

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年11月15日
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	犬伏 貴民
【電話番号】	03-6447-6147
【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】	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド (代替資産)
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	継続募集額 上限5兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので、平成22年5月14日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2 【訂正の内容】

下線部__は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

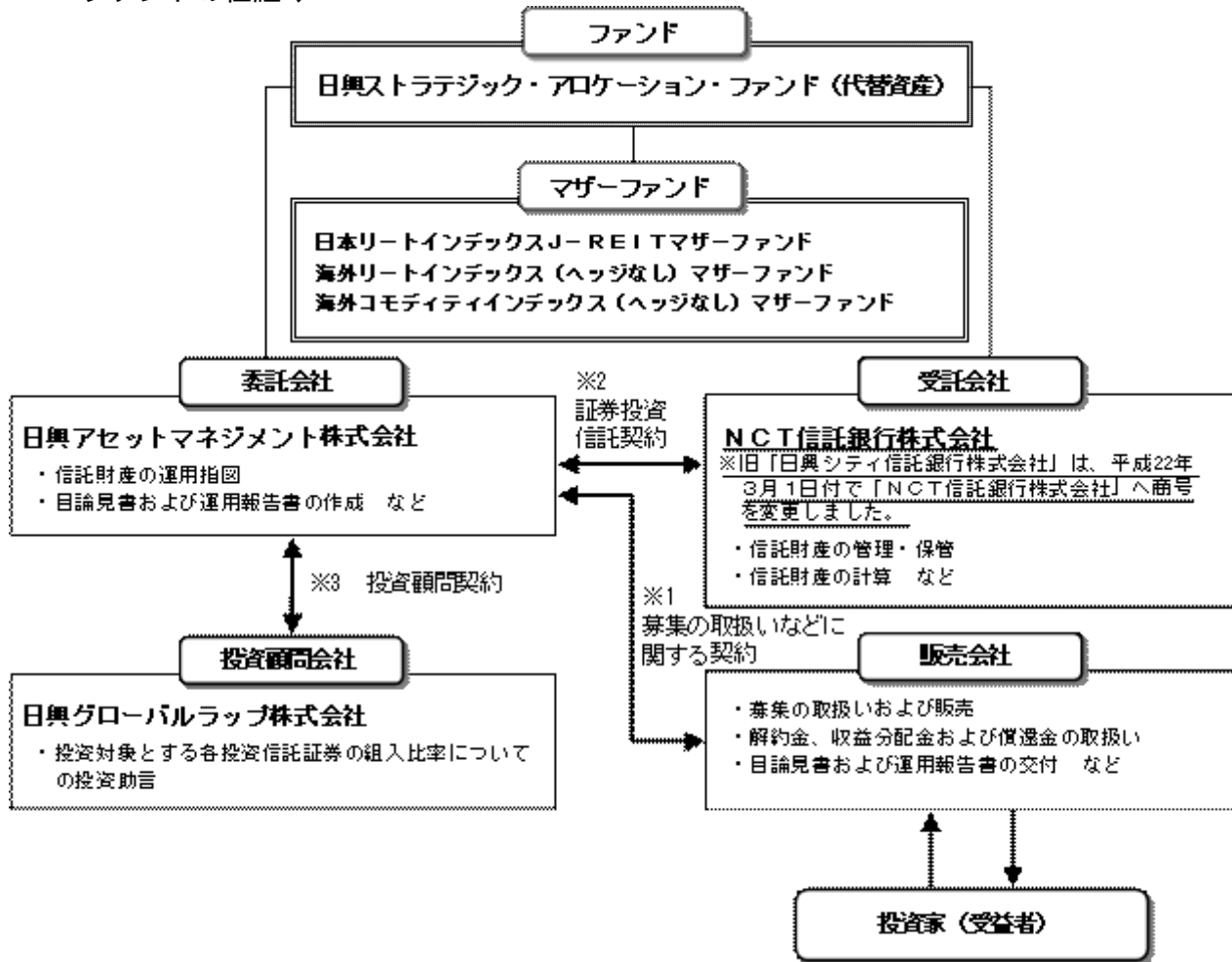
第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(2) ファンドの仕組み

