

【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26年12月26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26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

(以下略)

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

(以下略)

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。

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

(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26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26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26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)

2. 欧州債券マザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマーク	シティグループ欧州国債インデックス(円換算)
--------	------------------------

(以下略)

投資態度	シティグループ欧州国債インデックス(円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 (以下略)
------	---

(以下略)

ベンチマークについて	シティグループ欧州国債インデックスとは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。シティグループ欧州国債インデックス(円換算)とは、シティグループ欧州国債インデックスを委託会社が円換算したものです。
------------	--

(以下略)

4. 新興国債券マザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドとは、J Pモルガン社が公表する債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はJ Pモルガン社に帰属します。J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円換算)とはJ Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドを委託会社が円換算したものです。
------------	---

(以下略)

5. T.Rowe Price Funds SICAV – Global High Yield Bond Fund

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	J Pモルガン・グローバル・ハイ・イールド・ボンド・インデックスとは、J Pモルガン社が公表する債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はJ Pモルガン社に帰属します。
------------	---

(以下略)

10. コモディティ・マザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

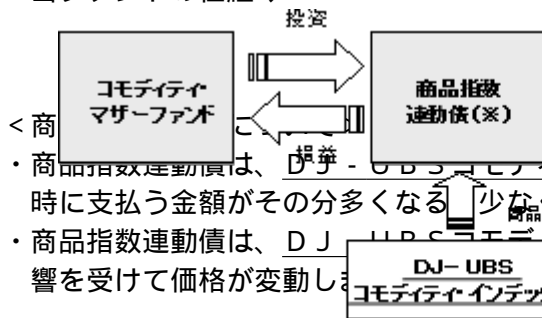
(以下略)

運用基本方針	ダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス(以下「DJ-UBSコモディティ・インデックス」)の騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券へ投資することにより、DJ-UBSコモディティ・インデックスが表す世界の商品市況について、その中長期的な動きを概ね捉えることを目標として運用します。 ダウジョーンズUBSコモディティ・インデックス(DJ-UBSコモディティ・インデックス)は、平成26年7月1日付でBloomberg Commodity Indexに名称変更される予定です。以下同じです。
主要投資対象	DJ-UBSコモディティ・インデックスの騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>DJ-UBSコモディティ・インデックスの騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券へ投資することにより、DJ-UBSコモディティ・インデックスが表す世界の商品市況について、その中長期的な動きを概ね捉えることを目標として運用します。</p> <p style="text-align: center;">（以下略）</p>
------	---

（以下略）

<当ファンドの仕組み>



<商

・商品指数連動債は、DJ-UBSコモディティ・インデックスが上昇（下落）した場合、発行体が償還時に支払う金額がその分多くなる（少なく）外貨建て証券です。

・商品指数連動債は、DJ-UBSコモディティ・インデックスのほか、発行体の信用度、金利などの影響を受けて価格が変動します。

< DJ-UBSコモディティインデックスは、商品先物指数的騰落率に連動する外貨建ての証券のことを指します。

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ます。さらに、UBS AG、UBS Securities、CME Group Inc.、それぞれ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

(以下略)

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成26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26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)

2. 欧州債券マザーファンド

<指定投資信託証券の概要>

(以下略)

ベンチマーク	シティ欧州世界国債インデックス(円換算)
投資態度	シティ欧州世界国債インデックス(円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

(以下略)

ベンチマークについて	シティ欧州世界国債インデックスは、Citigroup Index LLC により開発、算出および公表されている債券インデックスです。シティ欧州世界国債インデックス(円換算)とは、シティ欧州世界国債インデックスを委託会社が円換算したものです。
------------	--

(以下略)

4. 新興国債券マザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドとは、J.P. Morgan Securities LLCが公表する債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円換算)とはJ P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドを委託会社が円換算したものです。
------------	--

(以下略)

5. T.Rowe Price Funds SICAV – Global High Yield Bond Fund

< 指定投資信託証券の概要 >

(以下略)

ベンチマークについて	J P モルガン・グローバル・ハイ・イールド・ボンド・インデックスとは、J.P. Morgan Securities LLCが公表する債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。
------------	--

(以下略)

10. コモディティ・マザーファンド

< 指定投資信託証券の概要 >

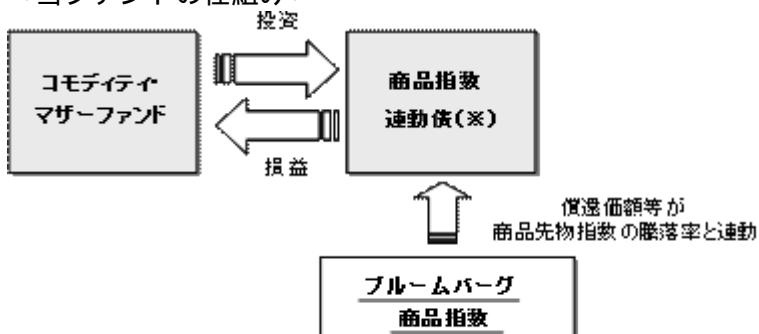
(以下略)

運用基本方針	ブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券へ投資することにより、ブルームバーグ商品指数が表す世界の商品市況について、その中長期的な動きを概ね捉えることを目標として運用します。
主要投資対象	ブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券を主要投資対象とします。
投資態度	ブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券へ投資することにより、ブルームバーグ商品指数が表す世界の商品市況について、その中長期的な動きを概ね捉えることを目標として運用します。

(以下略)

(以下略)

< 当ファンドの仕組み >



(※)ブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価額等が連動する外貨建ての証券のことを指します。

< 商品指数連動債について >

- ・商品指数連動債は、ブルームバーグ商品指数が上昇（下落）した場合、発行体が償還時に支払う金額がその分多くなる（少なくなる）仕組みの外貨建て証券です。
- ・商品指数連動債は、ブルームバーグ商品指数のほか、発行体の信用度、金利などの影響を受けて価格が変動します。

< ブルームバーグ商品指数について >

ブルームバーグ商品指数および「ブルームバーグ（Bloomberg(R))」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）の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での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBSセキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、大和住銀投信投資顧問株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは奨励するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれもブルームバーグ商品指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

（3）運用体制

（以下略）

* 当ファンドの運用体制に係る運用部門の人員数は、平成26年10月末現在で約100名です。

（以下略）

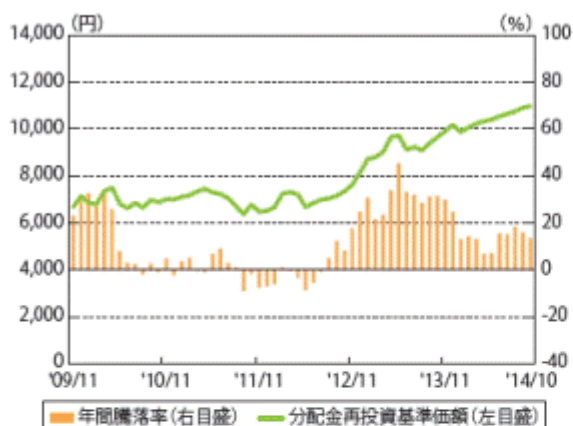
3 投資リスク

原届出書の「3 投資リスク」の末尾に、下記事項が追加されます。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

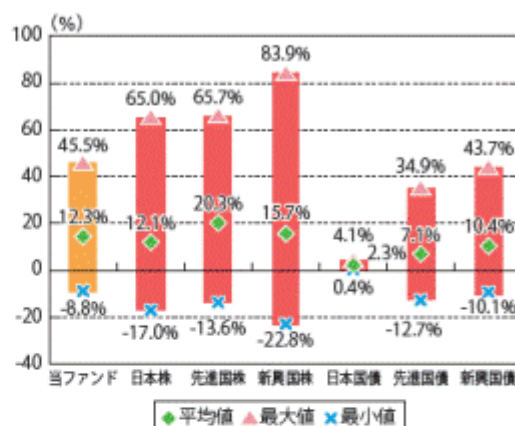
(2009年11月～2014年10月)



※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。
 ※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2009年11月～2014年10月)



※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 ※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX (配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社
先進国債	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	Citigroup Index LLC
新興国債	JP モルガン GBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注) 上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

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

(以下略)

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

(以下略)

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おりません。

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)

<訂正後>

(1) 申込手数料

(以下略)

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。

申込手数料は、販売会社による商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに販売の事務等の対価です。

(2) 換金（解約）手数料

(以下略)

(3) 信託報酬等

(以下略)

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おりません。

上記の委託会社、販売会社および受託会社間の信託報酬の配分はそれぞれ「ファンドの運用等の対価」、「購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価」および「運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価」です。

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)

[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。

グローバル資産分散オープン

(1)投資状況

（平成26年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （世界REITマザーファンド）	日本	2,623,284,059	15.14%
親投資信託受益証券 （グローバル好配当株マザーファンド）	日本	2,472,003,842	14.27%
親投資信託受益証券 （新興国債券マザーファンド）	日本	1,779,671,991	10.27%
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	1,752,770,776	10.11%
親投資信託受益証券 （欧州債券マザーファンド）	日本	1,732,174,724	10.00%
親投資信託受益証券 （日本好配当株マザーファンド）	日本	1,717,515,410	9.91%
親投資信託受益証券 （コモディティ・マザーファンド）	日本	802,366,080	4.63%
投資証券	ルクセンブルグ	4,285,701,217	24.73%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		163,438,532	0.94%
純資産総額		17,328,926,631	100.00%

（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26年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	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 -	2,637,791,915	0.9553 2,520,146,395	0.9945 2,623,284,059	- -	15.14%
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 -	1,505,575,152	1.6745 2,521,236,149	1.6419 2,472,003,842	- -	14.27%
3	新興国債券マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	933,524,964	1.8865 1,761,188,197	1.9064 1,779,671,991	- -	10.27%
4	T.Rowe Price Funds SICAV- U.S. Aggregate Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,472,536	1,185 1,745,349,206	1,191 1,754,977,870	- -	10.13%
5	アジア・オセアニア債券マザー ファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,262,166,614	1.3767 1,737,750,994	1.3887 1,752,770,776	- -	10.11%
6	欧州債券マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,361,772,582	1.2754 1,736,940,928	1.2720 1,732,174,724	- -	10.00%
7	日本好配当株マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,424,378,347	1.2077 1,720,364,167	1.2058 1,717,515,410	- -	9.91%
8	T.Rowe Price Funds SICAV- Global High Yield Bond Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,459,734	1,122 1,639,147,649	1,121 1,637,571,326	- -	9.45%
9	T.Rowe Price Funds SICAV- Global Emerging Markets Equity Fund ルクセンブルグ	投資証券 -	1,081,930	821 888,420,088	825 893,152,020	- -	5.15%
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 -	1,157,481,362	0.7034 814,288,138	0.6932 802,366,080	- -	4.63%

（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

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	74.33%
投資証券	24.73%
合計	99.06%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成26年10月末現在）

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26年10月末現在）

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

	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
第12特定期間末 （平成25年3月27日）	20,561	20,815	0.7552	0.7642
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10月末日	19,658	-	0.7930	-
平成25年11月末日	19,808	-	0.8096	-
平成25年12月末日	19,726	-	0.8325	-
平成26年1月末日	18,602	-	0.8042	-
平成26年2月末日	18,837	-	0.8197	-
第14特定期間末 （平成26年3月27日）	18,487	18,698	0.8172	0.8262
平成26年3月末日	18,757	-	0.8296	-
平成26年4月末日	18,679	-	0.8385	-
平成26年5月末日	18,505	-	0.8418	-
平成26年6月末日	18,334	-	0.8522	-
平成26年7月末日	17,966	-	0.8586	-
平成26年8月末日	17,783	-	0.8669	-
第15特定期間末 （平成26年9月29日）	17,485	17,674	0.8784	0.8874
平成26年9月末日	17,425	-	0.8756	-
平成26年10月末日	17,328	-	0.8821	-

（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

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

第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	0.0090
第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	0.0090
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	0.0090
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	0.0090
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	0.0090
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	0.0090
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
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	0.0090
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	0.0090

収益率の推移

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%
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	5.6%
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	8.6%

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

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1特定期間（平成19年5月22日～平成19年9月27日）	143,915,193,041	3,444,616,817
第2特定期間（平成19年9月28日～平成20年3月27日）	9,456,550,153	10,531,107,727
第3特定期間（平成20年3月28日～平成20年9月29日）	1,210,147,834	19,101,436,301
第4特定期間（平成20年9月30日～平成21年3月27日）	1,032,078,680	13,023,015,618
第5特定期間（平成21年3月28日～平成21年9月28日）	723,370,575	19,813,830,702
第6特定期間（平成21年9月29日～平成22年3月29日）	420,700,426	17,593,714,515
第7特定期間（平成22年3月30日～平成22年9月27日）	337,246,711	13,762,458,300
第8特定期間（平成22年9月28日～平成23年3月28日）	273,981,316	11,950,617,466
第9特定期間（平成23年3月29日～平成23年9月27日）	225,487,243	7,789,551,735
第10特定期間（平成23年9月28日～平成24年3月27日）	219,834,307	6,245,534,761
第11特定期間（平成24年3月28日～平成24年9月27日）	180,413,715	4,336,327,069
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
第14特定期間（平成25年9月28日～平成26年3月27日）	148,600,281	2,554,485,378
第15特定期間（平成26年3月28日～平成26年9月29日）	88,632,209	2,802,199,202

（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) マザーファンドの運用状況

日本好配当株マザーファンド

(1) 投資状況

（平成26年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
株式	日本	29,682,727,140	94.73%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,649,864,845	5.27%
純資産総額		31,332,591,985	100.00%

（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。

その他の資産の投資状況

（平成26年10月末現在）

投資資産の種類	国・地域名	買建/ 売建	時価合計（円）	投資比率
株価指数先物	日本	買建	1,203,300,000	3.84%

（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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

（平成26年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	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	296,900	6,252.00 1,856,218,800	6,498.00 1,929,256,200	- -	6.16%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	2,349,700	605.60 1,422,978,320	632.20 1,485,480,340	- -	4.74%
3	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	630,000	1,622.00 1,021,860,000	1,699.00 1,070,370,000	- -	3.42%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	152,700	6,378.00 973,920,600	6,892.00 1,052,408,400	- -	3.36%
5	三井物産 日本	株式 卸売業	563,000	1,646.00 926,698,000	1,665.50 937,676,500	- -	2.99%
6	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	237,600	3,567.50 847,638,000	3,766.00 894,801,600	- -	2.86%
7	HOYA 日本	株式 精密機器	195,200	3,502.50 683,688,000	3,907.50 762,744,000	- -	2.43%
8	マブチモーター 日本	株式 電気機器	72,800	9,380.00 682,864,000	9,480.00 690,144,000	- -	2.20%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	91,900	6,602.64 606,782,640	7,225.00 663,977,500	- -	2.12%
10	大東建託 日本	株式 建設業	47,200	12,660.00 597,552,000	13,825.00 652,540,000	- -	2.08%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	273,000	2,133.00 582,309,000	2,163.50 590,635,500	- -	1.89%
12	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	856,000	606.00 518,736,000	628.40 537,910,400	- -	1.72%
13	アズビル 日本	株式 電気機器	194,900	2,561.00 499,138,900	2,669.00 520,188,100	- -	1.66%
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	371,800	1,270.00 472,186,000	1,336.50 496,910,700	- -	1.59%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	140,600	3,327.50 467,846,500	3,513.00 493,927,800	- -	1.58%
16	JXホールディングス 日本	株式 石油・石炭製品	1,022,900	491.50 502,755,350	475.20 486,082,080	- -	1.55%
17	西日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	91,800	4,930.66 452,635,437	5,295.00 486,081,000	- -	1.55%
18	キヤノン 日本	株式 電気機器	125,700	3,479.50 437,373,150	3,389.00 425,997,300	- -	1.36%
19	三和ホールディングス 日本	株式 金属製品	540,000	761.00 410,940,000	762.00 411,480,000	- -	1.31%
20	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	94,900	4,094.97 388,612,863	4,281.00 406,266,900	- -	1.30%
21	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	217,300	1,742.50 378,645,250	1,862.00 404,612,600	- -	1.29%
22	大和ハウス工業 日本	株式 建設業	194,000	1,932.00 374,808,000	2,083.50 404,199,000	- -	1.29%
23	高砂熱学工業 日本	株式 建設業	267,000	1,350.00 360,450,000	1,424.00 380,208,000	- -	1.21%
24	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	107,500	3,541.00 380,657,500	3,479.00 373,992,500	- -	1.19%
25	アイダエンジニアリング 日本	株式 機械	349,000	1,071.00 373,779,000	1,053.00 367,497,000	- -	1.17%
26	興村組 日本	株式 建設業	581,000	617.00 358,477,000	624.00 362,544,000	- -	1.16%
27	塩野義製薬 日本	株式 医薬品	127,000	2,503.00 317,881,000	2,852.00 362,204,000	- -	1.16%
28	アイシン精機 日本	株式 輸送用機器	91,900	3,810.00 350,139,000	3,650.00 335,435,000	- -	1.07%
29	あおぞら銀行 日本	株式 銀行業	834,000	378.00 315,252,000	391.00 326,094,000	- -	1.04%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	88,000	3,536.50 311,212,000	3,651.50 321,332,000	- -	1.03%

(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

種類別	投資比率
株式	94.73%

合計	94.73%
----	--------

（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

業種別	投資比率
（国内）	
輸送用機器	10.49%
銀行業	10.44%
情報・通信業	9.52%
卸売業	7.36%
医薬品	7.04%
電気機器	6.99%
建設業	6.92%
機械	3.86%
化学	3.53%
小売業	3.43%
食料品	3.09%
保険業	2.97%
精密機器	2.43%
陸運業	2.07%
石油・石炭製品	2.05%
ゴム製品	1.54%
金属製品	1.51%
電気・ガス業	1.40%
証券、商品先物取引業	1.15%
非鉄金属	1.09%
その他金融業	1.01%
サービス業	0.97%
空運業	0.95%
倉庫・運輸関連業	0.68%
その他製品	0.61%
不動産業	0.57%
鉄鋼	0.37%
繊維製品	0.35%
水産・農林業	0.22%
ガラス・土石製品	0.10%
小計	94.73%
合計	94.73%

（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。

投資不動産物件

（平成26年10月末現在）

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26年10月末現在）

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 2612月	買建	90	1,147,050,000	1,203,300,000	3.84%

（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

（1）投資状況

（平成26年10月末現在）

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	624,986,270	23.82%
	オーストラリア	498,073,896	18.99%
	イギリス	460,676,590	17.56%
	日本	333,452,200	12.71%
	フランス	203,370,855	7.75%
	シンガポール	161,221,670	6.15%
	カナダ	125,775,750	4.79%
	オランダ	81,078,222	3.09%
	ベルギー	57,113,478	2.18%
	ドイツ	12,528,544	0.48%
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		65,025,750	2.48%
純資産総額		2,623,303,225	100.00%

（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26年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券 -	7,452	16,417 122,345,152	19,341 144,130,269	- -	5.49%
2	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券 -	16,431	6,350 104,344,526	7,662 125,903,313	- -	4.80%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券 -	16,496	6,246 103,043,817	7,431 122,595,629	- -	4.67%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券 -	4,077	26,113 106,463,108	27,497 112,109,305	- -	4.27%
5	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券 -	327,284	283 92,890,656	336 110,190,075	- -	4.20%
6	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券 -	82,515	1,160 95,777,379	1,253 103,428,021	- -	3.94%
7	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券 -	51,686	1,810 93,584,170	1,906 98,557,242	- -	3.76%
8	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資証券 -	102,992	637 65,622,043	755 77,796,047	- -	2.97%
9	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券 -	69,182	978 67,716,509	1,054 72,918,761	- -	2.78%
10	DERWENT LONDON PLC イギリス	投資証券 -	13,678	4,723 64,606,391	5,132 70,205,612	- -	2.68%
11	SEGro PLC イギリス	投資証券 -	105,198	580 61,062,275	657 69,159,743	- -	2.64%
12	ICADE フランス	投資証券 -	7,520	9,717 73,076,773	8,646 65,025,064	- -	2.48%
13	STOCKLAND オーストラリア	投資証券 -	157,638	355 56,115,076	401 63,262,525	- -	2.41%
14	CAPITAMALL TRUST シンガポール	投資証券 -	352,356	161 57,005,563	167 58,966,071	- -	2.25%
15	GPT GROUP オーストラリア	投資証券 -	148,900	349 51,999,066	389 58,032,107	- -	2.21%
16	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券 -	88	533,000 46,904,000	622,000 54,736,000	- -	2.09%
17	DEXUS PROPERTY GROUP オーストラリア	投資証券 -	462,600	100 46,412,102	116 53,775,561	- -	2.05%
18	CHARTER HALL RETAIL REIT オーストラリア	投資証券 -	133,400	348 46,457,443	386 51,605,082	- -	1.97%
19	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券 -	293	149,800 43,891,400	175,100 51,304,300	- -	1.96%
20	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT カナダ	投資証券 -	14,567	3,280 47,785,120	3,478 50,672,138	- -	1.93%
21	MIRVAC GROUP オーストラリア	投資証券 -	298,500	163 48,665,738	168 50,393,516	- -	1.92%
22	GREAT PORTLAND ESTATES PLC イギリス	投資証券 -	39,300	1,110 43,657,151	1,180 46,407,208	- -	1.77%
23	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT シンガポール	投資証券 -	218,205	189 41,269,739	192 42,026,283	- -	1.60%
24	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D アメリカ	投資証券 -	13,825	2,811 38,863,891	2,776 38,380,171	- -	1.46%
25	日本アコモデーションファンド 投資法人 日本	投資証券 -	94	351,000 32,994,000	405,500 38,117,000	- -	1.45%
26	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR カナダ	投資証券 -	14,663	2,557 37,506,575	2,576 37,778,569	- -	1.44%
27	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券 -	3,133	10,572 33,122,341	11,764 36,859,694	- -	1.41%
28	ジャパンリアルエステイト投資 法人 日本	投資証券 -	60	513,000 30,780,000	608,000 36,480,000	- -	1.39%
29	ケネディクス・オフィス投資法 人 日本	投資証券 -	60	532,000 31,920,000	592,000 35,520,000	- -	1.35%
30	EUROCOMMERCIAL オランダ	投資証券 -	6,955	4,341 30,194,359	4,992 34,722,795	- -	1.32%

(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

種類別	投資比率
投資証券	97.52%
合計	97.52%

（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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成26年10月末現在）

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26年10月末現在）

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

(1) 投資状況

（平成26年10月末現在）

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	28,479,711,665	26.28%
	オーストラリア	11,662,638,681	10.76%
	香港	9,544,340,196	8.81%
	台湾	9,382,642,767	8.66%
	イギリス	6,080,368,692	5.61%
	フランス	5,248,254,313	4.84%
	スウェーデン	4,402,299,078	4.06%
	カナダ	4,370,396,601	4.03%
	イタリア	3,948,585,966	3.64%
	ドイツ	3,947,678,690	3.64%
	スイス	3,578,574,276	3.30%
	シンガポール	3,549,207,120	3.27%
	ノルウェー	3,207,458,580	2.96%
	スペイン	1,995,956,093	1.84%
	フィンランド	1,133,300,547	1.05%
	韓国	1,072,497,360	0.99%
オランダ	979,181,686	0.90%	
ケイマン諸島	930,529,500	0.86%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,876,922,509	4.50%
純資産総額		108,390,544,320	100.00%

（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26年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	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	SINGAPORE EXCHANGE LTD シンガポール	株式 各種金融	2,350,000	617 1,450,927,582	596 1,402,085,200	- -	1.29%
2	VERIZON COMM アメリカ	株式 電気通信サービス	237,086	5,439 1,289,668,416	5,456 1,293,556,863	- -	1.19%
3	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	198,100	5,646 1,118,487,864	6,448 1,277,521,780	- -	1.18%
4	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	38,400	30,614 1,175,584,204	32,409 1,244,529,561	- -	1.15%
5	KLA-TENCOR CORPORATION アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	148,300	8,094 1,200,486,557	8,349 1,238,186,715	- -	1.14%
6	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	株式	3,096,800	397	398	-	1.14%

	イギリス	保険		1,231,407,278	1,233,574,295	-	
7	WELLS FARGO & COMPANY アメリカ	株式 銀行	214,800	5,740	5,735	-	1.14%
				1,233,027,180	1,232,087,730	-	
8	DNB ASA ノルウェー	株式 銀行	609,500	1,913	2,013	-	1.13%
				1,166,351,390	1,226,953,975	-	
9	BLACKROCK INC アメリカ	株式 各種金融	33,600	35,117	36,435	-	1.13%
				1,179,958,792	1,224,228,371	-	
10	NOVARTIS AG-REG スイス	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	121,300	9,177	10,029	-	1.12%
				1,113,272,746	1,216,562,823	-	
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	162,500	6,845	7,303	-	1.10%
				1,112,438,827	1,186,885,700	-	
12	SONIC HEALTHCARE LTD オーストラリア	株式 ヘルスケア機器 ・サービス	663,200	1,669	1,789	-	1.09%
				1,107,474,828	1,186,808,669	-	
13	ELECTROLUX AB スウェーデン	株式 耐久消費財・ア パレル	386,600	2,853	3,049	-	1.09%
				1,102,995,426	1,178,925,875	-	
14	QUANTA COMPUTER INC 台湾	株式 テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	4,300,000	309	273	-	1.09%
				1,332,828,000	1,176,480,000	-	
15	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	100,500	10,493	11,697	-	1.08%
				1,054,582,659	1,175,567,916	-	
16	AU OPTRONICS CORP 台湾	株式 テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	23,400,000	48	50	-	1.08%
				1,123,244,060	1,175,148,000	-	
17	KIMBERLY CLARK CORP アメリカ	株式 家庭用品・パー ソナル用品	94,400	11,769	12,423	-	1.08%
				1,111,034,582	1,172,751,099	-	
18	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	359,200	3,285	3,262	-	1.08%
				1,180,070,196	1,171,963,851	-	
19	HASBRO INC アメリカ	株式 耐久消費財・ア パレル	185,100	6,045	6,252	-	1.07%
				1,119,037,513	1,157,256,528	-	
20	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	171,900	5,752	6,689	-	1.06%
				988,797,501	1,149,911,504	-	
21	AMP LTD オーストラリア	株式 保険	2,073,100	499	553	-	1.06%
				1,035,565,433	1,147,953,833	-	
22	ROYAL BANK OF CANADA カナダ	株式 銀行	147,300	7,761	7,732	-	1.05%
				1,143,271,403	1,138,967,200	-	
23	SAMPO OYJ-A SHS フィンランド	株式 保険	217,400	5,196	5,212	-	1.05%
				1,129,705,621	1,133,300,547	-	
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体 製造装置	318,100	3,392	3,562	-	1.05%
				1,079,256,105	1,133,166,739	-	
25	TORONTO-DOMINION BANK カナダ	株式 銀行	211,700	5,374	5,345	-	1.04%
				1,137,788,318	1,131,587,837	-	
26	NEWELL RUBBERMAID INC アメリカ	株式 耐久消費財・ア パレル	295,000	3,480	3,821	-	1.04%
				1,026,873,279	1,127,322,735	-	
27	CONAGRA FOODS INC アメリカ	株式 食品・飲料・タバ コ	303,500	3,619	3,709	-	1.04%
				1,098,605,710	1,125,956,531	-	
28	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS スウェーデン	株式 銀行	215,100	4,846	5,220	-	1.04%
				1,042,524,094	1,122,915,353	-	
29	NESTLE SA (REGD) スイス	株式 食品・飲料・タバ コ	140,700	7,932	7,942	-	1.03%
				1,116,106,763	1,117,481,891	-	

30	AVIVA PLC イギリス	株式 保険	1,231,600	907 1,118,217,179	906 1,116,062,618	- -	1.03%
----	-------------------	----------	-----------	----------------------	----------------------	--------	-------

(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

種類別	投資比率
株式	95.50%
合計	95.50%

(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。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
(海外)	
銀行	14.81%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.50%
素材	7.62%
公益事業	6.47%
電気通信サービス	6.32%
保険	6.20%
エネルギー	5.07%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.99%
食品・飲料・タバコ	4.82%
各種金融	4.21%
耐久消費財・アパレル	4.21%
半導体・半導体製造装置	4.04%
不動産	3.60%
資本財	2.90%
ソフトウェア・サービス	2.00%
食品・生活必需品小売り	1.97%
消費者サービス	1.83%
自動車・自動車部品	1.77%
ヘルスケア機器・サービス	1.09%
家庭用品・パーソナル用品	1.08%
小売	0.99%
小計	95.50%
合計	95.50%

(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。

投資不動産物件

(平成26年10月末現在)

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26年10月末現在)

該当事項はありません。

新興国債券マザーファンド

(1) 投資状況

(平成26年10月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
---------	-------	---------	------

国債証券	メキシコ	558,430,939	5.24%
	セルビア	520,959,067	4.89%
	コロンビア	462,070,840	4.34%
	インドネシア	429,304,375	4.03%
	ブラジル	414,367,711	3.89%
	ウクライナ	412,553,296	3.87%
	トルコ	369,632,207	3.47%
	ロシア	311,731,680	2.93%
	南アフリカ	286,336,311	2.69%
	ハンガリー	240,788,165	2.26%
	アルゼンチン	232,061,395	2.18%
	バミューダ	206,239,841	1.94%
	フィリピン	200,748,240	1.88%
	ジャマイカ	186,835,442	1.75%
	スリランカ	185,216,493	1.74%
	ペルー	169,196,214	1.59%
	ルーマニア	167,571,575	1.57%
	クロアチア	151,651,518	1.42%
	モロッコ	130,697,108	1.23%
	アイスランド	103,447,339	0.97%
	コートジボアール	96,760,214	0.91%
	マレーシア	90,902,542	0.85%
	スロヴェニア	90,243,276	0.85%
	アルメニア	80,177,381	0.75%
	バハマ	69,933,864	0.66%
	ガボン	58,155,212	0.55%
	ザンビア	55,107,360	0.52%
	イラク	54,567,832	0.51%
	ギリシャ	51,617,950	0.48%
	ガーナ	44,020,284	0.41%
	モンゴル	42,549,661	0.40%
ドミニカ共和国	25,038,860	0.24%	
パラグアイ	23,562,770	0.22%	
パキスタン	22,688,050	0.21%	
バーレーン	22,600,578	0.21%	
バルバドス	17,756,816	0.17%	
エルサルバドル	12,948,808	0.12%	
特殊債券	メキシコ	127,012,672	1.19%
	南アフリカ	91,223,455	0.86%
	レバノン	37,302,500	0.35%
社債券	ヴェネズエラ	480,202,582	4.51%
	カザフスタン	433,191,412	4.07%
	トルコ	322,450,603	3.03%
	ケイマン諸島	308,243,111	2.89%
	ルクセンブルグ	228,683,625	2.15%
	チリ	206,756,801	1.94%
	インド	193,341,275	1.81%
	オランダ	170,824,064	1.60%
	ブラジル	149,005,271	1.40%
	イスラエル	110,964,109	1.04%
	アイルランド	69,324,293	0.65%
	イギリス	67,779,866	0.64%
	アメリカ	67,700,594	0.64%
	メキシコ	55,230,367	0.52%
	アラブ首長国連邦	47,194,424	0.44%
	シンガポール	44,282,700	0.42%
	香港	43,954,680	0.41%
	イギリス領バージン諸島	35,400,246	0.33%
	フィリピン	28,537,740	0.27%
	グルジア	23,344,090	0.22%
	バミューダ	22,525,133	0.21%
	ロシア	19,626,530	0.18%
	アルゼンチン	12,382,809	0.12%
ペルー	6,675,207	0.06%	
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		651,132,009	6.11%
純資産総額		10,652,763,382	100.00%

