000	3,072,656	0.16
Constellation Brands 4.25%/2023	アメリカ・ドル	3,450,000	3,264,563	0.17
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	595,951	697,262	0.04
Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust SerB 9.25%/2017	アメリカ・ドル	333,910	372,309	0.02
Continental Resources 5%/2022	アメリカ・ドル	2,675,000	2,735,188	0.14
CoreLogic 7.25%/2021	アメリカ・ドル	1,775,000	1,899,250	0.10

Cricket Communications 7.75%/2020	アメリカ・ドル	4,950,000	4,776,750	0.25
Crosstex Energy 7.125%/2022	アメリカ・ドル	1,100,000	1,116,500	0.06
Crosstex Energy 8.875%/2018	アメリカ・ドル	1,350,000	1,437,750	0.08
Crown Castle International 5.25%/2023	アメリカ・ドル	7,425,000	7,155,844	0.37
CSC Holdings 6.75%/2021	アメリカ・ドル	3,225,000	3,491,063	0.18
Del Monte 7.625%/2019	アメリカ・ドル	4,765,000	4,919,863	0.26
Delphi 5.875%/2019	アメリカ・ドル	850,000	907,375	0.05
Delphi 6.125%/2021	アメリカ・ドル	1,025,000	1,122,375	0.06
Dex Media 14%/2017	アメリカ・ドル	700,000	469,000	0.02
DISH DBS 5%/2023	アメリカ・ドル	3,150,000	3,047,625	0.16
DISH DBS 5.875%/2022	アメリカ・ドル	3,000,000	3,060,000	0.16
DISH DBS 7.125%/2016	アメリカ・ドル	1,375,000	1,495,313	0.08
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma Ser144A 10.5%/2019	アメリカ・ドル	1,400,000	1,491,000	0.08
DPL 6.5%/2016	アメリカ・ドル	3,275,000	3,438,750	0.18
DPL 7.25%/2021	アメリカ・ドル	2,925,000	3,042,000	0.16
Ducommun 9.75%/2018	アメリカ・ドル	925,000	1,015,188	0.05
Dycom Investments 7.125%/2021	アメリカ・ドル	3,300,000	3,514,500	0.18
E*Trade Financial 6.375%/2019	アメリカ・ドル	1,175,000	1,198,500	0.06
E*Trade Financial 6.75%/2016	アメリカ・ドル	8,725,000	9,008,563	0.47
Eagle Midco SerRegS 9%/2018	アメリカ・ドル	4,750,000	4,655,000	0.24
Earthlink 8.875%/2019	アメリカ・ドル	2,100,000	2,052,750	0.11
Epicor Software 8.625%/2019	アメリカ・ドル	3,100,000	3,193,000	0.17
Equinix 5.375%/2023	アメリカ・ドル	3,650,000	3,595,250	0.19
Equinix 7%/2021	アメリカ・ドル	3,000,000	3,266,250	0.17
Exopack Holding 10%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	2,365,688	0.12
Ferrellgas Finance 6.5%/2021	アメリカ・ドル	6,325,000	6,372,438	0.33
Fiesta Restaurant Group 8.875%/2016	アメリカ・ドル	2,575,000	2,755,250	0.15
First Data 12.625%/2021	アメリカ・ドル	10,925,000	11,607,813	0.61
First Data Ser144A 6.75%/2020	アメリカ・ドル	7,800,000	7,975,500	0.42
First Data Ser144A 7.375%/2019	アメリカ・ドル	200,000	206,500	0.01
Florida East Coast Holdings 10.5%/2017	アメリカ・ドル	1,599,689	1,687,672	0.09
Florida East Coast Railway 8.125%/2017	アメリカ・ドル	3,700,000	3,931,250	0.21
Foresight Energy Ser144A 9.625%/2017	アメリカ・ドル	6,275,000	6,620,125	0.35
Fresenius Medical Care US Finance 6.875%/2017	アメリカ・ドル	316,000	346,810	0.02
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.625%/2019	アメリカ・ドル	4,825,000	5,042,125	0.26
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.875%/2022	アメリカ・ドル	2,175,000	2,300,063	0.12
FTI Consulting 6.75%/2020	アメリカ・ドル	825,000	872,438	0.05
GenOn Energy 9.5%/2018	アメリカ・ドル	10,800,000	12,042,000	0.63
Goodyear Tire & Rubber 6.5%/2021	アメリカ・ドル	2,575,000	2,632,938	0.14
Goodyear Tire & Rubber 8.25%/2020	アメリカ・ドル	3,965,000	4,361,500	0.23
Goodyear Tire & Rubber 8.75%/2020	アメリカ・ドル	800,000	919,544	0.05
Graton Economic Development Authority Ser144A 9.625%/2019	アメリカ・ドル	300,000	330,000	0.02
Griffey Intermediate / Griffey Finance Sub Ser144A 7%/2020	アメリカ・ドル	500,000	485,000	0.02
GTP Acquisition Partners I Ser144A 7.628%/2016	アメリカ・ドル	750,000	788,261	0.04
Gymboree 9.125%/2018	アメリカ・ドル	4,625,000	4,370,625	0.23
H&E Equipment Services 7%/2022	アメリカ・ドル	1,850,000	1,937,875	0.10
Hanesbrands 6.375%/2020	アメリカ・ドル	2,775,000	2,972,719	0.16
HD Supply 10.5%/2021	アメリカ・ドル	5,925,000	6,154,594	0.32
HD Supply 11.5%/2020	アメリカ・ドル	1,225,000	1,424,063	0.08
HDTFS 6.25%/2022	アメリカ・ドル	1,125,000	1,179,844	0.06
Hertz 5.875%/2020	アメリカ・ドル	625,000	646,875	0.03
Hexion US Finance 8.875%/2018	アメリカ・ドル	2,425,000	2,485,625	0.13
Hexion US Finance 9%/2020	アメリカ・ドル	3,200,000	3,072,000	0.16
Hologic 6.25%/2020	アメリカ・ドル	2,275,000	2,370,266	0.12

Hub International Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	3,125,000	3,265,625	0.17
Hughes Satellite Systems 6.5%/2019	アメリカ・ドル	4,920,000	5,239,800	0.27
Huntsman International 4.875%/2020	アメリカ・ドル	1,550,000	1,538,375	0.08
Huntsman International 8.625%/2020	アメリカ・ドル	1,375,000	1,502,188	0.08
IASIS Healthcare 8.375%/2019	アメリカ・ドル	4,975,000	5,046,516	0.26
iGATE 9%/2016	アメリカ・ドル	8,525,000	8,908,625	0.47
Igloo Holdings SerRegS 8.25%/2017	アメリカ・ドル	2,250,000	2,306,250	0.12
Infor US 9.375%/2019	アメリカ・ドル	4,200,000	4,572,750	0.24
Infor US 11.5%/2018	アメリカ・ドル	1,175,000	1,336,563	0.07
Interline Brands 10%/2018	アメリカ・ドル	1,650,000	1,782,000	0.09
Iron Mountain 5.75%/2024	アメリカ・ドル	2,050,000	1,932,125	0.10
Jaguar Holding I Ser144A 9.375%/2017	アメリカ・ドル	1,125,000	1,181,250	0.06
Jaguar Holding II Ser144A 9.5%/2019	アメリカ・ドル	950,000	1,054,500	0.06
Jefferies LoanCore / JLC Finance Ser144A 6.875%/2020	アメリカ・ドル	200,000	195,000	0.01
JMC Steel Group Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	6,100,000	5,993,250	0.31
Jo-Ann Stores Holdings Ser144A 9.75%/2019	アメリカ・ドル	2,750,000	2,839,375	0.15
Jo-Ann Stores Ser144A 8.125%/2019	アメリカ・ドル	2,450,000	2,511,250	0.13
Kindred Healthcare 8.25%/2019	アメリカ・ドル	3,375,000	3,476,250	0.18
Kinetic Concepts USA 10.5%/2018	アメリカ・ドル	6,250,000	6,750,000	0.35
Kinetic Concepts USA 12.5%/2019	アメリカ・ドル	1,650,000	1,716,000	0.09
Kratos Defense & Security Solutions 10%/2017	アメリカ・ドル	4,650,000	4,998,750	0.26
Lamar Media 5%/2023	アメリカ・ドル	1,400,000	1,351,000	0.07
Land O'Lakes Capital Trust I Ser144A 7.45%/2028	アメリカ・ドル	2,050,000	2,029,500	0.11
Laredo Petroleum 7.375%/2022	アメリカ・ドル	3,825,000	4,035,375	0.21
Level 3 Communications 8.875%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,330,781	0.07
Level 3 Financing 7%/2020	アメリカ・ドル	1,200,000	1,203,000	0.06
Level 3 Financing 8.625%/2020	アメリカ・ドル	7,125,000	7,614,844	0.40
Levi Strauss 6.875%/2022	アメリカ・ドル	1,975,000	2,152,750	0.11
LifePoint Hospitals 6.625%/2020	アメリカ・ドル	3,525,000	3,762,938	0.20
LIN Television 8.375%/2018	アメリカ・ドル	4,375,000	4,675,781	0.24
Magnetation / Mag Finance Ser144A 11%/2018	アメリカ・ドル	2,850,000	2,807,250	0.15
MBIA Insurance Ser144A 11.537%/2033	アメリカ・ドル	1,525,000	1,319,125	0.07
Mcron Finance Ser144A 8.375%/2019	アメリカ・ドル	2,400,000	2,460,000	0.13
Meccanica Holdings USA Ser144A 6.25%/2019	アメリカ・ドル	1,400,000	1,438,979	0.08
MedAssets 8%/2018	アメリカ・ドル	3,350,000	3,567,750	0.19
Mediacom Broadband 6.375%/2023	アメリカ・ドル	3,075,000	3,075,000	0.16
MEMC Electronic Materials 7.75%/2019	アメリカ・ドル	12,375,000	11,787,188	0.62
Mercer International 9.5%/2017	アメリカ・ドル	4,225,000	4,541,875	0.24
Meritage Homes 7%/2022	アメリカ・ドル	1,525,000	1,685,125	0.09
MGM Resorts International 6.75%/2020	アメリカ・ドル	3,775,000	3,916,562	0.21
Michael Foods Holding SerRegS 8.5%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	2,400,562	0.13
Milacron Finance Ser144A 7.75%/2021	アメリカ・ドル	3,775,000	3,784,437	0.20
Momentive Performance Materials 8.875%/2020	アメリカ・ドル	1,700,000	1,785,000	0.09
Momentive Performance Materials 9%/2021	アメリカ・ドル	2,950,000	2,551,750	0.13
MPT Operating Partnership 6.875%/2021	アメリカ・ドル	2,775,000	2,955,375	0.16
National CineMedia 6%/2022	アメリカ・ドル	2,225,000	2,294,531	0.12
Nationstar Mortgage / Nationstar Capital 6.5%/2022	アメリカ・ドル	3,125,000	3,062,500	0.16
NCR 4.625%/2021	アメリカ・ドル	2,250,000	2,160,000	0.11
NCR 5%/2022	アメリカ・ドル	4,625,000	4,486,250	0.23
New Academy Finance SerRegS 8%/2018	アメリカ・ドル	6,500,000	6,695,000	0.35
NII Capital 7.625%/2021	アメリカ・ドル	6,100,000	4,803,750	0.25
NII Capital 8.875%/2019	アメリカ・ドル	2,012,000	1,720,260	0.09
NII Capital 10%/2016	アメリカ・ドル	3,250,000	3,168,750	0.17
Northwest Airlines Ser992A 7.575%/2019	アメリカ・ドル	509,360	588,311	0.03
Omega Healthcare Investors 5.875%/2024	アメリカ・ドル	4,125,000	4,279,687	0.22
Pantry 8.375%/2020	アメリカ・ドル	2,075,000	2,238,406	0.12
PBF Finance 8.25%/2020	アメリカ・ドル	4,925,000	5,183,562	0.27

Peabody Energy 6%/2018	アメリカ・ドル	4,575,000	4,603,594	0.24
Peabody Energy 6.25%/2021	アメリカ・ドル	550,000	533,500	0.03
Peninsula Gaming Ser144A 8.375%/2018	アメリカ・ドル	2,400,000	2,508,000	0.13
Penn Virginia Resource Partners Finance II 8.375%/2020	アメリカ・ドル	3,325,000	3,524,500	0.18
Penske Automotive Group 5.75%/2022	アメリカ・ドル	4,075,000	4,176,875	0.22
PH Glatfelter 5.375%/2020	アメリカ・ドル	4,150,000	4,129,250	0.22
Plastipak Holdings Ser144A 10.625%/2019	アメリカ・ドル	425,000	469,625	0.02
Post Holdings 7.375%/2022	アメリカ・ドル	1,125,000	1,209,375	0.06
PQ Ser144A 8.75%/2018	アメリカ・ドル	6,000,000	6,180,000	0.32
Prestige Brands 8.125%/2020	アメリカ・ドル	1,800,000	1,975,500	0.10
Provident Funding Associates / PFG Finance Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	3,250,000	3,258,125	0.17
Provident Funding Associates Ser144A 10.125%/2019	アメリカ・ドル	1,275,000	1,415,250	0.07
PVH 4.5%/2022	アメリカ・ドル	2,850,000	2,750,250	0.14
QEP Resources 5.25%/2023	アメリカ・ドル	6,900,000	6,762,000	0.35
RadioShack 6.75%/2019	アメリカ・ドル	875,000	634,375	0.03
Range Resources 5%/2023	アメリカ・ドル	4,375,000	4,298,437	0.23
Realogy Group / Sunshine Group Florida Ser144A 3.375%/2016	アメリカ・ドル	2,725,000	2,677,312	0.14
Regency Energy Partners 5.5%/2023	アメリカ・ドル	2,175,000	2,153,250	0.11
Reynolds Group Issuer 7.125%/2019	アメリカ・ドル	1,025,000	1,087,781	0.06
Rite Aid 9.25%/2020	アメリカ・ドル	7,175,000	7,955,281	0.42
Rock Tenn 4.9%/2022	アメリカ・ドル	1,815,000	1,873,958	0.10
Rockies Express Pipeline Ser144A 6%/2019	アメリカ・ドル	3,975,000	3,567,562	0.19
Rockies Express Pipeline Ser144A 6.85%/2018	アメリカ・ドル	375,000	358,125	0.02
Rosetta Resources 5.625%/2021	アメリカ・ドル	3,800,000	3,714,500	0.19
RSI Home Products Ser144A 6.875%/2018	アメリカ・ドル	500,000	513,750	0.03
Sabine Pass LNG 7.5%/2016	アメリカ・ドル	1,650,000	1,784,062	0.09
Safway Group Holding / Safway Finance Ser144A 7%/2018	アメリカ・ドル	1,425,000	1,400,062	0.07
SandRidge Energy 7.5%/2021	アメリカ・ドル	1,650,000	1,584,000	0.08
SandRidge Energy 7.5%/2023	アメリカ・ドル	1,925,000	1,838,375	0.10
Sealed Air SerRegS 5.25%/2023	アメリカ・ドル	3,850,000	3,753,750	0.20
Seminole Hard Rock Entertainment / Seminole Hard Rock International Ser144A 5.875%/2021	アメリカ・ドル	1,650,000	1,603,594	0.08
Seneca Gaming Ser144A 8.25%/2018	アメリカ・ドル	1,100,000	1,177,000	0.06
ServiceMaster 8%/2020	アメリカ・ドル	1,875,000	1,879,687	0.10
SESI 7.125%/2021	アメリカ・ドル	1,675,000	1,817,375	0.10
Severstal Columbus 10.25%/2018	アメリカ・ドル	3,725,000	3,878,656	0.20
Shea Homes 8.625%/2019	アメリカ・ドル	5,325,000	5,711,062	0.30
Shearer's Foods Ser144A 9%/2019	アメリカ・ドル	2,250,000	2,390,625	0.13
SIWF Merger Sub / Springs Industries Inc Ser144A 6.25%/2021	アメリカ・ドル	1,600,000	1,572,000	0.08
Six Flags Entertainment Ser144A 5.25%/2021	アメリカ・ドル	1,500,000	1,451,250	0.08
SLM SerMTN 5.05%/2014	アメリカ・ドル	175,000	179,375	0.01
SM Energy 6.5%/2021	アメリカ・ドル	1,875,000	1,978,125	0.10
SM Energy 6.5%/2023	アメリカ・ドル	6,425,000	6,778,375	0.35
SM Energy 6.625%/2019	アメリカ・ドル	825,000	868,312	0.05
Sonic Automotive 7%/2022	アメリカ・ドル	1,925,000	2,107,875	0.11
Spanish Broadcasting System SerB pref stk ¹	アメリカ・ドル	1,823	1,330,790	0.07
Sprint Nextel 11.5%/2021	アメリカ・ドル	2,750,000	3,671,250	0.19
Sprint Nextel Ser144A 9%/2018	アメリカ・ドル	7,000,000	8,207,500	0.43
Starz 5%/2019	アメリカ・ドル	5,200,000	5,187,000	0.27
Suburban Propane Partners 7.375%/2021	アメリカ・ドル	4,425,000	4,624,125	0.24
Sun Products Ser144A 7.75%/2021	アメリカ・ドル	2,450,000	2,443,875	0.13
Swift Energy 7.875%/2022	アメリカ・ドル	6,150,000	6,150,000	0.32
Syniverse Holdings 9.125%/2019	アメリカ・ドル	4,875,000	5,228,437	0.27