<訂正前>

ファンドの仕組み



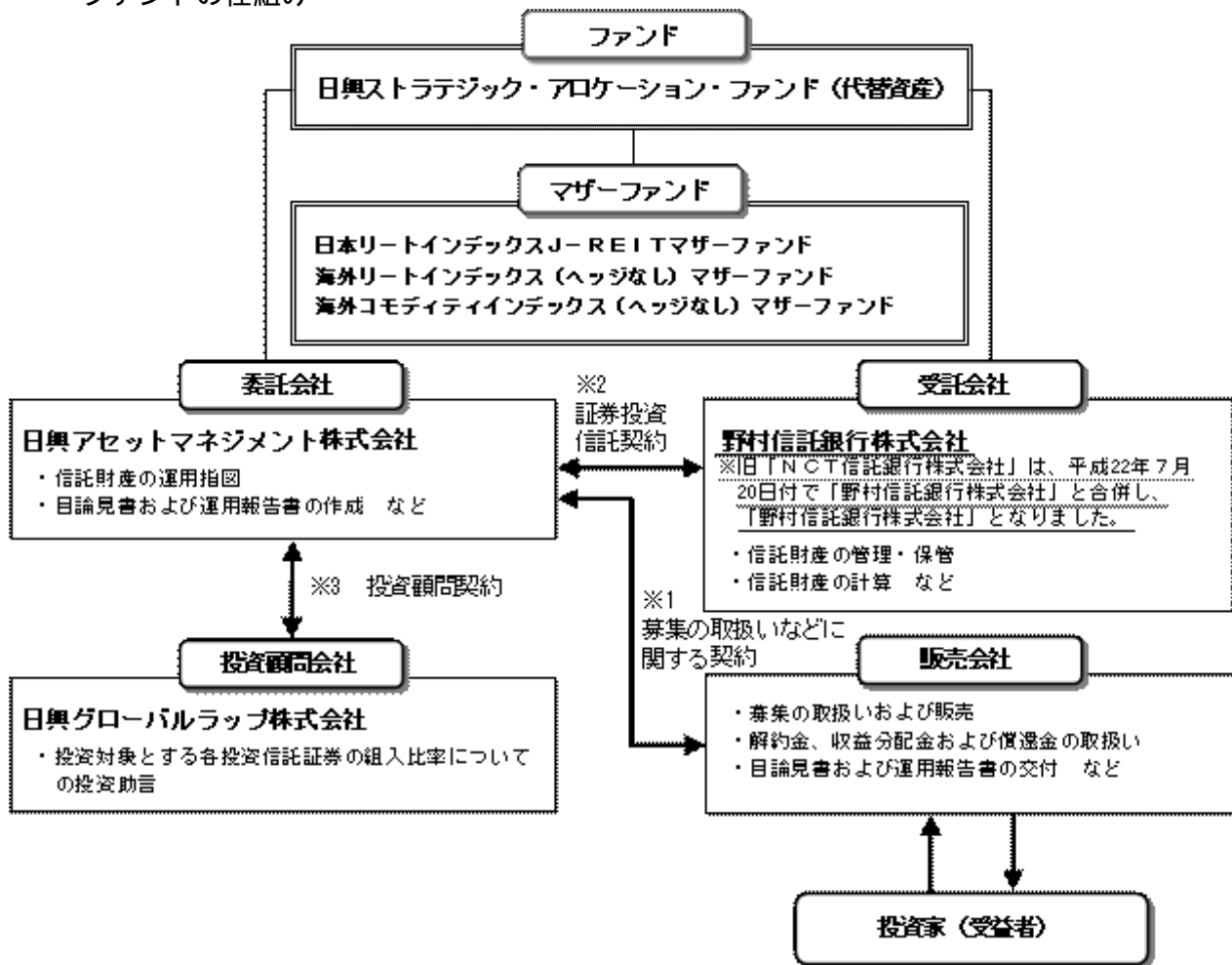
(略)

委託会社の概況（平成22年3月末現在）

(略)

< 訂正後 >

ファンドの仕組み



(略)

委託会社の概況 (平成22年9月末現在)

(略)

2 投資方針

(2) 投資対象

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - REITマザーファンド>

<訂正前>

その他	
委託会社	(略)
受託会社	NCT信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

<訂正後>

その他	
委託会社	(略)
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

<訂正前>

その他	
委託会社	(略)
受託会社	NCT信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

* S & P先進国REIT指数(除く日本)は、スタンダード&プアーズ社(S & P社)が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS & P社に帰属します。また、S & P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<訂正後>

その他	
委託会社	(略)
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

* S & P先進国REIT指数(除く日本)は、スタンダード&プアーズファイナンシャルサービスズエルエルシー(S & P社)が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS & P社に帰属します。また、S & P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外コモディティインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >
< 訂正前 >

その他	
委託会社	(略)
受託会社	NCT信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

* 「Dow Jones?」、「UBS」および「Dow Jones-UBS Commodity IndexSM」および「DJ-UBS商品指数SM」は、Dow Jones & Company, Inc.（以下「ダウ ジョーンズ」といいます。）、およびUBS AGの登録商標またはサービスマークであり、日興アセットマネジメント株式会社による一定の目的のための利用を許諾されています。