(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26年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	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	UKRAINE GOVERNMENT ウクライナ	国債証券 -	3,710,000	9,184.56 340,747,176	9,665.10 358,575,555	6.5800 2016/11/21	3.37%
2	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	2,750,000	12,164.07 334,512,062	12,874.78 354,056,587	6.6250 2037/02/17	3.32%
3	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	4,540,000	8,892.06 403,699,681	7,292.97 331,101,201	5.2500 2017/04/12	3.11%
4	RUSSIAN FEDERATION ロシア	国債証券 -	2,508,650	12,226.91 306,730,487	12,426.27 311,731,680	7.5000 2030/03/31	2.93%
5	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	33,354,000	873.70 291,415,607	913.57 304,713,555	7.7500 2042/11/13	2.86%
6	REPUBLIC OF SERBIA セルビア	国債証券 -	1,900,000	12,312.23 233,932,383	12,516.69 237,817,233	7.2500 2021/09/28	2.23%
7	KAZMUNAIGAZ NATIONAL カザフスタン	社債券 -	1,900,000	12,419.93 235,978,681	12,350.49 234,659,494	7.0000 2020/05/05	2.20%
8	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	2,200,000	10,065.26 221,435,914	10,141.28 223,108,270	2.6250 2023/01/05	2.09%
9	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,600,000	12,779.11 204,465,800	13,120.80 209,932,800	6.1250 2041/01/18	1.97%
10	GOVT OF BERMUDA バミューダ	国債証券 -	1,805,000	11,375.30 205,324,179	11,426.03 206,239,841	4.8540 2024/02/06	1.94%
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券 -	1,798,000	11,139.01 200,279,444	11,426.03 205,440,019	4.6650 2024/01/17	1.93%
12	REPUBLIC OF PHILIPPINES フィリピン	国債証券 -	1,700,000	11,589.23 197,017,012	11,808.72 200,748,240	4.2000 2024/01/21	1.88%
13	TURKEY REP OF トルコ	国債証券 -	1,325,000	14,335.56 189,946,268	14,720.99 195,053,129	8.0000 2034/02/14	1.83%
14	CODELCO INC チリ	社債券 -	1,750,000	10,464.16 183,122,905	10,545.40 184,544,598	3.0000 2022/07/17	1.73%
15	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券 -	1,340,000	12,184.84 163,276,984	12,626.58 169,196,214	5.6250 2050/11/18	1.59%
16	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券 -	1,559,000	10,714.44 167,038,201	10,742.65 167,477,991	5.0000 2045/01/27	1.57%
17	JAMAICA GOVERNMENT BOND ジャマイカ	国債証券 -	1,428,570	10,753.15 153,616,392	11,425.26 163,218,002	8.5000 2021/11/16	1.53%
18	EXPORT-IMPORT BK INDIA インド	社債券 -	1,450,000	10,520.66 152,549,582	10,992.49 159,391,205	4.0000 2023/01/14	1.50%
19	REPUBLIC OF ARGENTINA アルゼンチン	国債証券 -	1,615,000	9,878.57 159,539,052	9,504.81 153,502,792	7.0000 2017/04/17	1.44%
20	ROMANIA ルーマニア	国債証券 -	1,236,000	11,166.34 138,016,055	11,433.13 141,313,574	4.3750 2023/08/22	1.33%
21	REPUBLIC OF SRI LANKA スリランカ	国債証券 -	1,200,000	11,043.34 132,520,080	11,535.37 138,424,440	5.8750 2022/07/25	1.30%
22	PETROLEOS DE VENEZUELA S ヴェネズエラ	社債券 -	1,610,000	9,949.94 160,194,034	8,429.02 135,707,231	8.5000 2017/11/02	1.27%
23	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,200,000	11,223.75 134,685,012	11,234.68 134,816,220	4.0000 2024/02/26	1.27%
24	KINGDOM OF MOROCCO モロッコ	国債証券 -	1,175,000	10,655.72 125,204,823	11,123.15 130,697,108	4.2500 2022/12/11	1.23%
25	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	11,046,000	1,079.84 119,279,391	1,121.21 123,849,055	10.0000 2036/11/20	1.16%
26	REPUBLIC OF TURKEY トルコ	国債証券 -	1,000,000	11,863.39 118,633,900	11,996.12 119,961,287	5.6250 2021/03/30	1.13%
27	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券 -	1,000,000	11,631.04 116,310,425	11,732.18 117,321,820	4.3750 2021/07/12	1.10%
28	HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	970,000	11,781.38 114,279,434	12,041.06 116,798,354	5.7500 2023/11/22	1.10%
29	HUNGARY ハンガリー	国債証券 -	940,000	11,542.03 108,495,129	11,684.07 109,830,280	5.3750 2024/03/25	1.03%
30	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO カザフスタン	社債券 -	1,000,000	10,701.65 107,016,525	10,715.32 107,153,200	4.4000 2023/04/30	1.01%

(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

種類別	投資比率
国債証券	61.94%
社債券	29.55%

特殊債券	2.40%
合計	93.89%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成26年10月末現在）

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26年10月末現在）

該当事項はありません。

欧州債券マザーファンド

（1）投資状況

（平成26年10月末現在）

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	357,390,046	20.63%
	イギリス	280,657,956	16.20%
	フランス	232,896,128	13.45%
	スロヴェニア	64,276,982	3.71%
	ポーランド	47,833,302	2.76%
	ベルギー	45,559,522	2.63%
	オランダ	41,964,950	2.42%
	インドネシア	34,898,938	2.01%
	アイスランド	33,816,120	1.95%
	ルーマニア	33,080,991	1.91%
	ドイツ	31,848,327	1.84%
	スペイン	26,735,735	1.54%
	オーストリア	26,257,792	1.52%
	ロシア	25,727,946	1.49%
	チェコ	23,422,885	1.35%
	メキシコ	15,248,259	0.88%
	イスラエル	15,158,000	0.88%
	ラトヴィア	15,037,425	0.87%
	ブラジル	14,315,353	0.83%
	モンテネグロ	14,262,300	0.82%
リトアニア	10,053,535	0.58%	
ノルウェー	9,484,081	0.55%	
社債券	イタリア	77,872,476	4.50%
	フランス	49,749,280	2.87%
	オーストリア	43,274,712	2.50%
	オランダ	35,388,925	2.04%
	ルクセンブルグ	29,013,790	1.68%
	韓国	22,958,582	1.33%
	イギリス	8,509,839	0.49%
	アイルランド	8,470,221	0.49%
	ブラジル	7,647,900	0.44%
	ドイツ	5,893,773	0.34%
アメリカ	687,932	0.04%	
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		42,730,513	2.47%
純資産総額		1,732,124,516	100.00%

（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26年10月末現在）

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	656,000	15,713.72 103,082,028	15,514.90 101,777,757	4.5000 2018/08/01	5.88%
2	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	477,000	15,496.98 73,920,632	15,421.19 73,559,114	5.2500 2017/08/01	4.25%
3	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	408,000	16,108.95 65,724,547	16,030.27 65,403,517	4.2500 2018/10/25	3.78%

4	UK GILT イギリス	国債証券 -	250,000	21,596.34 53,990,857	23,219.78 58,049,465	4.7500 2038/12/07	3.35%
5	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	370,000	14,593.57 53,996,213	15,183.07 56,177,394	2.2500 2024/05/25	3.24%
6	POLAND GOVERNMENT BOND ポーランド	国債証券 -	1,387,000	3,395.14 47,090,594	3,448.68 47,833,302	3.2500 2019/07/25	2.76%
7	REPUBLIKA SLOVENIJA スロヴェニア	国債証券 -	280,000	16,222.90 45,424,134	16,618.68 46,532,304	5.1250 2026/03/30	2.69%
8	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	283,000	15,197.55 43,009,072	16,168.07 45,755,649	4.7500 2044/09/01	2.64%
9	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	262,000	16,607.10 43,510,614	16,578.71 43,436,241	3.7500 2021/04/25	2.51%
10	HYPO ALPE-ADRIA INTL AG オーストリア	社債券 -	300,000	14,158.49 42,475,472	14,424.90 43,274,712	2.3750 2022/12/13	2.50%
11	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	202,000	19,165.22 38,713,752	20,774.72 41,964,950	5.5000 2028/01/15	2.42%
12	UK GILT イギリス	国債証券 -	182,000	20,274.71 36,899,989	22,233.12 40,464,286	4.2500 2046/12/07	2.34%
13	UK GILT イギリス	国債証券 -	179,000	19,882.63 35,589,909	21,008.54 37,605,294	4.2500 2027/12/07	2.17%
14	DEXIA CREDIT LOCAL フランス	社債券 -	200,000	17,460.93 34,921,872	17,740.66 35,481,330	1.8750 2017/07/17	2.05%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	221,000	16,203.62 35,810,014	15,986.17 35,329,453	4.5000 2020/02/01	2.04%
16	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券 -	249,000	13,852.33 34,492,304	14,015.63 34,898,938	2.8750 2021/07/08	2.01%
17	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	247,000	13,939.57 34,430,743	13,999.10 34,577,781	1.5000 2016/12/15	2.00%
18	REPUBLIC OF ICELAND アイスランド	国債証券 -	240,000	13,737.55 32,970,138	14,090.05 33,816,120	2.5000 2020/07/15	1.95%
19	ROMANIA ルーマニア	国債証券 -	211,000	15,704.69 33,136,903	15,678.19 33,080,991	4.8750 2019/11/07	1.91%
20	UK GILT イギリス	国債証券 -	177,000	17,350.37 30,710,162	17,688.18 31,308,084	1.7500 2019/07/22	1.81%
21	UK GILT イギリス	国債証券 -	173,000	17,604.56 30,455,892	17,586.71 30,425,022	2.7500 2015/01/22	1.76%
22	BANCA MONTE DEI PASCHI S イタリア	社債券 -	200,000	14,160.60 28,321,207	15,080.14 30,160,286	2.8750 2021/04/16	1.74%
23	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	178,000	15,261.60 27,165,664	16,621.43 29,586,156	3.2500 2045/05/25	1.71%
24	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	180,000	15,083.58 27,150,458	16,152.91 29,075,248	4.5000 2026/03/01	1.68%
25	UK GILT イギリス	国債証券 -	146,000	19,182.17 28,005,969	19,673.75 28,723,678	3.7500 2021/09/07	1.66%
26	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	144,000	17,016.23 24,503,375	18,566.48 26,735,735	5.9000 2026/07/30	1.54%
27	UK GILT イギリス	国債証券 -	147,000	18,566.38 27,292,581	18,139.52 26,665,107	4.7500 2015/09/07	1.54%
28	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券 -	106,000	20,221.41 21,434,699	21,870.65 23,182,890	6.2500 2027/07/15	1.34%
29	EXPORT-IMPORT BK KOREA 韓国	社債券 -	160,000	13,806.87 22,090,993	14,349.11 22,958,582	2.0000 2020/04/30	1.33%
30	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	136,000	13,849.31 18,835,066	14,465.27 19,672,779	1.7500 2024/11/25	1.14%

（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

種類別	投資比率
国債証券	80.82%
社債券	16.71%
合計	97.53%

（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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

（平成26年10月末現在）

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26年10月末現在）

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

(1) 投資状況

(平成26年10月末現在)

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	234,197,353	13.36%
	シンガポール	45,118,476	2.57%
	香港	44,717,868	2.55%
	マレーシア	43,929,393	2.51%
特殊債券	国際機関	1,218,653,725	69.53%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		166,094,690	9.48%
純資産総額		1,752,711,505	100.00%

(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26年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	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 -	6,200,000	9,554.87 592,402,011	9,779.16 606,308,161	3.5000 2018/07/25	34.59%
2	INTER-AMERICAN DEVEL BK 国際機関	特殊債券 -	3,500,000	9,053.14 316,860,194	9,082.70 317,894,539	6.2500 2017/12/15	18.14%
3	EUROPEAN INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	2,300,000	9,350.81 215,068,789	9,374.11 215,604,678	7.5000 2017/12/15	12.30%
4	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	1,100,000,000	11.05 121,581,702	11.50 126,570,460	4.2500 2021/06/10	7.22%
5	KOREA TREASURY BOND 韓国	国債証券 -	1,000,000,000	10.43 104,395,603	10.76 107,626,893	3.2500 2018/09/10	6.14%
6	NORDIC INVESTMENT BANK 国際機関	特殊債券 -	900,000	8,576.10 77,184,970	8,760.70 78,846,346	4.8750 2019/01/22	4.50%
7	SINGAPORE GOVERNMENT シンガポール	国債証券 -	500,000	8,986.45 44,932,296	9,023.69 45,118,476	2.5000 2019/06/01	2.57%
8	HONG KONG GOVERNMENT 香港	国債証券 -	3,000,000	1,461.52 43,845,642	1,490.59 44,717,868	2.4400 2020/12/07	2.55%
9	MALAYSIAN GOVERNMENT マレーシア	国債証券 -	1,300,000	3,392.85 44,107,082	3,379.18 43,929,393	4.2620 2016/09/15	2.51%

(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

種類別	投資比率
特殊債券	69.53%
国債証券	20.99%
合計	90.52%

(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。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成26年10月末現在)

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26年10月末現在)

該当事項はありません。

コモディティ・マザーファンド

(1) 投資状況

(平成26年10月末現在)

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	799,738,345	99.67%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,685,145	0.33%
純資産総額		802,423,490	100.00%

(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26年10月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	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	BCOM/BARCLAYS 10/20/15 イギリス	社債券 -	7,400,000	10,934.50 809,153,175	10,807.27 799,738,345	0.3400 2015/10/20	99.67%

(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

種類別	投資比率
社債券	99.67%
合計	99.67%

(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。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(平成26年10月末現在)

該当事項はありません。

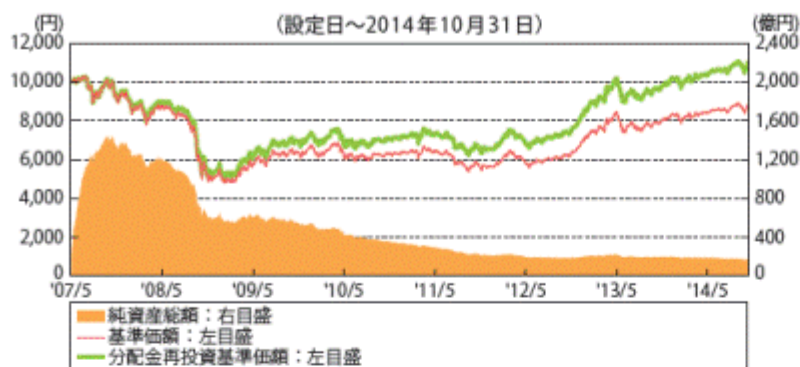
その他投資資産の主要なもの

(平成26年10月末現在)

該当事項はありません。

(参考情報)

基準価額・純資産の推移



*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

分配の推移

2014年9月	30円
2014年7月	30円
2014年5月	30円
2014年3月	30円
2014年1月	30円
直近1年間累計	180円
設定来累計	1,490円

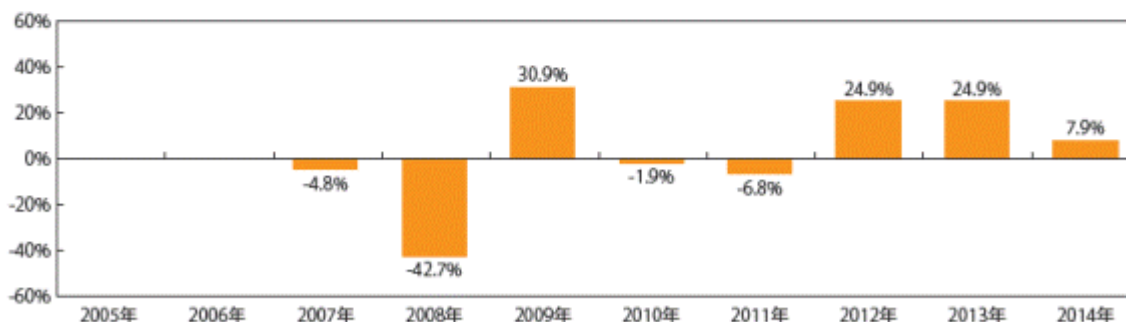
*分配金は1万円当たり、税引前

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	15.1%
グローバル好配当株マザーファンド	14.3%
新興国債券マザーファンド	10.3%
T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	10.1%
アジア・オセアニア債券マザーファンド	10.1%
欧州債券マザーファンド	10.0%
日本好配当株マザーファンド	9.9%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	9.4%
T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	5.2%
コモディティ・マザーファンド	4.6%

*投資比率は全て純資産総額対比

年間収益率の推移



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2007年は当初設定日(2007年5月22日)から年末までの収益率、2014年は10月末までの収益率です。

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

*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。

第2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(5)その他

運用にかかる報告等開示方法

委託会社は、特定期末（毎年3月、9月に属する計算期末）から3ヵ月以内に有価証券報告書を提出します。また、委託会社は特定期末に運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者へ交付します。

委託会社と関係法人との契約の変更

（以下略）

<訂正後>

(5)その他

運用にかかる報告等開示方法

イ．委託会社は、特定期末（毎年3月、9月に属する計算期末）から3ヵ月以内に有価証券報告書を提出します。

ロ．委託会社は、特定期末および償還時に運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）および交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める書面）を作成します。

ハ．委託会社は、交付運用報告書を販売会社を通じて受益者へ交付します。また、委託会社は、運用報告書（全体版）を委託会社のインターネットホームページに掲載します。

<インターネットホームページ><http://www.daiwasbi.co.jp/>

ニ．前ハ．にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

委託会社と関係法人との契約の変更

（以下略）

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26年3月28日から平成26年9月29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26年3月27日現在 金額（円）	当期 平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,684,611	1,808,993
コール・ローン	300,307,868	350,515,870
投資証券	4,615,762,923	4,380,215,635
親投資信託受益証券	13,552,469,184	12,811,914,968
未収入金	150,000,000	140,000,000
流動資産合計	18,620,224,586	17,684,455,466
資産合計	18,620,224,586	17,684,455,466
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	67,863,478	59,722,777
未払解約金	18,969,463	90,601,614
未払受託者報酬	1,269,410	1,322,571
未払委託者報酬	44,429,792	46,290,509
その他未払費用	609,023	620,884
流動負債合計	133,141,166	198,558,355
負債合計	133,141,166	198,558,355
純資産の部		
元本等		
元本	22,621,159,347	19,907,592,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,134,075,927	2,421,695,243
（分配準備積立金）	677,415,389	717,925,424
元本等合計	18,487,083,420	17,485,897,111
純資産合計	18,487,083,420	17,485,897,111
負債純資産合計	18,620,224,586	17,684,455,466

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	前期 自 平成25年9月28日 至 平成26年3月27日 金額（円）	当期 自 平成26年3月28日 至 平成26年9月29日 金額（円）
営業収益		
受取配当金	99,174,386	97,554,577
受取利息	88,257	84,514
有価証券売買等損益	972,795,646	1,237,870,388
為替差損益	141,131,284	316,116,353

営業収益合計	1,213,189,573	1,651,625,832
営業費用		
受託者報酬	4,008,399	4,009,618
委託者報酬	140,295,297	140,338,502
その他費用	793,901	807,499
営業費用合計	145,097,597	145,155,619
営業利益又は営業損失()	1,068,091,976	1,506,470,213
経常利益又は経常損失()	1,068,091,976	1,506,470,213
当期純利益又は当期純損失()	1,068,091,976	1,506,470,213
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()	30,432,666	38,764,757
期首剰余金又は期首欠損金()	5,449,580,078	4,134,075,927
剰余金増加額又は欠損金減少額	518,351,889	447,500,610
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	518,351,889	447,500,610
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,987,142	14,094,668
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,987,142	14,094,668
分配金	211,519,906	188,730,714
期末剰余金又は期末欠損金()	4,134,075,927	2,421,695,243

[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26年 3月28日	至 平成26年 9月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくはは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落日において、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	(1)外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。 (2)当ファンドの特定期間は、当計算期末が休日のため、平成26年 3月28日から平成26年 9月29日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	平成26年 3月27日現在	平成26年 9月29日現在
1. 元本状況		
期首元本額	25,027,044,444円	22,621,159,347円
期中追加設定元本額	148,600,281円	88,632,209円
期中一部解約元本額	2,554,485,378円	2,802,199,202円
2. 受益権の総数	22,621,159,347口	19,907,592,354口
3. 元本の欠損	4,134,075,927円	2,421,695,243円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期																																	
	自 平成25年 9月28日	自 平成26年 3月28日																																
至 平成26年 3月27日	至 平成26年 9月29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	12,773,849円	12,328,985円																																
2. 分配金の計算過程 第39期計算期間末（平成25年11月27日）に、投資信託約款に基づき計算した849,112,298円（1万口当たり346.77円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い173,457,984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42期計算期間末（平成26年 5月27日）に、投資信託約款に基づき計算した867,550,861円（1万口当たり394.34円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い165,999,663円（1万口当たり30円）を分配しております。																																	
<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 (費用控除後)</td> <td>96,258,964円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>93,994,474円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>658,858,860円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>849,112,298円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり分配可能額)</td> <td>(346.77円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>73,457,984円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり収益分配金)</td> <td>(30円)</td> </tr> </table>	配当等収益 (費用控除後)	96,258,964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	93,994,474円	分配準備積立金	658,858,860円	分配可能額	849,112,298円	(1万口当たり分配可能額)	(346.77円)	収益分配金	73,457,984円	(1万口当たり収益分配金)	(30円)	<table border="1"> <tr> <td>配当等収益 (費用控除後)</td> <td>121,267,600円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>88,339,446円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>657,943,815円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>867,550,861円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり分配可能額)</td> <td>(394.34円)</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>65,999,663円</td> </tr> <tr> <td>(1万口当たり収益分配金)</td> <td>(30円)</td> </tr> </table>		配当等収益 (費用控除後)	121,267,600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	88,339,446円	分配準備積立金	657,943,815円	分配可能額	867,550,861円	(1万口当たり分配可能額)	(394.34円)	収益分配金	65,999,663円	(1万口当たり収益分配金)	(30円)
配当等収益 (費用控除後)	96,258,964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	93,994,474円																																	
分配準備積立金	658,858,860円																																	
分配可能額	849,112,298円																																	
(1万口当たり分配可能額)	(346.77円)																																	
収益分配金	73,457,984円																																	
(1万口当たり収益分配金)	(30円)																																	
配当等収益 (費用控除後)	121,267,600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	88,339,446円																																	
分配準備積立金	657,943,815円																																	
分配可能額	867,550,861円																																	
(1万口当たり分配可能額)	(394.34円)																																	
収益分配金	65,999,663円																																	
(1万口当たり収益分配金)	(30円)																																	

第40期計算期間末（平成26年1月27日）に、投資信託約款に基づき計算した811,896,184円（1万口当たり346.97円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い170,198,444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）	70,597,102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	91,857,187円
分配準備積立金	649,441,895円
分配可能額	811,896,184円
（1万口当たり分配可能額）	（346.97円）
収益分配金	70,198,444円
（1万口当たり収益分配金）	（30円）

第41期計算期間末（平成26年3月27日）に、投資信託約款に基づき計算した835,202,168円（1万口当たり369.21円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い167,863,478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）	118,148,254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	89,923,301円
分配準備積立金	627,130,613円
分配可能額	835,202,168円
（1万口当たり分配可能額）	（369.21円）
収益分配金	67,863,478円
（1万口当たり収益分配金）	（30円）

第43期計算期間末（平成26年7月28日）に、投資信託約款に基づき計算した849,012,346円（1万口当たり404.24円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い163,008,274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）	83,772,895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	85,255,477円
分配準備積立金	679,983,974円
分配可能額	849,012,346円
（1万口当たり分配可能額）	（404.24円）
収益分配金	63,008,274円
（1万口当たり収益分配金）	（30円）

第44期計算期間末（平成26年9月29日）に、投資信託約款に基づき計算した859,445,885円（1万口当たり431.72円）を分配対象収益とし、収益分配方針に従い159,722,777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）	114,397,512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	81,797,684円
分配準備積立金	663,250,689円
分配可能額	859,445,885円
（1万口当たり分配可能額）	（431.72円）
収益分配金	59,722,777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26年3月28日 至 平成26年9月29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っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	当期
	平成26年9月29日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

前期（平成26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	361,060,090
投資証券	50,443,573
合計	411,503,663

当期（平成26年9月29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	368,577,841
投資証券	90,916,239
合計	277,661,602

（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26年3月27日現在）

該当事項はありません。

当期（平成26年9月29日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当期（自平成26年3月28日至平成26年9月29日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 平成26年3月27日現在	当期 平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 0.8172円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,172円）」	1口当たり純資産額 0.8784円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,784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	1,424,378,347	1,720,364,167	
	親投資信託 受益証券	世界REITマザーファンド	2,637,791,915	2,520,146,395	
	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	1,505,575,152	2,521,236,149	
	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	933,524,964	1,761,188,197	
	親投資信託 受益証券	欧州債券マザーファンド	1,361,772,582	1,736,940,928	
	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	1,262,166,614	1,737,750,994	
	親投資信託 受益証券	コモディティ・マザーファンド	1,157,481,362	814,288,138	
	小計（日本）7銘柄		10,282,690,936	12,811,914,968	
アメリカ・ドル	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global Emerging Markets Equity Fund	1,081,930.500	8,125,298.050	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - Global High Yield Bond Fund	1,558,608.550	16,006,909.800	
	投資証券	T.Rowe Price Funds SICAV - U.S. Aggregate Bond Fund	1,468,386.420	15,917,308.790	
	小計（アメリカ・ドル）3銘柄		4,108,925.470	40,049,516.640 (4,380,215,635)	
合計				17,192,130,603 (4,380,215,635)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 3銘柄	25.04%	25.48%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、指定投資信託証券である、「日本好配当株マザーファンド」、「世界REITマザーファンド」、「グローバル好配当株マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「欧州債券マザーファンド」、「アジア・オセアニア債券マザーファンド」、「コモディティ・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せん。

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26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,424,429,426	1,506,464,643
株式	27,639,515,400	29,956,956,190
派生商品評価勘定	-	47,626,623
未収入金	60,324,108	67,950,637
未収配当金	399,484,750	307,448,150
前払金	45,900,000	-
差入委託証拠金	53,550,000	31,050,000
流動資産合計	29,623,203,684	31,917,496,243
資産合計	29,623,203,684	31,917,496,243
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,259,350	-
前受金	-	45,990,000
未払金	32,324,740	86,395,136
未払解約金	22,131,731	26,005,710
流動負債合計	84,715,821	158,390,846
負債合計	84,715,821	158,390,846
純資産の部		
元本等		
元本	28,562,998,465	26,295,630,832
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	975,489,398	5,463,474,565
元本等合計	29,538,487,863	31,759,105,397
純資産合計	29,538,487,863	31,759,105,397
負債純資産合計	29,623,203,684	31,917,496,243

(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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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26年 3月27日現在	平成26年 9月29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	31,053,614,846円	28,562,998,465円
期中追加設定元本額	547,560,412円	372,993,681円
期中一部解約元本額	3,038,176,793円	2,640,361,314円
元本の内訳		
日本好配当株オープン	26,878,946,889円	24,871,252,485円
グローバル資産分散オープン	1,684,051,576円	1,424,378,347円
合計	28,562,998,465円	26,295,630,832円
2. 受益権の総数	28,562,998,465口	26,295,630,832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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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26年 9月29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26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	596,216,043
合計	596,216,043

「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10月9日から平成26年3月27日まで）を指しております。

(平成26年9月29日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,157,128,458
合計	4,157,128,458

「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26年4月9日から平成26年9月29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26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	1,232,329,350	-	1,202,070,000	30,259,350
	合計	-	-	1,202,070,000	30,259,350

区分	種類	平成26年9月29日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	1,157,023,377	-	1,204,650,000	47,626,623
	合計	-	-	1,204,650,000	47,626,623

(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26年3月28日至平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 1.0342円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,342円)」	1口当たり純資産額 1.2078円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,078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	奥村組	581,000	642.00	373,002,000	
	大東建託	47,200	12,990.00	613,128,000	
	大和ハウス工業	194,000	2,003.00	388,582,000	
	積水ハウス	53,000	1,311.00	69,483,000	
	協和エクシオ	152,000	1,440.00	218,880,000	
	高砂熱学工業	267,000	1,445.00	385,815,000	
	雪印メグミルク	50,000	1,429.00	71,450,000	
	日本たばこ産業	237,600	3,591.50	853,340,400	
	ワコールホールディングス	96,000	1,082.00	103,872,000	
	三菱ケミカルホールディングス	415,000	545.70	226,465,500	
	住友ベークライト	75,000	436.00	32,700,000	
	ADEKA	190,100	1,467.00	278,876,700	
	花王	18,300	4,271.50	78,168,450	
	太陽ホールディングス	69,600	3,490.00	242,904,000	
	ポーラ・オルビスホールディングス	29,000	4,305.00	124,845,000	
	日本バルカー工業	202,000	316.00	63,832,000	
	武田薬品工業	44,600	4,812.00	214,615,200	
	アステラス製薬	630,000	1,634.00	1,029,420,000	
	塩野義製薬	127,000	2,523.00	320,421,000	
	田辺三菱製薬	23,500	1,626.00	38,211,000	
	科研製薬	62,000	2,483.00	153,946,000	
	エーザイ	7,300	4,458.50	32,547,050	
	小野薬品工業	12,800	9,830.00	125,824,000	
	参天製薬	15,500	6,170.00	95,635,000	
	東燃ゼネラル石油	162,000	974.00	157,788,000	
	JXホールディングス	1,022,900	515.50	527,304,950	
	ブリヂストン	88,000	3,639.00	320,232,000	
	住友ゴム工業	46,000	1,565.00	71,990,000	
	ニチアス	46,000	739.00	33,994,000	
	丸一鋼管	38,600	2,729.00	105,339,400	
	日本軽金属ホールディングス	1,060,000	160.00	169,600,000	
	住友金属鉱山	82,000	1,565.00	128,330,000	
	アサヒホールディングス	32,000	1,992.00	63,744,000	
	三和ホールディングス	540,000	785.00	423,900,000	
	日本発条	62,000	1,088.00	67,456,000	
	アマダ	29,000	1,048.00	30,392,000	
	アイダエンジニアリング	349,000	1,117.00	389,833,000	
	サトーホールディングス	135,000	3,080.00	415,800,000	
	小松製作所	65,300	2,555.00	166,841,500	
	アマノ	38,100	1,182.00	45,034,200	
	マックス	69,000	1,260.00	86,940,000	
	キッツ	205,000	561.00	115,005,000	
	ブラザー工業	199,000	2,089.00	415,711,000	
	東芝	402,000	515.00	207,030,000	
	マブチモーター	72,800	9,650.00	702,520,000	
	スミダコーポレーション	245,000	770.00	188,650,000	
	アズビル	194,900	2,708.00	527,789,200	
	スター精密	171,300	1,627.00	278,705,100	
	キヤノン	125,700	3,596.00	452,017,200	
	リコー	137,500	1,185.50	163,006,250	
	日産自動車	343,800	1,077.50	370,444,500	
	トヨタ自動車	304,700	6,488.00	1,976,893,600	
	アイシン精機	114,200	4,000.00	456,800,000	
本田技研工業	132,500	3,770.00	499,525,000		
ショーワ	126,000	1,226.00	154,476,000		
エクセディ	57,000	2,816.00	160,512,000		
H O Y A	195,200	3,691.50	720,580,800		
トッパン・フォームズ	157,000	1,144.00	179,608,000		
大日本印刷	27,000	1,111.00	29,997,000		
中国電力	150,700	1,437.00	216,555,900		
大阪瓦斯	79,000	447.70	35,368,300		
西日本旅客鉄道	88,800	4,925.50	437,384,400		
山九	222,000	592.00	131,424,000		
センコー	104,000	482.00	50,128,000		
日本航空	90,000	3,020.00	271,800,000		
住友倉庫	354,000	583.00	206,382,000		
新日鉄住金ソリューションズ	62,000	3,295.00	204,290,000		

ティーガイア	146,000	1,059.00	154,614,000
伊藤忠テクノソリューションズ	66,000	4,655.00	307,230,000
日本電信電話	152,700	6,864.00	1,048,132,800
KDDI	58,800	6,627.00	389,667,600
NTTドコモ	321,800	1,870.00	601,766,000
エヌ・ティ・ティ・データ	42,000	3,940.00	165,480,000
カブコン	20,600	1,736.00	35,761,600
NSD	49,000	1,713.00	83,937,000
第一興商	39,000	2,920.00	113,880,000
伊藤忠商事	371,800	1,387.00	515,686,600
三井物産	563,000	1,769.00	995,947,000
三菱商事	273,000	2,313.50	631,585,500
オートバックスセブン	29,000	1,704.00	49,416,000
ローソン	19,900	7,580.00	150,842,000
DCMホールディングス	43,000	768.00	33,024,000
セブン&アイ・ホールディングス	73,200	4,223.00	309,123,600
良品計画	7,100	12,970.00	92,087,000
青山商事	30,700	2,573.00	78,991,100
ブレナス	73,000	2,550.00	186,150,000
あおぞら銀行	834,000	380.00	316,920,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,349,700	621.60	1,460,573,520
りそなホールディングス	856,000	627.00	536,712,000
三井住友トラスト・ホールディングス	534,000	460.40	245,853,600
横浜銀行	435,000	613.10	266,698,500
ふくおかフィナンシャルグループ	300,000	530.00	159,000,000
みずほフィナンシャルグループ	1,027,600	198.70	204,184,120
野村ホールディングス	463,000	666.90	308,774,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	119,000	763.00	90,797,000
いちよし証券	69,000	1,364.00	94,116,000
極東証券	52,000	1,841.00	95,732,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	108,000	2,419.00	261,252,000
東京海上ホールディングス	140,600	3,401.00	478,180,600
T&Dホールディングス	129,500	1,411.50	182,789,250
ジャックス	295,000	605.00	178,475,000
日立キャピタル	46,000	2,668.00	122,728,000
パーク24	41,500	1,764.00	73,206,000
スターツコーポレーション	66,000	1,611.00	106,326,000
もしもしホットライン	33,000	1,061.00	35,013,000
ユー・エス・エス	87,000	1,696.00	147,552,000
メイテック	47,100	3,305.00	155,665,500
合計 107銘柄	22,238,100	-	29,956,956,190

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26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	36,806,693	27,364,950
コール・ローン	152,908,398	25,649,092
投資証券	2,613,505,208	2,461,590,608
派生商品評価勘定	85,451	15,339
未収入金	4,093,657	-
未収配当金	8,563,941	7,747,872
流動資産合計	2,815,963,348	2,522,367,861
資産合計	2,815,963,348	2,522,367,861
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,191	16,484
未払金	-	2,170,985
未払解約金	150,000,000	-
流動負債合計	150,012,191	2,187,469
負債合計	150,012,191	2,187,469
純資産の部		
元本等		
元本	3,127,204,033	2,637,791,915
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	461,252,876	117,611,523
元本等合計	2,665,951,157	2,520,180,392
純資産合計	2,665,951,157	2,520,180,392
負債純資産合計	2,815,963,348	2,522,367,861

[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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 国内投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 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26年 3月27日現在	平成26年 9月29日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	3,716,972,934円	3,127,204,033円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	589,768,901円	489,412,118円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	3,127,204,033円	2,637,791,915円
合計	3,127,204,033円	2,637,791,915円
2. 受益権の総数	3,127,204,033口	2,637,791,915口
3. 元本の欠損	461,252,876円	117,611,523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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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26年9月29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26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	18,072,881
合計	18,072,881

「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26年3月27日まで）を指しております。

(平成26年9月29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	140,763,309
合計	140,763,309

「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26年3月28日から平成26年9月29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26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	4,094,838	-	4,091,746	3,092
	売建 アメリカ・ドル	15,350,700	-	15,276,000	74,700
	オーストラリア・ドル	2,198,681	-	2,202,433	3,752
	シンガポール・ドル	1,896,157	-	1,890,753	5,404
	合計	-	-	23,460,932	73,260