Targa Resources Partners Finance 6.375%/2022	アメリカ・ドル	3,550,000	3,736,375	0.20
Tekni-Plex Ser144A 9.75%/2019	アメリカ・ドル	166,000	177,205	0.01
Toll Brothers Finance 4.375%/2023	アメリカ・ドル	3,575,000	3,342,625	0.18
Travelport / Travelport Holdings Ser144A 13.875%/2016	アメリカ・ドル	2,475,000	2,543,062	0.13
Travelport 11.875%/2016	アメリカ・ドル	4,500,000	4,207,500	0.22
TRW Automotive Ser144A 4.5%/2021	アメリカ・ドル	675,000	676,687	0.03
tw telecom holdings 5.375%/2022	アメリカ・ドル	2,075,000	2,069,812	0.11
United Continental Holdings 6.375%/2018	アメリカ・ドル	3,350,000	3,308,125	0.17
United Rentals North America 5.75%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	2,452,875	0.13
Universal Health Services 7%/2018	アメリカ・ドル	3,400,000	3,599,750	0.19
Universal Hospital Services 7.625%/2020	アメリカ・ドル	3,675,000	3,858,750	0.20
Univision Communications Ser144A 5.125%/2023	アメリカ・ドル	2,900,000	2,755,000	0.14
Univision Communications Ser144A 6.875%/2019	アメリカ・ドル	2,350,000	2,479,250	0.13
Univision Communications SerRegS 5.125%/2023	アメリカ・ドル	6,075,000	5,771,250	0.30
Univision Communications SerRegS 6.75%/2022	アメリカ・ドル	3,200,000	3,376,000	0.18
Univision Communications SerRegS 7.875%/2020	アメリカ・ドル	5,125,000	5,573,437	0.29
Univision Communications SerRegS 8.5%/2021	アメリカ・ドル	14,200,000	15,158,500	0.79
US Airways Group 6.125%/2018	アメリカ・ドル	5,775,000	5,486,250	0.29
US Coatings Acquisition Ser144A 7.375%/2021	アメリカ・ドル	1,800,000	1,842,750	0.10
US Coatings Acquisition SerRegS 5.75%/2021	ユーロ	575,000	751,151	0.04
US Foods 8.5%/2019	アメリカ・ドル	7,775,000	8,163,750	0.43
USG Ser144A 8.375%/2018	アメリカ・ドル	550,000	598,125	0.03
USG Ser144A 9.75%/2014	アメリカ・ドル	975,000	1,028,625	0.05
Valeant Pharmaceuticals International Ser144A 6.375%/2020	アメリカ・ドル	4,725,000	4,695,469	0.25
Vanguard Health Holding II 7.75%/2019	アメリカ・ドル	3,700,000	3,940,500	0.21
ViaSat 6.875%/2020	アメリカ・ドル	2,425,000	2,570,500	0.13
Vulcan Materials 7.5%/2021	アメリカ・ドル	3,675,000	4,134,375	0.22
Watco Finance Ser144A 6.375%/2023	アメリカ・ドル	2,075,000	2,075,000	0.11
WaveDivision Escrow Ser144A 8.125%/2020	アメリカ・ドル	1,025,000	1,066,000	0.06
West 7.875%/2019	アメリカ・ドル	1,350,000	1,409,062	0.07
West 8.625%/2018	アメリカ・ドル	3,475,000	3,731,281	0.19
WideOpenWest Finance / WideOpenWest Capital 10.25%/2019	アメリカ・ドル	4,975,000	5,310,812	0.28
WideOpenWest Finance / WideOpenWest Capital 13.375%/2019	アメリカ・ドル	1,075,000	1,193,250	0.06
WMG Acquisition SerRegS 6%/2021	アメリカ・ドル	1,547,000	1,581,807	0.08
Wok Acquisition Ser144A 10.25%/2020	アメリカ・ドル	3,700,000	4,088,500	0.21
WPX Energy 6%/2022	アメリカ・ドル	1,550,000	1,573,250	0.08
アメリカ 計			813,655,681	42.59
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			969,085,025	50.74
直近に発行された取引可能な有価証券				
バミューダ				
NCL Ser144A 5%/2018	アメリカ・ドル	1,575,000	1,551,375	0.08
バミューダ 計			1,551,375	0.08
ルクセンブルグ				
Intelsat Jackson Holdings Ser144A 5.5%/2023	アメリカ・ドル	4,250,000	4,016,250	0.21
Intelsat Luxembourg Ser144A 6.75%/2018	アメリカ・ドル	2,500,000	2,531,250	0.13
Intelsat Luxembourg Ser144A 7.75%/2021	アメリカ・ドル	6,075,000	6,158,531	0.32
Intelsat Luxembourg Ser144A 8.125%/2023	アメリカ・ドル	3,100,000	3,212,375	0.17
NII International Telecom Ser144A 7.875%/2019	アメリカ・ドル	3,200,000	3,048,000	0.16
Trinseo Materials Operating Ser144A 8.75%/2019	アメリカ・ドル	4,175,000	4,008,000	0.21
ルクセンブルグ 計			22,974,406	1.20

アメリカ

Affinia Group Ser144A 7.75%/2021	アメリカ・ドル	825,000	835,312	0.04
American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust Ser144A 4%/2025	アメリカ・ドル	845,000	798,525	0.04
American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust Ser144A 5.625%/2021	アメリカ・ドル	885,000	915,975	0.05
Ancestry.com Ser144A 11%/2020	アメリカ・ドル	2,725,000	3,024,750	0.16
Aramark Ser144A 5.75%/2020	アメリカ・ドル	2,100,000	2,157,750	0.11
Ashland Ser144A 3.875%/2018	アメリカ・ドル	1,325,000	1,316,719	0.07
Ashland Ser144A 4.75%/2022	アメリカ・ドル	2,925,000	2,903,062	0.15
Associated Materials / AMH New Finance Ser144A 9.125%/2017	アメリカ・ドル	775,000	817,625	0.04
Athlon Holdings Ser144A 7.375%/2021	アメリカ・ドル	5,875,000	5,816,250	0.30
Beazer Homes USA Ser144A 7.25%/2023	アメリカ・ドル	1,075,000	1,091,125	0.06
Bonanza Creek Energy Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	2,500,000	2,531,250	0.13
Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management Ser144A 5.25%/2021	アメリカ・ドル	3,100,000	2,987,625	0.16
Cinemark USA Ser144A 4.875%/2023	アメリカ・ドル	2,000,000	1,925,000	0.10
Clear Channel Communications Ser144A 9%/2019	アメリカ・ドル	6,350,000	6,191,250	0.32
Clearwater Paper Ser144A 4.5%/2023	アメリカ・ドル	5,400,000	5,157,000	0.27
CNH Capital Ser144A 3.625%/2018	アメリカ・ドル	2,575,000	2,459,125	0.13
Coinstar Ser144A 6%/2019	アメリカ・ドル	2,825,000	2,828,531	0.15
Continental Resources Ser144A 4.5%/2023	アメリカ・ドル	6,300,000	6,134,625	0.32
Corrections Corporation of America Ser144A 4.625%/2023	アメリカ・ドル	2,825,000	2,775,562	0.15
Crown Americas IV Ser144A 4.5%/2023	アメリカ・ドル	5,275,000	4,998,062	0.26
CST Brands Ser144A 5%/2023	アメリカ・ドル	1,600,000	1,568,000	0.08
DISH DBS Ser144A 4.25%/2018	アメリカ・ドル	3,925,000	3,866,125	0.20
DISH DBS Ser144A 5.125%/2020	アメリカ・ドル	4,175,000	4,112,375	0.22
Eagle Spinco Ser144A 4.625%/2021	アメリカ・ドル	3,625,000	3,493,594	0.18
EarthLink Ser144A 7.375%/2020	アメリカ・ドル	1,050,000	1,013,250	0.05
Exterran Partners Ser144A 6%/2021	アメリカ・ドル	3,175,000	3,143,250	0.17
FTI Consulting Ser144A 6%/2022	アメリカ・ドル	2,400,000	2,442,000	0.13
General Cable Ser144A 5.75%/2022	アメリカ・ドル	2,025,000	2,014,875	0.11
General Motors Financial Ser144A 3.25%/2018	アメリカ・ドル	2,225,000	2,169,375	0.11
General Motors Financial Ser144A 4.25%/2023	アメリカ・ドル	3,100,000	2,894,625	0.15
General Motors Financial Ser144A 4.75%/2017	アメリカ・ドル	4,750,000	4,892,500	0.26
GNET Escrow Ser144A 12.125%/2018	アメリカ・ドル	1,025,000	1,081,375	0.06
Harbinger Group Ser144A 7.875%/2019	アメリカ・ドル	4,275,000	4,392,562	0.23
Hawk Acquisition Ser144A 4.25%/2020	アメリカ・ドル	5,275,000	5,057,406	0.26
HD Supply Ser144A 7.5%/2020	アメリカ・ドル	5,775,000	5,861,625	0.31
Hexion US Finance Ser144A 6.625%/2020	アメリカ・ドル	3,100,000	3,107,750	0.16
Hexion US Finance Ser144A 8.875%/2018	アメリカ・ドル	2,675,000	2,741,875	0.14
Inergy Midstream Ser144A 6%/2020	アメリカ・ドル	1,325,000	1,285,250	0.07
Ladder Capital Finance Holdings Ser144A 7.375%/2017	アメリカ・ドル	4,150,000	4,253,750	0.22
Laureate Education Ser144A 9.25%/2019	アメリカ・ドル	6,100,000	6,557,500	0.34
LKQ Ser144A 4.75%/2023	アメリカ・ドル	1,425,000	1,364,437	0.07
McGraw-Hill Global Education Holdings / McGraw-Hill Global Education Finance Ser144A 9.75%/2021	アメリカ・ドル	3,050,000	3,133,875	0.16
MetroPCS Wireless Ser144A 6.25%/2021	アメリカ・ドル	6,175,000	6,306,219	0.33
Nationstar Mortgage/Nationstar Capital Ser144A 6.5%/2021	アメリカ・ドル	1,250,000	1,206,250	0.06
Netflix Ser144A 5.375%/2021	アメリカ・ドル	10,325,000	10,325,000	0.54
Nielsen Finance Ser144A 4.5%/2020	アメリカ・ドル	4,250,000	4,101,250	0.22
NRG Energy Ser144A 6.625%/2023	アメリカ・ドル	3,525,000	3,542,625	0.20
PDC Energy Ser144A 7.75%/2022	アメリカ・ドル	8,950,000	9,285,625	0.49
Penn Virginia Resource Partners / Penn Virginia Resource Finance II Ser144A 6.5%/2021	アメリカ・ドル	6,325,000	6,103,625	0.32