本件商品は、ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社により後援、是認、販売または宣伝されていません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれらの関係会社のいずれも、受益者または公衆に対し、証券もしくは商品全般または特に本件商品への投資の適否について明示的または暗示的ないかなる表明または保証も行っておりません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社の日興アセットマネジメント株式会社に対する唯一の関係は、一定の商標、商号およびサービスマークの使用許諾、ならびに日興アセットマネジメント株式会社または本件商品に関わりなくUBS Securities LLCと共同してダウ ジョーンズにより決定、構成および計算が行われるDow Jones-UBS Commodity Indexの使用許諾です。ダウ ジョーンズおよびUBS Securities LLCはDow Jones-UBS Commodity Indexの決定、構成、または計算に際し、日興アセットマネジメント株式会社または受益者の要求を考慮する義務を負うものではありません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、本件商品の設定の時期、価格もしくはその数量の決定についてまたは本件商品が現金に換金される際の等式の決定もしくは計算について責任を負わず、またはこれらに参加していません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、本件商品の管理、販売または取引に関連し受益者等に対しいかなる義務または責任を負うものではありません。上記にかかわらずUBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、日興アセットマネジメント株式会社が募集している本件商品と無関係であるが、これらに類似しておりかつこれらと競合し得る金融商品を独自に発行し、および/または支援することがあります。さらに、UBS AG、UBS Securities LLCまたはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、商品、商品指数および商品先物（Dow Jones-UBS Commodity IndexおよびDow Jones-UBS Commodity Total Return Indexを含みます。）ならびに当該商品、商品指数および商品先物のパフォーマンスに連動するスワップ、オプションおよび派生商品の取引を積極的に進めています。かかる取引がDow Jones-UBS Commodity Indexおよび本件商品の評価に影響を及ぼす可能性があります。

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

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

< 訂正後 >

その他	
委託会社	(略)
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	(略)
決算日	(略)

* 「Dow Jones-UBS Commodity IndexSM」および「DJ-UBS商品指数SM」は、CME Group Index Services LLC（以下「CME指数」といいます。）の許諾商標であるDow Jones指数とUBS Securities LLC（以下「UBS証券」といいます。）の共同商品であり、使用ライセンスが供与されています。「Dow Jones²」、「DJ」、「Dow Jones指数」、「UBS」および「Dow Jones-UBS Commodity IndexSM」および「DJ-UBS商品指数SM」は、Dow Jones Trademark Holdings, LLC（以下「ダウ ジョーンズ」といいます。）あるいはUBS AG（以下「UBS AG」といいます。）のサービスマークであり、日興アセットマネジメント株式会社による一定の目的のために使用が許諾されています。

当商品は、ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社により後援、是認、販売または宣伝されていません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれらの関係会社のいずれも、受益者または公衆に対し、一般的な有価証券もしくはコモディティまたは特に当商品への投資の適否について明示的または暗示的ないかなる表明または保証も行っておりません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社の日興アセットマネジメント株式会社に対する唯一の関係は、一定の商標、商号およびサービスマークの使用許諾、ならびに日興アセットマネジメント株式会社、または当商品に関わりなくUBS証券と共同してCME指数により決定、構成および計算が行われるDow Jones-UBS Commodity IndexSMの使用許諾です。ダウ ジョーンズ、UBS証券およびCME指数はDow Jones-UBS Commodity IndexSMの決定、構成、または計算に際し、日興アセットマネジメント株式会社、当商品または受益者の要求を考慮する義務を負うものではありません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、当商品の設定の時期、価格もしくはその数量の決定についてまたは当商品が現金に換金される際の算式の決定もしくは計算について責任を負わず、またはこれらに参加していません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、当商品の管理、販売または取引（必ずしもこれらに限定されませんが）に関連し受益者等に対しいかなる義務または責任を負うものではありません。上記にかかわらずUBS AG、UBS証券およびCME Group Inc.、またはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、日興アセットマネジメント株式会社の当商品と無関係であるが、これらに類似しておりかつこれらと競合し得る金融商品を独自に発行し、および/または支援することがあります。さらに、UBS AG、UBS証券およびCME Group Inc.、またはこれら各々の子会社もしくは関係会社は、コモディティ、コモディティ指数およびコモディティ先物（Dow Jones-UBS Commodity IndexSMおよびDow Jones-UBS Commodity Total Return IndexSMを含みます。）ならびに当該コモディティ、コモディティ指数およびコモディティ先物のパフォーマンスに連動するスワップ、オプションおよび派生商品の取引を積極的に行っています。かかる取引がDow Jones-UBS Commodity IndexSMおよび当商品の評価に影響を及ぼす可能性があります。