区分	種類	平成26年9月29日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 イギリス・ポンド	2,155,524	-	2,170,863	15,339
	売建 アメリカ・ドル	2,155,524	-	2,172,008	16,484
	合計	-	-	4,342,871	1,145

(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26年3月28日 至 平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 0.8525円 「1口 = 1円(10,000口 = 8,525円)」	1口当たり純資産額 0.9554円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,554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	94	36,519,000	
	投資証券	産業ファンド投資法人	27	24,759,000	
	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	60	15,264,000	
	投資証券	日本ビルファンド投資法人	88	50,688,000	
	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	60	33,480,000	
	投資証券	日本リテールファンド投資法人	107	23,283,200	
	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	293	49,018,900	
	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	100	19,800,000	
	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	60	35,580,000	
	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	225	31,725,000	
		小計(日本)10銘柄		1,114	320,117,100
アメリカ・ドル	投資証券	ASHFORD HOSPITALITY TRUS-D	13,825.000	350,878.500	
	投資証券	DUKE REALTY CORP	12,500.000	216,625.000	
	投資証券	EPR PROPERTIES	3,800.000	194,218.000	
	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,496.000	1,012,854.400	
	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,900.000	92,391.000	
	投資証券	GLIMCHER REALTY TRUST - G	9,569.000	240,277.590	
	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	16,431.000	1,036,960.410	
	投資証券	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	5,400.000	146,880.000	
	投資証券	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,000.000	240,380.000	
	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,452.000	1,227,046.320	
	投資証券	VENTAS INC	3,700.000	230,621.000	
	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	3,133.000	315,681.080	
	小計(アメリカ・ドル)12銘柄		103,206.000	5,304,813.300 (580,187,430)	
カナダ・ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,567.000	497,317.380	
	投資証券	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	5,300.000	136,475.000	
	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,405.000	220,171.050	
	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,663.000	375,812.690	
	小計(カナダ・ドル)4銘柄		43,935.000	1,229,776.120 (120,579,548)	
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	462,600.000	518,112.000	
	投資証券	GPT GROUP	148,900.000	574,754.000	
	投資証券	INVESTA OFFICE FUND	97,792.000	329,559.040	
	投資証券	MIRVAC GROUP	298,500.000	505,957.500	

	投資証券	SCENTRE GROUP	327,284.000	1,080,037.200	
	投資証券	STOCKLAND	157,638.000	625,822.860	
	投資証券	WESTFIELD CORP	102,992.000	766,260.480	
	小計(オーストラリア・ドル) 8銘柄		1,729,106.000	4,902,087.080 (468,737,566)	
シンガ ポール・ ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	218,205.000	497,507.400	
	投資証券	CAPITACOMMERCIAL TRUST	245,500.000	392,800.000	
	投資証券	CAPITAMALL TRUST	352,356.000	671,238.180	
	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	255,120.000	290,836.800	
	小計(シンガポール・ドル) 4銘柄		1,071,181.000	1,852,382.380 (158,952,932)	
イギリ ス・ポ ンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	82,515.000	582,555.900	
	投資証券	DERWENT LONDON PLC	13,678.000	372,999.060	
	投資証券	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	39,300.000	250,930.500	
	投資証券	HAMMERSON PLC	69,182.000	395,375.130	
	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	51,686.000	543,219.860	
	投資証券	SEGR0 PLC	105,198.000	384,393.490	
	小計(イギリス・ポンド) 6銘柄		361,559.000	2,529,473.940 (449,411,635)	
ユーロ	投資証券	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	9,324.000	89,976.600	
	投資証券	BEFIMMO S.C.A.	1,547.000	91,319.410	
	投資証券	COFINIMMO	1,495.000	133,563.300	
	投資証券	CORIO NV	6,403.000	250,453.340	
	投資証券	EUROCOMMERCIAL	6,955.000	246,832.950	
	投資証券	ICADE	7,520.000	509,780.800	
	投資証券	KLEPIERRE	5,633.000	196,366.380	
	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,077.000	824,573.250	
	投資証券	VASTNED RETAIL	2,584.000	94,483.960	
	投資証券	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,242.000	183,788.980	
	小計(ユーロ) 10銘柄		48,780.000	2,621,138.970 (363,604,397)	
合計				2,461,590,608 (2,141,473,508)	

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

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 12銘柄	23.02%	23.57%
カナダ・ドル	投資証券 4銘柄	4.78%	4.90%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	18.60%	19.04%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	6.31%	6.46%
イギリス・ポンド	投資証券 6銘柄	17.83%	18.26%
ユーロ	投資証券 10銘柄	14.43%	14.77%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

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](#)

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26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	4,577,104,467	3,017,632,479
コール・ローン	1,763,261,540	1,864,478,095
株式	111,569,202,861	107,752,917,553
派生商品評価勘定	32,795,061	10,202,330
未収入金	1,863,239,547	3,021,685,199
未収配当金	388,394,777	302,097,611
流動資産合計	120,193,998,253	115,969,013,267
資産合計	120,193,998,253	115,969,013,267
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,003,182	11,067,972
未払金	2,445,255,632	3,326,851,235
未払解約金	112,683,049	309,959,706
流動負債合計	2,586,941,863	3,647,878,913
負債合計	2,586,941,863	3,647,878,913
純資産の部		
元本等		
元本	76,426,712,720	67,071,780,536
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	41,180,343,670	45,249,353,818
元本等合計	117,607,056,390	112,321,134,354
純資産合計	117,607,056,390	112,321,134,354
負債純資産合計	120,193,998,253	115,969,013,267

[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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年3月27日現在	平成26年9月29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	90,957,290,100円	76,426,712,720円
期中追加設定元本額	541,762,855円	352,240,430円
期中一部解約元本額	15,072,340,235円	9,707,172,614円
元本の内訳		
グローバル好配当株オープン	74,656,789,747円	65,566,205,384円
グローバル資産分散オープン	1,769,922,973円	1,505,575,152円
合計	76,426,712,720円	67,071,780,536円
2. 受益権の総数	76,426,712,720口	67,071,780,536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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年9月29日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成26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	2,898,103,700
合計	2,898,103,700

「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26年1月9日から平成26年3月27日まで）を指しております。

(平成26年9月29日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	790,415,349
合計	790,415,349

「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26年7月9日から平成26年9月29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26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	1,884,288,059	-	1,870,031,355	14,256,704
	スウェーデン・クローナ	1,236,916,741	-	1,228,545,133	8,371,608
	ユーロ	1,222,143,125	-	1,215,843,889	6,299,236
	売建				
	アメリカ・ドル	3,994,129,866	-	3,974,645,699	19,484,167
	オーストラリア・ドル	18,277,593	-	18,308,786	31,193
	スイス・フラン	700,268,588	-	695,735,518	4,533,070
	ユーロ	1,165,741,878	-	1,157,008,495	8,733,383
	合計	-	-	10,160,118,875	3,791,879

区分	種類	平成26年9月29日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,105,534,163	-	1,108,549,936	3,015,773
	ユーロ	1,088,901,688	-	1,096,088,245	7,186,557
	売建				
	アメリカ・ドル	1,088,901,688	-	1,097,229,232	8,327,544
	香港・ドル	20,906,200	-	21,025,664	119,464
	イギリス・債券	1,058,389,498	-	1,060,957,390	2,567,892
	ユーロ	26,238,465	-	26,291,537	53,072

合計	-	-	4,410,142,004	865,642
----	---	---	---------------	---------

(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26年3月28日 至 平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在		平成26年9月29日現在	
1口当たり純資産額	1.5388円 「1口 = 1円(10,000口 = 15,388円)」	1口当たり純資産額	1.6746円 「1口 = 1円(10,000口 = 16,746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	ABBVIE INC	205,400	59.190	12,157,626.000	
	APPLE INC	112,500	100.750	11,334,375.000	
	AT&T INC	153,200	35.280	5,404,896.000	
	BLACKROCK INC	33,600	335.070	11,258,352.000	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	198,100	51.100	10,122,910.000	
	CARNIVAL CORP	293,000	40.870	11,974,910.000	
	CHEVRON CORP	69,100	121.470	8,393,577.000	
	CONOCOPHILLIPS	133,300	78.120	10,413,396.000	
	DOW CHEMICAL	210,200	53.570	11,260,414.000	
	ELI LILLY & CO	162,500	65.480	10,640,500.000	
	FORD MOTOR CO	662,800	16.330	10,823,524.000	
	HALLIBURTON CO	127,700	65.880	8,412,876.000	
	HASBRO INC	185,100	55.330	10,241,583.000	
	INTEL CORP	318,100	34.260	10,898,106.000	
	JOHNSON & JOHNSON	83,200	107.100	8,910,720.000	
	KIMBERLY CLARK CORP	94,400	107.850	10,181,040.000	
	KLA-TENCOR CORPORATION	148,300	80.060	11,872,898.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	98,400	113.250	11,143,800.000	
	MERCK & CO INC	166,800	59.390	9,906,252.000	
	MICROSOFT CORP	257,200	46.410	11,936,652.000	
	NEXTERA ENERGY INC	97,100	93.440	9,073,024.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	85,500	98.350	8,408,925.000	
	PFIZER INC	359,200	29.720	10,675,424.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	104,900	83.230	8,730,827.000	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	121,200	90.050	10,914,060.000	
	SCHLUMBERGER LTD	80,400	103.460	8,318,184.000	
	VERIZON COMM	237,086	49.770	11,799,770.220	
	WELLS FARGO & COMPANY	214,800	51.870	11,141,676.000	
小計(アメリカ・ドル) 28銘柄	5,013,086	-	286,350,297.220 (31,318,132,007)		
カナダ ・ドル	BANK OF MONTREAL	129,700	82.740	10,731,378.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	160,800	69.350	11,151,480.000	
	HUSKY ENERGY INC	366,300	30.920	11,325,996.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	147,300	80.440	11,848,812.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	211,700	55.390	11,726,063.000	
	小計(カナダ・ドル) 5銘柄	1,015,800	-	56,783,729.000 (5,567,644,628)	
オースト ラリア ・ドル	AMCOR LTD	988,700	11.340	11,211,858.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	306,000	30.990	9,482,940.000	
	BORAL LIMITED	1,999,500	5.030	10,057,485.000	
	COMMONWEALTH BK	137,700	75.260	10,363,302.000	

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,786,500	6.200	11,076,300.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	171,700	57.790	9,922,543.000	
	SANTOS LTD	710,600	13.810	9,813,386.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	663,200	17.520	11,619,264.000	
	TELSTRA CORP	1,980,300	5.310	10,515,393.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	300,100	31.890	9,570,189.000	
	小計(オーストラリア・ドル) 10銘柄	9,044,300	-	103,632,660.000 (9,909,354,949)	
香港・ドル	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,740,000	25.700	70,418,000.000	
	CHEUNG KONG HOLDING	560,000	134.700	75,432,000.000	
	CHINA MOBILE LTD	800,000	92.700	74,160,000.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,500,000	20.700	72,450,000.000	
	CNOOC LTD	4,700,000	13.880	65,236,000.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	23,000,000	3.150	72,450,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	557,900	128.300	71,578,570.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	400,000	175.300	70,120,000.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,104,500	69.850	77,149,325.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	610,000	116.400	71,004,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	690,000	103.900	71,691,000.000	
	小計(香港・ドル) 11銘柄	38,662,400	-	791,688,895.000 (11,154,896,531)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,350,000	7.250	17,037,500.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,325,000	3.800	12,635,000.000	
	小計(シンガポール・ドル) 2銘柄	5,675,000	-	29,672,500.000 (2,546,197,225)	
台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	7,548,000	39.150	295,504,200.000	
	AU OPTRONICS CORP	23,400,000	13.150	307,710,000.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	1,280,000	270.000	345,600,000.000	
	CHINA STEEL CORP	6,120,000	26.000	159,120,000.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	172,000	2,090.000	359,480,000.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	5,728,520	45.100	258,356,252.000	
	QUANTA COMPUTER INC	4,300,000	78.000	335,400,000.000	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	2,600,000	121.500	315,900,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	2,913,131	121.000	352,488,851.000	
	小計(台湾・ドル) 9銘柄	54,061,651	-	2,729,559,303.000 (9,853,709,084)	
イギリス・ポンド	AVIVA PLC	1,231,600	5.320	6,552,112.000	
	BHP BILLITON PLC	324,200	17.320	5,615,144.000	
	BP PLC	1,270,400	4.517	5,738,396.800	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,100	35.060	5,192,386.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,096,800	2.344	7,258,899.200	
	NATIONAL GRID PLC	566,100	8.790	4,976,019.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	250,500	24.350	6,099,675.000	
	小計(イギリス・ポンド) 7銘柄	6,887,700	-	41,432,632.000 (7,361,335,727)	
スイス・フラン	NESTLE SA (REGD)	140,700	69.600	9,792,720.000	
	NOVARTIS AG-REG	121,300	88.300	10,710,790.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	38,400	280.900	10,786,560.000	
	小計(スイス・フラン) 3銘柄	300,400	-	31,290,070.000 (3,597,106,447)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	609,500	120.500	73,444,750.000	
	STATOIL ASA	354,700	174.200	61,788,740.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	216,700	317.000	68,693,900.000	
	小計(ノルウェー・クローネ) 3銘柄	1,180,900	-	203,927,390.000 (3,452,490,713)	
スウェーデン・クローナ	ELECTROLUX AB	386,600	197.700	76,430,820.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	246,000	295.600	72,717,600.000	
	SKANSKA AB-B SHS	470,500	145.100	68,269,550.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	215,100	339.000	72,918,900.000	
	小計(スウェーデン・クローナ) 4銘柄	1,318,200	-	290,336,870.000 (4,372,473,262)	
韓国・ウォン	KT&G CORP	110,400	93,900.000	10,366,560,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄	110,400	-	10,366,560,000.000 (1,083,305,520)	
ユーロ	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	252,900	30.470	7,705,863.000	
	ALLIANZ SE-REG	57,300	128.200	7,345,860.000	
	BANCO SANTANDER	1,044,600	7.720	8,064,312.000	
	BASF SE	104,900	73.160	7,674,484.000	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	85,900	85.640	7,356,476.000	
CAPGEMINI SA	151,900	56.080	8,518,552.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG	549,400	11.960	6,570,824.000	
ENEL SPA	1,882,400	4.190	7,887,256.000	
ENI SPA	398,200	18.550	7,386,610.000	
GDF SUEZ	424,200	19.540	8,288,868.000	
INTESA SANPAOLO SPA	3,130,200	2.428	7,600,125.600	
SAMPO OYJ-A SHS	217,400	38.480	8,365,552.000	
SANOFI	104,000	88.410	9,194,640.000	
SIEMENS AG DM 5	91,400	93.910	8,583,374.000	
SNAM SPA	1,830,900	4.366	7,993,709.400	
TOTAL SA	155,300	50.730	7,878,369.000	
小計(ユーロ)16銘柄	10,480,900	-	126,414,875.000 (17,536,271,460)	
合計	133,750,737	-	107,752,917,553 (107,752,917,553)	

- (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 28銘柄	27.88%	29.07%
カナダ・ドル	外国株式 5銘柄	4.96%	5.17%
オーストラリア・ドル	外国株式 10銘柄	8.82%	9.20%
香港・ドル	外国株式 11銘柄	9.93%	10.35%
シンガポール・ドル	外国株式 2銘柄	2.27%	2.36%
台湾・ドル	外国株式 9銘柄	8.77%	9.14%
イギリス・ポンド	外国株式 7銘柄	6.56%	6.83%
スイス・フラン	外国株式 3銘柄	3.20%	3.34%
ノルウェー・クローネ	外国株式 3銘柄	3.07%	3.20%
スウェーデン・クローナ	外国株式 4銘柄	3.89%	4.06%
韓国・ウォン	外国株式 1銘柄	0.97%	1.01%
ユーロ	外国株式 16銘柄	15.61%	16.27%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

新興国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	395,504,525	396,043,689
コール・ローン	155,050,393	158,007,685
国債証券	7,049,080,565	6,463,132,210
特殊債券	332,548,380	219,920,139
社債券	5,165,747,136	3,253,408,386
派生商品評価勘定	360,077	25,849,824
未収入金	22,126,913	42,462,903
未収利息	220,392,115	173,909,993
前払費用	18,587,250	4,436,866
流動資産合計	13,359,397,354	10,737,171,695
資産合計	13,359,397,354	10,737,171,695
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,432,671	13,700,931
未払金	66,556,712	22,557,563
流動負債合計	69,989,383	36,258,494
負債合計	69,989,383	36,258,494
純資産の部		
元本等		
元本	7,924,242,148	5,672,108,090
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,365,165,823	5,028,805,111
元本等合計	13,289,407,971	10,700,913,201
純資産合計	13,289,407,971	10,700,913,201
負債純資産合計	13,359,397,354	10,737,171,695

[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26年 3月28日 至 平成26年 9月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益約定日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成26年 3月27日現在	平成26年 9月29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	8,679,336,834円	7,924,242,148円
期中追加設定元本額	1,589,185,231円	196,509,521円
期中一部解約元本額	2,344,279,917円	2,448,643,579円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,114,384,618円	933,524,964円
大和住銀/T・ロウ・プライスF0Fs用新興国債券ファンド（適格機関投資家専用）	3,823,089,707円	3,199,647,056円
T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	2,986,767,823円	1,538,936,070円
合計	7,924,242,148円	5,672,108,090円
2. 受益権の総数	7,924,242,148口	5,672,108,090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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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26年 9月29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26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	77,391,192
特殊債証券	10,382,602
社債証券	12,050,672
合計	99,824,466

「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11月8日から平成26年3月27日まで)を指しております。

(平成26年9月29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	51,084,991
特殊債証券	583,875
社債証券	33,337,826
合計	18,331,040

「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26年5月8日から平成26年9月29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26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	332,776,071	-	329,343,400	3,432,671
	売建 メキシコ・ペソ	281,877,600	-	281,877,600	0
	ユーロ	45,898,471	-	45,538,394	360,077
合計		-	-	656,759,394	3,072,594

区分	種類	平成26年9月29日現在			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	449,141,520	-	474,991,344	25,849,824
	メキシコ・ペソ	7,457,271	-	7,442,800	14,471
	ユーロ	13,471,394	-	13,451,960	19,434
	売建 アメリカ・ドル	22,928,665	-	23,347,891	419,226
	メキシコ・ペソ	427,856,400	-	440,937,360	13,080,960
	ユーロ	13,285,120	-	13,451,960	166,840

合計	-	-	973,623,315	12,148,893
----	---	---	-------------	------------

(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26年3月28日 至 平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 1.6771円 「1口 = 1円(10,000口 = 16,771円)」	1口当たり純資産額 1.8866円 「1口 = 1円(10,000口 = 18,866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	ANGOL 7 08/16/19	380,000.000	410,400.000	
	国債証券	ARGBON 7 04/17/17	1,415,000.000	1,218,017.850	
	国債証券	ARGBON 7 10/03/15	300,000.000	278,778.000	
	国債証券	ARMEN 6 09/30/20	700,000.000	723,975.000	
	国債証券	BAHAMA 5.75 01/16/24	600,000.000	636,000.000	
	国債証券	BARBAD 6.625 12/05/35	200,000.000	163,000.000	
	国債証券	BERMUD 4.854 02/06/24	1,805,000.000	1,877,200.000	
	国債証券	BHRAIN 6 09/19/44	200,000.000	203,750.000	
	国債証券	BRAZIL 2.625 01/05/23	2,200,000.000	2,008,600.000	
	国債証券	BRAZIL 5 01/27/45	1,559,000.000	1,492,742.500	
	国債証券	BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.000	211,000.000	
	国債証券	COLOM 4 02/26/24	1,200,000.000	1,218,000.000	
	国債証券	COLOM 4.375 07/12/21	1,000,000.000	1,062,000.000	
	国債証券	COLOM 6.125 01/18/41	1,600,000.000	1,896,000.000	
	国債証券	CROATI 5.5 04/04/23	360,000.000	374,850.000	
	国債証券	CROATI 6 01/26/24	220,000.000	236,346.000	
	国債証券	CROATI 6.375 03/24/21	700,000.000	768,586.000	
	国債証券	DOMREP 7.5 05/06/21	200,000.000	227,200.000	
	国債証券	ELSALV 6.375 01/18/27	115,000.000	116,190.250	
	国債証券	GABON 6.375 12/12/24	500,000.000	536,250.000	
	国債証券	GHANA 7.875 08/07/23	200,000.000	203,750.000	
	国債証券	GHANA 8.125 01/18/26	200,000.000	203,250.000	
	国債証券	ICELND 4.875 06/16/16	1,000,000.000	1,043,170.000	
	国債証券	INDON 4.625 04/15/43	740,000.000	665,075.000	
	国債証券	INDON 6.625 02/17/37	2,750,000.000	3,176,250.000	
	国債証券	IRAQ 5.8 01/15/28	561,000.000	506,302.500	
	国債証券	IVYCST 5.375 07/23/24	320,000.000	310,400.000	
	国債証券	JAMAN 7.625 07/09/25	200,000.000	215,000.000	
	国債証券	JMGB 8.5 11/16/21	1,428,570.880	1,484,628.000	
	国債証券	MALAYS 4.646 07/06/21	750,000.000	831,150.000	
	国債証券	MEX 4 10/02/23	300,000.000	309,558.000	
	国債証券	MONGOL 5.125 12/05/22	430,000.000	386,475.400	
	国債証券	MOROC 4.25 12/11/22	1,175,000.000	1,182,167.500	
国債証券	PARGUY 6.1 08/11/44	200,000.000	214,000.000		
国債証券	PERU 5.625 11/18/50	1,340,000.000	1,534,233.000		
国債証券	PHILIP 4.2 01/21/24	1,700,000.000	1,802,000.000		
国債証券	PKSTAN 7.25 04/15/19	200,000.000	202,960.000		
国債証券	REPHUN 5.375 03/25/24	940,000.000	1,003,450.000		
国債証券	REPHUN 5.75 11/22/23	970,000.000	1,067,000.000		
国債証券	REPHUN 7.625 03/29/41	100,000.000	129,500.000		
国債証券	REPNAM 5.5 11/03/21	400,000.000	428,140.000		
国債証券	ROMANI 4.375 08/22/23	1,236,000.000	1,275,280.080		
国債証券	ROMANI 6.75 02/07/22	200,000.000	237,750.000		

国債証券	RUSSIA FL 03/31/30	2,829,050.000	3,192,696.080
国債証券	SERBIA 4.875 02/25/20	900,000.000	903,375.000
国債証券	SERBIA 5.25 11/21/17	700,000.000	724,500.000
国債証券	SERBIA 5.875 12/03/18	240,000.000	252,600.000
国債証券	SERBIA 7.25 09/28/21	1,900,000.000	2,154,315.000
国債証券	SERBIA FL 11/01/24	678,210.450	687,535.840
国債証券	SLOVEN 5.25 02/18/24	295,000.000	316,815.250
国債証券	SLOVEN 5.85 05/10/23	450,000.000	504,562.500
国債証券	SOAF 4.665 01/17/24	1,798,000.000	1,833,960.000
国債証券	SOAF 6.25 03/08/41	627,000.000	717,915.000
国債証券	SRILAN 5.875 07/25/22	1,200,000.000	1,260,000.000
国債証券	SRILAN 6.25 07/27/21	200,000.000	213,500.000
国債証券	SRILAN 6.25 10/04/20	200,000.000	213,720.000
国債証券	TURKEY 5.625 03/30/21	1,000,000.000	1,078,660.000
国債証券	TURKEY 6 01/14/41	450,000.000	476,437.500
国債証券	TURKEY 8 02/14/34	1,325,000.000	1,726,806.250
国債証券	UKRAIN 6.58 11/21/16	3,710,000.000	3,121,037.500
国債証券	UKRAIN 6.75 11/14/17	565,000.000	474,006.750
国債証券	ZAMBIN 5.375 09/20/22	525,000.000	501,375.000
特殊債券	ESKOM 5.75 01/26/21	500,000.000	507,000.000
特殊債券	LIBAN 10 04/25/15	330,000.000	342,658.800
特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	100,000.000	103,050.000
特殊債券	PEMEX 6.5 06/02/41	819,000.000	952,087.500
社債券	ACKAF 5 04/03/23	350,000.000	333,812.500
社債券	ADAIND 7.625 10/22/19	200,000.000	208,110.000
社債券	AEFES 3.375 11/01/22	200,000.000	178,750.000
社債券	ALDAR 4.348 12/03/18	200,000.000	210,000.000
社債券	ALTICE 8.125 01/15/24	200,000.000	214,000.000
社債券	BANCO 3.875 02/08/22	200,000.000	201,914.000
社債券	BANGRA 7.375 02/02/22	400,000.000	424,760.000
社債券	BCOCPE FL 09/22/29	60,000.000	60,036.600
社債券	BEEFBZ 7.75 01/31/23	235,000.000	244,259.000
社債券	BHARTI 5.125 03/11/23	400,000.000	421,340.000
社債券	BRFSBZ 5.875 06/06/22	200,000.000	214,500.000
社債券	BRPRSA 9 PERPETUAL	500,000.000	518,125.000
社債券	CDEL 3 07/17/22	1,750,000.000	1,693,580.000
社債券	CEMEX 9.375 10/12/22	300,000.000	337,500.000
社債券	CIFIHG 8.875 01/27/19	200,000.000	201,000.000
社債券	DALWAN 7.25 01/29/24	300,000.000	321,480.000
社債券	DEVTAM 5.412 12/30/25	75,000.000	76,968.750
社債券	EMAAR 4.564 06/18/24	200,000.000	206,130.000
社債券	EUCHEM 5.125 12/12/17	200,000.000	197,010.000
社債券	EVRAZ 6.5 04/22/20	200,000.000	186,010.000
社債券	EXIMBK 4 01/14/23	1,450,000.000	1,454,379.000
社債券	FRES 5.5 11/13/23	200,000.000	209,800.000
社債券	GARAN 6.25 04/20/21	500,000.000	533,750.000
社債券	GCCAMM 8.125 02/08/20	200,000.000	217,000.000
社債券	GCX 7 08/01/19	200,000.000	205,690.000
社債券	GEBGG 7.75 07/05/17	200,000.000	214,934.000
社債券	GRNLGR 5.875 07/03/24	200,000.000	197,710.000
社債券	HALKBK 4.875 07/19/17	375,000.000	388,237.500
社債券	HSBKKZ 7.25 01/28/21	200,000.000	216,760.000
社債券	ICICI FL 04/30/22	300,000.000	316,140.000
社債券	ISCTR 6 10/24/22	300,000.000	296,400.000
社債券	ISRELE 6.875 06/21/23	550,000.000	633,561.500
社債券	ISRELE 7.875 12/15/26	250,000.000	305,000.000
社債券	JAFZSK 7 06/19/19	250,000.000	288,950.000
社債券	KAISAG 10.25 01/08/20	200,000.000	209,380.000
社債券	KWGPRO 8.975 01/14/19	220,000.000	221,309.000
社債券	KZOKZ 4.4 04/30/23	1,000,000.000	966,250.000
社債券	KZOKZ 5.75 04/30/43	300,000.000	283,500.000
社債券	KZOKZ 6.375 04/09/21	300,000.000	325,785.000
社債券	KZOKZ 7 05/05/20	1,900,000.000	2,110,615.000
社債券	LNGFOR 6.75 01/29/23	200,000.000	189,486.000
社債券	MABEMX 7.875 10/28/19	250,000.000	284,375.000
社債券	MERSIN 5.875 08/12/20	480,000.000	510,499.200
社債券	METLIG 5.25 01/17/18	400,000.000	405,000.000

社債券	MHPSA 8.25 04/02/20	555,000.000	471,750.000	
社債券	MIICF 6.625 10/15/21	200,000.000	210,910.000	
社債券	MPEL 8.5 12/01/20	250,000.000	270,000.000	
社債券	MRFGBZ 6.875 06/24/19	200,000.000	198,270.000	
社債券	ODBR 7.125 06/26/42	400,000.000	433,200.000	
社債券	ODEBRE 6.75 10/01/22	572,220.000	602,261.550	
社債券	PCCW 5.75 04/17/22	300,000.000	323,166.000	
社債券	PDVSA 4.9 10/28/14	4,642.000	4,600.220	
社債券	PDVSA 5.25 04/12/17	4,540,000.000	3,309,660.000	
社債券	PDVSA 8.5 11/02/17	1,610,000.000	1,324,225.000	
社債券	PDVSA 9.75 05/17/35	200,000.000	137,500.000	
社債券	PETBRA 4.875 03/17/20	420,000.000	427,820.400	
社債券	PETBRA 5.625 05/20/43	238,000.000	215,063.940	
社債券	PETBRA 7.25 03/17/44	260,000.000	291,155.800	
社債券	PSALM 7.39 12/02/24	200,000.000	256,000.000	
社債券	RILIN 5.4 02/14/22	250,000.000	273,387.500	
社債券	RPCUH 6 08/31/36	200,000.000	225,000.000	
社債券	SBERRU 6.125 02/07/22	200,000.000	202,368.000	
社債券	SBERRU FL 02/26/24	200,000.000	183,000.000	
社債券	SIBRSE 3.914 01/31/18	250,000.000	232,087.500	
社債券	TATAIN 5.95 07/31/24	200,000.000	202,490.000	
社債券	TCZIRA 4.25 07/03/19	700,000.000	690,550.000	
社債券	UKRLAN 10.875 03/26/18	200,000.000	138,000.000	
社債券	VEDLN 7.125 05/31/23	400,000.000	414,000.000	
社債券	VIP 7.748 02/02/21	200,000.000	207,040.000	
社債券	VOTORA 7.25 04/05/41	200,000.000	213,500.000	
社債券	YASAR 9.625 10/07/15	725,000.000	742,980.000	
社債券	YPFDAR 8.75 04/04/24	110,000.000	113,025.000	
	小計(アメリカ・ドル) 138銘柄	84,715,693.330	86,075,797.010 (9,414,109,919)	
メキシコ・ペソ	国債証券	MBONO 10 11/20/36	11,046,000.000	14,913,646.440
	国債証券	MBONO 6.5 06/09/22	6,000,000.000	6,238,020.000
	国債証券	MBONO 7.75 11/13/42	33,354,000.000	36,363,531.420
	国債証券	MBONO 8.5 11/18/38	4,500,000.000	5,308,695.000
	特殊債券	PEMEX 7.19 09/12/24	1,400,000.000	1,425,900.000
		小計(メキシコ・ペソ) 5銘柄	56,300,000.000	64,249,792.860 (522,350,816)
合計			9,936,460,735 (9,936,460,735)	

- (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	87.97%	94.74%
	特殊債券		
	社債券		
メキシコ・ペソ	国債証券	4.88%	5.26%
	特殊債券		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[前へ](#) [次へ](#)

欧州債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	14,745,291	77,717,034
コール・ローン	524,681	524,686
国債証券	1,460,552,641	1,422,042,475
特殊債券	15,581,397	-
社債券	285,498,197	224,469,699
派生商品評価勘定	1,563,943	6,278,798
未収入金	13,776	-
未収利息	22,048,275	11,450,224
前払費用	4,450,021	5,980,212
流動資産合計	1,804,978,222	1,748,463,128
資産合計	1,804,978,222	1,748,463,128
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	930,978	11,504,982
未払金	3,493,480	-
流動負債合計	4,424,458	11,504,982
負債合計	4,424,458	11,504,982
純資産の部		
元本等		
元本	1,491,906,783	1,361,772,582
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	308,646,981	375,185,564
元本等合計	1,800,553,764	1,736,958,146
純資産合計	1,800,553,764	1,736,958,146
負債純資産合計	1,804,978,222	1,748,463,128

[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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年3月27日現在	平成26年9月29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	1,789,998,049円	1,491,906,783円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	298,091,266円	130,134,201円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,491,906,783円	1,361,772,582円
合計	1,491,906,783円	1,361,772,582円
2. 受益権の総数	1,491,906,783口	1,361,772,582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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年9月29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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
------------	---

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成26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	16,857,765
特殊債券	592,165
社債券	3,256,763
合計	19,522,363

「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26年3月27日まで）を指しております。

（平成26年9月29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	43,969,297
社債券	4,992,079
合計	48,961,376

「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26年3月28日から平成26年9月29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26年3月27日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ポンド	34,636,496	-	34,351,767	284,729
	スイス・フラン	13,288,075	-	13,352,760	64,685
	デンマーク・クローネ	28,112,050	-	28,177,380	65,330
	ノルウェー・クローネ	30,636,203	-	30,828,000	191,797
	スウェーデン・クローナ	458,891	-	456,460	2,431
	ポーランド・ズロチ	61,631,992	-	61,676,800	44,808
	ユーロ	122,264,175	-	122,330,313	66,138
	売建				
	イギリス・ポンド	65,084,685	-	64,434,465	650,220
	スイス・フラン	1,030,770	-	1,035,990	5,220
	デンマーク・クローネ	27,774,460	-	27,725,940	48,520
	ノルウェー・クローネ	16,409,080	-	16,312,800	96,280
	スウェーデン・クローナ	1,488,020	-	1,479,560	8,460
	ポーランド・ズロチ	10,477,160	-	10,424,720	52,440
	ユーロ	168,763,707	-	169,127,040	363,333
合計	-	-	581,713,995	632,965	

区分	種類	平成26年9月29日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	イギリス・ポンド	88,771,304	-	90,570,920	1,799,616
	スイス・フラン	10,967,373	-	11,150,150	182,777
	デンマーク・クローネ	1,671,397	-	1,695,330	23,933
	ノルウェー・クローネ	17,348,436	-	17,555,200	206,764
	スウェーデン・クローナ	17,484,686	-	17,623,550	138,864
	ポーランド・ズロチ	47,324,604	-	47,819,220	494,616
	ユーロ	312,647,831	-	314,729,559	2,081,728
	売建				
	イギリス・ポンド	262,031,330	-	271,559,700	9,528,370
	ノルウェー・クローネ	816,000	-	844,000	28,000
	スウェーデン・クローナ	1,667,680	-	1,685,600	17,920
	ポーランド・ズロチ	48,132,821	-	47,819,219	313,602
	ユーロ	183,567,800	-	184,461,594	893,794
合計	-	-	1,007,514,042	5,226,184	