Penn Virginia Ser144A 8.5%/2020	アメリカ・ドル	4,925,000	4,789,562	0.25
PetroLogistics Finance Ser144A 6.25%/2020	アメリカ・ドル	1,925,000	1,896,125	0.10
PolyOne Ser144A 5.25%/2023	アメリカ・ドル	2,625,000	2,598,750	0.14
Regency Energy Partners / Regency Energy Finance Ser144A 4.5%/2023	アメリカ・ドル	3,750,000	3,403,125	0.18
RHP Hotel Properties Ser144A 5%/2021	アメリカ・ドル	1,900,000	1,852,500	0.10
Rite Aid Ser144A 6.75%/2021	アメリカ・ドル	4,925,000	4,863,437	0.26
Ryerson Ser144A 9%/2017	アメリカ・ドル	3,975,000	4,049,531	0.21
Ryerson Ser144A 11.25%/2018	アメリカ・ドル	7,150,000	7,239,375	0.38
Sabine Pass Liquefaction Ser144A 5.625%/2023	アメリカ・ドル	1,625,000	1,539,687	0.08
Sabine Pass LNG Ser144A 6.5%/2020	アメリカ・ドル	4,375,000	4,440,625	0.23
Select Medical Ser144A 6.375%/2021	アメリカ・ドル	3,750,000	3,581,250	0.19
Sinclair Television Group Ser144A 6.125%/2022	アメリカ・ドル	3,800,000	3,819,000	0.20
Sky Growth Acquisition Ser144A 7.375%/2020	アメリカ・ドル	1,900,000	1,957,000	0.10
SM Energy Ser144A 5%/2024	アメリカ・ドル	3,825,000	3,662,437	0.19
Sonic Automotive Ser144A 5%/2023	アメリカ・ドル	2,025,000	1,974,375	0.10
Spectrum Brands Escrow Ser144A 6.375%/2020	アメリカ・ドル	1,375,000	1,443,750	0.08
Spectrum Brands Escrow Ser144A 6.625%/2022	アメリカ・ドル	1,275,000	1,338,750	0.07
Station Casinos Ser144A 7.5%/2021	アメリカ・ドル	4,400,000	4,466,000	0.23
Steel Dynamics Ser144A 6.125%/2019	アメリカ・ドル	2,050,000	2,178,125	0.12
SunGard Data Systems Ser144A 6.625%/2019	アメリカ・ドル	3,225,000	3,257,250	0.17
Tempur-Pedic International Ser144A 6.875%/2020	アメリカ・ドル	2,175,000	2,305,500	0.12
Tenet Healthcare Ser144A 4.5%/2021	アメリカ・ドル	3,225,000	3,015,375	0.16
TransUnion Holding Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	1,675,000	1,781,781	0.09
Tronox Finance Ser144A 6.375%/2020	アメリカ・ドル	3,275,000	3,103,062	0.16
Western Refining Ser144A 6.25%/2021	アメリカ・ドル	3,000,000	2,940,000	0.15
William Lyon Homes Ser144A 8.5%/2020	アメリカ・ドル	3,200,000	3,496,000	0.18
Wolverine World Wide Ser144A 6.125%/2020	アメリカ・ドル	1,300,000	1,348,750	0.07
アメリカ 計			251,324,213	13.16
直近に発行された取引可能な有価証券 計			275,849,994	14.44
その他取引可能な有価証券				
アメリカ				
FTS International Services Ser144A 8.125%/2018	アメリカ・ドル	3,616,000	3,769,680	0.20
Goodman Networks Ser144A 13.125%/2018	アメリカ・ドル	2,575,000	2,742,375	0.14
inVentiv Health Ser144A 10.75%/2018	アメリカ・ドル	2,900,000	2,436,000	0.13
inVentiv Health Ser144A 11%/2018	アメリカ・ドル	2,325,000	1,953,000	0.10
Smurfit-Stone Container pref stk ¹	アメリカ・ドル	7,275	0	0.00
Spanish Broadcasting System pref stk ¹	アメリカ・ドル	24,424	178	0.00
Summit Materials Finance Ser144A 10.5%/2020	アメリカ・ドル	3,425,000	3,681,875	0.20
Truven Health Analytics Ser144A 10.625%/2020	アメリカ・ドル	1,625,000	1,795,625	0.09
アメリカ 計			16,378,733	0.86
その他取引可能な有価証券 計			16,378,733	0.86
有価証券 計			1,872,335,964	98.03

為替予約取引

決済日	買い	売り	評価(損)益 (アメリカ・ドル)	対純資産比率 (%)
2013年7月10日	イギリス・ボンド 1,170,000	アメリカ・ドル 1,817,837	(37,901)	
2013年7月10日	アメリカ・ドル 21,495,260	イギリス・ボンド 14,023,277	161,462	
2013年8月12日	スイス・フラン 454,000	アメリカ・ドル 493,015	(12,091)	
2013年8月12日	アメリカ・ドル 13,280,574	スイス・フラン 12,700,000	(172,608)	
2013年9月12日	アメリカ・ドル 150,914,200	ユーロ 113,849,012	2,520,670	
為替予約取引に係る評価(損)益 計			2,459,532	0.13
ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価(損)益 計			(18,323,787)	(0.96)

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)	対純資産比率 (%)
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Clear Channel Communications, 6.875% 2018), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年12月	アメリカ・ドル 2,175,000	(6,796)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: JC Penney, 6.375% 2036), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年12月	アメリカ・ドル 4,250,000	55,880	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Mc Clatchy Co. 5.75% 2017), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2013年12月	アメリカ・ドル 750,000	12,716	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Mc Clatchy Co., 5.75% 2017), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年12月	アメリカ・ドル 1,075,000	18,227	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Sears Roebuck Acceptance, 7% 2032), Receive 5.00% Payment upon credit default	2013年12月	アメリカ・ドル 4,250,000	44,493	
JP Morgan Chase, Protection sold (Relevant Credit: Advanced Micro Devices, 7.75% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	2014年3月	アメリカ・ドル 3,050,000	85,965	
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	(97,119)	
Barclays, 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	(304,673)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: AK Steel Corp. 7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	2017年9月	アメリカ・ドル 1,700,000	(346,549)	
Goldman Sachs, Protection sold (Relevant Credit: Realogy Corp. 11.5% 2017), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2017年12月	アメリカ・ドル 750,000	30,543	
Goldman Sachs, Protection sold (Relevant Credit: Realogy Corp. 11.5% 2017), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2017年12月	アメリカ・ドル 2,250,000	91,629	
Goldman Sachs, Protection sold (Relevant Credit: Delta Airlines Inc. 8% 2015), Pay 5.00%, Payment upon credit default	2017年12月	アメリカ・ドル 1,500,000	(17,418)	
Barclays Bank, Protection sold (Relevant Credit: Wind Acquisition Finance, 11.75% 2017), Receive 5.00% Payment upon credit default	2018年3月	ユーロ 3,025,000	(127,961)	
スワップ契約 計(評価額)			(561,063)	(0.03)

オプション

銘柄	満期日	契約数	通貨	評価額 (アメリカ・ドル)	純資産比率 (%)
Dell Inc., Call Option, Strike Price 12 17	2015年1月	8,500	アメリカ・ドル	1,419,500	
US Airways, Call Option, Strike Price 15 17	2015年1月	5,258	アメリカ・ドル	1,958,605	
オプション 計				3,378,105	0.18

その他資産（負債控除後）	50,661,514	2.65
純資産	1,909,950,265	100.00

(1)これらの証券は公正価値で評価されている。

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

GMTN: Global Medium Term Note

MTN: 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

2013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	157,412	0.13
ベルギー 計			157,412	0.13
イギリス領バージン諸島				
CNOOC Finance 2013 1.75%/2018	アメリカ・ドル	200,000	191,523	0.16
イギリス領バージン諸島 計			191,523	0.16
カナダ				
Province of Manitoba Canada 1.3%/2017	アメリカ・ドル	275,000	276,627	0.22
Province of Ontario Canada 1.6%/2016	アメリカ・ドル	415,000	421,420	0.35
カナダ 計			698,047	0.57
ケイマン諸島				
Petrobras International Finance 5.75%/2020	アメリカ・ドル	130,000	135,899	0.11
Petrobras International Finance 7.875%/2019	アメリカ・ドル	150,000	174,204	0.14
Transocean 2.5%/2017	アメリカ・ドル	35,000	34,623	0.03
Transocean 5.05%/2016	アメリカ・ドル	100,000	108,829	0.09
Vale Overseas 4.375%/2022	アメリカ・ドル	115,000	109,806	0.09
ケイマン諸島 計			563,361	0.46
チリ				
Chilean Government International Bond 3.875%/2020	アメリカ・ドル	155,000	163,525	0.14
チリ 計			163,525	0.14
ドイツ				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau SerGMTN 0.5%/2016	アメリカ・ドル	240,000	238,285	0.20
ドイツ 計			238,285	0.20
ジャージー				
Heathrow Funding Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	180,000	192,516	0.16
ジャージー 計			192,516	0.16
ルクセンブルグ				
Gazprom Via Gaz Capital Ser144A 4.95%/2016	アメリカ・ドル	200,000	208,166	0.17
Telecom Italia Capital 5.25%/2013	アメリカ・ドル	330,000	334,166	0.27
Telecom Italia Capital 5.25%/2015	アメリカ・ドル	65,000	68,313	0.06
ルクセンブルグ 計			610,645	0.50
ポーランド				
Polish Government International Bond 3.875%/2015	アメリカ・ドル	265,000	277,754	0.23
ポーランド 計			277,754	0.23
スペイン				

Telefonica Emisiones 6.221%/2017	アメリカ・ドル	145,000	158,486	0.13
スペイン 計			158,486	0.13
スウェーデン				
Nordea Bank Ser144A 3.125%/2017	アメリカ・ドル	200,000	205,996	0.17
Nordea Bank Ser144A 4.875%/2021	アメリカ・ドル	290,000	298,082	0.24
Svensk Exportkredit 5.125%/2017	アメリカ・ドル	350,000	398,287	0.33
スウェーデン 計			902,365	0.74
イギリス				
HSBC Holdings 5.1%/2021	アメリカ・ドル	260,000	286,113	0.24
Invesco Finance 3.125%/2022	アメリカ・ドル	70,000	65,428	0.05
Royal Bank of Scotland Group 2.55%/2015	アメリカ・ドル	100,000	101,730	0.08
イギリス 計			453,271	0.37
アメリカ				
Actavis 3.25%/2022	アメリカ・ドル	175,000	163,473	0.13
Aetna 2.75%/2022	アメリカ・ドル	75,000	69,214	0.06
Agilent Technologies 3.2%/2022	アメリカ・ドル	50,000	46,443	0.04
Altria Group 4.75%/2021	アメリカ・ドル	55,000	59,000	0.05
Altria Group 9.25%/2019	アメリカ・ドル	215,000	285,094	0.23
American International Group 4.875%/2022	アメリカ・ドル	50,000	53,393	0.04
American International Group 6.4%/2020	アメリカ・ドル	35,000	40,650	0.03
American Tower 4.7%/2022	アメリカ・ドル	240,000	242,492	0.20
Ameriprise Financial 7.3%/2019	アメリカ・ドル	140,000	174,345	0.14
Anadarko Petroleum 6.375%/2017	アメリカ・ドル	185,000	212,945	0.18
Avon Products 4.6%/2020	アメリカ・ドル	160,000	162,000	0.13
Bank of America 2%/2018	アメリカ・ドル	250,000	242,413	0.20
Bank of America 5.75%/2016	アメリカ・ドル	145,000	157,680	0.13
Boardwalk Pipelines 3.375%/2023	アメリカ・ドル	160,000	147,603	0.12
Bunge Finance 3.2%/2017	アメリカ・ドル	65,000	66,559	0.05
Bunge NA Finance 5.9%/2017	アメリカ・ドル	205,000	225,991	0.19
Cellco Partnership 8.5%/2018	アメリカ・ドル	65,000	84,517	0.07
CNA Financial 5.875%/2020	アメリカ・ドル	215,000	243,680	0.20
ConAgra Foods 3.2%/2023	アメリカ・ドル	185,000	177,270	0.15
DCP Midstream Operating 2.5%/2017	アメリカ・ドル	90,000	88,931	0.07
Dollar General 3.25%/2023	アメリカ・ドル	200,000	183,014	0.15
El Paso Natural Gas 5.95%/2017	アメリカ・ドル	110,000	124,960	0.10
Energy Transfer Partners 3.6%/2023	アメリカ・ドル	150,000	140,663	0.12
Energy Transfer Partners 5.2%/2022	アメリカ・ドル	345,000	365,723	0.30
Enterprise Products Operating 7.55%/2038	アメリカ・ドル	115,000	146,826	0.12
EQT 4.875%/2021	アメリカ・ドル	275,000	283,401	0.23
Equity One 3.75%/2022	アメリカ・ドル	165,000	155,580	0.13
Exelon Generation 6.25%/2039	アメリカ・ドル	175,000	190,985	0.16
Federal National Mortgage Association 4.375%/2015	アメリカ・ドル	300,000	326,120	0.27
FHLMC (Gold) Pool A90053 4.5%/2039	アメリカ・ドル	102,643	110,036	0.09
FHLMC (Gold) Pool A91947 5%/2040	アメリカ・ドル	34,681	37,862	0.03
FHLMC (Gold) Pool A92240 4.5%/2040	アメリカ・ドル	5,891	6,210	0.01
FHLMC (Gold) Pool A93101 5%/2040	アメリカ・ドル	186,349	203,485	0.17
FHLMC (Gold) Pool A93451 4.5%/2040	アメリカ・ドル	415,192	442,277	0.36
FHLMC (Gold) Pool A94185 4%/2040	アメリカ・ドル	4,009	4,172	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94251 4%/2040	アメリカ・ドル	3,423	3,562	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94576 4%/2040	アメリカ・ドル	1,937	2,016	0.00
FHLMC (Gold) Pool A95734 4%/2040	アメリカ・ドル	27,287	28,663	0.02

FHLMC (Gold) Pool A96312 4%/2041	アメリカ・ドル	130,542	135,870	0.11
FHLMC (Gold) Pool C01787 6%/2034	アメリカ・ドル	124,324	138,752	0.11
FHLMC (Gold) Pool C04238 3.5%/2042	アメリカ・ドル	704,109	713,851	0.59
FHLMC (Gold) Pool C09036 3.5%/2043	アメリカ・ドル	626,703	634,439	0.52
FHLMC (Gold) Pool E01341 5.5%/2018	アメリカ・ドル	26,501	28,428	0.02
FHLMC (Gold) Pool E01497 5.5%/2018	アメリカ・ドル	7,302	7,838	0.01
FHLMC (Gold) Pool G03551 6%/2037	アメリカ・ドル	356,798	387,065	0.32
FHLMC (Gold) Pool G04814 5.5%/2038	アメリカ・ドル	1,490,112	1,601,063	1.32
FHLMC (Gold) Pool G05535 4.5%/2039	アメリカ・ドル	324,831	342,109	0.28
FHLMC (Gold) Pool G05659 4.5%/2039	アメリカ・ドル	426,636	449,329	0.37
FHLMC (Gold) Pool G05695 4.5%/2039	アメリカ・ドル	346,547	364,981	0.30
FHLMC (Gold) Pool G05955 5%/2040	アメリカ・ドル	341,181	373,072	0.31
FHLMC (Gold) Pool G05958 5%/2040	アメリカ・ドル	899,494	983,662	0.81
FHLMC (Gold) Pool G06231 4%/2040	アメリカ・ドル	231,312	240,752	0.20
FHLMC (Gold) Pool G06506 4%/2040	アメリカ・ドル	1,188	1,237	0.00
FHLMC (Gold) Pool G08016 6%/2034	アメリカ・ドル	730,127	792,074	0.65
FHLMC (Gold) Pool G08421 4%/2040	アメリカ・ドル	8,748	9,105	0.01
FHLMC (Gold) Pool G18465 2.5%/2028	アメリカ・ドル	208,940	209,822	0.17
FHLMC (Gold) Pool J03640 6%/2021	アメリカ・ドル	75,111	82,849	0.07
FHLMC (Gold) Pool J15139 4%/2026	アメリカ・ドル	128,663	135,209	0.11
FHLMC (Gold) Pool Q04674 4%/2041	アメリカ・ドル	89,330	92,917	0.08
FHLMC (Gold) Pool Q14426 3%/2043	アメリカ・ドル	782,238	763,881	0.63
FHLMC (Gold) Pool V80025 3%/2043	アメリカ・ドル	49,622	48,535	0.04
FHLMC Pool 1B3203 VR 2.726%/2037	アメリカ・ドル	51,256	54,339	0.04
FHLMC Pool 1G1762 VR 2.9%/2035	アメリカ・ドル	60,142	64,319	0.05
FirstEnergy Series C 7.375%/2031	アメリカ・ドル	155,000	163,880	0.13
FNMA 7.125%/2030	アメリカ・ドル	100,000	141,260	0.12
FNMA Pool 190360 5%/2035	アメリカ・ドル	731,931	790,227	0.65
FNMA Pool 254140 5.5%/2017	アメリカ・ドル	21,966	23,237	0.02
FNMA Pool 555526 5.5%/2018	アメリカ・ドル	21,463	22,774	0.02
FNMA Pool 569097 6.5%/2016	アメリカ・ドル	23,493	24,566	0.02
FNMA Pool 670373 6.5%/2017	アメリカ・ドル	64,835	69,691	0.06
FNMA Pool 725238 5%/2034	アメリカ・ドル	78,590	85,032	0.07
FNMA Pool 735318 4.5%/2019	アメリカ・ドル	74,352	79,138	0.07
FNMA Pool 735500 5.5%/2035	アメリカ・ドル	52,169	56,689	0.05
FNMA Pool 735575 5.5%/2018	アメリカ・ドル	23,776	25,154	0.02
FNMA Pool 735578 5%/2035	アメリカ・ドル	135,001	145,375	0.12
FNMA Pool 735997 5.5%/2035	アメリカ・ドル	51,049	55,684	0.05
FNMA Pool 745336 5%/2036	アメリカ・ドル	131,221	141,645	0.12
FNMA Pool 745428 5.5%/2036	アメリカ・ドル	158,395	172,128	0.14
FNMA Pool 745453 5.5%/2021	アメリカ・ドル	74,336	80,333	0.07
FNMA Pool 745458 6%/2036	アメリカ・ドル	1,001	1,090	0.00
FNMA Pool 745516 5.5%/2036	アメリカ・ドル	268,354	292,716	0.24
FNMA Pool 745947 6.5%/2036	アメリカ・ドル	17,431	19,380	0.02
FNMA Pool 750412 6.5%/2033	アメリカ・ドル	73,646	84,895	0.07
FNMA Pool 763199 VR 1.861%/2033	アメリカ・ドル	28,874	30,154	0.02
FNMA Pool 764852 5%/2019	アメリカ・ドル	173,059	185,118	0.15
FNMA Pool 842123 5.5%/2035	アメリカ・ドル	55,059	60,058	0.05
FNMA Pool 848522 VR 2.237%/2035	アメリカ・ドル	19,872	21,077	0.02
FNMA Pool 888223 5.5%/2036	アメリカ・ドル	56,451	61,902	0.05
FNMA Pool 889307 5%/2037	アメリカ・ドル	55,191	59,715	0.05
FNMA Pool 889829 5%/2035	アメリカ・ドル	451,801	490,199	0.40
FNMA Pool 900724 5.5%/2021	アメリカ・ドル	13,752	14,864	0.01
FNMA Pool 901646 6.5%/2036	アメリカ・ドル	8,552	9,379	0.01
FNMA Pool 902382 6.5%/2036	アメリカ・ドル	32,066	35,846	0.03
FNMA Pool 905743 6.5%/2036	アメリカ・ドル	44,452	49,701	0.04
FNMA Pool 906064 6%/2037	アメリカ・ドル	3,165	3,444	0.00
FNMA Pool 923129 5.5%/2034	アメリカ・ドル	37,017	40,591	0.03
FNMA Pool 929836 6%/2038	アメリカ・ドル	122,898	137,063	0.11

FNMA Pool 933051 6.5%/2037	アメリカ・ドル	69,606	77,411	0.06
FNMA Pool 942477 6%/2022	アメリカ・ドル	7,181	7,947	0.01
FNMA Pool 948410 6%/2022	アメリカ・ドル	11,871	13,047	0.01
FNMA Pool 952354 6.5%/2037	アメリカ・ドル	19,931	22,943	0.02
FNMA Pool 952502 6.5%/2037	アメリカ・ドル	63,535	71,159	0.06
FNMA Pool 953221 6%/2037	アメリカ・ドル	16,841	18,304	0.02
FNMA Pool 995051 6%/2037	アメリカ・ドル	476,239	521,578	0.43
FNMA Pool 995112 5.5%/2036	アメリカ・ドル	102,642	112,554	0.09
FNMA Pool 995203 5%/2035	アメリカ・ドル	185,551	200,698	0.17
FNMA Pool 995388 5.5%/2037	アメリカ・ドル	33,525	36,569	0.03
FNMA Pool 995434 5%/2023	アメリカ・ドル	228,064	244,064	0.20
FNMA Pool AB1479 5%/2040	アメリカ・ドル	99,684	108,989	0.09
FNMA Pool AB6491 3%/2042	アメリカ・ドル	87,136	85,295	0.07
FNMA Pool AB6633 3.5%/2042	アメリカ・ドル	1,141,323	1,160,515	0.96
FNMA Pool AB6670 3%/2042	アメリカ・ドル	68,507	67,057	0.06
FNMA Pool AB6768 3%/2042	アメリカ・ドル	243,450	238,290	0.20
FNMA Pool AB7143 2.5%/2027	アメリカ・ドル	303,434	306,144	0.25
FNMA Pool AB7846 3%/2043	アメリカ・ドル	907,329	888,066	0.73
FNMA Pool AB8700 3%/2043	アメリカ・ドル	1,578,228	1,544,796	1.27
FNMA Pool AC9582 5.5%/2040	アメリカ・ドル	153,427	168,471	0.14
FNMA Pool AD3125 4.5%/2040	アメリカ・ドル	1,156,953	1,226,164	1.01
FNMA Pool AE0801 6%/2039	アメリカ・ドル	110,716	120,337	0.10
FNMA Pool AE0949 4%/2041	アメリカ・ドル	251,966	263,916	0.22
FNMA Pool AE3884 4.5%/2040	アメリカ・ドル	574,849	609,238	0.50
FNMA Pool AE4629 4%/2040	アメリカ・ドル	277,114	288,920	0.24
FNMA Pool AE4834 5%/2040	アメリカ・ドル	59,129	64,599	0.05
FNMA Pool AE5471 4.5%/2040	アメリカ・ドル	67,578	71,621	0.06
FNMA Pool AH1111 4%/2040	アメリカ・ドル	1,362,529	1,427,295	1.17
FNMA Pool AH3431 3.5%/2026	アメリカ・ドル	270,600	282,547	0.23
FNMA Pool AH3586 4%/2041	アメリカ・ドル	254,744	265,596	0.22
FNMA Pool AL0065 4.5%/2041	アメリカ・ドル	284,212	301,653	0.25
FNMA Pool AL0160 4.5%/2041	アメリカ・ドル	749,545	796,943	0.66
FNMA Pool AL0546 5%/2041	アメリカ・ドル	407,502	446,371	0.37
FNMA Pool AL1105 4.5%/2040	アメリカ・ドル	836,499	886,539	0.73
FNMA Pool AL1408 3.5%/2027	アメリカ・ドル	96,127	100,401	0.08
FNMA Pool AL1524 4.5%/2040	アメリカ・ドル	56,985	60,394	0.05
FNMA Pool AL1697 4%/2041	アメリカ・ドル	665,303	693,646	0.57
FNMA Pool AL1938 4%/2026	アメリカ・ドル	183,373	193,668	0.16
FNMA Pool AL2118 4%/2042	アメリカ・ドル	414,809	432,481	0.36
FNMA Pool AL2579 4%/2026	アメリカ・ドル	535,123	565,157	0.47
FNMA Pool AL2645 4.5%/2027	アメリカ・ドル	521,189	553,660	0.46
FNMA Pool AL2661 4%/2026	アメリカ・ドル	48,891	51,641	0.04
FNMA Pool A07977 3%/2027	アメリカ・ドル	687,563	709,338	0.58
FNMA Pool AP7539 3%/2027	アメリカ・ドル	241,356	249,194	0.21
FNMA Pool AP9736 3.5%/2042	アメリカ・ドル	690,048	701,652	0.58
FNMA Pool AP9785 2.5%/2027	アメリカ・ドル	377,371	380,152	0.31
FNMA Pool AQ0546 3.5%/2042	アメリカ・ドル	179,976	183,003	0.15
FNMA Pool AQ9330 3.5%/2043	アメリカ・ドル	568,035	577,587	0.48
FNMA Pool AR1196 3%/2043	アメリカ・ドル	190,334	185,962	0.15
FNMA Pool AR8152 3%/2043	アメリカ・ドル	465,289	455,416	0.37
FNMA Pool AT2060 2.5%/2028	アメリカ・ドル	286,441	288,555	0.24
FNMA Pool AT2721 3%/2043	アメリカ・ドル	788,141	771,364	0.63
FNMA Pool MA0639 4%/2041	アメリカ・ドル	411,853	429,398	0.35
FNMA Pool MA0907 4%/2041	アメリカ・ドル	337,701	352,404	0.29
FNMA Pool MA0971 4%/2042	アメリカ・ドル	379,138	398,830	0.33
Ford Motor Credit 5.75%/2021	アメリカ・ドル	600,000	651,256	0.54
GATX 3.5%/2016	アメリカ・ドル	110,000	115,133	0.09
GATX 4.85%/2021	アメリカ・ドル	150,000	155,343	0.13
General Electric Capital 5.3%/2021	アメリカ・ドル	220,000	241,714	0.20

General Electric Capital SerGMTN 6.875%/2039	アメリカ・ドル	125,000	153,266	0.13
General Electric Capital SerMTN 5.875%/2038	アメリカ・ドル	85,000	93,038	0.08
GNMA 2010-103 IN 4.5%/2039	アメリカ・ドル	134,457	17,687	0.01
GNMA 2010-92 PI 4.5%/2037	アメリカ・ドル	395,930	54,301	0.04
GNMA 2011-41 AI 4.5%/2039	アメリカ・ドル	546,368	91,336	0.08
GNMA 2011-88 EI 4.5%/2039	アメリカ・ドル	97,685	16,402	0.01
GNMA 2013-24 OI 4%/2043	アメリカ・ドル	141,930	30,348	0.02
GNMA I Pool 616826 5.5%/2035	アメリカ・ドル	22,348	24,822	0.02
GNMA I Pool 783403 3.5%/2041	アメリカ・ドル	781,831	801,744	0.66
GNMA II Pool 3306 5.5%/2032	アメリカ・ドル	220,146	242,761	0.20
GNMA II Pool 3490 6.5%/2033	アメリカ・ドル	441,592	496,486	0.41
GNMA II Pool 3611 6%/2034	アメリカ・ドル	129,338	150,208	0.12
GNMA II Pool 4060 6%/2037	アメリカ・ドル	19,871	21,982	0.02
GNMA II Pool 4498 6%/2039	アメリカ・ドル	17,628	19,783	0.02
GNMA II Pool 4559 5%/2039	アメリカ・ドル	81,858	89,233	0.07
GNMA II Pool 4577 4.5%/2039	アメリカ・ドル	36,535	39,052	0.03
GNMA II Pool 4618 5%/2040	アメリカ・ドル	87,102	96,075	0.08
GNMA II Pool 4801 4.5%/2040	アメリカ・ドル	145,249	155,257	0.13
GNMA II Pool 4833 4%/2040	アメリカ・ドル	77,145	81,555	0.07
GNMA II Pool 4854 4.5%/2040	アメリカ・ドル	115,633	123,980	0.10
GNMA II Pool 4882 4%/2040	アメリカ・ドル	234,310	247,355	0.20
GNMA II Pool 4946 4.5%/2041	アメリカ・ドル	473,356	505,974	0.42
GNMA II Pool 4978 4.5%/2041	アメリカ・ドル	365,371	393,935	0.32
GNMA II Pool 4979 5%/2041	アメリカ・ドル	321,428	354,596	0.29
GNMA II Pool 5301 3.5%/2027	アメリカ・ドル	286,310	301,195	0.25
GNMA II Pool MA0072 2.5%/2027	アメリカ・ドル	265,765	268,732	0.22
GNMA II Pool MA0139 3%/2027	アメリカ・ドル	96,069	99,402	0.08
GNMA II Pool MA0205 3%/2027	アメリカ・ドル	423,951	438,652	0.36
GNMA II Pool MA0221 4%/2042	アメリカ・ドル	339,010	356,905	0.29
GNMA II Pool MA0319 4%/2042	アメリカ・ドル	103,617	109,020	0.09
GNMA II Pool MA0374 2.5%/2027	アメリカ・ドル	475,205	480,510	0.40
GNMA II Pool MA0375 3%/2027	アメリカ・ドル	138,511	143,310	0.12
GNMA II Pool MA0392 3.5%/2042	アメリカ・ドル	404,121	414,793	0.34
GNMA II Pool MA0623 2.5%/2042	アメリカ・ドル	133,898	125,211	0.10
GNMA II Pool MA0624 3%/2042	アメリカ・ドル	708,382	702,133	0.58
GNMA II Pool MA0697 2.5%/2043	アメリカ・ドル	504,064	471,183	0.39
GNMA II Pool MA0781 2.5%/2043	アメリカ・ドル	1,442,194	1,348,117	1.11
GNMA II Pool MA1011 3%/2043	アメリカ・ドル	404,072	399,589	0.33
GNMA II Pool MA1012 3.5%/2043	アメリカ・ドル	1,451,210	1,492,484	1.23
GNMA II Pool MA1089 3%/2043	アメリカ・ドル	185,000	183,368	0.15
Goldman Sachs Group 2.375%/2018	アメリカ・ドル	100,000	98,288	0.08
Goldman Sachs Group 3.625%/2023	アメリカ・ドル	165,000	158,182	0.13
Goldman Sachs Group 5.75%/2022	アメリカ・ドル	315,000	348,043	0.29
Goldman Sachs Group SerGMTN 7.5%/2019	アメリカ・ドル	200,000	237,793	0.20
Hospitality Properties Trust 5.625%/2017	アメリカ・ドル	115,000	124,286	0.10
Host Hotels & Resorts SerD 3.75%/2023	アメリカ・ドル	85,000	78,125	0.06
Hyatt Hotels 3.875%/2016	アメリカ・ドル	290,000	305,844	0.25
International Lease Finance SerMTN 6.625%/2013	アメリカ・ドル	290,000	294,713	0.24
International Paper 4.75%/2022	アメリカ・ドル	330,000	347,855	0.29
Interpublic Group of Companies 10%/2017	アメリカ・ドル	235,000	247,972	0.20
Interpublic Group of Companies 2.25%/2017	アメリカ・ドル	50,000	48,640	0.04