(注) 時価の算定方法

- A. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨につきましては、以下のように評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。
 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
 ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- B. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成26年3月28日 至 平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 1.2069円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,069円)」	1口当たり純資産額 1.2755円 「1口 = 1円(10,000口 = 12,755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	315,000.000	311,157.000	
	国債証券	UKT 1.75 07/22/19	608,000.000	606,388.800	
	国債証券	UKT 2.25 09/07/23	102,000.000	101,255.400	
	国債証券	UKT 3.75 09/07/20	82,000.000	90,232.800	
	国債証券	UKT 3.75 09/07/21	218,000.000	241,456.800	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/27	179,000.000	210,575.600	
	国債証券	UKT 4.25 12/07/46	182,000.000	226,189.600	
	国債証券	UKT 4.75 09/07/15	147,000.000	152,791.800	
	国債証券	UKT 4.75 12/07/38	250,000.000	325,050.000	
	国債証券	UKT 5 03/07/18	51,000.000	57,120.000	
	社債券	DEXGRP 1.875 07/17/17	200,000.000	201,460.000	
	小計(イギリス・ポンド) 11銘柄		2,334,000.000	2,523,677.800 (448,381,835)	
ノルウェー・クローネ	国債証券	NGB 4.25 05/19/17	541,000.000	578,707.700	
	小計(ノルウェー・クローネ) 1銘柄		541,000.000	578,707.700 (9,797,521)	
ロシア・ルーブル	国債証券	RFLB 7.5 02/27/19	9,573,000.000	9,036,912.000	
	小計(ロシア・ルーブル) 1銘柄		9,573,000.000	9,036,912.000 (25,303,353)	
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 3.25 07/25/19	1,387,000.000	1,444,976.600	
	小計(ポーランド・ズロチ) 1銘柄		1,387,000.000	1,444,976.600 (47,944,323)	
ユーロ	国債証券	BGB 2.6 06/22/24	67,000.000	75,217.550	
	国債証券	BGB 4 03/28/22	22,000.000	27,142.500	
	国債証券	BGB 4.25 03/28/41	62,000.000	86,335.000	
	国債証券	BGB 4.25 09/28/22	27,000.000	34,005.150	
	国債証券	BGB 5 03/28/35	71,000.000	104,864.870	
	国債証券	BRAZIL 2.875 04/01/21	100,000.000	103,315.000	

国債証券	BTPS 4.5 03/01/26	180,000.000	213,570.000	
国債証券	BTPS 4.5 08/01/18	656,000.000	746,856.000	
国債証券	BTPS 4.75 09/01/44	276,000.000	331,636.080	
国債証券	BTPS 5 08/01/39	46,000.000	57,417.200	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	532,000.000	601,266.400	
国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	110,000.000	138,341.500	
国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	58,000.000	78,868.400	
国債証券	CZECH 3.875 05/24/22	117,000.000	140,072.400	
国債証券	CZECH 5 06/11/18	115,000.000	135,004.250	
国債証券	DBR 2.5 07/04/44	78,000.000	89,457.420	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/28	96,000.000	136,809.600	
国債証券	FRTR 1.75 11/25/24	136,000.000	141,694.320	
国債証券	FRTR 2.25 05/25/24	370,000.000	405,257.300	
国債証券	FRTR 3.25 05/25/45	178,000.000	212,033.600	
国債証券	FRTR 4.25 10/25/18	408,000.000	475,932.000	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	85,000.000	133,714.350	
国債証券	ICELND 2.5 07/15/20	240,000.000	246,312.000	
国債証券	INDON 2.875 07/08/21	100,000.000	101,990.000	
国債証券	ISRAEL 2.875 01/29/24	100,000.000	108,665.000	
国債証券	LATVIA 2.875 04/30/24	100,000.000	107,000.000	
国債証券	LITHUN 4.85 02/07/18	64,000.000	72,682.880	
国債証券	MEX 3.625 04/09/29	100,000.000	109,440.000	
国債証券	MONTEN FL 12/09/16	100,000.000	103,500.000	
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	202,000.000	301,808.200	
国債証券	RAGB 4.85 03/15/26	16,000.000	22,074.880	
国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	106,000.000	166,433.780	
国債証券	ROMANI 6.5 06/18/18	83,000.000	97,855.340	
国債証券	RUSSIA 3.625 09/16/20	100,000.000	102,762.000	
国債証券	SLOREP 4.125 01/26/20	115,000.000	130,376.650	
国債証券	SLOREP 5.125 03/30/26	280,000.000	344,534.400	
国債証券	SPGB 5.9 07/30/26	144,000.000	194,018.400	
社債券	AIB 4.875 06/29/17	50,000.000	56,125.000	
社債券	BACRED 3.625 10/17/23	107,000.000	125,368.690	
社債券	C FL 02/10/19	5,000.000	5,001.750	
社債券	EIBKOR 2 04/30/20	160,000.000	167,024.000	
社債券	ENELIM 5.25 09/29/23	20,000.000	25,416.400	
社債券	HAA 2.375 12/13/22	300,000.000	312,900.000	
社債券	ISPIM 4.125 04/14/20	50,000.000	57,770.500	
社債券	MONTE 2.875 04/16/21	200,000.000	218,080.000	
社債券	MONTE 3.5 03/20/17	100,000.000	106,420.000	
社債券	NWIDE 6.75 07/22/20	50,000.000	62,200.000	
社債券	PSMGR 2.625 04/15/21	7,000.000	7,198.170	
社債券	SYMRIS 1.75 07/10/19	35,000.000	35,577.850	
社債券	TITIM 8.25 03/21/16	50,000.000	55,205.000	
社債券	VALEBZ 4.375 03/24/18	50,000.000	55,672.500	
社債券	VW FL PERPETUAL	8,000.000	8,575.920	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	61,587.500	
	小計(ユーロ)53銘柄	6,882,000.000	8,038,387.700 (1,115,085,142)	
	合計		1,646,512,174 (1,646,512,174)	

- (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 10銘柄	25.81%	27.23%
	社債券 1銘柄		
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	0.56%	0.60%
ロシア・ルーブル	国債証券 1銘柄	1.46%	1.54%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	2.76%	2.91%
ユーロ	国債証券 37銘柄	64.20%	67.72%
	社債券 16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](#)

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26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	97,694,226	79,537,259
コール・ローン	10,892,689	54,164,547
国債証券	417,476,597	366,610,705
特殊債券	1,246,986,796	1,211,036,531
未収入金	-	43,670,044
未収利息	15,850,944	16,824,242
前払費用	1,121,152	-
流動資産合計	1,790,022,404	1,771,843,328
資産合計	1,790,022,404	1,771,843,328
負債の部		
流動負債		
未払金	-	34,052,100
流動負債合計	-	34,052,100
負債合計	-	34,052,100
純資産の部		
元本等		
元本	1,364,341,479	1,262,166,614
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	425,680,925	475,624,614
元本等合計	1,790,022,404	1,737,791,228
純資産合計	1,790,022,404	1,737,791,228
負債純資産合計	1,790,022,404	1,771,843,328

[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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年3月27日現在	平成26年9月29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	1,582,971,086円	1,364,341,479円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	218,629,607円	102,174,865円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,364,341,479円	1,262,166,614円
合計	1,364,341,479円	1,262,166,614円
2. 受益権の総数	1,364,341,479口	1,262,166,614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26年3月28日 至 平成26年9月29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26年9月29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	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成26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	3,338,341
特殊債券	33,090,847
合計	36,429,188

「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26年3月27日まで）を指しております。

（平成26年9月29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	6,165,595
特殊債券	11,967,010
合計	18,132,605

「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26年3月28日から平成26年9月29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26年3月27日現在）

該当事項はありません。

（平成26年9月29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26年3月28日 至 平成26年9月29日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 1.3120円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,120円）」	1口当たり純資産額 1.3768円 「1口 = 1円（10,000口 = 13,768円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
オーストラリア・ドル	特殊債券	ASIA 3.5 07/25/18	6,200,000.000	6,247,120.000	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄		6,200,000.000	6,247,120.000 (597,349,615)	
香港・ドル	国債証券	HKGB 2.44 12/07/20	3,000,000.000	3,145,380.000	
	小計（香港・ドル）1銘柄		3,000,000.000	3,145,380.000 (44,318,404)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 2.5 06/01/19	500,000.000	522,760.000	
	小計（シンガポール・ドル）1銘柄		500,000.000	522,760.000 (44,858,036)	
ニュージーランド・ドル	特殊債券	EIB 7.5 12/15/17	2,300,000.000	2,513,877.000	
	特殊債券	IADB 6.25 12/15/17	3,500,000.000	3,703,525.000	
	特殊債券	NIB 4.875 01/22/19	900,000.000	914,346.000	
	小計（ニュージーランド・ドル）3銘柄		6,700,000.000	7,131,748.000 (613,686,916)	
韓国・ウォン	国債証券	NDFB 3.25 09/10/18	1,000,000,000.000	1,029,300,000.000	
	国債証券	NDFB 4.25 06/10/21	1,100,000,000.000	1,201,992,000.000	
	小計（韓国・ウォン）2銘柄		2,100,000,000.000	2,231,292,000.000 (233,170,014)	
マレーシア・リンギット	国債証券	MGS 4.262 09/15/16	1,300,000.000	1,323,296.000	
	小計（マレーシア・リンギット）1銘柄		1,300,000.000	1,323,296.000 (44,264,251)	
合計				1,577,647,236 (1,577,647,236)	

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

通貨	銘柄数	組入有価証券 時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
オーストラリア・ドル	特殊債券 1 銘柄	34.37%	37.86%
香港・ドル	国債証券 1 銘柄	2.55%	2.81%
シンガポール・ドル	国債証券 1 銘柄	2.58%	2.84%
ニュージーランド・ドル	特殊債券 3 銘柄	35.31%	38.90%
韓国・ウォン	国債証券 2 銘柄	13.42%	14.78%
マレーシア・リングgit	国債証券 1 銘柄	2.55%	2.81%

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](#)

コモディティ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	平成26年3月27日現在 金額（円）	平成26年9月29日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,030,112	2,804,362
社債券	957,763,484	809,329,250
未収利息	1,056,290	2,156,352
流動資産合計	961,849,886	814,289,964
資産合計	961,849,886	814,289,964
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	1,157,481,362
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	354,590,546	343,191,398
元本等合計	961,849,886	814,289,964
純資産合計	961,849,886	814,289,964
負債純資産合計	961,849,886	814,289,964

[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26年 3月28日 至 平成26年 9月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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26年 3月27日現在	平成26年 9月29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	1,316,440,432円	1,316,440,432円
期中追加設定元本額	-	-
期中一部解約元本額	-	158,959,070円
元本の内訳		
グローバル資産分散オープン	1,316,440,432円	1,157,481,362円
合計	1,316,440,432円	1,157,481,362円
2. 受益権の総数	1,316,440,432口	1,157,481,362口
3. 元本の欠損	354,590,546円	343,191,398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26年 3月28日 至 平成26年 9月29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26年 9月29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26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	30,959,039
合計	30,959,039

「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26年3月27日まで)を指しております。

(平成26年9月29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	94,828,165
合計	94,828,165

「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26年3月28日から平成26年9月29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26年3月27日現在)

該当事項はありません。

(平成26年9月29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26年3月28日 至 平成26年9月29日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成26年3月27日現在	平成26年9月29日現在
1口当たり純資産額 0.7306円 「1口 = 1円(10,000口 = 7,306円)」	1口当たり純資産額 0.7035円 「1口 = 1円(10,000口 = 7,035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 10/20/14	8,000,000.000	7,399,920.000	
	小計(アメリカ・ドル) 1銘柄		8,000,000.000	7,399,920.000 (809,329,250)	
合計				809,329,250 (809,329,250)	

(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](#)

(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2014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、2014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

2014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)	1,329,822,887	1,742,684,950	96,752,372
評価(損)益	201,866,164	107,522,409	2,720,731
有価証券(時価)	1,531,689,051	1,850,207,359	99,473,103
現金預金	54,006,293	144,957,571	2,052,453
未収配当金および未収利息	5,124,711	29,677,915	635,512
有価証券売却未収金	192,327	2,399,481	391,745
発行未収金	516,792	1,385,269	210,731
スワップ契約(時価)	-	6,812,163	-
為替予約取引に係る評価益	-	1,669,855	87,150
委託証拠金	-	-	170,266
スワップ契約に係る未収入金	-	130,760	-
先物取引に係る評価益	-	-	345
オプション(時価)	-	-	-
その他の資産	6,921	6,733	3,930
資産合計	1,591,536,095	2,037,247,106	103,025,235
負 債			
有価証券購入未払金	-	9,714,937	1,122,889
為替予約取引に係る評価損	-	16,265,524	-
未払運用報酬	1,351,546	638,576	459
買戻未払金	1,573,657	989,494	365,000
スワップ契約(時価)	-	3,039,214	-
銀行当座貸越	-	-	-
外国税引当金	200,938	-	-
先物取引に係る評価損	-	-	17,539
オプション(時価)	-	27,750	-

委託証拠金	-	498	-
その他の負債	415,705	1,635,834	59,778
負債合計	3,541,846	32,311,827	1,565,665
純資産	1,587,994,249	2,004,935,279	101,459,570

添付の注記は、当財務諸表と不可分のものである。

2014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	181,240,860	333,361,916	-
発行済投資証券口数	7,432,971	12,900,072	-
一口当たり純資産額	24.38	25.84	-
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Ad			
純資産	4,576,271	113,452,200	-
発行済投資証券口数	469,984	8,519,691	-
一口当たり純資産額	9.74	13.32	-
一口当たり公表配当金	0.0287	0.3319	-
クラスAh(EUR)			
純資産(基準通貨)	-	674,104,019	-
純資産(クラス通貨)	-	EUR 493,350,341	-
発行済投資証券口数	-	22,582,648	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	EUR 21.85	-
クラスAh(NOK)			
純資産(基準通貨)	-	161,040,918	-
純資産(クラス通貨)	-	NOK 990,003,874	-
発行済投資証券口数	-	4,993,693	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	NOK 198.25	-
クラスAh(SEK)			
純資産(基準通貨)	-	113,794,879	-
純資産(クラス通貨)	-	SEK 763,264,360	-
発行済投資証券口数	-	6,190,168	-
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	SEK 123.30	-
クラスI			
純資産	1,369,214,108	403,979,562	1,362,877
発行済投資証券口数	45,114,148	14,812,786	123,415
一口当たり純資産額	30.35	27.27	11.04
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)	-	-	24,822,643
純資産(クラス通貨)	-	-	EUR 18,166,720
発行済投資証券口数	-	-	1,609,156
一口当たり純資産額(クラス通貨)	-	-	EUR 11.29
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	8,240,818	74,699,104	75,274,050
発行済投資証券口数	1,074,530	7,035,249	6,901,321
一口当たり純資産額	7.67	10.62	10.91
一口当たり公表配当金	0.0565	0.3318	0.0971
クラスQ			
純資産	16,477,212	86,388,357	-
発行済投資証券口数	1,629,442	7,684,953	-
一口当たり純資産額	10.11	11.24	-
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Q(GBP)			
純資産(基準通貨)	8,244,980	-	-
純資産(クラス通貨)	GBP 4,834,772	-	-
発行済投資証券口数	458,008	-	-
一口当たり純資産額	GBP 10.56	-	-
クラスQh(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S			
純資産	-	-	-
発行済投資証券口数	-	-	-
一口当たり純資産額	-	-	-
クラスSD			
純資産	-	5,207	-
発行済投資証券口数	-	511	-
一口当たり純資産額	-	10.20	-
一口当たり公表配当金	-	0.217085	-
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	-	44,109,117	-
発行済投資証券口数	-	1,425,925	-
一口当たり純資産額	-	30.93	-

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

2014年6月30日に終了した年度（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）	3,976	59,800,248	1,755,870
受取配当金（源泉税控除後）	15,486,813	617,261	-
スワップに係る利息	-	1,726,500	-
収益合計	15,490,789	62,144,009	1,755,870
費用			
運用報酬	7,133,987	9,048,138	59,417
カストディーフィー	185,270	125,168	6,190
管理会社報酬	166,422	240,358	39,099
年次税	103,018	382,072	4,994
専門家報酬	100,188	233,771	15,688
スワップに係る利息	-	50,011	652
支払利息	-	631	26
その他の費用	9,840	12,976	-
費用合計	7,698,725	10,093,125	126,066
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	7,792,064	52,050,884	1,629,804
運用会社により免除または負担された費用	26,334	29,418	25,118
投資（損）益	7,818,398	52,080,302	1,654,922
実現（損）益の内訳：			
スイング・プライシング	400,846	803,294	2,004
有価証券（外国税控除後）	1,643,819	26,287,300	306,442
為替予約取引	70,505	14,579,426	33,312
先物取引	-	(1,023)	(172,002)
オプション	-	62,637	(6,750)
スワップ	-	(3,776,141)	(2,545)
外貨取引	(80,919)	1,835,823	(106,467)
外国税引当金の変動	-	-	-
実現（損）益計	2,034,251	39,791,316	53,994
評価（損）益の内訳：			
有価証券（外国税控除後）	89,120,364	20,733,709	2,765,059
為替予約取引	-	(27,178,915)	(66,778)
先物取引	-	-	(167,300)
オプション	-	(20,250)	-
スワップ	-	4,232,722	-
外貨建のその他の資産および負債	41,528	(61,990)	(14)

評価(損)益計	89,161,892	(2,294,724)	2,530,967
運用による純資産の純増(減)額	99,014,541	89,576,894	4,239,883
分配金:			
分配による純資産の減少額	(84,691)	(5,277,514)	(1,255,421)
資本取引:			
投資証券発行受領額	215,068,830	421,144,455	10,067,270
投資証券買戻支払額	(145,845,267)	(530,289,575)	(25,352,549)
資本取引による純資産の純増(減)額	69,223,563	(109,145,120)	(15,285,279)
純資産の増(減)額 合計	168,153,413	(24,845,740)	(12,300,817)
期首現在純資産	1,419,840,836	2,029,781,019	113,760,387
換算調整	-	-	-
期末現在純資産	1,587,994,249	2,004,935,279	101,459,570

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

2014年6月30日に終了した年度(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	2,899,555	9,710,316	-
発行投資証券口数	6,071,629	6,039,423	-
買戻投資証券口数	(1,538,213)	(2,849,667)	-
期末現在発行済投資証券	7,432,971	12,900,072	-
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	3,011,017	7,322,701	-
発行投資証券口数	10,712	2,628,299	-
買戻投資証券口数	(2,551,745)	(1,431,309)	-
期末現在発行済投資証券	469,984	8,519,691	-
クラスAh(EUR)			
期首現在発行済投資証券	-	23,090,802	-
発行投資証券口数	-	1,209,574	-
買戻投資証券口数	-	(1,717,728)	-
期末現在発行済投資証券	-	22,582,648	-

クラスAh (NOK)			
期首現在発行済投資証券	-	4,436,197	-
発行投資証券口数	-	830,493	-
買戻投資証券口数	-	(272,997)	-
期末現在発行済投資証券	-	4,993,693	-
クラスAh (SEK)			
期首現在発行済投資証券	-	5,566,666	-
発行投資証券口数	-	3,275,049	-
買戻投資証券口数	-	(2,651,547)	-
期末現在発行済投資証券	-	6,190,168	-
クラスI			
期首現在発行済投資証券	45,962,321	25,184,269	465,179
発行投資証券口数	2,274,737	1,774,491	86,576
買戻投資証券口数	(3,122,910)	(12,145,974)	(428,340)
期末現在発行済投資証券	45,114,148	14,812,786	123,415
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	-	-	2,062,372
発行投資証券口数	-	-	518,404
買戻投資証券口数	-	-	(971,620)
期末現在発行済投資証券	-	-	1,609,156
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	-	-	-
クラスJ			
期首現在発行済投資証券	-	-	-
発行投資証券口数	-	-	-
買戻投資証券口数	-	-	-
期末現在発行済投資証券	-	-	-
クラスJd			
期首現在発行済投資証券	1,257,792	7,465,788	7,337,144
発行投資証券口数	9,770	229,527	116,463
買戻投資証券口数	(193,032)	(660,066)	(552,286)
期末現在発行済投資証券	1,074,530	7,035,249	6,901,321

クラスQ			
期首現在発行済投資証券	1,342,268	3,011,450	-
発行投資証券口数	459,094	5,351,054	-
買戻投資証券口数	(171,920)	(677,551)	-
期末現在発行済投資証券	1,629,442	7,684,953	-
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	434,815	-	-
発行投資証券口数	23,193	-	-
買戻投資証券口数	-	-	-
期末現在発行済投資証券	458,008	-	-
クラスQh (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Sd			
期首現在発行済投資証券	-	-	-
発行投資証券口数	-	511	-
買戻投資証券口数	-	-	-
期末現在発行済投資証券	-	511	-
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	-	1,301,272	-
発行投資証券口数	-	124,653	-
買戻投資証券口数	-	-	-
期末現在発行済投資証券	-	1,425,925	-

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：			
2014年 6月30日	24.38	25.84	-
2013年12月31日	22.79	24.56	-
2012年12月31日	23.96	22.85	-
以下の時点のクラスA(EUR)証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	9.74	13.32	-
2013年12月31日	9.13	12.98	-
2012年12月31日	9.65	12.73	-
以下の時点のクラスAh(EUR)証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	EUR 21.85	-
2013年12月31日	-	EUR 20.76	-
2012年12月31日	-	EUR 19.36	-
以下の時点のクラスAh(NOK)証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	NOK 198.25	-
2013年12月31日	-	NOK 187.23	-
2012年12月31日	-	NOK 172.03	-
以下の時点のクラスAh(SEK)証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	SEK 123.30	-
2013年12月31日	-	SEK 116.82	-
2012年12月31日	-	SEK 108.13	-
以下の時点のクラスI証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	30.35	27.27	11.04
2013年12月31日	28.23	25.84	10.62
2012年12月31日	29.39	23.90	10.84
以下の時点のクラスId証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	EUR 11.29
2013年12月31日	-	-	EUR 10.85
2012年12月31日	-	-	EUR 11.08
以下の時点のクラスIh(USD)証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	7.67	10.62	10.91
2013年12月31日	7.15	10.35	10.63
2012年12月31日	7.51	10.15	11.15
以下の時点のクラスQ証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	10.11	11.24	-
2013年12月31日	9.41	10.66	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	GBP 10.56	-	-
2013年12月31日	GBP 10.12	-	-
2012年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスQh (GBP) 証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012年12月31日	-	-	-
以下の時点のクラスSd証券一口当たり純資産額：			
2014年 6月30日	-	10.20	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	-	-
2013年12月31日	-	-	-
2012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：			
2014年 6月30日	-	30.93	-
2013年12月31日	-	29.22	-
2012年12月31日	-	26.84	-
以下の時点の純資産：			
2014年 6月30日	1,587,994,249	2,004,935,279	101,459,570
2013年12月31日	1,419,840,836	2,029,781,019	113,760,387
2012年12月31日	1,117,874,697	2,125,693,052	119,791,246

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

2014年6月30日現在(未監査)

銘柄名	通貨	株数	評価額 (米ドル)	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				
アルゼンチン				
MercadoLibre	USD	52,400	4,961,232	0.31
アルゼンチン 計			4,961,232	0.31
ブラジル				
BM&F BOVESPA	BRL	1,425,762	7,540,772	0.48
BR Malls Participacoes	BRL	3,299,500	28,047,097	1.77
BRF	BRL	292,112	6,973,535	0.44
CCR	BRL	1,052,900	8,606,213	0.54
Lojas Renner	BRL	1,182,800	38,146,185	2.40
Natura Cosméticos	BRL	351,400	6,002,778	0.38
Petroleo Brasileiro ADR	USD	1,241,200	19,362,720	1.22
Petroleo Brasileiro ADR	USD	799,400	11,631,270	0.73
Raia Drogasil	BRL	963,600	7,985,563	0.50
Usinas Siderurgicas de Minas Gerais	BRL	76,900	235,800	0.01
ブラジル 計			134,531,933	8.47
チリ				
Banco Santander (Chile) ADR	USD	232,443	6,143,468	0.39
SACI Falabella	CLP	861,283	7,792,412	0.49
チリ 計			13,935,880	0.88
中国				
58.com ADR	USD	93,500	5,088,270	0.32
Baidu ADR	USD	219,900	41,079,519	2.59
Bank of China H-shares	HKD	22,538,100	10,091,011	0.63
China Longyuan Power Group H-shares	HKD	8,593,000	9,324,334	0.59
China National Building Material H-shares	HKD	8,638,000	7,612,723	0.48
China Shanshui Cement Group	HKD	16,272,000	5,732,064	0.36
China Vanke A-shares ¹	CNY	2,619,883	3,487,131	0.22
China Vanke H-shares	HKD	1,948,750	3,459,729	0.22
Dongfeng Motor Group H-shares	HKD	7,422,000	13,292,404	0.84
Huaneng Power International H-shares	HKD	5,390,000	6,085,521	0.38
Huaneng Renewables H-shares	HKD	21,120,000	6,979,517	0.44
Industrial & Commercial Bank of China H-shares	HKD	24,064,445	15,214,940	0.96

Ping An Insurance Group of China A-shares ¹	CNY	804,700	5,094,727	0.32
Ping An Insurance Group of China H-shares	HKD	2,215,800	17,155,079	1.08
Shimao Property Holdings	HKD	1,438,000	2,642,788	0.17
Sina	USD	112,400	5,531,204	0.35
Tencent Holdings	HKD	2,819,600	43,029,722	2.71
Vipshop Holdings ADR	USD	29,300	5,498,438	0.34
Want Want China Holdings	HKD	8,718,000	12,531,034	0.79
中国 計			218,930,155	13.79
香港				
AIA Group	HKD	5,641,000	28,353,920	1.78
ASM Pacific Technology	HKD	334,100	3,651,222	0.23
Beijing Enterprises Holdings	HKD	3,103,500	29,373,802	1.85
China Gas Holdings	HKD	2,902,000	6,021,170	0.38
China Unicom	HKD	9,658,000	14,928,638	0.94
CNOOC	HKD	13,690,000	24,588,073	1.55
香港 計			106,916,825	6.73
インド				
Adani Ports and Special Economic Zone	INR	3,076,205	12,480,605	0.79
Axis Bank	INR	391,513	12,681,934	0.80
Bharti Airtel	INR	1,694,408	9,504,694	0.60
Container of India	INR	446,654	8,953,314	0.56
Housing Development Finance	INR	1,327,107	21,929,242	1.38
ICICI Bank	INR	871,607	20,578,052	1.30
Infosys	INR	524,798	28,442,880	1.79
Jaiprakash Associates	INR	3,878,287	4,985,428	0.31
Maruti Suzuki India	INR	247,744	10,084,015	0.64
Power Grid of India	INR	3,575,326	8,284,898	0.52
Tata Consultancy Services	INR	86,901	3,509,092	0.22
Tata Motors	INR	1,380,575	9,913,021	0.62
インド 計			151,347,175	9.53
インドネシア				
Astra International	IDR	21,370,600	13,123,572	0.83
Bank Central Asia	IDR	3,825,500	3,550,615	0.22
Bank Mandiri	IDR	16,199,783	13,298,029	0.84
XL Axiata	IDR	13,233,000	5,692,699	0.36
インドネシア 計			35,664,915	2.25
クウェート				
National Bank of Kuwait	KWD	1,722,016	5,864,262	0.37

クウェート 計			5,864,262	0.37
ルクセンブルグ				
Tenaris ADR	USD	273,500	12,854,500	0.81
ルクセンブルグ 計			12,854,500	0.81
マカオ				
Wynn Macau	HKD	1,532,000	6,010,013	0.38
マカオ 計			6,010,013	0.38
マレーシア				
Astro Malaysia Holdings	MYR	6,422,200	7,020,233	0.44
CIMB Group Holdings	MYR	5,202,808	11,863,795	0.75
マレーシア 計			18,884,028	1.19
メキシコ				
Fresnillo	GBP	511,942	7,521,242	0.47
Grupo Financiero Banorte Class O	MXN	1,769,800	12,688,308	0.80
Grupo Financiero Santander Mexico ADR Class B	USD	459,800	6,083,154	0.38
Wal-Mart de Mexico (Series V)	MXN	11,578,940	30,753,979	1.94
メキシコ 計			57,046,683	3.59
オランダ				
Yandex Class A	USD	401,100	14,231,028	0.90
オランダ 計			14,231,028	0.90
フィリピン				
GT Capital Holdings	PHP	434,450	8,653,419	0.55
SM Investments	PHP	823,212	15,379,162	0.97
Universal Robina	PHP	4,020,970	14,204,625	0.89
フィリピン 計			38,237,206	2.41
カタール				
Qatar National Bank	QAR	288,081	12,921,943	0.81
カタール 計			12,921,943	0.81
ロシア				
Lukoil ADR	USD	7,799	466,224	0.03
Lukoil ADR	USD	90,880	5,432,806	0.34
Magnit GDR	USD	691,656	40,842,287	2.57
NovaTek GDR	USD	44,133	5,501,178	0.35
Sberbank of Russia ADR	USD	2,777,777	27,986,103	1.76
Sberbank of Russia ADR	USD	436,708	4,402,017	0.28
ロシア 計			84,630,615	5.33

南アフリカ

Aspen Pharmacare Holdings	ZAR	613,687	17,290,810	1.09
FirstRand	ZAR	820,059	3,133,211	0.20
Sanlam	ZAR	2,115,993	12,321,295	0.78
Shoprite Holdings	ZAR	1,685,864	24,382,856	1.53
Truworths International	ZAR	671,945	4,744,616	0.30
Woolworths Holdings	ZAR	2,528,061	18,598,632	1.17

南アフリカ 計			80,471,420	5.07
----------------	--	--	-------------------	-------------

韓国

Hana Financial Group	KRW	195,965	7,262,159	0.46
Hyundai Glovis	KRW	34,455	9,178,746	0.58
Hyundai Mobis	KRW	30,514	8,563,765	0.54
Hyundai Motor	KRW	150,766	34,192,870	2.15
KEPCO Plant Service & Engineering	KRW	46,716	3,194,481	0.20
LG Household & Health Care	KRW	46,057	20,731,092	1.30
NAVER	KRW	21,899	18,072,362	1.14
Samsung Electronics	KRW	42,278	55,231,808	3.48
Shinhan Financial Group	KRW	167,929	7,774,650	0.49
SK Hynix	KRW	284,051	13,628,704	0.86

韓国 計			177,830,637	11.20
-------------	--	--	--------------------	--------------

スイス

Compagnie Financière Richemont	ZAR	1,932,154	20,315,180	1.28
--------------------------------	-----	-----------	------------	------

スイス 計			20,315,180	1.28
--------------	--	--	-------------------	-------------

台湾

Catcher Technology	TWD	1,830,000	17,066,224	1.08
China Life Insurance	TWD	6,897,000	6,362,525	0.40
Far EasTone Telecommunications	TWD	3,769,000	8,583,834	0.54
Quanta Computer	TWD	4,608,000	13,424,016	0.85
Taiwan Semiconductor Manufacturing	TWD	14,297,050	60,561,284	3.81
Uni-President Enterprises	TWD	14,810,042	26,590,599	1.67

台湾 計			132,588,482	8.35
-------------	--	--	--------------------	-------------

タイ

Bangkok Bank	THB	1,863,300	11,087,330	0.70
CP ALL (Foreign)	THB	3,947,300	5,840,641	0.36
Kasikornbank	THB	2,774,500	17,448,773	1.10
Siam Cement	THB	512,100	7,136,101	0.45

タイ 計			41,512,845	2.61
-------------	--	--	-------------------	-------------

トルコ				
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii	TRY	423,095	5,173,066	0.33
BIM Birlesik Magazalar	TRY	820,119	18,895,505	1.19
Turkiye Garanti Bankasi	TRY	1,952,043	7,642,988	0.48
Turkiye Halk Bankasi	TRY	770,687	5,773,616	0.36
トルコ 計			37,485,175	2.36
アラブ首長国連邦				
DP World	USD	637,495	12,558,652	0.79
Emaar Properties	AED	2,788,744	6,385,683	0.40
First Gulf Bank	AED	728,927	3,155,614	0.20
アラブ首長国連邦 計			22,099,949	1.39
イギリス				
SABMiller	ZAR	540,009	31,305,990	1.97
Tullow Oil	GBP	535,398	7,797,370	0.49
イギリス 計			39,103,360	2.46
アメリカ				
Southern Copper	USD	253,400	7,553,854	0.47
アメリカ 計			7,553,854	0.47
優先株式				
ブラジル				
Banco Bradesco pref stk	BRL	1,098,999	16,226,262	1.02
Itau Unibanco Holding pref stk	BRL	2,725,314	39,533,494	2.49
ブラジル 計			55,759,756	3.51
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			1,531,689,051	96.45
有価証券 計			1,531,689,051	96.45
その他資産（負債控除後）			56,305,198	3.55
純資産			1,587,994,249	100.00

1：中国A株は制限を受けることがある。2014年6月30日現在で保有する中国A株の評価額は 8,581,858米ドル、対純資産比率0.54%である（詳細は注記3b参照）。

AED: アラブ首長国連邦・

BRL: ブラジル・リアル

CLP: チリ・ペソ

CNY: 中国・人民元

GBP:	イギリス・ポンド
HKD:	香港・ドル
IDR:	インドネシア・ルピア
INR:	インド・ルピー
KRW:	韓国・ウォン
KWD:	クウェート・ディナール
MXN:	メキシコ・ペソ
MYR:	マレーシア・リンギット
PHP:	フィリピン・ペソ
QAR:	カタール・リアル
THB:	タイ・バーツ
TRY:	トルコ・リラ
TWD:	台湾・ドル
USD:	米ドル
ZAR:	南アフリカ・ランド