Interpublic Group of Companies 3.75%/2023	アメリカ・ドル	70,000	65,136	0.05
Interpublic Group of Companies 4%/2022	アメリカ・ドル	65,000	62,437	0.05
Jefferies Group 3.875%/2015	アメリカ・ドル	220,000	228,525	0.19
JPMorgan Chase 2%/2017	アメリカ・ドル	110,000	109,276	0.09
JPMorgan Chase 4.5%/2022	アメリカ・ドル	495,000	519,246	0.43
Kilroy Realty 4.8%/2018	アメリカ・ドル	145,000	154,792	0.13
Kinder Morgan Energy Partners 3.95%/2022	アメリカ・ドル	115,000	113,661	0.09
Magellan Midstream Partners 6.55%/2019	アメリカ・ドル	125,000	148,811	0.12
Marriott International 3%/2019	アメリカ・ドル	110,000	111,110	0.09
Merrill Lynch SerMTN 6.875%/2018	アメリカ・ドル	400,000	460,848	0.38
Morgan Stanley 2.125%/2018	アメリカ・ドル	355,000	340,130	0.28
Morgan Stanley SerGMTN 5.5%/2021	アメリカ・ドル	185,000	197,871	0.16
Morgan Stanley SerGMTN 7.3%/2019	アメリカ・ドル	175,000	203,529	0.17
Motorola Solutions 3.5%/2023	アメリカ・ドル	85,000	80,290	0.07
Murphy Oil 4%/2022	アメリカ・ドル	95,000	90,913	0.07
Nabors Industries 9.25%/2019	アメリカ・ドル	120,000	149,054	0.12
Newell Rubbermaid 2.05%/2017	アメリカ・ドル	55,000	53,955	0.04
Nisource Finance 5.95%/2041	アメリカ・ドル	125,000	131,781	0.11
Nisource Finance 6.25%/2040	アメリカ・ドル	90,000	99,885	0.08
Noble Energy 6%/2041	アメリカ・ドル	120,000	135,675	0.11
Omnicom Group 4.45%/2020	アメリカ・ドル	250,000	260,148	0.21
Omnicom Group 6.25%/2019	アメリカ・ドル	75,000	86,757	0.07
ONEOK 4.25%/2022	アメリカ・ドル	150,000	147,842	0.12
Owens Corning 4.2%/2022	アメリカ・ドル	160,000	155,336	0.13
Pioneer Natural Resources 3.95%/2022	アメリカ・ドル	130,000	128,604	0.11
Plains All American Pipeline 5.75%/2020	アメリカ・ドル	250,000	285,206	0.23
PNC Funding 3.3%/2022	アメリカ・ドル	270,000	260,025	0.21
PNC Funding 5.625%/2017	アメリカ・ドル	115,000	127,692	0.11
PPL Capital Funding 3.5%/2022	アメリカ・ドル	90,000	86,270	0.07
Principal Financial Group 6.05%/2036	アメリカ・ドル	180,000	209,593	0.17
Principal Financial Group 8.875%/2019	アメリカ・ドル	20,000	25,917	0.02
ProLogis 6.625%/2019	アメリカ・ドル	190,000	219,255	0.18
Provident 7%/2018	アメリカ・ドル	165,000	191,126	0.16
Public Service of Oklahoma 5.15%/2019	アメリカ・ドル	135,000	153,178	0.13
Reinsurance Group of America 5%/2021	アメリカ・ドル	105,000	112,696	0.09
Reinsurance Group of America 5.625%/2017	アメリカ・ドル	50,000	55,045	0.05
Reinsurance Group of America 6.45%/2019	アメリカ・ドル	70,000	80,623	0.07
Republic Services 3.55%/2022	アメリカ・ドル	105,000	102,383	0.08
Republic Services 5.7%/2041	アメリカ・ドル	110,000	120,413	0.10
Reynolds American 3.25%/2022	アメリカ・ドル	90,000	83,829	0.07
Reynolds American 7.625%/2016	アメリカ・ドル	115,000	134,166	0.11
Rowan 4.875%/2022	アメリカ・ドル	100,000	103,368	0.09
Southwest Airlines 5.125%/2017	アメリカ・ドル	245,000	264,347	0.22
Starwood Hotels & Resorts Worldwide 3.125%/2023	アメリカ・ドル	35,000	32,458	0.03
Tyson Foods 4.5%/2022	アメリカ・ドル	130,000	133,075	0.11
UnitedHealth Group 4.625%/2041	アメリカ・ドル	120,000	115,641	0.10
Unum Group 5.625%/2020	アメリカ・ドル	80,000	88,304	0.07
Unum Group 5.75%/2042	アメリカ・ドル	65,000	69,190	0.06
US Treasury 0.125%/2013	アメリカ・ドル	1,245,000	1,245,171	1.02

US Treasury 0.625%/2017	アメリカ・ドル	235,000	229,116	0.19
US Treasury 0.875%/2017	アメリカ・ドル	1,620,000	1,616,140	1.33
US Treasury 2.625%/2014	アメリカ・ドル	185,000	189,849	0.16
US Treasury 2.625%/2016	アメリカ・ドル	5,375,000	5,676,925	4.67
US Treasury 3.125%/2043	アメリカ・ドル	1,230,000	1,148,417	0.95
US Treasury 4.625%/2040	アメリカ・ドル	2,455,000	2,992,414	2.46
US Treasury Inflation Indexed 1.875%/2013	アメリカ・ドル	718,100	910,466	0.75
US Treasury Inflation Indexed 2%/2014	アメリカ・ドル	956,000	1,218,433	1.00
Valmont Industries 6.625%/2020	アメリカ・ドル	150,000	171,273	0.14
Ventas Realty 3.25%/2022	アメリカ・ドル	95,000	88,354	0.07
Ventas Realty 4%/2019	アメリカ・ドル	100,000	104,119	0.09
Walt Disney SerMTN 1.1%/2017	アメリカ・ドル	185,000	179,550	0.15
Weingarten Realty Investors 3.5%/2023	アメリカ・ドル	40,000	37,000	0.03
Western Gas Partners 4%/2022	アメリカ・ドル	205,000	199,364	0.16
Whirlpool SerMTN 3.7%/2023	アメリカ・ドル	125,000	120,042	0.10
Williams Partners 4.125%/2020	アメリカ・ドル	70,000	70,670	0.06
Williams Partners 6.3%/2040	アメリカ・ドル	180,000	189,311	0.16
Xerox 6.35%/2018	アメリカ・ドル	185,000	212,250	0.17
アメリカ 計			78,285,533	64.43
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			82,892,723	68.22
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				
Newcrest Finance Pty Ser144A 4.45%/2021	アメリカ・ドル	2,000	1,798	-
SMART Trust 2012-4US A4A 1.25%/2018	アメリカ・ドル	190,000	191,188	0.16
SMART Trust 2013-1US A4A 1.05%/2018	アメリカ・ドル	90,000	89,833	0.07
SMART Trust 2013-2US A4A 1.18%/2019	アメリカ・ドル	110,000	108,636	0.09
オーストラリア 計			391,455	0.32
バミューダ				
Bermuda Government International Bond Ser144A 5.603%/2020	アメリカ・ドル	100,000	109,000	0.09
バミューダ 計			109,000	0.09
チリ				
Banco Santander Chile Ser144A 3.875%/2022	アメリカ・ドル	150,000	139,833	0.12
Corporación Nacional del Cobre de Chile Ser144A 7.5%/2019	アメリカ・ドル	155,000	186,177	0.15
チリ 計			326,010	0.27
フランス				
BPCE Ser144A 2.375%/2013	アメリカ・ドル	205,000	205,953	0.17
Electricité de France Ser144A 4.6%/2020	アメリカ・ドル	255,000	276,231	0.23
RCI Banque Ser144A 3.5%/2018	アメリカ・ドル	65,000	64,751	0.05
RCI Banque Ser144A 4.6%/2016	アメリカ・ドル	190,000	198,242	0.17
フランス 計			745,177	0.62
アイルランド				
Iberdrola Finance Ireland Ser144A 3.8%/2014	アメリカ・ドル	135,000	138,527	0.11
アイルランド 計			138,527	0.11

イタリア					
Intesa Sanpaolo 3.125%/2016	アメリカ・ドル	200,000	196,770	0.16	
イタリア 計			196,770	0.16	
ルクセンブルグ					
Holcim US Finance Ser144A 6%/2019	アメリカ・ドル	135,000	150,942	0.12	
SES Ser144A 3.6%/2023	アメリカ・ドル	95,000	92,613	0.08	
ルクセンブルグ 計			243,555	0.20	
メキシコ					
Petroleos Mexicanos 4.875%/2022	アメリカ・ドル	535,000	547,038	0.45	
メキシコ 計			547,038	0.45	
オランダ					
EADS Finance Ser144A 2.7%/2023	アメリカ・ドル	190,000	176,425	0.15	
Heineken Ser144A 2.75%/2023	アメリカ・ドル	95,000	87,278	0.07	
Petrobras Global Finance 4.375%/2023	アメリカ・ドル	125,000	115,918	0.10	
オランダ 計			379,621	0.32	
ノルウェー					
DNB Bank Ser144A 3.2%/2017	アメリカ・ドル	210,000	217,610	0.18	
ノルウェー 計			217,610	0.18	
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	358,700	0.30	
トリニダード・トバゴ 計			358,700	0.30	
スペイン					
Telefonica Emisiones 3.192%/2018	アメリカ・ドル	185,000	179,390	0.15	
スペイン 計			179,390	0.15	
イギリス					
British Sky Broadcasting Group Ser144A 3.125%/2022	アメリカ・ドル	60,000	56,219	0.04	
Holmes Master Issuer 2012-1A A2 Ser144A VR 1.927%/2054	アメリカ・ドル	250,000	254,465	0.21	
Lanark Master Issuer 2013-1A 1A1 Ser144A VR 0.741%/2054	アメリカ・ドル	265,000	265,000	0.22	
Motor 12A A1C Ser144A 1.286%/2020	アメリカ・ドル	250,000	250,705	0.20	
PPL WEM Holdings Ser144A 3.9%/2016	アメリカ・ドル	240,000	250,991	0.21	
WPP Finance 2010 4.75%/2021	アメリカ・ドル	185,000	191,680	0.16	
イギリス 計			1,269,060	1.04	
アメリカ					
Actavis 4.625%/2042	アメリカ・ドル	40,000	35,831	0.03	
Aflac 3.625%/2023	アメリカ・ドル	190,000	185,059	0.15	
Allegheny Energy Supply Ser144A 6.75%/2039	アメリカ・ドル	70,000	75,796	0.06	
Ally Auto Receivables Trust 2009-B C Ser144A 4.06%/2016	アメリカ・ドル	575,000	581,778	0.48	
American Express Credit Account Master Trust 2012-5 C Ser144A 1.07%/2018	アメリカ・ドル	100,000	100,406	0.08	
Apple 2.4%/2023	アメリカ・ドル	190,000	176,599	0.15	
Avis Budget Rental Car Funding AESOP 2013-1A A Ser144A 1.92%/2019	アメリカ・ドル	270,000	264,054	0.22	

Avon Products 5%/2023	アメリカ・ドル	165,000	164,320	0.14
Bank of America 3.875%/2017	アメリカ・ドル	190,000	199,166	0.16
Bank of America Commercial Mortgage Trust 2007-4 AM VR 5.81%/2051	アメリカ・ドル	120,000	130,237	0.11
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage 2005-3 A2 4.501%/2043	アメリカ・ドル	122,737	122,804	0.10
Bank of America Mortgage Securities 2004-A 2A2 VR 2.925%/2034	アメリカ・ドル	20,415	20,130	0.02
Bank of America Mortgage Securities 2004-B 2A2 VR 2.867%/2034	アメリカ・ドル	139,082	138,339	0.11
Bank of America Mortgage Securities 2004-D 2A2 VR 2.868%/2034	アメリカ・ドル	309,316	300,161	0.25
Bank of America Mortgage Securities 2004-H 2A2 VR 3.104%/2034	アメリカ・ドル	125,000	123,089	0.10
Bank of America Mortgage Securities 2004-I 3A2 VR 3.079%/2034	アメリカ・ドル	56,999	57,615	0.05
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 2A1 VR 3.099%/2035	アメリカ・ドル	317,500	279,018	0.23
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 3A1 VR 3.136%/2035	アメリカ・ドル	160,968	146,335	0.12
Bank of New York Mellon SerD VR 4.5%/2049	アメリカ・ドル	115,000	108,388	0.09
Baxter International 3.2%/2023	アメリカ・ドル	75,000	73,721	0.06
Bay Area Toll Authority California 6.263%/2049	アメリカ・ドル	150,000	174,264	0.14
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2002-TOP8 A2 4.83%/2038	アメリカ・ドル	538	538	-
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2005-PWR9 AAB 4.804%/2042	アメリカ・ドル	479,960	488,567	0.40
Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007-PW17 A4 VR 5.694%/2050	アメリカ・ドル	120,000	136,474	0.11
Berkshire Hathaway Finance 4.3%/2043	アメリカ・ドル	110,000	100,307	0.08
Cabela's Master Credit Card Trust 2012-1A Ser144A 1.63%/2020	アメリカ・ドル	100,000	100,230	0.08
California Educational Facilities Authority 5.25%/2040	アメリカ・ドル	110,000	134,517	0.11
Capital Auto Receivables Asset Trust 2013-1 B 1.29%/2018	アメリカ・ドル	15,000	14,824	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust 2013-1 C 1.74%/2018	アメリカ・ドル	20,000	19,641	0.02
CarMax Auto Owner Trust 2010-2 B 3.96%/2016	アメリカ・ドル	380,000	392,728	0.32
CC Holdings GS V / Crown Castle GS III 3.849%/2023	アメリカ・ドル	350,000	330,696	0.27
Celgene 3.25%/2022	アメリカ・ドル	240,000	228,064	0.19
Chevron 1.718%/2018	アメリカ・ドル	210,000	208,315	0.17
Chicago Illinois Metropolitan Water Reclamation 5.72%/2038	アメリカ・ドル	225,000	262,543	0.22
Chicago Illinois O' Hare International Airport General Third Lien Series B 6.395%/2040	アメリカ・ドル	170,000	200,161	0.16
Chicago Illinois Transit Authority Sales And Taxable-pension Funding Series A 6.899%/2040	アメリカ・ドル	170,000	197,521	0.16
City of Houston TX 5%/2023	アメリカ・ドル	105,000	122,829	0.10