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

2014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 (米ドル)	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				
アルゼンチン				
YPF SerRegS 8.75%/2024	USD	1,035,000	1,079,044	0.05
アルゼンチン 計			1,079,044	0.05
オーストリア				
ESAL SerRegS 6.25%/2023	USD	5,705,000	5,606,389	0.28
JBS Investments SerRegS 7.75%/2020	USD	1,520,000	1,632,465	0.08
Wienerberger VR 6.5%/2049	EUR	1,000,000	1,422,402	0.07
オーストリア 計			8,661,256	0.43
バミューダ				
Pacnet SerRegS 9%/2018	USD	200,000	217,689	0.01
バミューダ 計			217,689	0.01
イギリス領バージン諸島				
Studio City Finance SerRegS 8.5%/2020	USD	3,200,000	3,562,400	0.18
イギリス領バージン諸島 計			3,562,400	0.18
カナダ				
First Quantum Minerals SerRegS 7.25%/2022	USD	3,425,000	3,570,562	0.18
カナダ 計			3,570,562	0.18
ケイマン諸島				
Brakes Capital SerRegS 7.125%/2018	GBP	1,875,000	3,282,586	0.17
Mizzen Bondco SerRegS 7%/2021	GBP	2,100,000	3,647,721	0.18
ケイマン諸島 計			6,930,307	0.35
クロアチア				
Agrokor SerRegS 9.125%/2020	EUR	1,600,000	2,483,281	0.12
クロアチア 計			2,483,281	0.12
チェコ共和国				
RPG Byty SerRegS 6.75%/2020	EUR	2,800,000	4,007,669	0.20

チェコ共和国 計			4,007,669	0.20
フランス				
Europcar Groupe SerRegS 11.5%/2017	EUR	2,275,000	3,585,594	0.18
Holding Medi-Partenaires SAS SerRegS 7%/2020	EUR	2,950,000	4,344,681	0.22
Numericable Group SerRegS 4.875%/2019	USD	4,375,000	4,489,428	0.22
Numericable Group SerRegS 6.25%/2024	USD	4,215,000	4,409,796	0.22
フランス 計			16,829,499	0.84
ドイツ				
Deutsche Raststaetten Gruppe IV SerRegS 6.75%/2020	EUR	875,000	1,287,487	0.07
Faenza SerRegS 8.25%/2021	EUR	2,725,000	4,143,402	0.21
KraussMaffei Group SerRegS 8.75%/2020	EUR	2,625,000	4,041,475	0.20
Pfleiderer Ser144A 7.875%/2019	EUR	1,025,000	1,393,201	0.07
Safari Holding Verwaltungs SerRegS 8.25%/2021	EUR	1,925,000	2,824,567	0.14
Techem SerRegS 6.125%/2019	EUR	575,000	852,360	0.04
Trionista Holdco SerRegS 5%/2020	EUR	475,000	681,138	0.03
Unitymedia KabelBW SerRegS 9.5%/2021	EUR	4,000,000	6,258,457	0.31
WEPA Hygieneprodukte SerRegS 6.5%/2020	EUR	825,000	1,232,556	0.06
ドイツ 計			22,714,643	1.13
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance SerRegS 6.25%/2019	USD	575,000	592,250	0.03
Vimpel Communications SerRegS 7.748%/2021	USD	4,000,000	4,385,280	0.22
アイルランド 計			4,977,530	0.25
イタリア				
Cerved Group SerRegS 6.375%/2020	EUR	975,000	1,446,765	0.07
Telecom Italia SerEMTN 6.375%/2019	GBP	3,450,000	6,422,971	0.32
UniCredit SerRegs VR 8%/2049	USD	1,800,000	1,924,884	0.10
イタリア 計			9,794,620	0.49
日本				
SoftBank com stk	JPY	30,900	2,299,173	0.12
日本 計			2,299,173	0.12
ルクセンブルグ				
Aguila 3 SerRegS 7.875%/2018	CHF	2,175,000	2,590,964	0.13
Altice com stk	EUR	27,518	1,912,714	0.10
Altice Financing SerRegS 6.5%/2022	USD	6,400,000	6,799,680	0.34

Altice Finco SerRegS 8.125%/2024	USD	625,000	692,197	0.03
Altice Finco SerRegS 9%/2023	EUR	3,350,000	5,319,502	0.27
Altice Finco SerRegS 9.875%/2020	USD	3,800,000	4,392,097	0.22
Altice SerRegS 7.75%/2022	USD	7,500,000	8,005,950	0.40
ArcelorMittal 10.35%/2019	USD	2,850,000	3,645,250	0.18
ArcelorMittal 5.75%/2020	USD	550,000	590,213	0.03
ArcelorMittal 6%/2021	USD	3,250,000	3,518,986	0.18
ArcelorMittal 6.75%/2022	USD	4,825,000	5,419,271	0.27
Bormioli Rocco Holdings SerRegS 10%/2018	EUR	2,800,000	4,108,136	0.21
Cirsa Funding Luxembourg SerRegS 8.75%/2018	EUR	2,100,000	2,989,195	0.15
Elior Finance SerRegS 6.5%/2020	EUR	471,250	715,345	0.04
Gategroup Finance Luxembourg SerRegS 6.75%/2019	EUR	725,000	1,058,384	0.05
Gestamp Funding Luxembourg SerRegS 5.625%/2020	USD	1,775,000	1,856,588	0.09
Gestamp Funding Luxembourg SerRegS 5.875%/2020	EUR	1,200,000	1,755,883	0.09
Intralot Finance Luxembourg SerRegS 9.75%/2018	EUR	1,075,000	1,697,207	0.08
Magnolia SerRegS 9%/2020	EUR	1,600,000	2,335,613	0.12
Matterhorn Financing & CY SerRegS 9%/2019	EUR	3,175,000	4,488,273	0.22
Matterhorn Midco & Cy SerRegS 7.75%/2020	EUR	3,725,000	5,454,803	0.27
Matterhorn Mobile SerRegS 6.75%/2019	CHF	1,900,000	2,285,685	0.11
MHP SerRegS 8.25%/2020	USD	2,055,000	1,882,678	0.09
Millicom International Cellular SerRegS 6.625%/2021	USD	1,200,000	1,301,772	0.06
Mobile Challenger Intermediate Group SerRegS 8.75%/2019	CHF	2,600,000	3,008,738	0.15
Sberbank of Russia SerRegS 5.125%/2022	USD	3,125,000	2,986,141	0.15
Sberbank of Russia SerRegS VR 5.5%/2024	USD	2,050,000	2,014,361	0.10
Sunrise Communications Holdings SerRegS 8.5%/2018	EUR	3,950,000	5,760,352	0.29
Sunrise Communications International SerRegS 7%/2017	EUR	700,000	1,008,665	0.05
Wind Acquisition Finance SerRegS 4.75%/2020	USD	4,025,000	4,059,857	0.20
Wind Acquisition Finance SerRegS 6.5%/2020	USD	3,100,000	3,376,179	0.17
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.25%/2018	USD	1,775,000	1,876,175	0.09
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.375%/2021	USD	5,950,000	6,402,111	0.32
ルクセンブルグ 計			105,308,965	5.25
メキシコ				
Cemex SerRegS 7.25%/2021	USD	7,025,000	7,738,810	0.39
メキシコ 計			7,738,810	0.39
オランダ				

Adria Bidco SerRegS 7.875%/2020	EUR	2,075,000	3,081,876	0.15
Bite Finance International SerRegS VR 7.835%/2018	EUR	3,475,000	4,823,880	0.24
Cable Communications Systems SerRegS 7.5%/2020	EUR	4,025,000	6,063,451	0.30
Constellium SerRegS 5.75%/2024	USD	2,350,000	2,470,438	0.12
Frigoglass Finance SerRegS 8.25%/2018	EUR	3,750,000	5,446,399	0.27
InterXion Holding SerRegS 6%/2020	EUR	925,000	1,349,828	0.07
OI European Group SerRegS 6.75%/2020	EUR	1,075,000	1,734,759	0.09
Polish Television Holding SerRegS 11%/2021	EUR	2,075,000	3,464,435	0.17
PortAventura Entertainment Barcelona SerRegS 7.25%/2020	EUR	550,000	793,282	0.04
UPC Holding SerRegS 6.75%/2023	CHF	1,900,000	2,379,139	0.12
UPC Holding SerRegS 6.75%/2023	EUR	3,625,000	5,489,526	0.27
VimpelCom Holdings SerRegS 5.2%/2019	USD	1,675,000	1,682,630	0.09
Ziggo SerRegS 8%/2018	EUR	3,300,000	5,023,875	0.25
オランダ 計			43,803,518	2.18
ノルウェー				
Albain Bidco Norway SerRegS 6.75%/2020	EUR	2,650,000	3,796,937	0.19
ノルウェー 計			3,796,937	0.19
スウェーデン				
Ciech Group Financing SerRegS 9.5%/2019	EUR	2,550,000	3,985,638	0.20
Norcell Sweden Holding 2 SerRegS 10.75%/2019	EUR	2,425,000	3,769,024	0.19
TVN Finance III SerRegS 7.375%/2020	EUR	1,250,000	1,937,441	0.09
スウェーデン 計			9,692,103	0.48
イギリス				
Arqiva Broadcast Finance SerRegS 9.5%/2020	GBP	6,000,000	11,739,698	0.59
Equiniti Newco 2 SerRegS 7.125%/2018	GBP	550,000	981,960	0.05
Infinis SerRegS 7%/2019	GBP	2,075,000	3,838,144	0.19
Kerling SerRegS 10.625%/2017	EUR	1,975,000	2,872,593	0.14
Liberty Global Class A com stk	USD	52,300	2,305,384	0.11
Liberty Global Class C com stk	USD	22,800	964,440	0.05
Matalan Finance SerRegS 6.875%/2019	GBP	2,350,000	3,996,632	0.20
Moy Park Bondco SerRegS 6.25%/2021	GBP	1,775,000	2,979,079	0.15
New Look Bondco I SerRegS 8.375%/2018	USD	2,250,000	2,415,791	0.12
New Look Bondco I SerRegS 8.75%/2018	GBP	2,200,000	4,033,640	0.20
Premier Foods Finance SerRegS 6.5%/2021	GBP	450,000	778,880	0.04
Priory Group No 3 SerRegS 7%/2018	GBP	800,000	1,440,148	0.07
R&R Pik SerRegS 9.25%/2018	EUR	2,525,000	3,545,971	0.18

Rexam SerRegS VR 6.75%/2067	EUR	1,925,000	2,787,901	0.14
Towergate Finance SerRegS 10.5%/2019	GBP	2,700,000	4,513,093	0.23
Towergate Finance SerRegS 8.5%/2018	GBP	1,175,000	2,046,277	0.10
Vedanta Resources SerRegS 6%/2019	USD	2,825,000	2,933,536	0.15
Vedanta Resources SerRegS 8.25%/2021	USD	2,200,000	2,488,794	0.12
Vougeot Bidco SerRegS 7.875%/2020	GBP	625,000	1,161,541	0.06
Voyage Care Bondco SerRegS 6.5%/2018	GBP	500,000	895,965	0.04
イギリス 計			58,719,467	2.93
アメリカ				
AES 5.5%/2024	USD	4,075,000	4,199,267	0.21
AK Steel 8.375%/2022	USD	3,725,000	3,926,690	0.19
Ally Financial 5.5%/2017	USD	3,400,000	3,691,431	0.18
Ally Financial pref stk 8.50%	USD	13,475	371,371	0.02
American Axle & Manufacturing 6.25%/2021	USD	150,000	161,838	0.01
American Axle & Manufacturing 6.625%/2022	USD	4,250,000	4,657,724	0.23
American International Group warrants/19/01/2021	USD	51,500	1,348,270	0.07
American Tower SerA CV 5.25%/2017	USD	12,240	1,293,034	0.06
AmeriGas Finance 7%/2022	USD	2,525,000	2,806,563	0.14
Ares Capital com stk	USD	108,725	1,921,171	0.09
Atwood Oceanics 6.5%/2020	USD	1,875,000	2,010,937	0.10
Bank of America warrants/16/01/2019	USD	113,900	791,605	0.04
Bill Barrett 7%/2022	USD	6,000,000	6,364,080	0.32
Bill Barrett 7.625%/2019	USD	6,575,000	7,118,917	0.35
CBRE Services 5%/2023	USD	6,000,000	6,062,340	0.30
Celanese US Holdings 4.625%/2022	USD	6,500,000	6,583,882	0.33
Cemex Finance SerRegS 9.375%/2022	USD	3,690,000	4,347,872	0.22
CenturyLink SerS 6.45%/2021	USD	2,225,000	2,416,461	0.12
CenturyLink SerV 5.625%/2020	USD	7,225,000	7,672,697	0.38
Charter Communications Class A com stk	USD	15,000	2,346,450	0.12
Chesapeake Energy 5.75%/2023	USD	9,075,000	10,131,285	0.50
CIT Group 5%/2022	USD	10,575,000	11,002,706	0.55
CIT Group 5%/2023	USD	1,100,000	1,127,077	0.06
CIT Group 5.25%/2018	USD	3,525,000	3,797,676	0.19
CIT Group 5.375%/2020	USD	2,900,000	3,125,330	0.16
CMS Energy 5.05%/2022	USD	1,875,000	2,120,625	0.11
Community Health Systems 7.125%/2020	USD	3,875,000	4,218,790	0.21
Concho Resources 5.5%/2023	USD	11,600,000	12,557,000	0.63
Concho Resources 7%/2021	USD	1,275,000	1,409,570	0.07
Crown Castle International SerA 4.5%/2016	USD	41,650	4,223,102	0.21
Dana Holding 5.375%/2021	USD	3,625,000	3,806,159	0.19

Denbury Resources 5.5%/2022	USD	3,725,000	3,824,681	0.19
Discover Financial Services 10.25%/2019	USD	3,700,000	4,790,216	0.24
El Paso SerMTN 8.25%/2016	USD	165,000	181,500	0.01
General Motors com stk	USD	107,278	3,932,811	0.20
Graphic Packaging International 4.75%/2021	USD	1,775,000	1,826,031	0.09
Greif 7.75%/2019	USD	450,000	519,750	0.03
HCA Holdings 6.25%/2021	USD	6,475,000	6,967,100	0.35
Howard Hughes com stk	USD	18,000	2,813,580	0.14
iStar Financial 7.125%/2018	USD	2,900,000	3,237,444	0.16
JPMorgan Chase & Co warrants/28/10/2018	USD	93,050	1,785,629	0.09
KB Home 8%/2020	USD	3,550,000	4,073,909	0.20
Lands' End com stk	USD	1,375	46,887	0.00
Laredo Petroleum 5.625%/2022	USD	3,125,000	3,226,562	0.16
Manitowoc 5.875%/2022	USD	1,225,000	1,338,674	0.07
Manitowoc 8.5%/2020	USD	3,300,000	3,692,848	0.18
MarkWest Energy Partners 4.5%/2023	USD	8,400,000	8,577,576	0.43
Masonite International com stk	USD	48,900	2,713,950	0.13
MGM Resorts International 6.625%/2021	USD	4,325,000	4,828,495	0.24
MPT Operating Partnership 6.375%/2022	USD	2,050,000	2,208,875	0.11
Navistar International 8.25%/2021	USD	1,850,000	1,936,580	0.10
Newfield Exploration 5.75%/2022	USD	3,350,000	3,721,950	0.18
Range Resources 5%/2022	USD	1,375,000	1,464,595	0.07
Range Resources com stk	USD	20,712	1,780,611	0.09
Regal Entertainment Group 5.75%/2022	USD	10,850,000	11,248,846	0.56
Reynolds Group Issuer 5.75%/2020	USD	1,375,000	1,451,402	0.07
Reynolds Group Issuer 9%/2019	USD	7,250,000	7,691,525	0.38
Reynolds Group Issuer 9.875%/2019	USD	2,250,000	2,489,220	0.12
Rite Aid 7.7%/2027	USD	3,650,000	4,085,938	0.20
Sears Holdings com stk	USD	44,800	1,719,424	0.09
Springleaf Finance SerMTN 6.9%/2017	USD	1,775,000	1,966,310	0.10
Swift Energy 8.875%/2020	USD	875,000	934,154	0.05
Synovus Financial 5.125%/2017	USD	9,225,000	9,654,977	0.48
Synovus Financial 7.875%/2019	USD	2,725,000	3,128,041	0.16
Terex 6%/2021	USD	5,500,000	5,920,695	0.30
Terex 6.5%/2020	USD	1,775,000	1,933,756	0.10
Tesoro 5.125%/2024	USD	3,900,000	3,948,478	0.20
Time Warner Cable com stk	USD	13,700	2,015,338	0.10
T-Mobile USA 6.25%/2021	USD	5,450,000	5,824,687	0.29
T-Mobile USA 6.633%/2021	USD	4,100,000	4,452,169	0.22
T-Mobile USA 6.731%/2022	USD	8,025,000	8,690,714	0.43
Toll Brothers Finance 5.875%/2022	USD	1,975,000	2,157,687	0.11

United Rentals North America 6.125%/2023	USD	3,800,000	4,097,711	0.20
United States Steel 6.875%/2021	USD	3,925,000	4,168,605	0.21
USG 9.75%/2018	USD	6,125,000	7,346,784	0.37
WellCare Health Plans 5.75%/2020	USD	3,100,000	3,317,000	0.17
Wells Fargo warrants/28/10/2018	USD	109,750	2,366,210	0.12
Wolverine World Wide 6.125%/2020	USD	1,300,000	1,407,250	0.07

アメリカ 計			299,119,095	14.92
---------------	--	--	--------------------	--------------

公認の証券取引所で上場または取引されている有価証券 計			615,306,568	30.69
------------------------------------	--	--	--------------------	--------------

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	USD	2,275,000	2,454,156	0.12
---	-----	-----------	-----------	------

オーストラリア 計			2,454,156	0.12
------------------	--	--	------------------	-------------

オーストリア

Sappi Papier Holding Ser144A 7.75%/2017	USD	2,250,000	2,508,649	0.13
---	-----	-----------	-----------	------

Sappi Papier Holding Ser144A 8.375%/2019	USD	1,675,000	1,859,250	0.09
--	-----	-----------	-----------	------

Sappi Papier Holding SerRegS 6.625%/2021	USD	3,400,000	3,604,000	0.18
--	-----	-----------	-----------	------

オーストリア 計			7,971,899	0.40
-----------------	--	--	------------------	-------------

ベルギー

Barry Callebaut Services SerRegS 5.5%/2023	USD	9,900,000	10,499,197	0.52
--	-----	-----------	------------	------

ベルギー 計			10,499,197	0.52
---------------	--	--	-------------------	-------------

バミューダ

Aircastle 6.25%/2019	USD	3,625,000	3,969,375	0.20
----------------------	-----	-----------	-----------	------

Aircastle 7.625%/2020	USD	4,300,000	5,009,500	0.25
-----------------------	-----	-----------	-----------	------

Central European Media Enterprises 5%/2015	USD	4,595,000	4,554,794	0.23
--	-----	-----------	-----------	------

Digicel Group SerRegS 7.125%/2022	USD	2,425,000	2,532,961	0.13
-----------------------------------	-----	-----------	-----------	------

Digicel Group SerRegS 8.25%/2020	USD	3,725,000	4,060,343	0.20
----------------------------------	-----	-----------	-----------	------

Digicel SerRegS 6%/2021	USD	3,525,000	3,647,811	0.18
-------------------------	-----	-----------	-----------	------

バミューダ 計			23,774,784	1.19
----------------	--	--	-------------------	-------------

カナダ

Air Canada SerRegS 7.75%/2021	USD	1,800,000	1,912,500	0.09
-------------------------------	-----	-----------	-----------	------

Baytex Energy Ser144A 5.125%/2021	USD	950,000	963,728	0.05
-----------------------------------	-----	---------	---------	------

Cogeco Cable SerRegS 4.875%/2020	USD	775,000	787,594	0.04
----------------------------------	-----	---------	---------	------

Eldorado Gold SerRegS 6.125%/2020	USD	4,700,000	4,770,500	0.24
-----------------------------------	-----	-----------	-----------	------

Great Canadian Gaming Ser144A 6.625%/2022	CAD	1,875,000	1,880,671	0.09
---	-----	-----------	-----------	------

Imperial Metals SerRegS 7%/2019	USD	3,100,000	3,193,000	0.16
MDC Partners 6.75%/2020	USD	775,000	821,500	0.04
MDC Partners Ser144A 6.75%/2020	USD	1,325,000	1,404,500	0.07
MDC Partners SerRegS 6.75%/2020	USD	3,200,000	3,392,000	0.17
MPL 2 Acquisition Canco Ser144A 9.875%/2018	USD	1,975,000	2,125,495	0.11
Novelis 8.75%/2020	USD	4,075,000	4,520,072	0.23
Precision Drilling 6.5%/2021	USD	875,000	955,937	0.05
Precision Drilling 6.625%/2020	USD	4,075,000	4,372,944	0.22
Seven Generations Energy SerRegS 8.25%/2020	USD	2,250,000	2,475,000	0.12
Tervita Ser144A 8%/2018	USD	2,825,000	2,952,125	0.15
Tervita SerRegS 10.875%/2018	USD	2,575,000	2,634,998	0.13
Tervita SerRegS 8%/2018	USD	3,700,000	3,866,500	0.19
Valeant Pharmaceuticals International SerRegS 6.75%/2018	USD	4,100,000	4,433,125	0.22
Videotron 5%/2022	USD	4,300,000	4,439,750	0.22
カナダ 計			51,901,939	2.59
ケイマン諸島				
BCP Singapore VI Cayman Financing SerRegS 8%/2021	USD	1,675,000	1,729,814	0.09
UPCB Finance V SerRegS 7.25%/2021	USD	4,000,000	4,408,500	0.22
UPCB Finance VI SerRegS 6.875%/2022	USD	2,900,000	3,197,250	0.16
ケイマン諸島 計			9,335,564	0.47
クロアチア				
Agrokor SerRegS 8.875%/2020	USD	650,000	731,919	0.04
クロアチア 計			731,919	0.04
アイルランド				
Ardagh Packaging Finance SerRegS 6%/2021	USD	3,525,000	3,542,625	0.18
Ardagh Packaging Finance USA SerRegS 7%/2020	USD	511,765	530,956	0.02
アイルランド 計			4,073,581	0.20
イスラエル				
B Communications Ser144A 7.375%/2021	USD	2,900,000	3,133,899	0.16
Total for Israel			3,133,899	0.16
ルクセンブルグ				
Aguila 3 Ser144A 7.875%/2018	USD	675,000	713,391	0.04
Aguila 3 SerRegS 7.875%/2018	USD	1,350,000	1,428,354	0.07
ARD Finance Ser144A 11.125%/2018	USD	1,365,937	1,445,189	0.07

Ardagh Finance Holdings SerRegS 8.625%/2019	USD	2,025,000	2,095,875	0.11
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SerRegS 5.625%/2016	USD	2,350,000	2,420,500	0.12
Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SerRegS 6%/2017	USD	1,350,000	1,390,500	0.07
Boardriders SerRegS 8.875%/2017	EUR	2,450,000	3,498,274	0.17
Capsugel SerRegS 7%/2019	USD	2,175,000	2,247,047	0.11
INEOS Group Holdings SerRegS 6.125%/2018	USD	2,250,000	2,342,813	0.12
Intelsat Jackson Holdings 5.5%/2023	USD	6,500,000	6,500,000	0.32
Intelsat Jackson Holdings 6.625%/2022	USD	4,775,000	5,013,750	0.25
Intelsat Luxembourg 7.75%/2021	USD	6,500,000	6,914,375	0.34
Intelsat Luxembourg 8.125%/2023	USD	2,725,000	2,956,625	0.15
NII International Telecom SerRegS 11.375%/2019	USD	1,475,000	1,316,438	0.07
Silver II Borrower Ser144A 7.75%/2020	USD	2,400,000	2,568,000	0.13
Trinseo Materials Operating 8.75%/2019	USD	4,175,000	4,513,133	0.22
Wind Acquisition Finance SerRegS 7.25%/2018	USD	2,225,000	2,351,825	0.12
ルクセンブルグ 計			49,716,089	2.48
オランダ				
Delta Dutch Newco Ser144A 7.5%/2022	USD	1,525,000	1,584,094	0.08
Playa Resorts Holding SerRegS 8%/2020	USD	2,025,000	2,192,062	0.11
Schaeffler Finance SerRegS 4.75%/2021	USD	2,625,000	2,703,553	0.14
Schaeffler Holding Finance SerRegS 6.875%/2018	USD	2,750,000	2,911,563	0.14
VimpelCom Holdings Ser144A 7.504%/2022	USD	2,425,000	2,628,203	0.13
VTR Finance SerRegS 6.875%/2024	USD	2,475,000	2,649,141	0.13
オランダ 計			14,668,616	0.73
パナマ				
McDermott International Ser144A 8%/2021	USD	1,725,000	1,794,000	0.09
パナマ 計			1,794,000	0.09
イギリス				
Jaguar Land Rover Automotive SerRegS 5.625%/2023	USD	4,550,000	4,879,739	0.24
イギリス 計			4,879,739	0.24
アメリカ				
24 Hour Holdings III SerRegS 8%/2022	USD	2,775,000	2,781,937	0.14
99 Cents Only Stores 11%/2019	USD	2,350,000	2,614,375	0.13
Activision Blizzard SerRegS 5.625%/2021	USD	11,000,000	11,907,500	0.59
Activision Blizzard SerRegS 6.125%/2023	USD	2,000,000	2,205,000	0.11
AEP Industries 8.25%/2019	USD	2,075,000	2,191,719	0.11

Affinia Group 7.75%/2021	USD	825,000	872,437	0.04
AGCO 5.875%/2021	USD	3,450,000	3,916,816	0.20
Alcatel-Lucent USA SerRegS 6.75%/2020	USD	1,550,000	1,662,375	0.08
Alcatel-Lucent USA SerRegS 8.875%/2020	USD	2,175,000	2,474,063	0.12
Aleris International 7.875%/2020	USD	2,700,000	2,814,750	0.14
Allegiant Travel 5.5%/2019	USD	1,975,000	2,019,437	0.10
Allison Transmission Ser144A 7.125%/2019	USD	1,275,000	1,370,625	0.07
Ally Financial pref stk 7% 1	USD	5,500	5,538,844	0.28
Alpha Natural Resources Ser144A 7.5%/2020	USD	3,300,000	3,210,603	0.16
AMC Networks 4.75%/2022	USD	3,000,000	2,997,240	0.15
American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust Ser144A 4%/2025	USD	822,108	842,147	0.04
American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust Ser144A 5.625%/2021	USD	859,079	906,328	0.04
American Axle & Manufacturing 5.125%/2019	USD	775,000	817,369	0.04
American Capital Ser144A 6.5%/2018	USD	3,250,000	3,477,500	0.17
Ancestry.com 11%/2020	USD	2,400,000	2,826,000	0.14
Ancestry.com SerRegS 9.625%/2018	USD	2,575,000	2,665,125	0.13
Antero Resources Finance 5.375%/2021	USD	4,850,000	5,074,337	0.25
Antero Resources Finance 6%/2020	USD	5,425,000	5,825,284	0.29
Aramark 5.75%/2020	USD	2,100,000	2,232,626	0.11
Ares Capital 4.875%/2018	USD	4,700,000	5,009,824	0.25
A-S Co-Issuer Subsidiary Ser144A 7.875%/2020	USD	1,650,000	1,751,063	0.09
Ashtead Capital 6.5%/2022	USD	1,450,000	1,587,750	0.08
Ashtead Capital SerRegS 6.5%/2022	USD	1,500,000	1,640,625	0.08
Associated Materials 9.125%/2017	USD	4,750,000	4,949,524	0.25
Athlon Holdings Ser144A 6%/2022	USD	3,625,000	3,742,812	0.19
Aviv Healthcare Properties 7.75%/2019	USD	1,350,000	1,445,047	0.07
Bankrate SerRegS 6.125%/2018	USD	3,125,000	3,332,031	0.17
BC Mountain Finance Ser144A 7%/2021	USD	3,000,000	2,895,000	0.14
BI-LO Finance Ser144A 8.625%/2018	USD	2,700,000	2,747,250	0.14
BlueLine Rental Finance SerRegS 7%/2019	USD	2,425,000	2,597,781	0.13
BMC Software Finance SerRegS 8.125%/2021	USD	3,350,000	3,450,500	0.17
Boise Cascade 6.375%/2020	USD	4,700,000	5,076,000	0.25
Boyd Gaming 9%/2020	USD	425,000	471,185	0.02
Builders FirstSource Ser144A 7.625%/2021	USD	1,425,000	1,523,617	0.08
Building Materials Holding SerRegS 9%/2018	USD	3,800,000	4,123,000	0.21
Caesars Entertainment Operating 11.25%/2017	USD	2,150,000	1,976,119	0.10
CCO Holdings 5.125%/2023	USD	1,900,000	1,917,271	0.10
CCO Holdings 5.25%/2021	USD	225,000	232,369	0.01
CCO Holdings 6.625%/2022	USD	14,350,000	15,495,991	0.77

CCO Holdings 5.25%/2022	USD	5,575,000	5,674,291	0.28
CCO Holdings 5.75%/2023	USD	600,000	619,926	0.03
CDR DB Sub Ser144A 7.75%/2020	USD	2,800,000	2,457,000	0.12
Cedar Fair 5.25%/2021	USD	2,725,000	2,820,375	0.14
CEDC Finance International 10%/2018	USD	1,119,968	946,373	0.05
CEDC Finance International step coupon 9%/2018	USD	2,378,639	2,243,606	0.11
Cequel Communications Holdings I Ser144A 5.125%/2021	USD	1,300,000	1,300,000	0.06
Cequel Communications Holdings I Ser144A 6.375%/2020	USD	8,750,000	9,318,750	0.46
Chester Downs & Marina Ser144A 9.25%/2020	USD	4,525,000	4,411,875	0.22
Chrysler Group 8.25%/2021	USD	9,325,000	10,569,375	0.53
Claire's Stores 10.5%/2017	USD	2,988,000	2,841,678	0.14
Clean Harbors 5.125%/2021	USD	1,800,000	1,849,122	0.09
Clean Harbors 5.25%/2020	USD	1,350,000	1,396,190	0.07
Clear Channel Communications 14%/2021	USD	3,750,000	3,895,312	0.19
Clear Channel Communications 9%/2019	USD	6,375,000	6,833,458	0.34
Clear Channel Worldwide Holdings 6.5%/2022	USD	575,000	616,688	0.03
Clear Channel Worldwide Holdings SerA 7.625%/2020	USD	550,000	591,412	0.03
Clear Channel Worldwide Holdings SerB 6.5%/2022	USD	4,650,000	5,029,696	0.25
Clear Channel Worldwide Holdings SerB 7.625%/2020	USD	1,150,000	1,243,443	0.06
CNH Capital 3.625%/2018	USD	2,275,000	2,329,372	0.12
Columbus McKinnon 7.875%/2019	USD	3,425,000	3,673,312	0.18
Community Health Systems 8%/2019	USD	2,525,000	2,775,038	0.14
Consolidated Container SerRegS 10.125%/2020	USD	3,925,000	3,993,687	0.20
Continental Airlines 2009-2 Class A Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	USD	560,482	655,764	0.03
Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust SerB 9.25%/2017	USD	275,488	312,298	0.02
CoreLogic 7.25%/2021	USD	1,575,000	1,710,844	0.08
Corrections Corporation of America 4.625%/2023	USD	2,500,000	2,468,750	0.12
Crown Castle International 5.25%/2023	USD	5,175,000	5,418,018	0.27
CSC Holdings 6.75%/2021	USD	2,850,000	3,154,366	0.16
Dell 4.625%/2021	USD	750,000	736,309	0.04
Dell 5.65%/2018	USD	1,925,000	2,060,934	0.10
Dell 5.875%/2019	USD	2,525,000	2,706,156	0.13
Denali Borrower Ser144A 5.625%/2020	USD	500,000	531,250	0.03
Dex Media 14%/2017	USD	4,368,088	3,013,981	0.15
Diamond Foods Ser144A 7%/2019	USD	1,125,000	1,175,625	0.06