City of Los Angeles Department of Airports 7.053%/2040	アメリカ・ドル	185,000	228,998	0.19
City of New York 5%/2023	アメリカ・ドル	105,000	120,955	0.10
City of New York 5.846%/2040	アメリカ・ドル	100,000	113,300	0.09
City Public Service Board of San Antonio TX 5.25%/2024	アメリカ・ドル	165,000	194,659	0.16
CKE Restaurant Holdings 2013-1A A2 Ser144A 4.474%/2043	アメリカ・ドル	224,156	228,149	0.19
CNH Equipment Trust 2012-D B 1.27%/2020	アメリカ・ドル	105,000	103,091	0.08
Comcast 6.95%/2037	アメリカ・ドル	185,000	233,622	0.19
Commonwealth of Massachusetts 4.5%/2031	アメリカ・ドル	160,000	158,499	0.13
Commonwealth of Massachusetts 5.25%/2024	アメリカ・ドル	115,000	139,019	0.11
Commonwealth of Pennsylvania 5%/2021	アメリカ・ドル	115,000	136,449	0.11
Commonwealth of Pennsylvania 5%/2024	アメリカ・ドル	95,000	110,242	0.09
Commonwealth of Pennsylvania 5%/2025	アメリカ・ドル	80,000	92,915	0.08
Commonwealth of Virginia 4%/2024	アメリカ・ドル	100,000	109,686	0.09
Commonwealth of Virginia 5%/2023	アメリカ・ドル	40,000	48,184	0.04
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	アメリカ・ドル	85,136	99,609	0.08
Continental Airlines 2010-1 Class A Pass Through Trust SerA 4.75%/2021	アメリカ・ドル	64,623	69,147	0.06
Continental Airlines 2012-1 Class A Pass Through Trust SerA 4.15%/2024	アメリカ・ドル	45,000	44,213	0.04
COX Communications Ser144A 3.25%/2022	アメリカ・ドル	40,000	37,708	0.03
COX Communications Ser144A 8.375%/2039	アメリカ・ドル	200,000	271,915	0.22
Credit Suisse First Boston Commercial Mortgage Pass-Through Certificates Series 2008-C1 A3 VR 6.0508%/2041	アメリカ・ドル	545,000	624,738	0.51
Crown Castle Towers Ser144A 6.113%/2020	アメリカ・ドル	213,000	244,747	0.20
DCP Midstream Operating 3.875%/2023	アメリカ・ドル	85,000	79,878	0.07
Delta Air Lines 2010-2 Class A Pass Through Trust Ser2A 4.95%/2019	アメリカ・ドル	57,492	61,085	0.05
Delta Air Lines 2011-1 Class A Pass Through Trust SerA 5.3%/2019	アメリカ・ドル	52,244	56,163	0.05
Denver City & County School District No 1 4.242%/2037	アメリカ・ドル	70,000	60,493	0.05
DIRECTV Holdings 1.75%/2018	アメリカ・ドル	100,000	96,647	0.08
DIRECTV Holdings 5.875%/2019	アメリカ・ドル	230,000	259,184	0.21
District of Columbia 5.25%/2034	アメリカ・ドル	170,000	188,906	0.16
District of Columbia 5.591%/2034	アメリカ・ドル	60,000	68,428	0.06
Dominion Resources SerB 2.75%/2022	アメリカ・ドル	90,000	84,029	0.07
Domino's Pizza Master Issuer 2012-1A A2 Ser144A 5.216%/2042	アメリカ・ドル	328,719	351,405	0.29
East Bay Municipal Utility District 5.874%/2040	アメリカ・ドル	220,000	258,865	0.21
Enogex Ser144A 6.25%/2020	アメリカ・ドル	60,000	65,456	0.06
Enterprise Products Operating 3.35%/2023	アメリカ・ドル	185,000	178,391	0.15
ERAC USA Finance Ser144A 3.3%/2022	アメリカ・ドル	30,000	28,533	0.02
ERAC USA Finance Ser144A 5.25%/2020	アメリカ・ドル	190,000	210,422	0.17
FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.875%/2022	アメリカ・ドル	124,064	122,859	0.10

FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates K502 A2				
1.426%/2017	アメリカ・ドル	75,000	75,457	0.06
Fifth Third Bancorp 3.5%/2022	アメリカ・ドル	90,000	89,375	0.07
Fifth Third Bancorp 8.25%/2038	アメリカ・ドル	150,000	190,789	0.16
FirstEnergy SerA 2.75%/2018	アメリカ・ドル	65,000	63,349	0.05
FirstEnergy SerB 4.25%/2023	アメリカ・ドル	255,000	237,385	0.20
Fiserv 3.125%/2016	アメリカ・ドル	80,000	83,479	0.07
Fiserv 3.5%/2022	アメリカ・ドル	80,000	76,078	0.06
Florida Gas Transmission Ser144A				
3.875%/2022	アメリカ・ドル	85,000	85,961	0.07
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance 1.298%/2016	アメリカ・ドル	125,000	124,118	0.10
Florida Hurricane Catastrophe Fund Finance Series A 2.995%/2020	アメリカ・ドル	140,000	131,326	0.11
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust 2010-3 C Ser144A 4.99%/2017	アメリカ・ドル	590,000	622,111	0.51
FREMF Mortgage Trust 2012-K22 B Ser144A VR 3.812%/2045	アメリカ・ドル	95,000	86,544	0.07
FREMF Mortgage Trust 2012-K23 B Ser144A VR 3.656%/2045	アメリカ・ドル	90,000	88,517	0.07
FREMF Mortgage Trust 2012-K711 B Ser144A VR 3.562%/2045	アメリカ・ドル	140,000	134,747	0.11
FREMF Mortgage Trust 2013-K24 B Ser144A VR 3.502%/2045	アメリカ・ドル	50,000	44,782	0.04
FREMF Mortgage Trust 2013-K26 B Ser144A VR 3.6%/2040	アメリカ・ドル	100,000	89,962	0.07
FREMF Mortgage Trust 2013-K27 B Ser144A VR 3.497%/2046	アメリカ・ドル	90,000	79,856	0.07
FREMF Mortgage Trust 2013-K28 B Ser144A VR 3.494%/2046	アメリカ・ドル	115,000	103,685	0.09
FREMF Mortgage Trust 2013-K712 B Ser144A VR 3.367%/2045	アメリカ・ドル	60,000	58,672	0.05
FREMF Mortgage Trust 2013-K713 B Ser144A VR 3.165%/2046	アメリカ・ドル	150,000	138,066	0.11
Greenwich Capital Commercial Funding 2005-GG3 AAB 4.619%/2042	アメリカ・ドル	248,701	252,451	0.21
GS Mortgage Securities II 2012-GCJ9 A3 2.773%/2045	アメリカ・ドル	135,000	125,620	0.10
GSAA Trust 2005-8 A3 VR 0.623%/2035	アメリカ・ドル	100,497	91,955	0.08
GTP Acquisition Partners I Ser144A 2.364%/2018	アメリカ・ドル	125,000	121,926	0.10
GTP Acquisition Partners I Ser144A 4.347%/2016	アメリカ・ドル	70,000	73,761	0.06
Gulf South Pipeline 4%/2022	アメリカ・ドル	120,000	118,547	0.10
Huntington Auto Trust 2011-1A C Ser144A 2.53%/2017	アメリカ・ドル	155,000	157,857	0.13
Hyundai Auto Lease Securitization Trust 2012-A A4 Ser144A 1.05%/2017	アメリカ・ドル	100,000	100,264	0.08
JobsOhio Beverage System 4.532%/2035	アメリカ・ドル	50,000	47,168	0.04
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2005-LDP4 ASB VR 4.824%/2042	アメリカ・ドル	440,286	451,382	0.37
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-CB15 A4 VR 5.814%/2043	アメリカ・ドル	760,000	836,635	0.69
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2006-LDP9 A3 5.336%/2047	アメリカ・ドル	160,000	176,893	0.15

JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-CB18 A4 5.44%/2047	アメリカ・ドル	380,000	422,671	0.35
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-CB19 AM VR 5.711%/2049	アメリカ・ドル	125,000	135,862	0.11
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-LD12 A4 VR 5.882%/2051	アメリカ・ドル	210,000	237,942	0.20
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2007-LD12 AM VR 6%/2051	アメリカ・ドル	140,000	151,998	0.13
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities 2012-C8 A3 2.829%/2045	アメリカ・ドル	185,000	173,917	0.14
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Series Trust 2013-LC11 2013-LC11 A5 2.96%/2046	アメリカ・ドル	145,000	135,967	0.11
JPMorgan Chase 3.375%/2023	アメリカ・ドル	140,000	130,630	0.11
Kansas Development Finance Authority 5.501%/2034	アメリカ・ドル	200,000	217,272	0.18
Kilroy Realty 6.625%/2020	アメリカ・ドル	90,000	102,373	0.08
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007-C2 A3 5.43%/2040	アメリカ・ドル	390,000	429,320	0.35
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008-C1 AM VR 6.151%/2041	アメリカ・ドル	40,000	44,862	0.04
Life Technologies 3.5%/2016	アメリカ・ドル	175,000	182,249	0.15
Los Angeles Department of Water & Power 5%/2043	アメリカ・ドル	125,000	131,470	0.11
Maryland State Transportation Authority 5.754%/2041	アメリカ・ドル	200,000	227,370	0.19
Maryland State Transportation Authority 5.888%/2043	アメリカ・ドル	165,000	182,916	0.15
Massachusetts Bay Transportation Authority 5%/2020	アメリカ・ドル	80,000	94,962	0.08
McKesson 1.4%/2018	アメリカ・ドル	130,000	125,619	0.10
Merrill Lynch Mortgage Trust 2006-C2 AM VR 5.782%/2043	アメリカ・ドル	135,000	145,900	0.12
Merrill Lynch Mortgage Trust 2008-C1 A4 5.69%/2051	アメリカ・ドル	430,000	488,798	0.40
Metropolitan Transportation Authority New York Taxable Series C-build America Bds- 7.336%/2039	アメリカ・ドル	80,000	107,255	0.09
Morgan Stanley 3.75%/2023	アメリカ・ドル	240,000	229,966	0.19
NBCUniversal Enterprise Ser144A 1.974%/2019	アメリカ・ドル	110,000	107,204	0.09
NBCUniversal Media 2.875%/2023	アメリカ・ドル	80,000	76,144	0.06
NBCUniversal Media 5.15%/2020	アメリカ・ドル	115,000	131,117	0.11
New Jersey State Turnpike Authority 5%/2029	アメリカ・ドル	90,000	94,226	0.08
New York City Housing Development Taxable Series A 6.42%/2027	アメリカ・ドル	46,825	44,859	0.04
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5%/2023	アメリカ・ドル	100,000	116,248	0.10
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5%/2024	アメリカ・ドル	60,000	68,640	0.06
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5%/2025	アメリカ・ドル	60,000	67,818	0.06

New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5.508%/2037	アメリカ・ドル	270,000	296,800	0.24
New York City Water & Sewer System 5.952%/2042	アメリカ・ドル	120,000	138,288	0.11
New York State Dormitory Authority 5%/2024	アメリカ・ドル	105,000	120,954	0.10
New York State Urban Development 5%/2043	アメリカ・ドル	190,000	200,756	0.17
News America 6.15%/2037	アメリカ・ドル	260,000	282,845	0.23
Nordstrom Credit Card Master Note Trust II 2011-1A A Ser144A 2.28%/2019	アメリカ・ドル	385,000	393,328	0.32
NVR 3.95%/2022	アメリカ・ドル	195,000	189,947	0.16
O'Reilly Automotive 3.8%/2022	アメリカ・ドル	40,000	39,501	0.03
O'Reilly Automotive 4.875%/2021	アメリカ・ドル	175,000	186,607	0.15
Philadelphia Authority for Industrial Development 3.964%/2026	アメリカ・ドル	270,000	248,848	0.20
Phillips 66 4.3%/2022	アメリカ・ドル	95,000	98,335	0.08
Port Authority of New York & New Jersey 4.458%/2062	アメリカ・ドル	330,000	294,914	0.24
PPL Capital Funding 3.4%/2023	アメリカ・ドル	85,000	80,702	0.07
Principal Financial Group 3.3%/2022	アメリカ・ドル	10,000	9,733	0.01
Regional Transportation District 5%/2038	アメリカ・ドル	165,000	172,712	0.14
Reliance Holdings USA Ser144A 4.5%/2020	アメリカ・ドル	250,000	246,355	0.20
Rock Tenn 4%/2023	アメリカ・ドル	110,000	106,199	0.09
San Diego County Water Authority 6.138%/2049	アメリカ・ドル	125,000	146,371	0.12
SBA Tower Trust Ser144A 2.933%/2017	アメリカ・ドル	150,000	152,271	0.13
Sequoia Mortgage Trust 2010-H1 A1 VR 3.75%/2040	アメリカ・ドル	9,655	9,486	0.01
Sequoia Mortgage Trust 2013-6 A1 VR 2.5%/2043	アメリカ・ドル	188,995	175,296	0.14
Sequoia Mortgage Trust 2013-7 A2 VR 3%/2043	アメリカ・ドル	99,793	94,571	0.08
Sierra Timeshare Receivables Funding 2013-1A A Ser144A 1.59%/2029	アメリカ・ドル	121,835	121,037	0.10
Spectra Energy Capital 3.3%/2023	アメリカ・ドル	185,000	167,243	0.14
State of California 5%/2043	アメリカ・ドル	25,000	25,976	0.02
State of Florida Lottery Revenue 5%/2020	アメリカ・ドル	440,000	515,728	0.42
State of Georgia Series A 5%/2021	アメリカ・ドル	100,000	121,171	0.10
State of Georgia Series A 5%/2023	アメリカ・ドル	100,000	119,759	0.10
State of Louisiana Series A 5%/2021	アメリカ・ドル	60,000	71,005	0.06
State of Louisiana Series C 5%/2021	アメリカ・ドル	70,000	82,832	0.07
State Street 3.1%/2023	アメリカ・ドル	65,000	61,011	0.05
Texas Transportation Commission St Highway Fund Taxable-first Tier Series B 5.178%/2030	アメリカ・ドル	130,000	145,591	0.12
Tompkins County Industrial Development Agency 5%/2037	アメリカ・ドル	170,000	182,211	0.15
University of Texas System 5%/2043	アメリカ・ドル	165,000	178,411	0.15
University of Virginia 5%/2040	アメリカ・ドル	200,000	209,138	0.17
University of Virginia 5%/2043	アメリカ・ドル	40,000	43,656	0.04
US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95%/2025	アメリカ・ドル	125,000	120,313	0.10
US Bancorp SerMTN 2.95%/2022	アメリカ・ドル	85,000	79,004	0.07