DISH DBS 5.125%/2020	USD	3,675,000	3,877,051	0.19
DISH DBS 5.875%/2022	USD	3,100,000	3,375,295	0.17
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma Ser144A 10.5%/2019	USD	3,000,000	3,255,000	0.16
DreamWorks Animation SKG Ser144A 6.875%/2020	USD	750,000	811,875	0.04
DuPont Fabros Technology 5.875%/2021	USD	4,425,000	4,652,224	0.23
Dycom Investments 7.125%/2021	USD	2,900,000	3,132,000	0.16
Eagle Midco SerRegS 9%/2018	USD	4,200,000	4,368,000	0.22
EarthLink 7.375%/2020	USD	1,425,000	1,506,816	0.07
Earthlink 8.875%/2019	USD	1,525,000	1,524,527	0.08
Epicor Software 8.625%/2019	USD	2,725,000	2,956,625	0.15
Equinix 5.375%/2023	USD	3,000,000	3,065,235	0.15
Equinix 7%/2021	USD	3,750,000	4,161,412	0.21
Euramax International 9.5%/2016	USD	3,250,000	3,266,250	0.16
Exopack Holding SerRegS 10%/2018	USD	2,325,000	2,505,188	0.11
Exterran Partners 6%/2021	USD	1,100,000	1,116,500	0.06
Federal National Mortgage Association SerS VR 8.25%/2049	USD	228,775	2,360,958	0.12
Ferrellgas 6.5%/2021	USD	2,900,000	3,046,131	0.15
First Data 12.625%/2021	USD	13,975,000	17,245,429	0.86
First Data Holdings Ser144A 14.5%/2019	USD	3,877,343	4,346,269	0.22
First Data Ser144A 6.75%/2020	USD	8,175,000	8,890,312	0.44
Foresight Energy SerRegS 7.875%/2021	USD	2,775,000	2,983,125	0.15
Fresenius Medical Care US Finance 6.875%/2017	USD	316,000	358,701	0.02
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.625%/2019	USD	5,825,000	6,378,375	0.32
Fresenius Medical Care US Finance II SerRegS 5.875%/2022	USD	1,175,000	1,304,250	0.06
FTI Consulting 6%/2022	USD	10,825,000	11,190,344	0.56
FTI Consulting 6.75%/2020	USD	825,000	884,812	0.04
Gannett SerRegS 5.125%/2019	USD	1,775,000	1,850,437	0.09
Gannett SerRegS 6.375%/2023	USD	1,500,000	1,608,750	0.08
Gardner Denver Ser144A 6.875%/2021	USD	3,450,000	3,652,687	0.18
General Motors Financial 3.25%/2018	USD	3,325,000	3,382,888	0.17
General Motors Financial 4.75%/2017	USD	4,750,000	5,072,026	0.25
GenOn Energy 9.5%/2018	USD	4,675,000	5,151,990	0.26
Goodman Networks 12.125%/2018	USD	2,575,000	2,838,937	0.14
Goodman Networks Ser144A 12.125%/2018	USD	1,025,000	1,130,062	0.06
Goodyear Tire & Rubber 6.5%/2021	USD	2,275,000	2,480,615	0.12
Goodyear Tire & Rubber 8.75%/2020	USD	800,000	952,772	0.05

Government Development Bank for Puerto Rico				
3.448% 1/2/2015	USD	4,300,000	3,870,000	0.19
Graton Economic Development Authority Ser144A				
9.625%/2019	USD	300,000	342,750	0.02
Guitar Center Ser144A 6.5%/2019	USD	3,750,000	3,717,188	0.19
H&E Equipment Services 7%/2022	USD	1,850,000	2,046,239	0.10
Harbinger Group 7.875%/2019	USD	4,875,000	5,356,406	0.27
HD Supply 11.5%/2020	USD	1,075,000	1,295,434	0.06
HD Supply 7.5%/2020	USD	5,100,000	5,596,485	0.28
Hertz 5.875%/2020	USD	625,000	658,150	0.03
Hexion US Finance 6.625%/2020	USD	2,625,000	2,792,632	0.14
Hexion US Finance 8.875%/2018	USD	5,725,000	5,963,761	0.30
Hologic 6.25%/2020	USD	6,075,000	6,469,875	0.32
Howard Hughes SerRegS 6.875%/2021	USD	6,525,000	7,014,375	0.35
Hughes Satellite Systems 6.5%/2019	USD	4,350,000	4,861,125	0.24
IASIS Healthcare 8.375%/2019	USD	2,000,000	2,134,650	0.11
Icahn Enterprises 6%/2020	USD	6,425,000	6,914,938	0.34
Icahn Enterprises 4.875%/2019	USD	3,800,000	3,927,566	0.20
Igloo Holdings SerRegS 8.25%/2017	USD	2,250,000	2,303,438	0.11
Infor Software Parent Ser144A 7.125%/2021	USD	2,250,000	2,311,875	0.12
Infor US 9.375%/2019	USD	3,700,000	4,134,750	0.21
Interline Brands 10%/2018	USD	1,650,000	1,773,750	0.09
iStar Financial 5%/2019	USD	3,125,000	3,121,094	0.16
Jaguar Holding I Ser144A 9.375%/2017	USD	1,125,000	1,175,625	0.06
Jaguar Holding II Ser144A 9.5%/2019	USD	950,000	1,042,625	0.05
JBS USA SerRegS 5.875%/2024	USD	5,050,000	5,052,778	0.25
Jefferies LoanCore / JLC Finance Ser144A				
6.875%/2020	USD	2,700,000	2,740,500	0.14
JMC Steel Group Ser144A 8.25%/2018	USD	3,700,000	3,792,500	0.19
Kinetic Concepts USA 10.5%/2018	USD	3,100,000	3,518,128	0.18
Kinetic Concepts USA 12.5%/2019	USD	1,650,000	1,898,647	0.09
Ladder Capital Finance Holdings 7.375%/2017	USD	6,625,000	7,171,563	0.36
Laredo Petroleum 7.375%/2022	USD	3,375,000	3,775,984	0.19
Laureate Education Ser144A 9.25%/2019	USD	5,375,000	5,563,125	0.28
Lender Processing Services 5.75%/2023	USD	4,225,000	4,552,438	0.23
Level 3 Financing 7%/2020	USD	1,200,000	1,317,000	0.07
Level 3 Financing 8.625%/2020	USD	3,150,000	3,543,750	0.18
Levi Strauss 6.875%/2022	USD	1,750,000	1,939,910	0.10
Magnetation Ser144A 11%/2018	USD	2,850,000	3,127,875	0.16
McGraw-Hill Global Education Holdings 9.75%/2021	USD	2,700,000	3,118,500	0.16
Mcron Finance Ser144A 8.375%/2019	USD	1,700,000	1,870,000	0.09

MedAssets 8%/2018	USD	2,950,000	3,134,375	0.16
Mediacom Broadband 6.375%/2023	USD	8,250,000	8,698,140	0.43
Mercer International 9.5%/2017	USD	4,925,000	5,281,545	0.26
MGM Resorts International 6.75%/2020	USD	3,325,000	3,725,380	0.19
Midcontinent Communications & Midcontinent				
Finance Ser144A 6.25%/2021	USD	1,500,000	1,560,000	0.08
Milacron Finance Ser144A 7.75%/2021	USD	3,325,000	3,657,500	0.18
MPH Acquisition Holdings Ser144A 6.625%/2022	USD	2,275,000	2,398,237	0.12
MPT Operating Partnership 6.875%/2021	USD	2,450,000	2,674,175	0.13
Murray Energy Ser144A 8.625%/2021	USD	4,200,000	4,567,500	0.23
National CineMedia 6%/2022	USD	2,700,000	2,835,000	0.14
Nationstar Mortgage 6.5%/2021	USD	5,875,000	5,881,727	0.29
Nationstar Mortgage 6.5%/2022	USD	2,750,000	2,750,577	0.14
Netflix 5.375%/2021	USD	9,100,000	9,573,974	0.48
NII Capital 10%/2016	USD	5,075,000	1,598,625	0.08
NII Capital 7.625%/2021	USD	5,600,000	1,638,000	0.08
NRG Energy 6.625%/2023	USD	3,100,000	3,358,431	0.17
NuStar Logistics 6.75%/2021	USD	2,875,000	3,208,529	0.16
Omega Healthcare Investors 5.875%/2024	USD	775,000	822,194	0.04
Opal Acquisition SerRegS 8.875%/2021	USD	3,350,000	3,551,000	0.18
Outerwall 6%/2019	USD	5,125,000	5,355,625	0.27
Pantry 8.375%/2020	USD	1,825,000	1,980,125	0.10
Par Pharmaceutical 7.375%/2020	USD	1,675,000	1,821,562	0.09
Parsley Energy SerRegS 7.5%/2022	USD	1,275,000	1,367,438	0.07
Parsley Energy SerRegS 7.5%/2022	USD	2,725,000	2,922,563	0.15
PDC Energy 7.75%/2022	USD	7,900,000	8,848,000	0.44
Peninsula Gaming Ser144A 8.375%/2018	USD	2,125,000	2,284,375	0.11
Penn Virginia 8.5%/2020	USD	4,350,000	4,867,324	0.24
Penn Virginia pref stk 6%	USD	13,200	1,580,700	0.08
Penn Virginia Resource Partners 6.5%/2021	USD	450,000	492,750	0.02
Penn Virginia Resource Partners Finance				
8.375%/2020	USD	2,000,000	2,269,380	0.11
Penske Automotive Group 5.75%/2022	USD	3,600,000	3,793,464	0.19
PH Glatfelter 5.375%/2020	USD	4,150,000	4,336,750	0.22
Pinnacle Entertainment 6.375%/2021	USD	3,200,000	3,388,000	0.17
Pinnacle Entertainment 7.5%/2021	USD	1,675,000	1,812,693	0.09
Pittsburgh Glass Works Ser144A 8%/2018	USD	1,850,000	2,020,385	0.10
PolyOne 5.25%/2023	USD	2,325,000	2,402,411	0.12
Post Holdings 7.375%/2022	USD	1,125,000	1,223,550	0.06
Post Holdings Ser144A 6.75%/2021	USD	1,375,000	1,469,600	0.07
Post Holdings SerRegS 6%/2022	USD	1,750,000	1,800,312	0.09

PQ Ser144A 8.75%/2018	USD	5,250,000	5,709,375	0.28
Prestige Brands 8.125%/2020	USD	1,800,000	2,000,250	0.10
Provident Funding Associates Ser144A 10.125%/2019	USD	1,275,000	1,389,750	0.07
Provident Funding Associates Ser144A 6.75%/2021	USD	3,250,000	3,306,875	0.16
Quiksilver 10%/2020	USD	2,925,000	2,954,250	0.15
Quiksilver Ser144A 7.875%/2018	USD	1,450,000	1,503,628	0.07
Range Resources 5%/2023	USD	3,850,000	4,118,614	0.21
Rayonier AM Products SerRegS 5.5%/2024	USD	2,450,000	2,499,000	0.12
Reynolds Group Issuer 7.125%/2019	USD	1,025,000	1,074,108	0.05
Rite Aid 6.75%/2021	USD	4,350,000	4,707,505	0.23
Rite Aid 9.25%/2020	USD	4,425,000	5,055,917	0.25
Rockies Express Pipeline Ser144A 6.85%/2018	USD	375,000	406,875	0.02
Rosetta Resources 5.875%/2024	USD	4,975,000	5,172,657	0.26
RSI Home Products Ser144A 6.875%/2018	USD	500,000	534,828	0.03
Ryerson 11.25%/2018	USD	6,300,000	7,071,750	0.35
Ryerson 9%/2017	USD	3,500,000	3,753,750	0.19
Sabine Pass LNG 6.5%/2020	USD	3,850,000	4,169,184	0.21
Safway Group Holding Ser144A 7%/2018	USD	1,425,000	1,517,625	0.08
Samson Investment Ser144A 10.75%/2020	USD	1,550,000	1,646,875	0.08
Sealed Air SerRegS 5.25%/2023	USD	3,400,000	3,468,000	0.17
Select Medical 6.375%/2021	USD	3,900,000	4,081,155	0.20
Seventy Seven Energy Ser144A 6.5%/2022	USD	4,225,000	4,330,625	0.22
Shearer's Foods Ser144A 9%/2019	USD	2,250,000	2,475,000	0.12
Sinclair Television Group 6.125%/2022	USD	4,150,000	4,352,312	0.22
Sirius XM Holdings SerRegS 5.75%/2021	USD	2,900,000	3,059,500	0.15
Six Flags Entertainment Ser144A 5.25%/2021	USD	1,325,000	1,361,438	0.07
SM Energy 6.5%/2021	USD	1,650,000	1,798,541	0.09
SM Energy 6.5%/2023	USD	5,890,000	6,365,500	0.32
SM Energy 6.625%/2019	USD	825,000	876,034	0.04
SM Energy Ser144A 5%/2024	USD	3,375,000	3,375,000	0.17
Sonic Automotive 5%/2023	USD	3,175,000	3,141,662	0.16
Sonic Automotive 7%/2022	USD	1,700,000	1,874,250	0.09
Spectrum Brands 6.375%/2020	USD	1,375,000	1,485,055	0.07
Spectrum Brands 6.625%/2022	USD	1,275,000	1,387,761	0.07
Springs Industries 6.25%/2021	USD	1,600,000	1,640,000	0.08
Sprint Communications 11.5%/2021	USD	5,000,000	6,831,000	0.34
Sprint Ser144A 7.125%/2024	USD	29,275,000	31,470,625	1.57
Starz 5%/2019	USD	4,600,000	4,801,871	0.24
Station Casinos 7.5%/2021	USD	3,875,000	4,252,813	0.21
Steel Dynamics 6.125%/2019	USD	1,800,000	1,962,738	0.10

Summit Materials Finance 10.5%/2020	USD	4,050,000	4,566,375	0.23
SunCoke Energy Partners Ser144A 7.375%/2020	USD	1,500,000	1,608,750	0.08
SunGard Data Systems 6.625%/2019	USD	2,850,000	3,021,000	0.15
Syniverse Holdings 9.125%/2019	USD	2,000,000	2,150,000	0.11
Targa Resources Partners 4.25%/2023	USD	10,450,000	10,423,875	0.52
Targa Resources Partners 5.25%/2023	USD	4,175,000	4,350,079	0.22
Tempur Sealy International 6.875%/2020	USD	1,925,000	2,122,312	0.11
Tenet Healthcare 4.5%/2021	USD	5,675,000	5,716,513	0.28
Tenet Healthcare 6%/2020	USD	2,700,000	2,951,100	0.15
Time SerRegS 5.75%/2022	USD	2,900,000	2,936,250	0.15
Townsquare Radio Ser144A 9%/2019	USD	2,175,000	2,419,687	0.12
TransUnion Holding 8.125%/2018	USD	1,675,000	1,757,075	0.09
Travelport 11.875%/2016	USD	3,975,000	4,051,081	0.20
Travelport Ser144A 13.875%/2016	USD	2,534,825	2,636,218	0.13
Truven Health Analytics 10.625%/2020	USD	1,625,000	1,791,563	0.09
United Continental Holdings 6%/2020	USD	3,575,000	3,764,564	0.19
United Continental Holdings 6.375%/2018	USD	3,250,000	3,513,218	0.18
United Continental Holdings SerA 6%/2026	USD	6,000,000	5,873,130	0.29
United Continental Holdings SerB 6%/2028	USD	1,000,000	968,115	0.05
Universal Hospital Services 7.625%/2020	USD	3,825,000	4,012,961	0.20
Univision Communications Ser144A 5.125%/2023	USD	2,550,000	2,715,750	0.14
Univision Communications SerRegS 5.125%/2023	USD	7,650,000	8,147,250	0.41
Univision Communications SerRegS 6.75%/2022	USD	829,000	921,226	0.05
Univision Communications SerRegS 7.875%/2020	USD	2,325,000	2,566,219	0.13
Univision Communications SerRegS 8.5%/2021	USD	12,525,000	13,965,375	0.70
US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625%/2025	USD	869,877	923,701	0.05
US Airways 2012-2 Class B Pass Through Trust 6.75%/2021	USD	398,150	433,983	0.02
US Airways Group 6.125%/2018	USD	6,500,000	6,878,983	0.34
US Coatings Acquisition Ser144A 7.375%/2021	USD	1,600,000	1,756,000	0.09
US Coatings Acquisition SerRegS 5.75%/2021	EUR	475,000	695,417	0.03
USG SerRegS 5.875%/2021	USD	1,000,000	1,061,250	0.05
Valeant Pharmaceuticals International Ser144A 6.375%/2020	USD	1,975,000	2,101,696	0.10
ViaSat 6.875%/2020	USD	3,750,000	4,059,375	0.20
Vulcan Materials 7.5%/2021	USD	3,250,000	3,850,502	0.19
Watco Finance Ser144A 6.375%/2023	USD	2,075,000	2,126,875	0.11
WaveDivision Escrow Ser144A 8.125%/2020	USD	1,025,000	1,112,125	0.06
Western Refining 6.25%/2021	USD	3,400,000	3,565,427	0.18
WideOpenWest Finance 10.25%/2019	USD	3,150,000	3,535,875	0.18

WideOpenWest Finance 13.375%/2019	USD	4,250,000	4,951,250	0.25
William Lyon Homes 8.5%/2020	USD	4,225,000	4,747,844	0.24
WMG Acquisition Ser144A 6.75%/2022	USD	2,775,000	2,792,344	0.14
WMG Acquisition SerRegS 6%/2021	USD	1,547,000	1,605,012	0.08
Wok Acquisition Ser144A 10.25%/2020	USD	3,275,000	3,365,063	0.17
WPX Energy 6%/2022	USD	6,400,000	6,835,840	0.34

アメリカ 計**938,358,627****46.80****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****1,123,294,009****56.03****直近に発行された取引可能な有価証券****カナダ**

Niska Gas Storage Canada ULC Ser144A 6.5%/2019	USD	4,925,000	4,731,398	0.24
--	-----	-----------	-----------	------

カナダ 計**4,731,398****0.24****フランス**

CGG Ser144A 6.875%/2022	USD	4,525,000	4,547,625	0.22
-------------------------	-----	-----------	-----------	------

フランス 計**4,547,625****0.22****アメリカ 計**

Antero Resources Ser144A 5.125%/2022	USD	3,400,000	3,495,711	0.17
Athlon Holdings Ser144A 7.375%/2021	USD	5,250,000	5,748,750	0.29
Caesars Entertainment Resort Properties Ser144A 11%/2021	USD	5,125,000	5,509,324	0.27
CBS Outdoor Americas Capital Ser144A 5.25%/2022	USD	1,275,000	1,313,250	0.07
CBS Outdoor Americas Capital Ser144A 5.625%/2024	USD	1,325,000	1,371,375	0.07
Community Health Systems Ser144A 5.125%/2021	USD	4,450,000	4,581,631	0.23
Community Health Systems Ser144A 6.875%/2022	USD	14,525,000	15,448,717	0.77
Consol Energy Ser144A 5.875%/2022	USD	3,875,000	4,091,593	0.20
Cott Beverages Ser144A 5.375%/2022	USD	3,925,000	3,949,531	0.20
Darling Ingredients Ser144A 5.375%/2022	USD	1,725,000	1,796,156	0.09
Exterran Partners Ser144A 6%/2022	USD	3,000,000	3,060,000	0.15
FerrelIlgas Ser144A 6.75%/2022	USD	2,875,000	3,021,567	0.15
FTS International Ser144A 6.25%/2022	USD	1,875,000	1,926,562	0.10
General Motors Ser144A 6.25%/2043	USD	2,325,000	2,650,500	0.13
Group 1 Automotive Ser144A 5%/2022	USD	1,150,000	1,149,391	0.06
Hilton Worldwide Finance Ser144A 5.625%/2021	USD	4,200,000	4,464,264	0.22
Kindred Healthcare Ser144A 6.375%/2022	USD	2,125,000	2,151,563	0.11
Kratos Defense & Security Solutions Ser144A 7%/2019	USD	2,525,000	2,619,687	0.13

Men's Wearhouse Ser144A 7%/2022	USD	1,950,000	2,028,000	0.10
NRG Energy Ser144A 6.25%/2022	USD	4,500,000	4,803,750	0.24
Ocwen Financial Ser144A 6.625%/2019	USD	2,375,000	2,458,125	0.12
Parker Drilling Ser144A 6.75%/2022	USD	3,275,000	3,422,375	0.17
PC Nextco Holdings Ser144A 8.75%/2019	USD	3,400,000	3,485,000	0.17
Post Holdings Ser144A 7.375%/2022	USD	1,225,000	1,322,234	0.07
TransDigm Ser144A 6.5%/2024	USD	1,900,000	1,978,375	0.10
Walter Investment Management Ser144A 7.875%/2021	USD	9,000,000	9,450,000	0.47
William Carter Ser144A 5.25%/2021	USD	4,825,000	5,030,062	0.25
アメリカ 計			102,327,493	5.10

直近に発行された取引可能な有価証券 計			111,606,516	5.56
----------------------------	--	--	--------------------	-------------

その他取引可能な有価証券

アメリカ

Energy Future Ser 144A 10%/2020	USD	8,600,000	0	0.00
Smurfit-Stone Container pref stk 1	USD	7,275	0	0.00
Spanish Broadcasting System pref stk 1	USD	24,424	266	0.00
アメリカ 計			266	0.00

その他取引可能な有価証券 計			266	0.00
-----------------------	--	--	------------	-------------

有価証券 計			1,850,207,359	92.28
---------------	--	--	----------------------	--------------

為替予約取引

決済日	買い	売り	評価益（米ドル）	対純資産比率（％）
12 August 2014	10,493,984 USD	9,217,118 CHF	126,619	
12 September 2014	5,304,933 EUR	7,211,323 USD	39,231	
12 September 2014	1,301,153 EUR	1,771,052 USD	7,307	
為替予約取引に係る評価益 計			173,157	0.01

決済日	買い	売り	評価損（米ドル）	対純資産比率（％）
10 July 2014	35,360,703 USD	21,136,324 GBP	(681,871)	
10 July 2014	3,922,747 USD	2,346,000 GBP	(77,754)	
10 July 2014	730,894 USD	434,000 GBP	(9,181)	
10 July 2014	2,815,419 USD	1,661,776 GBP	(18,313)	
10 July 2014	3,565,993 USD	2,100,000 GBP	(15,018)	
10 July 2014	3,150,652 USD	1,874,043 GBP	(45,047)	
10 July 2014	2,093,372 USD	1,241,794 GBP	(24,188)	

10 September 2014	2,335,232	USD	238,751,030	JPY	(20,167)
12 September 2014	2,697,686	USD	1,991,200	EUR	(23,801)
12 September 2014	489,380	USD	358,830	EUR	(1,054)
12 September 2014	149,315,128	USD	110,260,358	EUR	(1,383,983)

為替予約取引に係る評価損 計 **(2,300,377)** **(0.11)**

為替予約取引に係る評価損 計 **(2,127,220)** **(0.11)**

ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価(損)益 計 **(12,468,449)** **(0.62)**

オプション取引

銘柄名	取引先	満期日	契約数	通貨	評価額(米ドル)	対純資産比率(%)
Charter Communication,						
Call Strike Price 155	Goldman Sachs	19 July 2014	(75)	USD	(27,750)	
オプション取引 計					(27,750)	0.00

クレジット・デフォルト・スワップ契約

銘柄名	取引先	満期日	通貨	想定元本	評価額 (米ドル)	対純資産比率(%)
Protection sold (Relevant Credit: Forest Oil,7.25% 2019), Receive 5.00%						
Payment upon credit default	Barclays Bank	March 2015	USD	350,000	6,567	
Protection sold (Relevant Credit: Forest Oil,7.25% 2019), Receive 5.00%						
Payment upon credit default	Goldman Sachs	March 2015	USD	750,000	14,071	
Protection sold (Relevant Credit: Forest Oil,7.25% 2019), Receive 5.00%						
Payment upon credit default	Morgan Stanley	March 2015	USD	850,000	15,947	
Protection sold (Relevant Credit: MBIA Insurance Corporation,5 % 2019), Receive 5.00% Payment upon credit default						
	Goldman Sachs	March 2015	USD	1,875,000	2,599	
Protection bought (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Pay 5.00%, Payment upon credit default						
	Barclays Bank	June 2016	USD	250,000	3,105	
Protection bought (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Pay 5.00%, Payment upon credit default						
	Barclays Bank	June 2016	USD	400,000	4,968	

Protection bought (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Pay 5.00%, Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2016	USD	650,000	8,072
Protection bought (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Pay 5.00%, Payment upon credit default	Citibank	June 2016	USD	575,000	7,141
Protection sold (Relevant Credit: Wind Acquisition Finance,11.75% 2017), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2019	EUR	1,275,000	182,110
Protection sold (Relevant Credit: Wind Acquisition Finance,11.75% 2017), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2019	EUR	1,425,000	203,534
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2019	USD	650,000	3,952
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2019	USD	250,000	1,520
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2019	USD	400,000	2,432
Protection sold (Relevant Credit: TVN Finance III,7.375%2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Goldman Sachs	June 2019	EUR	625,000	124,409
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Goldman Sachs	June 2019	USD	1,300,000	7,904
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Goldman Sachs	June 2019	USD	375,000	2,280
Protection sold (Relevant Credit: CDX High Yield Series 22,Payment upon credit default	JP Morgan Chase	June 2019	USDJ	34,650,000	3,065,014
Protection sold (Relevant Credit: CDX High Yield Series 22, Payment upon credit default	JP Morgan Chase	June 2019	USDJ	17,820,000	1,576,293

Protection sold (Relevant Credit: CDX High Yield Series 22, Payment upon credit default	JP Morgan Chase	June 2019	USDJ	17,820,000	1,576,293
Protection sold (Relevant Credit: AK Steel,7.625% 2020), Receive 5.00% Payment upon credit default	Goldman Sachs	June 2019	USD	650,000	3,952
Protection sold (Relevant Credit: RadioShack,6.75% 2019), Receive 5.00% Payment upon credit default	Citibank	September 2014	USD	1,100,000	(152,778)
Protection sold (Relevant Credit: Sears Roebuck Acceptance,7%2032), Receive 5.00% Payment upon credit default	Deutsche Bank	December 2014	USD	425,000	(12,592)
Protection sold (Relevant Credit: Sears Roebuck Acceptance,7% 2032), Receive 5.00% Payment upon credit default	JP Morgan Chase	December 2014	USD	650,000	(19,261)
Protection sold (Relevant Credit: Sears Roebuck Acceptance,7% 2032), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	December 2015	USD	2,250,000	(244,469)
Protection sold (Relevant Credit: Caesars Entertainment Operating, 5.625% 2015), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	March 2016	USD	625,000	(244,584)
Protection sold (Relevant Credit: Caesars Entertainment Operating,5.625% 2015), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	March 2016	USD	1,825,000	(714,184)
Protection sold (Relevant Credit: Caesars Entertainment Operating,5.625% 2015), Receive 5.00% Payment upon credit default	Citibank	March 2016	USD	1,300,000	(508,734)
Protection sold (Relevant Credit: Caesars Entertainment Operating,5.625% 2015), Receive 5.00% Payment upon credit default	Citibank	March 2016	USD	1,250,000	(489,665)
Protection sold (Relevant Credit: MBIA Insurance Corporation ,5% 2019), Receive 5.00% Payment upon credit default	Goldman Sachs	March 2017	USD	2,950,000	(92,938)

Protection sold (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2017	USD	1,075,000	(49,126)
Protection sold (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2017	USD	525,000	(23,992)
Protection sold (Relevant Credit: JC Penney,6.375% 2036), Receive 5.00% Payment upon credit default	Barclays Bank	June 2017	USD	675,000	(24,225)
Protection sold (Relevant Credit: JC Penney,6.375% 2036), Receive 5.00% Payment upon credit default	Deutsche Bank	June 2017	USD	1,450,000	(52,039)
Protection sold (Relevant Credit: JC Penney,6.375% 2036), Receive 5.00% Payment upon credit default	Deutsche Bank	June 2017	USD	3,625,000	(130,097)
Protection sold (Relevant Credit: Clear Channel Communications,6.875% 2018), Receive 5.00% Payment upon credit default	Citibank	June 2018	USD	1,375,000	(149,770)
スワップ契約 計				3,903,709	0.19
その他資産（負債控除後）				165,447,630	8.26
純資産				2,004,935,279	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

EMTN: EURO 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

CAD:カナダ・ドル

CHF:スイス・フラン

EUR:ユーロ

GBP:イギリス・ポンド

JPY:日本円

USD:米ドル

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

2014年6月30日現在（未監査）

銘柄名	通貨	額面金額	評価額（米ドル）	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				
バミューダ				
Bermuda Government International Bond				
Ser144A 4.854%/2024	USD	205,000	216,890	0.21
バミューダ 計			216,890	0.21
カナダ				
Province of Manitoba Canada 1.3%/2017	USD	275,000	277,827	0.27
Province of Ontario Canada 1.6%/2016	USD	415,000	423,095	0.42
カナダ 計			700,922	0.69
ケイマン諸島				
Baidu 2.75%/2019	USD	200,000	200,414	0.20
Braskem Finance 6.45%/2024	USD	205,000	219,015	0.22
Petrobras International Finance 5.75%/2020	USD	215,000	229,815	0.23
Petrobras International Finance 7.875%/2019	USD	150,000	175,294	0.17
Sun Hung Kai Properties Capital Market SerEMTN 3.625%/2023	USD	200,000	197,963	0.19
Tencent Holdings Ser144A 3.375%/2019	USD	200,000	204,487	0.20
Vale Overseas 4.375%/2022	USD	175,000	179,812	0.18
ケイマン諸島 計			1,406,800	1.39
コロンビア				
Ecopetrol 4.25%/2018	USD	120,000	129,076	0.13
Ecopetrol 5.875%/2045	USD	15,000	15,506	0.01
コロンビア 計			144,582	0.14
ドイツ				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau SerGMTN 0.5%/2016	USD	240,000	240,216	0.24
ドイツ 計			240,216	0.24
アイスランド				

Icelandic Government International Bond				
SerRegS 5.875%/2022	USD	115,000	127,082	0.13
アイスランド 計			127,082	0.13
インドネシア				
Indonesian Government International				
Bond Ser144A 11.625%/2019	USD	135,000	183,968	0.18
インドネシア 計			183,968	0.18
ジャージー				
Heathrow Funding Ser144A 4.875%/2021				
	USD	180,000	198,778	0.20
ジャージー 計			198,778	0.20
ルクセンブルグ				
Telecom Italia Capital 5.25%/2015				
	USD	65,000	68,021	0.07
ルクセンブルグ 計			68,021	0.07
メキシコ				
BBVA Bancomer Texas Ser144A 4.375%/2024				
	USD	150,000	152,921	0.15
メキシコ 計			152,921	0.15
オランダ				
LyondellBasell Industries 5%/2019				
	USD	225,000	251,917	0.24
オランダ 計			251,917	0.24
南アフリカ				
South African Government International				
Bond 5.5%/2020	USD	100,000	109,482	0.11
South African Government International				
Bond 6.875%/2019	USD	100,000	115,835	0.11
南アフリカ 計			225,317	0.22
スウェーデン				
Svensk Exportkredit 5.125%/2017				
	USD	350,000	388,636	0.38
スウェーデン 計			388,636	0.38
スイス				
Credit Suisse Ser144A 6.5%/2023				
	USD	200,000	222,262	0.22
スイス 計			222,262	0.22
トルコ				

Turkiye Halk Bankasi Ser144A 4.75%/2019	USD	205,000	205,581	0.20
トルコ 計			205,581	0.20
イギリス				
Barclays Bank 2.5%/2019	USD	200,000	202,900	0.20
HSBC Holdings 4.25%/2024	USD	200,000	206,063	0.20
Lloyds Bank Ser144A 6.5%/2020	USD	200,000	234,775	0.23
Royal Bank of Scotland 6.125%/2021	USD	170,000	200,253	0.20
イギリス 計			843,991	0.83
アメリカ				
American International Group				
4.125%/2024	USD	175,000	184,065	0.18
American Tower SerA CV 5.25%/2017	USD	833	87,998	0.09
Ameriprise Financial 7.3%/2019	USD	140,000	173,137	0.17
Avnet 5.875%/2020	USD	175,000	197,873	0.20
Avon Products 4.6%/2020	USD	160,000	166,039	0.16
Bank of America 2%/2018	USD	250,000	251,730	0.25
Bank of America 6.11%/2037	USD	180,000	208,682	0.21
Bank of America SerMTN 3.3%/2023	USD	235,000	231,833	0.23
Bunge Ltd Finance 3.2%/2017	USD	65,000	67,833	0.07
Burlington Northern Santa Fe 5.15%/2043	USD	240,000	264,775	0.26
Burlington Northern Santa Fe 5.4%/2041	USD	75,000	85,470	0.08
CNA Financial 5.875%/2020	USD	300,000	349,456	0.34
ConAgra Foods 3.2%/2023	USD	185,000	178,933	0.18
DCP Midstream Operating 2.5%/2017	USD	90,000	92,311	0.09
DCP Midstream Operating 2.7%/2019	USD	10,000	10,117	0.01
Energy Transfer Partners 3.6%/2023	USD	150,000	148,405	0.15
Energy Transfer Partners 5.2%/2022	USD	345,000	381,805	0.38
Enterprise Products Operating				
7.55%/2038	USD	115,000	159,763	0.16
EQT 4.875%/2021	USD	275,000	299,680	0.30
FHLMC (Gold) Pool A90053 4.5%/2039	USD	89,500	96,758	0.10
FHLMC (Gold) Pool A91947 5%/2040	USD	27,291	30,229	0.03
FHLMC (Gold) Pool A93101 5%/2040	USD	146,511	162,284	0.16
FHLMC (Gold) Pool A93451 4.5%/2040	USD	354,792	383,564	0.38
FHLMC (Gold) Pool A94185 4%/2040	USD	3,442	3,641	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94251 4%/2040	USD	2,951	3,122	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94576 4%/2040	USD	1,772	1,874	0.00
FHLMC (Gold) Pool A94713 4%/2040	USD	3,121	3,302	0.00
FHLMC (Gold) Pool A95734 4%/2040	USD	24,585	26,010	0.03