Utah Transit Authority 5.937%/2039	アメリカ・ドル	185,000	221,230	0.18
Verisk Analytics 5.8%/2021	アメリカ・ドル	115,000	127,134	0.10
Virginia College Building Authority 5%/2022	アメリカ・ドル	45,000	53,065	0.04
Virginia Commonwealth Transportation Board 5.35%/2035	アメリカ・ドル	45,000	49,149	0.04
Virginia Public Building Authority 5.9%/2030	アメリカ・ドル	100,000	114,369	0.09
Virginia Public School Authority 5%/2023	アメリカ・ドル	150,000	174,849	0.14
Volkswagen Auto Lease Trust 2012-A A4 1.06%/2017	アメリカ・ドル	160,000	160,644	0.13
WEA Finance Ser144A 3.375%/2022	アメリカ・ドル	105,000	99,159	0.08
WellPoint 3.3%/2023	アメリカ・ドル	115,000	109,696	0.09
Wells Fargo Mortgage Backed Securities Trust 2005-AR2 2A2 VR 2.681%/2035	アメリカ・ドル	100,578	101,339	0.08
WF-RBS Commercial Mortgage Trust 2013-C13 A4 3.001%/2045	アメリカ・ドル	185,000	180,730	0.15
Williams Companies 3.7%/2023	アメリカ・ドル	135,000	125,673	0.10
アメリカ 計			29,385,889	24.17
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			34,487,802	28.38
直近に発行された取引可能な有価証券				
アメリカ				
American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust Ser144A 4%/2025	アメリカ・ドル	75,000	70,875	0.06
ING US Ser144A 2.9%/2018	アメリカ・ドル	95,000	95,581	0.08
Kansas City Southern Railway Ser144A 4.3%/2043	アメリカ・ドル	175,000	158,299	0.13
アメリカ 計			324,755	0.27
直近に発行された取引可能な有価証券 計			324,755	0.27
有価証券 計			117,705,280	96.87
ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価（損）益 計			3,679	-
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）	対純資産比率 （％）
Short, 83 ten-year US Treasury Note Contracts, \$93,881 pledged as initial margin	2013年9月	(10,465,781)	265,125	
Short 2 US Long Bond Contracts, \$2,419 pledged as initial margin	2013年9月	(269,625)	11,969	
先物取引に係る評価益 計			277,094	0.23
その他資産（負債控除後）			3,516,597	2.90
純資産			121,502,650	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

GMTN: Global Medium Term Note

GNMA: Government National Mortgage Association

MTN: Medium Term Note

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

T．ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドから提供を受けた情報をもとに作成しております。

* 対純資産比率は、USアグリゲート・ボンド・ファンドの純資産に対する比率

* 添付の注記は、当財務諸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

2013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(Société d'Investissement à Capital Variable、略称:SICAV)としてルクセンブルグ大公国の法律に基づき組成されたオープン・エンド型の投資法人であり、「2010年12月17日の集団投資事業に関する法律のパート」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。2013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
	Ih (米ドル)	2012年12月7日	米ドル
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
	Sh (日本円)	2012年 9月21日	日本円
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
	Q	2013年1月14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
	Ih (ユーロ)	2011年 6月 1日	ユーロ
アジア・Ex-ジャパ・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
	Q	2013年1月31日	米ドル
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	2008年11月11日	ユーロ
	I	2008年11月11日	ユーロ
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	A	2007年 5月 3日	ユーロ
	I	2007年 2月26日	ユーロ
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	I	2007年 2月26日	ユーロ
	Q (英ポンド)	2013年5月24日	英ポンド
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	2008年11月26日	ユーロ
	I	2008年11月26日	ユーロ
ヨーロッパ・ストラクチャード・リサーチ・エクイティ・ファンド	I	2005年 1月 7日	ユーロ
グローバル・エマージング・マーケット・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
	Q	2013年1月14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 (英債券)	2009年 7月10日	英債券
グローバル・ナチュラル・リソースズ・エクイティ・ファンド	S	2011年3月11日	米ドル
	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・バリュー・エクイティ・ファンド	Q (ユーロ)	2013年1月18日	ユーロ
	A	2012年11月28日	米ドル
グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	I	2012年11月28日	米ドル
	A	2008年10月27日	米ドル
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	I	2008年10月27日	米ドル
	A	2006年 4月11日	ユーロ
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	I	2005年12月16日	ユーロ
	A	2009年 6月19日	米ドル
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	I	2008年 4月24日	米ドル
	A	2007年12月24日	米ドル
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	I	2007年 9月 4日	米ドル
	A	2003年 2月 5日	米ドル
USラージキャップ・エクイティ・ファンド	Q	2013年5月13日	米ドル
	A	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	I	2009年6月26日	米ドル
	A	2003年11月13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	I	2003年7月31日	米ドル
	Q	2013年1月14日	米ドル
	A	2003年 1月 2日	米ドル
USモーター・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	I	2002年3月27日	米ドル
	Q	2013年1月31日	米ドル
	A	2001年7月31日	米ドル
	A (ユーロ)	2013年5月22日	ユーロ
	Q	2013年5月8日	米ドル
	Q (英債券)	2013年1月18日	英債券

2013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Q証券、クラスS証券およびクラスZ証券という最大6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・ファンドおよびグローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドの投資家だけに、クラスI(英債券)証券は現在、グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンドの投資家だけに、Ih証券は現在、USアグリゲート・ボンド・ファンドおよびユーロ・コーポレート・ボンド・ファンドの投資家だけに、Sh証券は現在、グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンドの投資家だけに販売されている。クラスA証券およびクラスQ証券はあらゆる投資家に販売されている。クラスI、J、SおよびZ証券は、機関投資家向けの投資証券である。クラスId、JdおよびクラスSd証券は、それぞれクラスI証券、クラスJ証券およびクラスS証券の配当型投資証券であり、グローバル・アグリゲート・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・ファンドおよびグローバル・フィクスト・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。

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公正妥当と認められ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によりまたは取締役会の監督の下で合理的と認める公正価格に基づき評価される。

財務報告のため、有価証券は2013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、2013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。

日本、韓国、台湾及び中国に関連した市場インデックスが、営業日の最終相場と午後4時の評価時間で2%以上変動(上昇または下落)した場合、公正価値の調整が行われる。その評価はファンドで市場価格として適用されたインデックスの差異に等しい。2013年6月30日現在、台湾に関連した市場インデックスが2%以上変動し、公正価値の調整がアジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド、グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド、グローバル・エクイティ・ファンドおよびグローバル・バリュー・エクイティ・ファンドで行われた。

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で行われている。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損益から、当該証券に係わる外国為替レートの変動による損益を独立させ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	2013年6月30日 現在のレート	2013年6月30日に終了した 期間の平均レート
ユーロ	0.7693	0.7616
ノルウェー・クローネ	6.1061	5.7323
スウェーデン・クローナ	6.7495	6.4987
日本円	99.335	95.6

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認識される。財務報告の目的上、有価証券に係わる取引は2013年6月30日における各ファンドの主要市場の終了時点のカットオフ日として、約定日基準で認識されている。実現損益は、売却有価証券の平均原価に基づいて算定される。

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、発生基準で認識される。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、損益および純資産変動計算書の「その他費用」の項目に含まれている。

e) クラス別会計および設定費の処理

各クラスに個別に発生する費用は、関連するクラスに直接割り当てられる。すべてのクラスに共通の費用、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、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、5年を超えない期間にわたり、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日々評価される。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日々評価される。契約額の変動は、契約の終了または期日まで、未実現損益として日々計上される。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、指数、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、指数、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。各ファンドの各クラスに係わる全ての未決済契約が、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

2013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・エマーシング・マーケット・エクイティ・ファンドは、中国の現地投資家およ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、現行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ると想定しているため、未払税金を財務諸表で認識している。

c) TBA 購入確約

特定のファンドでは、To Be Announced(以下「TBA」)取引を行う場合がある。これは、決められた単価で、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、2013年6月30日に終了した期間におけるポートフォリオの回転率は以下のとおりである。

ファンド名	ポートフォリオ回転率
エマージング・ローカル・マーケット・ボンド・ファンド	149.17
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	(131.18)
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	182.37
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	81.08
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	66.90
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	156.20
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	166.39
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	(10.70)
USアグリゲート・ボンド・ファンド	40.44
アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	33.52
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	62.91
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	111.26
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	117.71
ヨーロッパ・スモーカー・カンパニー・エクイティ・ファンド	46.96
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	53.87
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	18.14
グローバル・エクイティ・ファンド	321.23
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	177.84
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	56.83
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	98.66
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	62.08
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	147.94
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	23.69
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	74.85
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	25.61
USラージキャップ・エクイティ・ファンド	118.06
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	42.36
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	(21.08)
USスモーカー・カンパニー・エクイティ・ファンド	(45.73)

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。

2013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・アグリゲート・ボンド・ファンド	Id	米ドル	0.025123	2013年 1月24日
	Id	米ドル	0.023240	2013年 2月22日
	Id	米ドル	0.020956	2013年 3月22日
	Id	米ドル	0.023669	2013年 4月24日
	Id	米ドル	0.020696	2013年 5月24日
	Id	米ドル	0.020645	2013年 6月24日
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	Id	米ドル	0.091218	2013年 1月24日
	Id	米ドル	0.044869	2013年 2月22日
	Id	米ドル	0.038759	2013年 3月22日
	Id	米ドル	0.046850	2013年 4月24日
	Id	米ドル	0.040390	2013年 5月24日
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Id	米ドル	0.040370	2013年 6月24日
	Ad	米ドル	0.180572	2013年 3月22日
	Ad	米ドル	0.171403	2013年 6月24日
	Jd	米ドル	0.065562	2013年 1月24日
	Jd	米ドル	0.053227	2013年 2月22日

	Jd	米ドル	0.055433	2013年 3月22日
	Jd	米ドル	0.059963	2013年 4月24日
	Jd	米ドル	0.053559	2013年 5月24日
	Jd	米ドル	0.054236	2013年 6月24日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.031114	2013年 1月24日
	Jd	米ドル	0.026413	2013年 2月22日
	Jd	米ドル	0.028703	2013年 3月22日
	Jd	米ドル	0.031103	2013年 4月24日
	Jd	米ドル	0.027921	2013年 5月24日
	Jd	米ドル	0.026030	2013年 6月24日
グローバル・エマージング・マーケット・ エクイティ・ファンド	Ad	米ドル	0.042839	2013年 6月24日
	Jd	米ドル	0.012420	2013年 2月22日
	Jd	米ドル	0.052888	2013年 5月24日

5. カストディーフィー

ファンドは、年間のカストディーフィーを負担する。当該費用は、カストディーに保管された資産価値に応じて、0.025%から0.01%まで逡減する。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

損益および純資産変動計算書における管理会社報酬は、名義書換代理人報酬および管理費用等を含む。

ファンドは、年間の管理費用を負担する。当該費用は、ファンドの純資産額に応じて0.07%から0.01%まで逡減する。しかしながら、サブファンドは年間最低40,000米ドルの管理費用を負担する。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。

7. 課税

現行の法規および慣行では、当社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

2013年6月30日に終了した期間において、当社には関係するルクセンブルグ法に基づき年次税(「Taxe d'Abonnement」)が課せられている。クラスA及びクラスQ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課税される。

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。投資先の国で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・ロスは、許容される最大範囲まで、キャピタル・ゲインを相殺するために使用される。保有期間に応じて税率が変わる場合、その範囲内において、各ファンドについて、適用最低税率を用いた繰延税金負債を計上している。

純キャピタル・ゲインに課され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。2013年6月30日に終了した期間においては、損益および純資産変動計算書に表示されている通り、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、グローバル・エクイティ・ファンドおよびグローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンドの実現損益および未実現損益について、インドのキャピタル・ゲインに起因する税額は控除されていない。

2013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、将来のインドの有価証券の実現損益に係るキャピタル・ゲイン税と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	9,596,595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	4,205,414米ドル
グローバル・エクイティ・ファンド	23,621,984米ドル
グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンド	306,160米ドル

繰り越されたキャピタル・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」)および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・リミテッドおよび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(以下「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**	クラスQ 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%	0.65%
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	0.90%	0.40%	0.40%
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	1.15%	0.60%	0.60%
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	0.90%	0.45%	0.45%
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%	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%	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%	0.45%	0.45%
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	1.15%	0.60%	0.60%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	0.90%	0.40%	0.40%
アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%	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%	1.00%
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%
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	1.80%	0.95%	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%	0.55%	0.55%
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%	1.00%
グローバル・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%	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%	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%	0.75%
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%	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%	0.75%
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%	0.75%
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%	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%	1.10%
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	0.65%
USラージキャップ・エクイティ・ファンド	1.50%	0.65%	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%	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%	0.65%
USスモーカー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.95%	0.95%

* Ad, AhおよびA(ユーロ)投資証券を含む。

** Id, Ih(ユーロ)、Ih(米ドル)およびI(英ポンド)投資証券を含む。

***Q(ユーロ)およびQ(英ポンド)投資証券を含む

クラスS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Q投資証券

クラスAおよびクラスQ投資証券はすべての投資家が購入できる。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I投資証券

クラスI投資証券は機関投資家のみが購入でき、運用報酬および運営管理費用のどちらも課せられている。

クラスS投資証券

クラスS投資証券に係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。

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、2013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・ボンド・ファンド	I	0.75	0.75
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	A	1.07	1.07
	I	0.50	0.50
	Ih(米ドル)	0.50	0.50
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・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・ボンド・ファンド	A	1.07	1.07
	I	0.55	0.55
	Id	0.55	0.55
	Sh(日本円)	0.10	0.10
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・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・ボンド・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	0.55	0.55
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	A	1.26	1.60
	Ad	1.25	1.60
	Ah(ユーロ)	1.23	1.60
	Ah(ノルウェー・クローネ)	1.25	1.60
	Ah(スウェーデン・クローナ)	1.27	1.60
	I	0.65	0.96
	Q**	0.77	0.77
USアグリゲート・ボンド・ファンド	I	0.56	0.68
	Ih(ユーロ)	0.52	0.68
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	A	2.03	2.30
	I	1.07	1.20
	S	0.09	0.32
	Q**	1.17	1.17
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	0.75	0.75
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	I	0.75	0.75
	Q(英ポンド)**	0.82	0.82
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	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	0.65	0.65
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	2.06	2.40
	I	1.07	1.40
	Q**	1.17	1.17
グローバル・エクイティ・ファンド	A	1.75	2.00
	I	0.84	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	0.82	0.85
	I(英ポンド)	0.85	0.85
	S	0.06	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	1.88	2.00
	I	0.82	1.07
	Q(ユーロ)**	0.89	0.92
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77
	I	0.85	0.85
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	2.50	2.50
	I	1.30	1.30
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	A	1.66	1.85
	Q**	0.82	0.82
USラージキャップ・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	1.60	1.85
	I	0.70	0.93
	Q**	0.80	0.82
USラージキャップ・バリュウ・エクイティ・ファンド	A	1.63	1.85
	I	0.72	0.93
	Q**	0.82	0.82
USモーター・カンパニー・エクイティ・ファンド	A	1.71	1.95
	A(ユーロ)**	1.95	1.95
	I	1.01	1.23
	Q**	1.12	1.12
	Q(英ポンド)**	1.12	1.12

* 総経費率は、2013年6月30日に終了した期間に、各クラスが負担した支払報酬および費用から権利放棄された費用を控除した額の当該クラスの平均純資産に対する比率を表す。

** 当該クラスは2013年6月30日に終了した期間に運用が開始された。総経費率は、年率換算されている。

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」)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。2013年6月30日現在、運用会社またはその関係会社により保有されるファンド(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	96%
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	36%
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	52%
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	99%
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	100%
ヨーロッパ・モーター・カンパニー・エクイティ・ファンド	90%
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・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	89%
グローバル・バリュウ・エクイティ・ファンド	100%
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	3%
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	10%
USラージキャップ・エクイティ・ファンド	96%
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	4%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	69%
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	2%
USラージキャップ・バリュウ・エクイティ・ファンド	1%