FHLMC (Gold) Pool A96312 4%/2041	USD	116,407	123,155	0.12
FHLMC (Gold) Pool A97620 4.5%/2041	USD	4,858	5,252	0.01
FHLMC (Gold) Pool C01787 6%/2034	USD	98,831	112,531	0.11
FHLMC (Gold) Pool C04238 3.5%/2042	USD	536,442	550,440	0.54
FHLMC (Gold) Pool C09036 3.5%/2043	USD	330,610	339,237	0.33
FHLMC (Gold) Pool C09042 3.5%/2043	USD	245,453	251,858	0.25
FHLMC (Gold) Pool E01341 5.5%/2018	USD	17,339	18,419	0.02
FHLMC (Gold) Pool E01497 5.5%/2018	USD	5,151	5,519	0.01
FHLMC (Gold) Pool G03551 6%/2037	USD	214,226	240,770	0.24
FHLMC (Gold) Pool G04814 5.5%/2038	USD	678,757	756,708	0.75
FHLMC (Gold) Pool G05535 4.5%/2039	USD	264,065	285,479	0.28
FHLMC (Gold) Pool G05659 4.5%/2039	USD	351,606	380,119	0.37
FHLMC (Gold) Pool G05955 5%/2040	USD	265,460	294,038	0.29
FHLMC (Gold) Pool G05958 5%/2040	USD	726,779	805,021	0.79
FHLMC (Gold) Pool G06231 4%/2040	USD	198,061	209,543	0.21
FHLMC (Gold) Pool G06252 4%/2041	USD	4,785	5,063	0.00
FHLMC (Gold) Pool G06506 4%/2040	USD	1,027	1,087	0.00
FHLMC (Gold) Pool G07543 4.5%/2041	USD	49,431	53,439	0.05
FHLMC (Gold) Pool G08016 6%/2034	USD	547,851	615,733	0.61
FHLMC (Gold) Pool G08534 3%/2043	USD	435,972	429,228	0.42
FHLMC (Gold) Pool G18465 2.5%/2028	USD	189,978	192,679	0.19
FHLMC (Gold) Pool J03640 6%/2021	USD	55,341	60,654	0.06
FHLMC (Gold) Pool J15139 4%/2026	USD	102,654	108,765	0.11
FHLMC (Gold) Pool Q04674 4%/2041	USD	77,750	82,257	0.08
FHLMC (Gold) Pool Q14426 3%/2043	USD	625,330	615,657	0.61
FHLMC (Gold) Pool V80025 3%/2043	USD	46,946	46,220	0.05
FirstEnergy SerC 7.375%/2031	USD	155,000	184,366	0.18
FNMA 4.375%/2015	USD	300,000	315,933	0.31
FNMA 7.125%/2030	USD	100,000	146,114	0.14
FNMA Pool 190360 5%/2035	USD	54,345	60,298	0.06
FNMA Pool 254140 5.5%/2017	USD	12,438	13,170	0.01
FNMA Pool 555526 5.5%/2018	USD	13,479	14,273	0.01
FNMA Pool 569097 6.5%/2016	USD	14,016	14,438	0.01
FNMA Pool 670373 6.5%/2017	USD	39,310	41,362	0.04
FNMA Pool 725238 5%/2034	USD	56,877	63,107	0.06
FNMA Pool 735141 5.5%/2035	USD	105,470	117,978	0.12
FNMA Pool 735318 4.5%/2019	USD	24,260	25,727	0.03
FNMA Pool 735500 5.5%/2035	USD	36,831	41,199	0.04
FNMA Pool 735575 5.5%/2018	USD	14,402	15,250	0.02
FNMA Pool 735578 5%/2035	USD	92,226	102,327	0.10
FNMA Pool 735997 5.5%/2035	USD	34,799	38,926	0.04

FNMA Pool 745428 5.5%/2036	USD	225,970	252,768	0.25
FNMA Pool 745458 6%/2036	USD	656	739	0.00
FNMA Pool 745516 5.5%/2036	USD	35,094	39,256	0.04
FNMA Pool 745947 6.5%/2036	USD	11,092	12,512	0.01
FNMA Pool 750412 6.5%/2033	USD	17,779	20,054	0.02
FNMA Pool 763199 VR 1.736%/2033	USD	23,230	24,303	0.02
FNMA Pool 848522 VR 1.987%/2035	USD	19,235	20,204	0.02
FNMA Pool 888223 5.5%/2036	USD	40,541	45,348	0.04
FNMA Pool 888437 5.5%/2036	USD	35,367	39,561	0.04
FNMA Pool 889307 5%/2037	USD	40,380	44,803	0.04
FNMA Pool 889829 5%/2035	USD	349,008	387,235	0.38
FNMA Pool 890565 3%/2043	USD	335,391	330,727	0.33
FNMA Pool 900724 5.5%/2021	USD	7,858	8,321	0.01
FNMA Pool 901646 6.5%/2036	USD	2,925	3,299	0.00
FNMA Pool 902382 6.5%/2036	USD	19,024	21,459	0.02
FNMA Pool 905743 6.5%/2036	USD	27,748	31,299	0.03
FNMA Pool 906064 6%/2037	USD	1,733	1,950	0.00
FNMA Pool 923129 5.5%/2034	USD	23,246	26,003	0.03
FNMA Pool 933051 6.5%/2037	USD	68,157	76,879	0.08
FNMA Pool 942477 6%/2022	USD	5,042	5,596	0.01
FNMA Pool 948410 6%/2022	USD	6,139	6,617	0.01
FNMA Pool 952502 6.5%/2037	USD	46,614	52,579	0.05
FNMA Pool 995051 6%/2037	USD	151,787	170,832	0.17
FNMA Pool 995112 5.5%/2036	USD	72,581	81,188	0.08
FNMA Pool 995203 5%/2035	USD	132,778	147,321	0.15
FNMA Pool 995388 5.5%/2037	USD	22,590	25,269	0.02
FNMA Pool 995434 5%/2023	USD	152,504	161,106	0.16
FNMA Pool AB6491 3%/2042	USD	81,492	80,359	0.08
FNMA Pool AB6496 3%/2042	USD	250,570	247,085	0.24
FNMA Pool AB6633 3.5%/2042	USD	759,046	780,038	0.77
FNMA Pool AB6670 3%/2042	USD	64,434	63,538	0.06
FNMA Pool AB6768 3%/2042	USD	103,723	102,280	0.10
FNMA Pool AB7143 2.5%/2027	USD	269,550	273,551	0.27
FNMA Pool AB7473 3%/2043	USD	111,731	110,177	0.11
FNMA Pool AB7733 3%/2043	USD	364,877	359,803	0.35
FNMA Pool AB7846 3%/2043	USD	268,484	264,750	0.26
FNMA Pool AB8700 3%/2043	USD	1,113,729	1,098,242	1.08
FNMA Pool AB8898 3%/2043	USD	653,524	644,436	0.64
FNMA Pool AC9582 5.5%/2040	USD	127,931	143,103	0.14
FNMA Pool AE0624 4%/2040	USD	212,267	224,970	0.22
FNMA Pool AE0698 4.5%/2040	USD	68,157	73,748	0.07

FNMA Pool AE5471 4.5%/2040	USD	55,782	60,358	0.06
FNMA Pool AH0921 4%/2040	USD	42,023	44,538	0.04
FNMA Pool AH1111 4%/2040	USD	729,994	773,680	0.76
FNMA Pool AL0065 4.5%/2041	USD	238,283	257,830	0.25
FNMA Pool AL0160 4.5%/2041	USD	1,114,079	1,205,468	1.19
FNMA Pool AL0546 5%/2041	USD	327,651	363,540	0.36
FNMA Pool AL1105 4.5%/2040	USD	421,547	456,128	0.45
FNMA Pool AL1524 4.5%/2040	USD	47,531	51,430	0.05
FNMA Pool AL1577 5%/2042	USD	55,109	61,145	0.06
FNMA Pool AL1697 4%/2041	USD	573,258	607,564	0.60
FNMA Pool AL1938 4%/2026	USD	133,652	141,817	0.14
FNMA Pool AL1950 4%/2042	USD	244,712	259,356	0.26
FNMA Pool AL2118 4%/2042	USD	205,316	217,603	0.21
FNMA Pool AL2462 2.5%/2027	USD	308,039	312,611	0.31
FNMA Pool AL2579 4%/2026	USD	331,489	351,741	0.35
FNMA Pool AL2645 4.5%/2027	USD	379,968	402,944	0.40
FNMA Pool AL2661 4%/2026	USD	38,329	40,670	0.04
FNMA Pool AL3318 3.5%/2043	USD	28,814	29,611	0.03
FNMA Pool AL4301 4.5%/2042	USD	118,552	128,277	0.13
FNMA Pool A07977 3%/2027	USD	553,853	574,710	0.57
FNMA Pool AP7539 3%/2027	USD	169,897	176,295	0.17
FNMA Pool AP9736 3.5%/2042	USD	121,770	125,138	0.12
FNMA Pool AP9785 2.5%/2027	USD	336,870	341,870	0.34
FNMA Pool AQ0535 3%/2042	USD	63,122	62,244	0.06
FNMA Pool AQ0546 3.5%/2042	USD	39,677	40,774	0.04
FNMA Pool AQ8653 2.5%/2042	USD	9,333	8,830	0.01
FNMA Pool AQ9316 2.5%/2043	USD	103,368	97,796	0.10
FNMA Pool AQ9330 3.5%/2043	USD	131,178	134,806	0.13
FNMA Pool AR9188 2.5%/2043	USD	141,885	134,503	0.13
FNMA Pool AT2016 3%/2043	USD	224,085	220,969	0.22
FNMA Pool AT2060 2.5%/2028	USD	258,542	262,380	0.26
FNMA Pool AT2721 3%/2043	USD	121,520	119,830	0.12
FNMA Pool MA0907 4%/2041	USD	59,366	62,919	0.06
FNMA Pool MA0971 4%/2042	USD	84,117	89,151	0.09
FNMA Pool MA1086 3.5%/2042	USD	92,093	94,640	0.09
Ford Motor Credit 5.75%/2021	USD	400,000	463,864	0.46
GATX 2.5%/2019	USD	150,000	151,183	0.15
GATX 2.5%/2019	USD	20,000	20,112	0.02
GATX 3.5%/2016	USD	110,000	115,384	0.11
GATX 4.85%/2021	USD	150,000	164,692	0.16
General Electric Capital 5.3%/2021	USD	440,000	501,796	0.49

GNMA 2010-103 IN 4.5%/2039	USD	97,163	11,659	0.01
GNMA 2010-92 PI 4.5%/2037	USD	291,231	36,710	0.04
GNMA 2011-41 AI 4.5%/2039	USD	441,433	73,577	0.07
GNMA 2011-88 EI 4.5%/2039	USD	79,086	13,072	0.01
GNMA 2013-24 OI 4%/2043	USD	120,679	25,280	0.02
GNMA I Pool 616826 5.5%/2035	USD	19,059	21,859	0.02
GNMA I Pool 783403 3.5%/2041	USD	158,702	164,679	0.16
GNMA II 3.5%/2044	USD	580,000	602,928	0.59
GNMA II Pool 3306 5.5%/2032	USD	174,413	194,497	0.19
GNMA II Pool 3490 6.5%/2033	USD	280,347	325,638	0.32
GNMA II Pool 3611 6%/2034	USD	96,428	110,311	0.11
GNMA II Pool 4060 6%/2037	USD	13,725	15,612	0.02
GNMA II Pool 4498 6%/2039	USD	14,119	16,033	0.02
GNMA II Pool 4558 4.5%/2039	USD	290,479	316,849	0.31
GNMA II Pool 4559 5%/2039	USD	64,851	71,468	0.07
GNMA II Pool 4577 4.5%/2039	USD	29,741	32,441	0.03
GNMA II Pool 4618 5%/2040	USD	69,918	77,052	0.08
GNMA II Pool 4800 4%/2040	USD	124,467	133,043	0.13
GNMA II Pool 4801 4.5%/2040	USD	118,996	129,799	0.13
GNMA II Pool 4833 4%/2040	USD	153,738	164,332	0.16
GNMA II Pool 4834 4.5%/2040	USD	94,693	103,289	0.10
GNMA II Pool 4854 4.5%/2040	USD	96,430	105,184	0.10
GNMA II Pool 4882 4%/2040	USD	199,217	212,945	0.21
GNMA II Pool 4946 4.5%/2041	USD	388,297	423,547	0.42
GNMA II Pool 4978 4.5%/2041	USD	298,567	325,672	0.32
GNMA II Pool 4979 5%/2041	USD	252,413	278,168	0.27
GNMA II Pool 5054 4%/2041	USD	168,095	179,677	0.18
GNMA II Pool MA0221 4%/2042	USD	317,480	339,356	0.33
GNMA II Pool MA0318 3.5%/2042	USD	185,205	192,526	0.19
GNMA II Pool MA0623 2.5%/2042	USD	127,119	122,736	0.12
GNMA II Pool MA0624 3%/2042	USD	366,204	368,893	0.36
GNMA II Pool MA0697 2.5%/2043	USD	597,351	576,770	0.57
GNMA II Pool MA0781 2.5%/2043	USD	77,079	74,422	0.07
GNMA II Pool MA0986 2.5%/2028	USD	35,313	36,336	0.04
GNMA II Pool MA1012 3.5%/2043	USD	950,241	987,805	0.97
GNMA II Pool MA1919 3.5%/2044	USD	359,175	373,373	0.37
Goldman Sachs Group 2.375%/2018	USD	100,000	101,778	0.10
Goldman Sachs Group 3.625%/2023	USD	395,000	396,590	0.39
Goldman Sachs Group 5.75%/2022	USD	315,000	365,002	0.36
Goldman Sachs Group SerGMTN 7.5%/2019	USD	330,000	403,296	0.40
International Paper 4.75%/2022	USD	195,000	214,927	0.21

Interpublic Group of Companies				
3.75%/2023	USD	70,000	70,076	0.07
Interpublic Group of Companies 4%/2022	USD	65,000	66,836	0.07
JPMorgan Chase & Co 4.5%/2022	USD	360,000	393,561	0.39
Merrill Lynch SerMTN 6.875%/2018	USD	400,000	471,462	0.47
Morgan Stanley 2.125%/2018	USD	355,000	358,875	0.35
Morgan Stanley SerGMTN 5.5%/2021	USD	185,000	212,596	0.21
Morgan Stanley SerGMTN 7.3%/2019	USD	175,000	214,020	0.21
Murphy Oil 4%/2022	USD	215,000	219,205	0.22
Newell Rubbermaid 2.05%/2017	USD	55,000	55,569	0.06
Noble Energy 6%/2041	USD	120,000	143,677	0.14
PPL Capital Funding 3.5%/2022	USD	90,000	91,548	0.09
Provident 7%/2018	USD	165,000	193,374	0.19
Reinsurance Group of America 5%/2021	USD	105,000	115,884	0.11
Reinsurance Group of America				
5.625%/2017	USD	50,000	54,619	0.05
Reinsurance Group of America 6.45%/2019	USD	70,000	82,712	0.08
Reynolds American 3.25%/2022	USD	90,000	86,836	0.09
Rowan 4.875%/2022	USD	100,000	107,604	0.11
Rowan 5%/2017	USD	105,000	115,013	0.11
Textron 4.3%/2024	USD	85,000	88,081	0.09
Thermo Fisher Scientific 2.4%/2019	USD	40,000	40,396	0.04
Thermo Fisher Scientific 4.15%/2024	USD	90,000	94,174	0.09
Time Warner Cable 6.55%/2037	USD	145,000	180,874	0.18
Time Warner Cable 8.25%/2019	USD	170,000	215,121	0.21
Tyson Foods 4.5%/2022	USD	130,000	136,960	0.13
Unum Group 5.625%/2020	USD	80,000	91,852	0.09
US Treasury 0.875%/2017	USD	2,100,000	2,106,891	2.08
US Treasury 1.25%/2018	USD	7,305,000	7,243,364	7.14
US Treasury 2.625%/2016	USD	3,325,000	3,461,052	3.41
US Treasury 3.125%/2043	USD	2,445,000	2,342,234	2.31
US Treasury 5.375%/2031	USD	610,000	798,623	0.79
US Treasury Inflation Indexed				
0.625%/2024	USD	1,150,000	1,209,564	1.19
US Treasury Inflation Indexed				
1.375%/2044	USD	565,000	629,575	0.62
US Treasury Inflation Indexed 1.625%				
15/1/2015	USD	480,000	606,017	0.60
US Treasury Inflation Indexed 2%				
15/7/2014	USD	956,000	1,205,045	1.19
Valmont Industries 6.625%/2020	USD	150,000	178,307	0.18

Verizon Communications 4.5%/2020	USD	210,000	231,572	0.23
Verizon Communications 5.05%/2034	USD	200,000	213,394	0.21
Verizon Communications 5.15%/2023	USD	175,000	196,122	0.19
Verizon Communications 6.4%/2033	USD	720,000	881,136	0.87
Western Gas Partners 4%/2022	USD	175,000	181,583	0.18
Williams Companies 4.55%/2024	USD	110,000	110,696	0.11
Williams Partners 4.125%/2020	USD	70,000	74,465	0.07
Williams Partners 6.3%/2040	USD	180,000	213,009	0.21
アメリカ 計			62,770,238	61.87

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 **68,348,122** **67.36**

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

Origin Energy Finance Ser144A 3.5%/2018	USD	200,000	207,043	0.20
SMART Trust 2012-4US A4A 1.25%/2018	USD	190,000	189,973	0.19
SMART Trust 2013-1US A4A 1.05%/2018	USD	90,000	90,063	0.09
SMART Trust 2013-2US A4A 1.18%/2019	USD	110,000	109,736	0.11
SMART Trust 2014-1US A4A 1.68%/2019	USD	120,000	120,601	0.12
オーストラリア 計			717,416	0.71

バミューダ

Bermuda Government International Bond

Ser144A 5.603%/2020	USD	100,000	112,000	0.11
---------------------	-----	---------	---------	------

バミューダ 計 **112,000** **0.11**

ブラジル

Itau Unibanco Holding SerRegs

5.65%/2022	USD	200,000	206,938	0.20
------------	-----	---------	---------	------

ブラジル 計 **206,938** **0.20**

チリ

Banco Santander Chile Ser144A

3.875%/2022	USD	150,000	151,426	0.15
-------------	-----	---------	---------	------

チリ 計 **151,426** **0.15**

フランス

BPCE Ser144A 5.15%/2024	USD	400,000	423,242	0.41
-------------------------	-----	---------	---------	------

Credit Agricole/London Branch Ser144A				
2.5%/2019	USD	250,000	252,285	0.25
RCI Banque Ser144A 4.6%/2016				
	USD	200,000	211,947	0.21
フランス 計			887,474	0.87
アイルランド				
Iberdrola Finance Ireland Ser144A 3.8%				
11/9/2014	USD	135,000	135,794	0.13
Perrigo Ser144A 2.3%/2018				
	USD	200,000	199,658	0.20
アイルランド 計			335,452	0.33
イタリア				
Intesa Sanpaolo Ser144A 5.017%/2024				
	USD	200,000	202,611	0.20
イタリア 計			202,611	0.20
ルクセンブルグ				
Holcim US Finance Ser144A 6%/2019				
	USD	135,000	156,917	0.16
SES Ser144A 3.6%/2023				
	USD	95,000	95,436	0.09
ルクセンブルグ 計			252,353	0.25
メキシコ				
Petroleos Mexicanos 3.5%/2018				
	USD	95,000	99,893	0.10
Petroleos Mexicanos 4.875%/2022				
	USD	535,000	577,837	0.57
メキシコ 計			677,730	0.67
オランダ				
Cooperatieve Centrale Raiffeisen-				
Boerenleenbank 4.625%/2023				
	USD	250,000	264,390	0.26
Petrobras Global Finance 3%/2019				
	USD	120,000	117,725	0.12
Petrobras Global Finance 4.375%/2023				
	USD	125,000	120,404	0.12
オランダ 計			502,519	0.50
スウェーデン				
Nordea Bank Ser144A 4.875%/2021				
	USD	290,000	314,923	0.31
スウェーデン 計			314,923	0.31
イギリス				
Holmes Master Issuer 2012-1A A2 Ser144A				
VR 1.876%/2054	USD	180,171	181,822	0.18
Lanark Master Issuer 2013-1A 1A1				
Ser144A VR 0.728%/2054	USD	265,000	265,402	0.26

Motor 12A A1C Ser144A 1.286%/2020	USD	133,333	133,503	0.13
Santander UK Ser144A 5%/2023	USD	200,000	214,987	0.21
WPP Finance 2010 4.75%/2021	USD	300,000	329,794	0.33
イギリス 計			1,125,508	1.11
アメリカ 計				
Ally Auto Receivables Trust 2012-A D Ser144A 3.15%/2018	USD	70,000	72,187	0.07
Ally Master Owner Trust 2014-1 A2 1.29%/2019	USD	145,000	145,293	0.14
American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust Ser144A 4%/2025	USD	72,968	74,747	0.07
American Express Credit Account Master Trust 2012-5 C Ser144A 1.07%/2018	USD	100,000	100,532	0.10
Avis Budget Rental Car Funding AESOP 2013-1A A 1.92%/2019	USD	270,000	269,191	0.27
Avis Budget Rental Car Funding AESOP 2014-1A A 2.46%/2020	USD	280,000	282,136	0.28
Avon Products 5%/2023	USD	165,000	167,374	0.16
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2006-3 AM VR 6.043%/2044	USD	140,000	148,670	0.15
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2006-5 AM 5.448%/2047	USD	275,000	296,045	0.29
Bank of America 3.875%/2017	USD	190,000	202,592	0.20
Bank of America Commercial Mortgage Trust 2007-4 AM VR 6.015%/2051	USD	120,000	134,457	0.13
Bank of America Mortgage Securities 2004-A 2A2 VR 2.68%/2034	USD	16,763	16,842	0.02
Bank of America Mortgage Securities 2004-B 2A2 VR 2.638%/2034	USD	100,023	101,971	0.10
Bank of America Mortgage Securities 2004-D 2A2 VR 2.634%/2034	USD	234,372	237,192	0.23
Bank of America Mortgage Securities 2004-H 2A2 VR 2.745%/2034	USD	104,305	104,620	0.10
Bank of America Mortgage Securities 2004-I 3A2 VR 2.746%/2034	USD	49,921	50,018	0.05
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 2A1 VR 2.76%/2035	USD	256,597	238,073	0.23
Bank of America Mortgage Securities 2005-J 3A1 VR 2.806%/2035	USD	119,758	114,071	0.11

Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007-PW17 A4 VR	5.694%/2050	USD	120,000	133,668	0.13
Cabela's Master Credit Card Trust 2012-1A Ser144A 1.63%/2020		USD	100,000	101,382	0.10
Capital Auto Receivables Asset Trust 2013-1 B 1.29%/2018		USD	15,000	15,057	0.01
Capital Auto Receivables Asset Trust 2013-1 C 1.74%/2018		USD	20,000	20,044	0.02
Capital Auto Receivables Asset Trust 2014-1 C 2.84%/2019		USD	30,000	30,591	0.03
CarMax Auto Owner Trust 2010-2 B	3.96%/2016	USD	380,000	380,645	0.38
CarMax Auto Owner Trust 2014-1 B	1.69%/2019	USD	25,000	24,988	0.02
CarMax Auto Owner Trust 2014-1 C	1.93%/2019	USD	35,000	35,034	0.03
CC Holdings GS V / Crown Castle GS III	3.849%/2023	USD	350,000	351,613	0.35
Celgene 5.25%/2043		USD	110,000	119,458	0.12
Chase Issuance Trust 2013-A8 A8	1.01%/2018	USD	145,000	145,474	0.14
Chicago Illinois Metropolitan Water Reclamation 5.72%/2038		USD	225,000	269,228	0.27
Chicago Illinois O' Hare International Airport General Third Lien Series B	6.395%/2040	USD	170,000	216,077	0.21
Chicago Illinois Transit Authority Sales And Taxable-pension Funding Series A 6.899%/2040		USD	170,000	211,932	0.21
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 AS 4.026%/2047		USD	100,000	103,961	0.10
City of Los Angeles Department of Airports 7.053%/2040		USD	185,000	239,790	0.24
CKE Restaurant Holdings 2013-1A A2	Ser144A 4.474%/2043	USD	289,469	297,491	0.29
CNH Equipment Trust 2012-D B 1.27%/2020		USD	105,000	105,157	0.10
CNH Equipment Trust 2013-D A3	0.77%/2018	USD	150,000	150,065	0.15
CNH Wholesale Master Note Trust 2013-2A	A VR 0.752%/2019	USD	155,000	155,515	0.15

COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust					
2007-C3 AM VR 5.965%/2046	USD	60,000	66,233	0.07	
Comcast 6.95%/2037	USD	185,000	249,410	0.25	
Commercial Mortgage Trust 2014-CR15 C					
VR 4.921%/2047	USD	190,000	202,130	0.20	
Commercial Mortgage Trust 2014-TWC A VR					
1.002%/2032	USD	100,000	100,237	0.10	
Commercial Mortgage Trust 2014-UBS2 C					
VR 5.151%/2047	USD	110,000	117,823	0.12	
Commercial Mortgage Pass Through					
Certificates 2013-CR13 C VR 4.916%/2023	USD	85,000	90,042	0.09	
Commercial Mortgage Trust 2007-GG9 AM					
5.475%/2039	USD	150,000	161,808	0.16	
Commercial Mortgage Trust 2007-GG9 AMFX					
5.475%/2039	USD	220,000	237,319	0.23	
Commonwealth of Massachusetts 4.5%/2031	USD	160,000	174,251	0.17	
Continental Airlines 2009-2 Class A					
Pass Through Trust SerA 7.25%/2019	USD	80,069	93,681	0.09	
Continental Airlines 2010-1 Class A					
Pass Through Trust SerA 4.75%/2021	USD	60,235	65,192	0.06	
Continental Airlines 2012-1 Class A					
Pass Through Trust SerA 4.15%/2024	USD	42,785	44,844	0.04	
Continental Resources 5%/2022	USD	275,000	299,666	0.30	
COX Communications Ser144A 3.25%/2022	USD	230,000	225,372	0.22	
Credit Suisse First Boston Commercial					
Mortgage Pass-Through Certificates					
Series 2008-C1 A3 VR 6.175%/2041	USD	545,000	611,270	0.60	
Crown Castle Towers Ser144A 6.113%/2020	USD	213,000	250,890	0.25	
CSMC Series 2014-ICE A VR 1.05%/2027	USD	100,000	100,148	0.10	
DCP Midstream Operating 3.875%/2023	USD	85,000	86,095	0.09	
Delphi 4.15%/2024	USD	190,000	196,937	0.19	
Delta Air Lines 2011-1 Class A Pass					
Through Trust SerA 5.3%/2019	USD	46,915	51,944	0.05	
Delta Air Lines 2010-2 Class A Pass					
Through Trust Ser2A 4.95%/2019	USD	50,757	55,563	0.06	
Denver City & County School District No					
1 4.242%/2037	USD	70,000	68,627	0.07	
Diamond Resorts Owner Trust 2013-2 A					
2.27%/2026	USD	94,250	94,691	0.09	
DIRECTV Holdings 3.8%/2022	USD	40,000	41,290	0.04	
District of Columbia 5.591%/2034	USD	60,000	72,263	0.07	

Domino's Pizza Master Issuer 2012-1A A2					
Ser144A 5.216%/2042	USD	323,694	348,037	0.34	
East Bay Municipal Utility District					
Water System Revenue 5.874%/2040	USD	115,000	145,854	0.14	
Enogex Ser144A 6.25%/2020	USD	60,000	69,000	0.07	
Enterprise Fleet Financing 2013-2 A2					
1.06%/2019	USD	194,198	195,067	0.19	
Enterprise Products Operating					
3.35%/2023	USD	185,000	184,865	0.18	
Exeter Automobile Receivables Trust					
2014-2 A 1.06%/2018	USD	50,000	50,003	0.05	
FHLMC Multifamily Structured Pass					
Through Certificates 1.875%/2022	USD	121,069	120,852	0.12	
FHLMC Multifamily Structured Pass					
Through Certificates K502 A2					
1.426%/2017	USD	75,000	75,657	0.08	
FirstEnergy SerA 2.75%/2018	USD	65,000	65,673	0.07	
FirstEnergy SerB 4.25%/2023	USD	130,000	129,745	0.13	
FirstEnergy Transmission Ser144A					
4.35%/2025	USD	100,000	100,895	0.10	
FirstEnergy Transmission Ser144A					
4.35%/2025	USD	50,000	50,447	0.05	
Fiserv 3.125%/2016	USD	80,000	83,196	0.08	
Fiserv 3.5%/2022	USD	80,000	80,230	0.08	
Florida Hurricane Catastrophe Fund					
Finance 1.298%/2016	USD	125,000	126,345	0.12	
Florida Hurricane Catastrophe Fund					
Finance SerA 2.995%/2020	USD	140,000	139,553	0.14	
Ford Credit Floorplan Master Owner					
Trust 2010-3 C Ser144A 4.99%/2017	USD	590,000	606,367	0.60	
GE Equipment Small Ticket Series 2013-					
1A A3 1.02%/2017	USD	115,000	115,778	0.11	
Grain Spectrum Funding Ser144A 4%/2018	USD	195,000	194,465	0.19	
GS Mortgage Securities 2014-GC20 B VR					
4.529%/2047	USD	80,000	84,233	0.08	
GS Mortgage Securities II 2012-GCJ9 A3					
2.773%/2045	USD	135,000	132,277	0.13	
GSA Trust 2005-8 A3 VR 0.582%/2035	USD	90,955	84,815	0.08	
GTP Acquisition Partners I Ser144A					
2.364%/2018	USD	125,000	123,137	0.12	
GTP Acquisition Partners I Ser144A					
4.347%/2016	USD	70,000	72,491	0.07	

Hilton Grand Vacations Trust 2014-A				
1.77%/2026	USD	145,000	145,000	0.14
Huntington Auto Trust 2011-1A C Ser144A				
2.53%/2017	USD	155,000	158,011	0.16
Hyundai Auto Lease Securitization Trust				
2012-A A4 Ser144A 1.05%/2017	USD	100,000	100,265	0.10
Hyundai Auto Lease Securitization Trust				
2013-B A2 0.75%/2016	USD	83,411	83,586	0.08
Hyundai Capital America Ser144A				
1.875%/2016	USD	55,000	55,844	0.06
Hyundai Capital America Ser144A				
2.55%/2019	USD	145,000	146,550	0.15
Hyundai Capital America Ser144A				
2.875%/2018	USD	90,000	92,514	0.09
Invitation Homes 2014-SFR1 Trust A VR				
1.154%/2031	USD	140,000	140,531	0.14
JobsOhio Beverage System 4.532%/2035	USD	100,000	102,369	0.10
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2005-LDP4 ASB VR				
4.824%/2042	USD	135,245	136,302	0.13
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2006-CB15 A4 VR				
5.814%/2043	USD	327,756	353,327	0.35
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2006-LDP9 A3				
5.336%/2047	USD	160,000	173,745	0.17
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2007-CB18 A4				
5.44%/2047	USD	374,534	408,903	0.40
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2007-CB19 AM VR				
5.892%/2049	USD	325,000	354,440	0.35
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2007-LD12 A4 VR				
5.882%/2051	USD	210,000	232,905	0.23
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2007-LD12 AM VR				
6.218%/2051	USD	140,000	157,237	0.15
JP Morgan Chase Commercial Mortgage				
Securities Trust 2012-C8 A3 2.829%/2045	USD	185,000	182,757	0.18

JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2006-LDP8 AJ VR 5.48%/2045	USD	30,000	32,044	0.03
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CB19 A4 VR 5.892%/2049	USD	200,000	220,848	0.22
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Series Trust 2013-LC11 2013-LC11 A5 2.96%/2046	USD	145,000	143,208	0.14
JPMorgan Chase & Co 3.375%/2023	USD	140,000	137,570	0.14
Kansas City Southern Railway Ser144A 4.3%/2043	USD	305,000	289,524	0.29
Kansas Development Finance Authority 5.501%/2034	USD	200,000	220,264	0.22
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007- C2 AM VR 5.493%/2040	USD	225,000	242,201	0.24
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007- C6 AM VR 6.114%/2040	USD	160,000	178,068	0.18
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008- C1 AM VR 6.32%/2041	USD	110,000	125,322	0.12
Life Technologies 6%/2020	USD	125,000	145,689	0.14
Marsh & McLennan 3.5%/2024	USD	90,000	89,944	0.09
Marsh & McLennan 3.5%/2024	USD	20,000	19,988	0.02
Maryland State Transportation Authority 5.754%/2041	USD	200,000	245,426	0.24
Maryland State Transportation Authority 5.888%/2043	USD	165,000	208,476	0.21
Mercedes Benz Auto Lease Trust 2013-B A4 0.76%/2019	USD	135,000	135,352	0.13
Merrill Lynch Mortgage Trust 2006-C2 AM VR 5.782%/2043	USD	135,000	146,554	0.15
Merrill Lynch Mortgage Trust 2008-C1 A4 5.69%/2051	USD	420,713	470,810	0.46
Metropolitan Transportation Authority New York Taxable SerC-build America Bds- 7.336%/2039	USD	80,000	116,258	0.12
MMAF Equipment Finance 2014-A A4 1.59%/2022	USD	110,000	110,059	0.12
Morgan Stanley 3.75%/2023	USD	240,000	244,242	0.24
Morgan Stanley 5%/2025	USD	240,000	256,884	0.25
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 B VR 4.565%/2047	USD	80,000	84,733	0.08