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況
純資産額計算書
（平成25年10月末現在）

グローバル資産分散オープン

資産総額	19,705,079,251 円
負債総額	46,159,938 円
純資産総額（ - ）	19,658,919,313 円
発行済数量	24,789,923,140 口
1 単位当り純資産額（ / ）	0.7930 円

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>
（平成25年10月末現在）

日本好配当株マザーファンド

資産総額	32,102,923,769 円
負債総額	58,676,648 円
純資産総額（ - ）	32,044,247,121 円
発行済数量	30,885,457,137 口
1 単位当り純資産額（ / ）	1.0375 円

世界REITマザーファンド

資産総額	3,048,105,233 円
負債総額	0 円
純資産総額（ - ）	3,048,105,233 円
発行済数量	3,716,972,934 口
1 単位当り純資産額（ / ）	0.8201 円

グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	127,384,946,084 円
------	-------------------

負債総額	131,627,224 円
純資産総額（ - ）	127,253,318,860 円
発行済数量	88,507,023,812 口
1 単位当り純資産額（ / ）	1.4378 円

新興国債券マザーファンド

資産総額	13,928,769,875 円
負債総額	152,642,542 円
純資産総額（ - ）	13,776,127,333 円
発行済数量	8,628,548,795 口
1 単位当り純資産額（ / ）	1.5966 円

欧州債券マザーファンド

資産総額	2,013,770,723 円
負債総額	8,404,476 円
純資産総額（ - ）	2,005,366,247 円
発行済数量	1,789,998,049 口
1 単位当り純資産額（ / ）	1.1203 円

アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	1,870,318,540 円
負債総額	0 円
純資産総額（ - ）	1,870,318,540 円
発行済数量	1,485,875,851 口

1 単位当り純資産額 (/)	1.2587 円
------------------	----------

コモディティ・マザーファンド

資産総額	879,746,350 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	879,746,350 円
発行済数量	1,316,440,432 口
1 単位当り純資産額 (/)	0.6683 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25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。

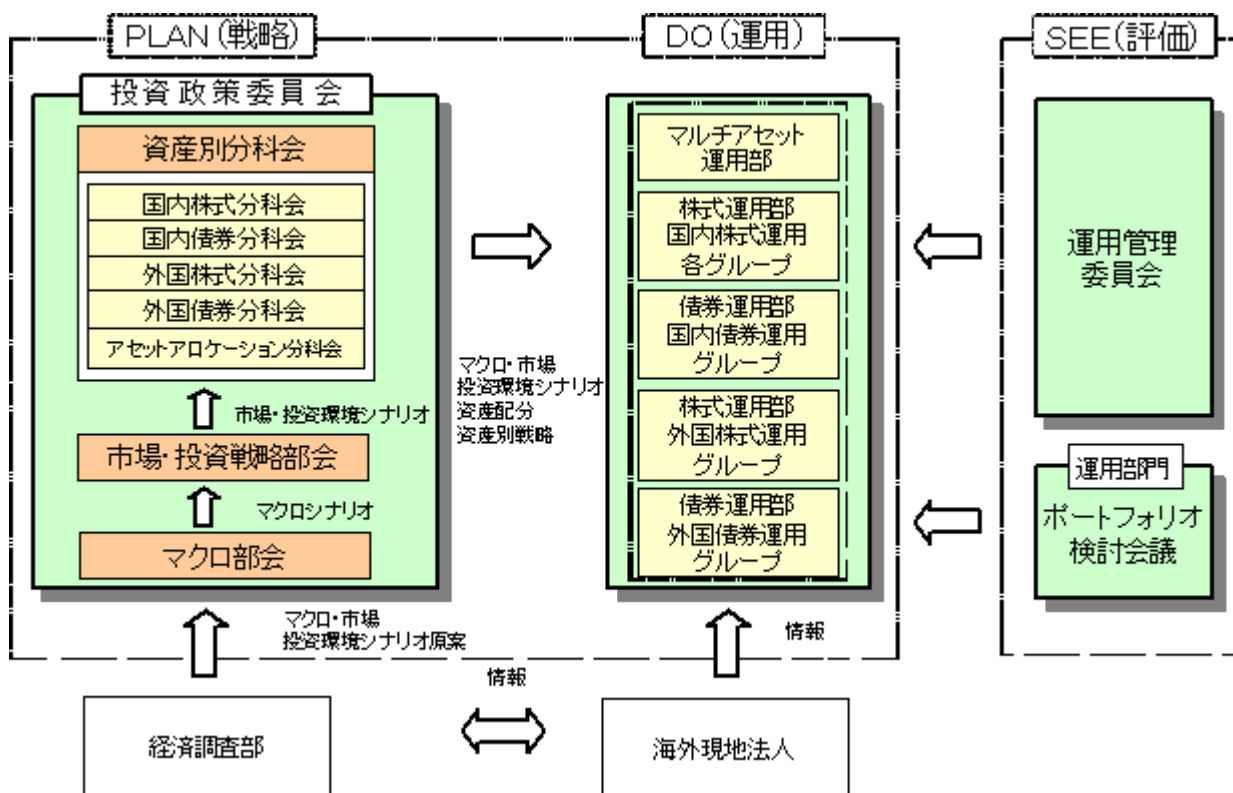
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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25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、179本であり、その純資産総額は、約2,744,234百万円です（なお、親投資信託56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	7	141,564百万円
追加型株式投資信託	171	2,600,136百万円
単位型公社債投資信託	1	2,533百万円
合計	179	2,744,234百万円

[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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）により作成しております。
- 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41期事業年度（平成24年4月1日から平成25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。

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,886,867	17,579,316
前払費用	176,593	156,563
未収委託者報酬	2,348,724	2,378,328
未収運用受託報酬	830,844	799,736
未収収益	24,384	21,990
繰延税金資産	485,508	473,110
その他	5,956	3,144
流動資産計	19,758,878	21,412,190
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 225,511	183,873
器具備品	1 60,686	87,233
土地	710	710
リース資産	1 7,309	8,895
有形固定資産計	294,217	280,711
無形固定資産		
ソフトウェア	389,329	261,979
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	402,036	274,685
投資その他の資産		
投資有価証券	4,950,199	5,125,836
関係会社株式	1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金	2,534	1,904
長期差入保証金	741,014	509,430
出資金	157,660	132,660
繰延税金資産	543,639	548,043
その他	2,403	1,716
貸倒引当金	70,650	70,650
投資その他の資産計	7,496,574	7,418,714
固定資産計	8,192,828	7,974,112
資産合計	27,951,706	29,386,302

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,841	3,396
未払金	222,814	165,892
未払手数料	1,094,446	1,113,859
未払費用	1,010,635	1,127,749
未払法人税等	1,570,446	939,336
賞与引当金	874,000	880,000
役員賞与引当金	79,100	73,000
その他	18,977	20,203
流動負債計	4,873,261	4,323,437
固定負債		
リース債務	4,833	5,944
退職給付引当金	1,139,061	1,268,146
役員退職慰労引当金	144,730	148,470
固定負債計	1,288,624	1,422,561
負債合計	6,161,886	5,745,998

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	18,204,076	19,981,120

利益剰余金合計	19,647,807	21,424,851
株主資本合計	21,804,076	23,581,120
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	14,256	59,183
評価・換算差額等合計	14,256	59,183
純資産合計	21,789,820	23,640,304
負債純資産合計	27,951,706	29,386,302

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第40期		第41期	
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
運用受託報酬		3,091,311		2,960,778
委託者報酬		27,285,403		27,854,931
その他営業収益		131,340		90,710
営業収益計		30,508,054		30,906,420
営業費用				
支払手数料		12,829,874		13,056,993
広告宣伝費		131,967		175,532
公告費		2,247		1,059
調査費				
調査費		1,103,744		1,114,992
委託調査費		3,541,508		4,000,398
委託計算費		122,453		131,444
営業雑経費				
通信費		29,616		31,982
印刷費		350,466		404,102
協会費		23,131		27,397
諸会費		3,166		4,830
その他		29,989		30,634
営業費用計		18,168,165		18,979,368
一般管理費				
給料				
役員報酬		197,010		201,630
給料・手当		2,831,165		2,883,776
賞与		44,371		55,582
退職金		844		4,450
福利厚生費		544,128		559,967
交際費		19,828		22,159
旅費交通費		151,573		146,403
租税公課		74,062		72,111
不動産賃借料		841,453		726,878
退職給付費用		206,629		213,305
固定資産減価償却費		96,356		79,314
賞与引当金繰入額		874,000		873,819

役員退職慰労引当金繰入額	38,080	38,530
役員賞与引当金繰入額	79,100	67,700
諸経費	255,488	255,296
一般管理費計	6,254,092	6,200,926
営業利益	6,085,796	5,726,125
営業外収益		
受取配当金	149,045	25,045
受取利息	3,732	3,232
投資有価証券売却益	-	33,455
為替差益	-	2,945
その他	11,769	11,668
営業外収益計	164,547	76,346
営業外費用		
投資有価証券売却損	4,016	-
為替差損	2,424	-
その他	957	55
営業外費用計	7,398	55
経常利益	6,242,945	5,802,417
特別利益		
投資有価証券売却益	-	42,767
特別利益計	-	42,767
特別損失		
投資有価証券評価損	50,687	-
投資有価証券売却損	1	111,382
その他	5,375	4,583
特別損失計	56,063	115,965
税引前当期純利益	6,186,881	5,729,219
法人税、住民税及び事業税	2,653,180	2,213,779
法人税等調整額	4,043	32,604
法人税等合計	2,657,223	2,181,175
当期純利益	3,529,657	3,548,044

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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	16,098,918	18,204,076
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044

当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	18,204,076	19,981,120
利益剰余金合計		
当期首残高	17,542,649	19,647,807
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044
当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	19,647,807	21,424,851
株主資本合計		
当期首残高	19,698,918	21,804,076
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044
当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	21,804,076	23,581,120
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	35,129	14,256
当期変動額		
株主資本以外の項目	20,873	73,440
の当期変動額(純額)		
当期変動額合計	20,873	73,440
当期末残高	14,256	59,183
評価・換算差額等合計		
当期首残高	35,129	14,256
当期変動額		
株主資本以外の項目	20,873	73,440
の当期変動額(純額)		
当期変動額合計	20,873	73,440
当期末残高	14,256	59,183
純資産合計		
当期首残高	19,663,789	21,789,820
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	20,873	73,440
当期変動額合計	2,126,030	1,850,484
当期末残高	21,789,820	23,640,304

[前へ](#) [次へ](#)

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(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</p> <p>(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。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>(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。</p>

会計方針の変更等

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益がそれぞれ2,523千円増加しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第40期 （平成24年3月31日）		第41期 （平成25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	315,276千円	建物	354,743千円
器具備品	273,481千円	器具備品	307,425千円
リース資産	3,712千円	リース資産	7,382千円
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	19,359千円	金額	15,346千円

（損益計算書関係）

関係会社に対するものは、次のとおりであります。

	第40期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第41期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
1.投資有価証券売却損	- 千円	111,382千円

（株主資本等変動計算書関係）

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.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

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

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25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. 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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	1,771,000	460	平成24年3月31日	平成24年6月29日

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

平成25年6月24日開催の第41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25年6月24日 定時株主総会	普通 株式	3,545,850	利益 剰余金	921	平成25年3月31日	平成25年6月25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

(単位：千円)

	第41期(平成25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	4,823	-
合計	4,823	4,823	-

(2) 未経過リース料期末残高相当額

(単位：千円)

	第40期(平成24年3月31日)	第41期(平成25年3月31日)
1年内	961	-
1年超	-	-
合計	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40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
支払リース料	1,070	981
減価償却費相当額	964	884
支払利息相当額	62	20

(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、そのほとんどが信託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）金融商品に該当するものを表示しております。

第41期（平成25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	17,579,316	17,579,316	-
(2) 未収委託者報酬	2,378,328	2,378,328	-
(3) 未収運用受託報酬	799,736	799,736	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,074,700	5,074,700	-
資産計	25,832,081	25,832,081	-
(1) 未払手数料	1,113,859	1,113,859	-
(2) 未払費用（*1）	853,268	853,268	-
負債計	1,967,127	1,967,127	-

（*1）金融商品に該当す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」をご参照下さい。

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40期（平成24年3月31日）	第41期（平成25年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	238,335	51,135
(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	741,014	509,430

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	-

第41期（平成25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	17,579,316	-	-	-
未収委託者報酬	2,378,328	-	-	-
未収運用受託報酬	799,736	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券	-	1,106,722	4,006	-
合計	20,757,380	1,106,722	4,006	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

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。

第41期（平成25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「その他有価証券」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。

第41期(平成25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	3,683,580	3,582,800	100,780
小計	3,683,580	3,582,800	100,780
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	1,391,120	1,400,000	8,880
小計	1,391,120	1,400,000	8,880
合計	5,074,700	4,982,800	91,900

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 51,135千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第40期(自平成23年4月1日 至平成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

第41期(自平成24年4月1日 至平成25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	953,041	76,223	111,382

(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40期(平成24年3月31日)	第41期(平成25年3月31日)
退職給付引当金	1,139,061	1,268,146

(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40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
勤務費用	151,221	156,423
確定拠出年金掛金	55,408	56,882
合計	206,629	213,305

(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の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
(1) 流動資産		
未払事業税	111,121	78,096
賞与引当金	332,120	334,400
社会保険料	29,079	33,579
未払事業所税	5,098	5,144
その他	8,088	21,890
繰延税金資産合計	485,508	473,110
(2) 固定資産		
退職給付引当金	408,872	454,741
投資有価証券	53,733	2,469
ゴルフ会員権	32,333	32,333
役員退職慰労引当金	54,186	55,431
その他有価証券評価差額金	7,880	-
その他	72,699	70,587
繰延税金資産小計	629,709	615,562
評価性引当額	86,067	34,803
繰延税金資産合計	543,639	580,759
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	32,716
繰延税金負債合計	-	32,716
繰延税金資産の純額	1,029,147	1,021,153

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40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25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41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。

(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
外部顧客からの営業収益	27,285,403	3,091,311	131,340	30,508,054

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25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
外部顧客からの営業収益	27,854,931	2,960,778	90,710	30,906,420

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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	関連当事者 との関係		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。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第41期（自平成24年4月1日 至平成25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	関連当事者 との関係		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	5,028,224	未払 手数料	536,727
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	2,621,684	未払 手数料	250,310

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。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	5,659円69銭	6,140円34銭
1株当たり当期純利益金額	916円79銭	921円57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株当たりの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40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益(千円)	3,529,657	3,548,044
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)	3,529,657	3,548,044
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25年3月末現在	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25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25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25年11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、「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前記25年3月28日から前記25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前記25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25年6月14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24年4月1日から平成25年3月31日までの第41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25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。