MVW Owner Trust 2013-1 2013-1A A					
Ser144A 2.15%/2030	USD	76,828	77,533	0.08	
Navistar Financial Dealer Note Master					
Trust 2013-2 A Ser144A VR 0.83%/2018	USD	145,000	145,624	0.14	
NBCUniversal Media 2.875%/2023	USD	480,000	474,300	0.47	
New York City Water & Sewer System					
5.952%/2042	USD	120,000	153,934	0.15	
Nissan Auto Lease Trust 2013-B 2013-B					
A3 0.75%/2016	USD	35,000	35,125	0.04	
Nissan Auto Receivables 2013-B Owner					
Trust 2013-B A3 0.84%/2017	USD	100,000	100,375	0.10	
Nordstrom Credit Card Master Note Trust					
II 2011-1A A Ser144A 2.28%/2019	USD	385,000	394,136	0.39	
O'Reilly Automotive 4.875%/2021	USD	175,000	192,584	0.19	
Penske Truck Leasing Ser144A 2.5%/2019	USD	115,000	115,094	0.11	
Philadelphia Authority for Industrial					
Development 3.964%/2026	USD	270,000	269,541	0.27	
Phillips 66 4.3%/2022	USD	120,000	129,604	0.13	
Port Authority of New York & New Jersey					
4.458%/2062	USD	330,000	336,795	0.33	
PPL Capital Funding 3.4%/2023	USD	85,000	85,021	0.08	
QVC 3.125%/2019	USD	270,000	275,743	0.27	
San Diego County Water Authority					
6.138%/2049	USD	125,000	163,870	0.16	
SBA Tower Trust Ser144A 2.933%/2017	USD	150,000	153,061	0.15	
Sequoia Mortgage Trust 2010-H1 A1 VR					
3.75%/2040	USD	4,340	4,278	0.00	
Sequoia Mortgage Trust 2013-6 A1 VR					
2.5%/2043	USD	180,526	165,038	0.16	
Sequoia Mortgage Trust 2013-7 A2 VR					
3%/2043	USD	95,669	92,044	0.09	
Sierra Timeshare 2013-1 Receivables					
Funding 2013-1A A 1.59%/2029	USD	66,944	67,246	0.07	
Sierra Timeshare 2013-2 Receivables					
Funding 2013-2A A Ser144A 2.28%/2025	USD	121,877	123,541	0.12	
Sierra Timeshare Receivables Funding					
2013-3A A Ser144A 2.2%/2030	USD	107,857	108,469	0.11	
Sierra Timeshare Receivables Funding					
2014-1A A 2.07%/2030	USD	163,571	163,880	0.16	
Sirius XM Radio Ser144A 5.25%/2022	USD	185,000	200,263	0.20	
Spectra Energy Capital 3.3%/2023	USD	185,000	176,452	0.17	

US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625%/2025	USD	114,709	121,807	0.12
US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95%/2025	USD	125,000	126,875	0.13
Utah Transit Authority 5.937%/2039	USD	185,000	229,888	0.23
Utility Debt Securitization Authority Series 2013-T T1 2.042%/2021	USD	100,000	102,136	0.10
Verisk Analytics 5.8%/2021	USD	115,000	129,144	0.13
Virginia Commonwealth Transportation Board 5.35%/2035	USD	45,000	52,267	0.05
Volkswagen Auto Lease Trust 2012-A A4 1.06%/2017	USD	160,000	160,333	0.16
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C13 A4 3.001%/2045	USD	185,000	182,587	0.18
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C19 B VR 4.723%/2047	USD	45,000	48,307	0.05
Williams Companies 3.7%/2023	USD	135,000	129,585	0.13
アメリカ 計			25,374,119	25.01

その他の規制のある市場において取引されている有価証券

計			30,860,469	30.42
----------	--	--	-------------------	--------------

直近に発行された取引可能な有価証券

アメリカ

American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust Ser144A 4.95%/2023	USD	194,080	209,364	0.21
Martin Marietta Materials Ser144A 4.25%/2024	USD	55,000	55,148	0.05
アメリカ 計			264,512	0.26

直近に発行された取引可能な有価証券 計

264,512	0.26
----------------	-------------

有価証券 計

99,473,103	98.04
-------------------	--------------

先物取引

銘柄名	満期日	契約額（米ドル）	評価（損）益 （米ドル）	対純資産比率 （％）
Long, 2				
US Ultra Bond Note Contracts	September 2014	298,313	345	
先物取引に係る評価益			345	

銘柄名	満期日	契約額（米ドル）	評価（損）益 （米ドル）	対純資産比率 （％）
Short, 4				
US Long Bond Note Contracts	September 2014	(547,000)	(1,688)	
Long, 4 five-year				
US Treasury Note Contracts	September 2014	477,438	(656)	
Short, 47 ten-year				
US Treasury Note Contracts	September 2014	(5,876,469)	(15,195)	
先物取引に係る評価損			(17,539)	
先物取引に係る評価損 計			(17,194)	(0.02)
ヘッジ証券に対する為替予約取引に係る評価（損）益 計			87,150	0.09
その他資産（負債控除後）			1,916,511	1.89
純資産			101,459,570	100.00

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

EMTN: Euro Medium Term Note

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

USD:米ドル

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
2014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。2014年6月30日に終了した年度において、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
	Q(ユーロ)	2014年2月11日	ユーロ
	SD	2014年2月14日	ユーロ
	Z	2001年6月20日	ユーロ
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	A	2011年 9月20日	ユーロ
	I	2011年 9月20日	ユーロ
	Q(ユーロ)	2014年2月11日	ユーロ
	SD	2014年2月14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
	Z	2001年7月9日	米ドル
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	A	2006年 6月27日	米ドル
	I	2004年12月31日	米ドル
	Id	2008年10月 7日	米ドル
	SD	2014年2月19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
	SD	2014年2月19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
	Qh(英ポンド)	2014年 2月 7日	英ポンド
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	A	2001年 8月17日	米ドル
	Ad	2009年 6月 2日	米ドル
	Ah(ユーロ)	2003年 4月 2日	ユーロ
	Ah(ノルウェー・クローネ)	2004年 7月15日	ノルウェー・クローネ
	Ah(スウェーデン・クローナ)	2012年6月26日	スウェーデン・クローナ
	I	2002年 3月 4日	米ドル
	Jd	2003年12月5日	米ドル
	Q	2013年1月14日	米ドル
	SD	2014年2月14日	米ドル
	Z	2001年6月28日	米ドル
USアグリゲート・ボンド・ファンド	I	2011年 6月 7日	米ドル
	Ih(ユーロ)	2013年 6月 1日	ユーロ
	Jd	2003年12月5日	米ドル
アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	A	2008年 1月28日	米ドル
	I	2006年12月13日	米ドル
	Id	2013年10月11日	米ドル
	Q	2013年1月31日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年3月31日	英ポンド
アジア・オパチュニティズ・エクイティ・ファンド(1)	A	2014年5月21日	米ドル

	I	2014年5月21日	米ドル
	Q	2014年5月21日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年5月21日	英ポンド
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
	Q(ユーロ)	2013年10月16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・スモーカー・カンパニーズ・エクイティ・ ファンド	A	2008年11月26日	ユーロ
	I	2008年11月26日	ユーロ
	Q(ユーロ)	2013年12月4日	ユーロ
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
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
フロンティア・マーケット・エクイティ・ファンド(2)	A	2014年6月24日	米ドル
	I	2014年6月24日	米ドル
	Q	2014年6月24日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年6月24日	英ポンド
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	A	2004年10月26日	米ドル
	Ad	2011年 3月 9日	米ドル
	I	2003年12月 2日	米ドル
	Jd	2007年10月31日	米ドル
	Q	2013年1月14日	米ドル
	Q(英ポンド)	2013年9月5日	英ポンド
グローバル・フォーカス・グロース・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
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
グローバル・グロース・エクイティ・ファンド	A	2008年10月27日	米ドル
	I	2008年10月27日	米ドル
	I(英ポンド)	2009年 7月10日	英ポンド
	Q(英ポンド)	2013年8月28日	英ポンド
	S	2011年3月11日	米ドル
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ ファンド	A	2007年11月5日	米ドル
	I	2006年11月15日	米ドル
	Q(ユーロ)	2013年1月18日	ユーロ
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	A	2012年11月28日	米ドル
	I	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	A	2008年10月27日	米ドル
	I	2008年10月27日	米ドル
	(Q 英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	A	2006年 4月11日	ユーロ
	I	2005年12月16日	ユーロ
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	A	2009年 6月19日	米ドル
	I	2008年 4月24日	米ドル
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ ファンド	A	2007年12月24日	米ドル
	I	2007年 9月 4日	米ドル
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	A	2003年 2月 5日	米ドル
	J	2007年2月20日	米ドル
	Q	2013年5月13日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
USラージキャップ・エクイティ・ ファンド	A	2009年6月26日	米ドル
	I	2009年6月26日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ ファンド	A	2003年11月13日	米ドル

	I	2003年7月31日	米ドル
	J	2007年2月20日	米ドル
	Q	2013年1月14日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	A	2003年 1月 3日	米ドル
	I	2002年3月27日	米ドル
	J	2007年2月20日	米ドル
	Q	2013年1月31日	米ドル
	Q(英ポンド)	2014年 1月31日	英ポンド
USモーター・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	2001年7月31日	米ドル
	A(ユーロ)	2013年5月22日	ユーロ
	I	2001年9月28日	米ドル
	Ih(ユーロ)	2014年3月31日	ユーロ
	Q	2013年5月8日	米ドル
	Q(英ポンド)	2013年1月18日	英ポンド

(1) 当ファンドは、2014年5月21日に設定された。

(2) 当ファンドは、2014年6月24日に設定された。

2014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・ファンドの投資家のみに、クラスI(英ポンド)証券は現在、グローバル・ラージキャップ・エクイティ・ファンドの投資家のみに、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・ファンドの投資家のみに、Sh証券は現在、グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンドの投資家のみに販売されている。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・フィックスド・インカム・アプソルート・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

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は取締役会の監督の下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。

2012年の純資産額の情報は各々の決算日におけるファンドの公式な純資産額を反映するために訂正された。過年度の情報は、取引所の最終相場による評価と直近の売買価格による評価を含んで純資産額を開示していた。

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、当年度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	2014年6月30日 現在のレート	2014年6月30日に終了した 期間の平均レート
ユーロ	0.7304	0.7293
ノルウェー・クローネ	6.1363	5.9314
スウェーデン・クローナ	6.6854	6.5199
日本円	101.31	102.48
英ポンド	0.5848	0.5990

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2014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

2014年6月30日に終了した期間において、アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンドとグローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンドは、中国の現地投資家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、2014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	125.82
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	170.03
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	93.53
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	178.62
グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	143.29
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	146.81
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	308.21
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	25.93
USアグリゲート・ボンド・ファンド	70.42
アジア・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	44.45
エマージング・ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	65.52
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	45.41
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	38.62
ヨーロッパ・スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	28.99
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	53.98
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	18.98
グローバル・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンド	251.34
グローバル・グロース・エクイティ・ファンド	181.74
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	117.93
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	154.17
グローバル・リアルエステート・セキュリティーズ・ファンド	31.64
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	95.25
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	53.65
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	81.41
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	18.21
USラージキャップ・エクイティ・ファンド	130.34
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	29.00
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	(31.40)
USスモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	(4.81)

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。

2014年6月30日に終了した期間に支払われた配当金は下表のとおりである。

ファンド名	クラス	通貨	一口当たり 配当金	権利落日
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	Sd	ユーロ	0.025650	2014年 3月20日

	Sd	ユーロ	0.076580	2014年 6月24日
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Sd	ユーロ	0.057025	2014年 3月20日
	Sd	ユーロ	0.172455	2014年 6月24日
グローバル・アグリゲート・ボンド・ファンド	ld	米ドル	0.042102	2014年 1月24日
	ld	米ドル	0.022977	2014年 2月24日
	ld	米ドル	0.020387	2014年 3月20日
	ld	米ドル	0.024733	2014年 4月24日
	ld	米ドル	0.020392	2014年 5月23日
	ld	米ドル	0.020470	2014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	ld	米ドル	0.075871	2014年 1月24日
	ld	米ドル	0.046871	2014年 2月24日
	ld	米ドル	0.040324	2014年 3月20日
	ld	米ドル	0.059184	2014年 4月24日
	ld	米ドル	0.052273	2013年 5月23日
	ld	米ドル	0.045317	2014年 6月24日
	Sd	米ドル	0.043300	2014年 3月20日
	Sd	米ドル	0.158060	2014年 6月24日
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	Sd	米ドル	0.060500	2014年 3月20日
	Sd	米ドル	0.157704	2014年 6月24日
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	Ad	米ドル	0.171616	2014年 3月20日
	Ad	米ドル	0.160326	2014年 6月24日
	Jd	米ドル	0.064302	2014年 1月24日
	Jd	米ドル	0.052864	2014年 2月24日
	Jd	米ドル	0.052305	2014年 3月20日
	Jd	米ドル	0.062866	2014年 4月24日
	Jd	米ドル	0.049487	2014年 5月23日
	Jd	米ドル	0.049935	2014年 6月24日
	Sd	米ドル	0.061980	2014年 3月20日
	Sd	米ドル	0.155105	2014年 6月24日
USアグリゲート・ボンド・ファンド	Jd	米ドル	0.034351	2014年 1月24日
	Jd	米ドル	0.035169	2014年 4月24日
	Jd	米ドル	0.027570	2014年 5月23日
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	ld	米ドル	0.008957	2014年 3月20日
	ld	米ドル	0.064304	2014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	0.028650	2014年 6月24日
	Jd	米ドル	0.016843	2014年 2月24日
	Jd	米ドル	0.039686	2014年5月23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

2014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、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。2014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・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンドおよびグローバル・グロース・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。

2014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	17,783,999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	5,209,777米ドル
グローバル・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンド	24,403,554米ドル
グローバル・グロース・エクイティ・ファンド	483,634米ドル

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

8. 関連当事者との取引

a) 運用報酬

ファンドは、T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド(以下「運用会社」)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%
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	1.90%	1.00%	1.00%
アジアン・オポチュニティズ・エクイティ・ファンド(1)	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%
フロンティア・マーケット・エクイティ・ファンド(2)	2.00%	1.10%	1.10%
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・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンド	1.60%	0.75%	0.75%
グローバル・グロース・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スモラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	1.60%	0.95%	0.95%

(1) 当ファンドは、2014年5月21日に設定された。

(2) 当ファンドは、2014年6月24日に設定された。

* Ad、A(ユーロ)、Ah(ユーロ)、Ah(ノルウェー・クローネ)およびAh(スウェーデン・クローナ)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、クラスJ及びクラスZ投資証券には運用報酬はない。

運用会社は、ファンドの販売手数料にあたる報酬(トレイラー・フィー)を運用報酬の一部から支払うことがある。さらに、運用会社は、営業上の観点から第三者のためにファンドの投資証券を保有する機関投資家に払戻しを行うことがある。

b) 運用報酬等の権利放棄

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

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、2014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
	Z	-	-
	Sd	0.10	0.10
	Q(ユーロ)**	0.57	0.57
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	A	1.32	1.32
	Sd	0.10	0.10
	Q(ユーロ)**	0.77	0.77
	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
	Z	-	-
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
	Sd	0.10	0.10
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
	Sd	0.10	0.10
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
	QH(英ポンド)**	0.62	0.62
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	A	1.26	1.32
	Ad	1.32	1.32
	Ah(ユーロ)	1.26	1.32

	Ah(ノルウェー・クローネ)	1.26	1.32
	Ah(スウェーデン・クローナ)	1.26	1.32
	I	0.67	0.70
	Jd	-	-
	Q**	0.74	0.77
	Z	-	-
	Sd	0.10	0.10
USアグリゲート・ボンド・ファンド	I	0.68	0.68
	Ih(ユーロ)	0.55	0.68
	Jd	-	-
アジアン・Ex-ジャパン・エクイティ・ファンド	A	2.02	2.07
	I	1.07	1.10
	Id(米ドル)**	1.10	1.10
	S	0.08	0.32
	Q**	1.17	1.17
	Q(英ボンド)**	1.17	1.17
アジアン・オポチュニティズ・エクイティ・ファンド(1)	A	2.07	2.07
	I	1.10	1.10
	Q**	1.17	1.17
	Q(英ボンド)**	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	0.74	0.75
	Q(ユーロ)**	0.81	0.82
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	I	0.75	0.75
	Q(英ボンド)**	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
	Q(ユーロ)**	1.12	1.12
	Q(英ボンド)**	1.12	1.12
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
フロンティア・マーケット・エクイティ・ファンド(2)	A	2.17	2.17
	I	1.20	1.20
	Q**	1.26	1.27
	Q(英ボンド)**	1.26	1.27
グローバル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	A	2.06	2.07
	Ad	2.07	2.07
	I	1.07	1.10
	Jd	-	-
	Q**	1.17	1.17
	Q(英ボンド)**	1.17	1.17
グローバル・フォーカス・グロース・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77
	I	0.84	0.85
	Q(英ボンド)**	0.92	0.92
グローバル・グロース・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77
	I	0.82	0.85
	I(英ボンド)	0.84	0.85
	Q(英ボンド)**	0.92	0.92
	S	0.08	0.10
グローバル・ナチュラル・リソース・エクイティ・ファンド	A	1.87	2.00
	I	0.83	0.85
	Q(ユーロ)**	0.87	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
	Q(英ボンド)**	0.92	0.92

ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.77	1.77
	I	0.85	0.85
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	A	2.40	2.40
	I	1.20	1.20
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	A	2.49	2.50
	I	1.30	1.30
USブルー・チップ・エクイティ・ファンド	A	1.65	1.67
	J	-	-
	Q**	0.82	0.82
	Q(英債券)**	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
	Q(英債券)**	0.82	0.82
USラージキャップ・グロース・エクイティ・ファンド	A	1.60	1.67
	I	0.70	0.75
	J	-	-
	Q**	0.78	0.82
	Q(英債券)**	0.82	0.82
USラージキャップ・バリュー・エクイティ・ファンド	A	1.62	1.67
	I	0.71	0.75
	J	-	-
	Q**	0.81	0.82
	Q(英債券)**	0.82	0.82
USモーラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	A	1.71	1.77
	A(ユーロ)**	1.77	1.77
	I	1.01	1.05
	Q**	1.11	1.12
	Q(英債券)**	1.12	1.12
	IH(ユーロ)	1.05	1.05

(1) 当ファンドは、2014年5月21日に設定された。

(2) 当ファンドは、2014年6月24日に設定された。

* 総経費率は、2014年6月30日に終了した年度に、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2014年6月30日に終了した年度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。2014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・債券・ファンド	100%
ユーロ・コーポレート・債券・ファンド	95%
ヨーロッパ・ハイ・イールド・債券・ファンド	81%
グローバル・アグリゲート・債券・ファンド	39%
グローバル・エマージング・マーケット・債券・ファンド	80%
グローバル・エマージング・マーケット・コーポレート・債券・ファンド	99%
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	100%
ヨーロッパ・エクイティ・ファンド	40%
ヨーロッパ・Ex-UK・エクイティ・ファンド	100%
ヨーロッパ・モーラー・カンパニーズ・エクイティ・ファンド	87%
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	90%
グローバル・バリュー・エクイティ・ファンド	94%
ジャパニーズ・エクイティ・ファンド	99%
ラテン・アメリカン・エクイティ・ファンド	4%
ミドル・イースト&アフリカ・エクイティ・ファンド	16%

USラージキャップ・エクイティ・ファンド	96%
アジアン・オポチュニティズ・エクイティ・ファンド	100%
フロンティア・マーケット・エクイティ・ファンド	100%
関係会社による保有比率	
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	4%
USアグリゲート・ボンド・ファンド	74%
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	3%
USラージキャップ・グロス・エクイティ・ファンド	1%
USラージキャップ・バリュアー・エクイティ・ファンド	2%

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(平成26年10月末現在)

グローバル資産分散オープン

資産総額	17,362,788,584 円
負債総額	33,861,953 円
純資産総額(-)	17,328,926,631 円
発行済数量	19,644,969,610 口
1単位当り純資産額(/)	0.8821 円

(参考)日本好配当株マザーファンド

資産総額	31,471,854,467 円
負債総額	139,262,482 円
純資産総額(-)	31,332,591,985 円
発行済数量	25,984,051,802 口
1単位当り純資産額(/)	1.2058 円

(参考)世界REITマザーファンド

資産総額	2,623,303,225 円
負債総額	0 円
純資産総額(-)	2,623,303,225 円
発行済数量	2,637,791,915 口
1単位当り純資産額(/)	0.9945 円

(参考)グローバル好配当株マザーファンド

資産総額	111,864,581,437 円
負債総額	3,474,037,117 円
純資産総額(-)	108,390,544,320 円
発行済数量	66,014,293,939 口
1単位当り純資産額(/)	1.6419 円

(参考)新興国債券マザーファンド

資産総額	10,770,104,824 円
負債総額	117,341,442 円
純資産総額(-)	10,652,763,382 円
発行済数量	5,587,820,490 口
1単位当り純資産額(/)	1.9064 円

(参考)欧州債券マザーファンド

資産総額	1,756,243,269 円
負債総額	24,118,753 円
純資産総額(-)	1,732,124,516 円
発行済数量	1,361,772,582 口
1単位当り純資産額(/)	1.2720 円

(参考)アジア・オセアニア債券マザーファンド

資産総額	1,752,711,505 円
負債総額	0 円
純資産総額(-)	1,752,711,505 円
発行済数量	1,262,166,614 口
1単位当り純資産額(/)	1.3887 円

(参考)コモディティ・マザーファンド

資産総額	802,423,490 円
負債総額	0 円
純資産総額(-)	802,423,490 円
発行済数量	1,157,481,362 口
1単位当り純資産額(/)	0.6932 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26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。

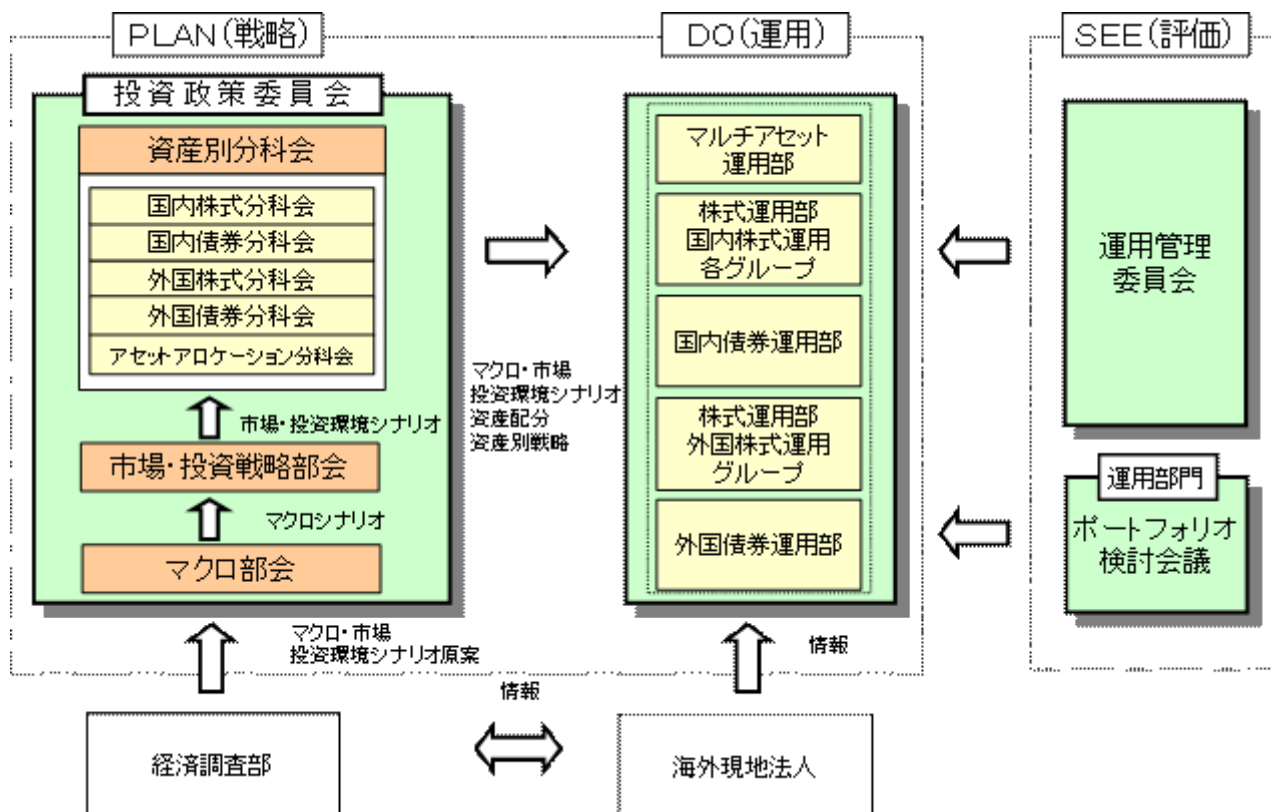
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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26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、232本であり、その純資産総額は、約3,004,573百万円です（なお、親投資信託78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	15	152,128百万円
追加型株式投資信託	208	2,791,360百万円
単位型公社債投資信託	9	61,084百万円
合計	232	3,004,573百万円

[次へ](#)

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26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26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26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

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42期事業年度（平成25年4月1日から平成26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41期 (平成25年3月31日)	第42期 (平成26年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	17,579,316	17,588,077
前払費用	156,563	149,868
未収委託者報酬	2,378,328	2,410,896
未収運用受託報酬	799,736	895,204
未収収益	21,990	15,769
繰延税金資産	473,110	490,240
その他	3,144	13,019
流動資産計	21,412,190	21,563,076
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 183,873	162,431
器具備品	1 87,233	68,912
土地	710	710
リース資産	1 8,895	9,490
有形固定資産計	280,711	241,544
無形固定資産		
ソフトウェア	261,979	173,597
ソフトウェア仮勘定	-	3,150
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	274,685	189,454
投資その他の資産		
投資有価証券	5,125,836	5,381,370
関係会社株式	1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金	1,904	2,299
長期差入保証金	509,430	511,366
出資金	132,660	132,660
繰延税金資産	548,043	611,818
その他	1,716	2,209
貸倒引当金	70,650	70,650
投資その他の資産計	7,418,714	7,740,848
固定資産計	7,974,112	8,171,846
資産合計	29,386,302	29,734,923

(単位：千円)

	第41期 (平成25年3月31日)	第42期 (平成26年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,396	3,558
未払金	165,892	158,035
未払手数料	1,113,859	1,109,332
未払費用	1,127,749	1,020,908
未払法人税等	939,336	1,316,049
賞与引当金	880,000	955,000
役員賞与引当金	73,000	80,000
その他	20,203	21,473
流動負債計	4,323,437	4,664,357
固定負債		
リース債務	5,944	6,569
退職給付引当金	1,268,146	1,391,001
役員退職慰労引当金	148,470	116,430
固定負債計	1,422,561	1,514,000
負債合計	5,745,998	6,178,358

(単位：千円)

	第41期 (平成25年3月31日)	第42期 (平成26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	19,981,120	19,953,563
利益剰余金合計	21,424,851	21,397,294
株主資本合計	23,581,120	23,553,563
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	59,183	3,001
評価・換算差額等合計	59,183	3,001
純資産合計	23,640,304	23,556,565
負債純資産合計	29,386,302	29,734,923

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	2,960,778	3,557,574
委託者報酬	27,854,931	27,766,163
その他営業収益	90,710	69,161
営業収益計	30,906,420	31,392,899
営業費用		
支払手数料	13,056,993	13,355,205
広告宣伝費	175,532	204,927
公告費	1,059	269
調査費		
調査費	1,114,992	1,191,119
委託調査費	4,000,398	3,772,225
委託計算費	131,444	145,854
営業雑経費		
通信費	31,982	35,588
印刷費	404,102	495,807
協会費	27,397	26,478
諸会費	4,830	2,206
その他	30,634	34,597
営業費用計	18,979,368	19,264,279
一般管理費		
給料		
役員報酬	201,630	201,630
給料・手当	2,883,776	2,983,202
賞与	55,582	92,691

退職金		4,450	5,583
福利厚生費		559,967	614,668
交際費		22,159	19,862
旅費交通費		146,403	167,353
租税公課		72,111	74,265
不動産賃借料		726,878	618,978
退職給付費用		213,305	222,235
固定資産減価償却費		79,314	77,093
賞与引当金繰入額		873,819	939,093
役員退職慰労引当金繰入額		38,530	38,530
役員賞与引当金繰入額		67,700	87,400
諸経費		255,296	290,905
一般管理費計		6,200,926	6,433,492
営業利益		5,726,125	5,695,126
営業外収益			
受取配当金		25,045	34,957
受取利息		3,232	3,291
投資有価証券売却益		33,455	68,331
為替差益		2,945	1,706
その他		11,668	11,918
営業外収益計		76,346	120,205
営業外費用			
投資有価証券売却損		-	23,470
その他		55	-
営業外費用計		55	23,470
経常利益		5,802,417	5,791,861
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			
投資有価証券売却損	1	111,382	-
固定資産除却損		7	1,884
その他		4,575	-
特別損失計		115,965	1,884
税引前当期純利益		5,729,219	5,789,977
法人税、住民税及び事業税		2,213,779	2,321,531
法人税等調整額		32,604	49,846
法人税等合計		2,181,175	2,271,684

当期純利益

3,548,044

3,518,293

(3) 株主資本等変動計算書

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	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期末首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	18,204,076
当期変動額						
剰余金の配当						1,771,000
当期純利益						3,548,044
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計						1,777,044
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,981,120

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期末首残高	19,647,807	21,804,076	14,256	14,256	21,789,820
当期変動額					
剰余金の配当	1,771,000	1,771,000			1,771,000
当期純利益	3,548,044	3,548,044			3,548,044
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			73,440	73,440	73,440
当期変動額合計	1,777,044	1,777,044	73,440	73,440	1,850,484
当期末残高	21,424,851	23,581,120	59,183	59,183	23,640,304

第42期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期末首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,981,120
当期変動額						
剰余金の配当						3,545,850
当期純利益						3,518,293
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計						27,556
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	19,953,563

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期末首残高	21,424,851	23,581,120	59,183	59,183	23,640,304
当期変動額					
剰余金の配当	3,545,850	3,545,850			3,545,850
当期純利益	3,518,293	3,518,293			3,518,293
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			56,182	56,182	56,182
当期変動額合計	27,556	27,556	56,182	56,182	83,739
当期末残高	21,397,294	23,553,563	3,001	3,001	23,556,565

[前へ](#) [次へ](#)

注記事項

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>

表示方法の変更

（損益計算書関係）

前事業年度において、「特別損失」の「その他」に含めていた「固定資産除却損」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「その他」に表示していた4,583千円は、「固定資産除却損」7千円、「その他」4,575千円として組み替えております。

（貸借対照表関係）

第41期 (平成25年3月31日)		第42期 (平成26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	354,743千円	建物	389,326千円
器具備品	307,425千円	器具備品	282,257千円
リース資産	7,382千円	リース資産	10,890千円
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	15,346千円	金額	11,273千円

（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41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第42期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1.投資有価証券売却損	111,382千円	-

（株主資本等変動計算書関係）

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

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

第42期（自平成25年4月1日 至平成26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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	3,545,850	921	平成25年3月31日	平成25年6月25日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月24日 定時株主総会	普通 株式	3,515,050	利益 剰余金	913	平成26年3月31日	平成26年6月25日

(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。

第42期（平成26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	17,588,077	17,588,077	-
(2) 未収委託者報酬	2,410,896	2,410,896	-
(3) 未収運用受託報酬	895,204	895,204	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,330,234	5,330,234	-
資産計	26,224,413	26,224,413	-
(1) 未払手数料	1,109,332	1,109,332	-
(2) 未払費用（*1）	752,915	752,915	-
負債計	1,862,248	1,862,248	-

（*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41期（平成25年3月31日）	第42期（平成26年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	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	509,430	511,366

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 その他有価証券の うち満期があるもの	-	1,106,722	4,006	-
合計	20,757,380	1,106,722	4,006	-

第42期(平成26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	17,588,077	-	-	-
未収委託者報酬	2,410,896	-	-	-
未収運用受託報酬	895,204	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期のあるもの	1,141,800	1,960,844	1,113,993	-
合計	22,035,978	1,960,844	1,113,993	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

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。

第42期(平成26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 その他 証券投資信託の受益証券	3,683,580	3,683,580	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 その他 証券投資信託の受益証券	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。

第42期（平成26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			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,171,477	3,105,800	65,677
小計	3,171,477	3,105,800	65,677
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	2,158,757	2,219,774	61,017
小計	2,158,757	2,219,774	61,017
合計	5,330,234	5,325,574	4,660

（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

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26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	2,506,861	68,331	23,470

（退職給付関係）

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、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。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

区分	第41期 （平成25年3月31日）
退職給付債務	1,268,146
退職給付引当金	1,268,146

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

区分	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	156,423

確定拠出年金掛金	56,882
退職給付費用	213,305

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、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。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2.簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

退職給付引当金の期首残高	1,268,146
退職給付費用	162,502
退職給付の支払額	76,988
その他	37,340
<u>退職給付引当金の期末残高</u>	<u>1,391,001</u>

（注）その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
<u>非積立型制度の退職給付債務</u>	<u>1,391,001</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,391,001</u>
<u>退職給付引当金</u>	<u>1,391,001</u>
<u>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</u>	<u>1,391,001</u>

（3）退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 162,502千円

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、59,733千円であります。

（表示方法の変更）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

（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41期	第42期
（平成25年3月31日）	（平成26年3月31日）

(1)流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	78,096	89,569
賞与引当金	334,400	339,980
社会保険料	33,579	33,038
未払事業所税	5,144	4,961
その他	21,890	22,690
繰延税金資産合計	473,110	490,240
(2)固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	454,741	495,196
投資有価証券	2,469	2,469
ゴルフ会員権	32,333	32,333
役員退職慰労引当金	55,431	41,449
その他	70,587	76,831
繰延税金資産小計	615,562	648,280
評価性引当額	34,803	34,803
繰延税金資産合計	580,759	613,477
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	32,716	1,659
繰延税金負債合計	32,716	1,659
繰延税金資産の純額	548,043	611,818

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成
 26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が廃止されることとなりました。

これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等にかかる繰延税金
 資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の38.0%から35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産は36,865千円減少し、法人税等調整額が36,865千円増加し
 ております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第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。

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26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	27,766,163	3,557,574	69,161	31,392,899

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)
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。

第42期（自 平成25年4月1日 至 平成26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)
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	5,613,672	未払手数料	488,758
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,142,899	未払手数料	277,360

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	6,140円34銭	6,118円59銭
1株当たり当期純利益金額	921円57銭	913円84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41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第42期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	3,548,044	3,518,293
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)	3,548,044	3,518,293
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](#)

独立監査人の監査報告書

平成26年11月7日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル資産分散オープンの平成26年3月28日から平成26年9月29日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル資産分散オープンの平成26年9月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月13日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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25年4月1日から平成26年3月31日までの第42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26年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

(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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。