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

ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity IndexSMまたはこれに関連するデータの正確性および/または完全性を保証しておらず、またダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、かかる指数に関する誤り、不作為または障害について責任を負わないものとします。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity IndexSMまたはこれに関連するデータの利用により日興アセットマネジメント株式会社、当商品、受益者またはその他の者もしくは機関が得る結果について明示的または暗示的ないかなる表明または保証も行いません。ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、Dow Jones-UBS Commodity IndexSMまたはこれに関連するデータについて特定の目的または利用のために明示的または暗示的な保証を行わず、また市場商品性または適性に関する一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合も、ダウ ジョーンズ、UBS AG、UBS証券およびCME指数またはこれら各々の子会社もしくは関係会社のいずれも、その可能性につき通知されていたとしても喪失利益または間接的、懲罰的、特別もしくは結果的損害もしくは損失について責任を負わないものとします。UBS証券およびCME指数および日興アセットマネジメント株式会社の間の契約の取決めについて、UBS AGおよびCMS指数から使用許諾を得ている者以外の第三者の権利者は存在しません。

5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

以下の運用状況は平成22年8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価（千円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	61,794	99.34
日本	61,794	99.34
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	410	0.66
純資産総額	62,205	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<親投資信託受益証券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	日本リートインデックスJ-REITマ ザーファンド	34,619,325	0.7210 0.7336	24,960,533 25,396,736	40.83
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外コモディティインデックス(ヘッジ なし)マザーファンド	30,991,937	0.6032 0.5905	18,694,336 18,300,738	29.42
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	24,571,447	0.7403 0.7365	18,190,242 18,096,870	29.09

ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.34
合計	99.34

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績
純資産の推移

期別	1口当たりの純資産額（円）		純資産総額（百万円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
設定時（2007年10月31日）	1.0000	1.0000	1	1
第1計算期間末（2008年2月15日）	0.8800	0.8820	45	46
第2計算期間末（2008年8月15日）	0.8283	0.8343	104	105
第3計算期間末（2009年2月16日）	0.3913	0.3953	57	57
第4計算期間末（2009年8月17日）	0.5085	0.5145	28	29
第5計算期間末（2010年2月15日）	0.4943	0.5003	27	27
第6計算期間末（2010年8月16日）	0.4999	0.5059	62	62

	1口当たりの純資産額（円）	純資産総額（百万円）
2009年8月末日	0.5126	28
2009年9月末日	0.5060	28
2009年10月末日	0.5152	28
2009年11月末日	0.4851	26
2009年12月末日	0.5337	29
2010年1月末日	0.5059	27
2010年2月末日	0.5043	27
2010年3月末日	0.5420	29
2010年4月末日	0.5673	31
2010年5月末日	0.5124	26
2010年6月末日	0.4907	61
2010年7月末日	0.5162	64
2010年8月末日	0.4993	62

分配の推移

	1口当たり税込み分配金（円）
第1計算期間（2007年10月31日～2008年2月15日）	0.0020
第2計算期間（2008年2月16日～2008年8月15日）	0.0060
第3計算期間（2008年8月16日～2009年2月16日）	0.0040
第4計算期間（2009年2月17日～2009年8月17日）	0.0060
第5計算期間（2009年8月18日～2010年2月15日）	0.0060
第6計算期間（2010年2月16日～2010年8月16日）	0.0060

収益率の推移

	収益率（％）
第1計算期間（2007年10月31日～2008年2月15日）	11.80
第2計算期間（2008年2月16日～2008年8月15日）	5.19
第3計算期間（2008年8月16日～2009年2月16日）	52.28
第4計算期間（2009年2月17日～2009年8月17日）	31.48
第5計算期間（2009年8月18日～2010年2月15日）	1.61
第6計算期間（2010年2月16日～2010年8月16日）	2.35

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額、以下、「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(参考) 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

以下の運用状況は平成22年8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
投資証券	15,282,686	97.95
日本	15,282,686	97.95
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	319,170	2.05
純資産総額	15,601,856	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 投資証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	投資証券 -	日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,795	750,071 712,000	2,096,447,564 1,990,040,000	12.76
日本円 日本	投資証券 -	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,523	755,047 746,000	1,904,983,534 1,882,158,000	12.06
日本円 日本	投資証券 -	日本リートリアルファンド投資法人 投資証券	8,707	107,623 112,600	937,071,920 980,408,200	6.28
日本円 日本	投資証券 -	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,248	669,026 695,000	834,944,920 867,360,000	5.56
日本円 日本	投資証券 -	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,687	207,822 187,300	766,241,394 690,575,100	4.43
日本円 日本	投資証券 -	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,054	120,886 131,000	610,958,698 662,074,000	4.24
日本円 日本	投資証券 -	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	1,574	450,495 417,000	709,078,535 656,358,000	4.21
日本円 日本	投資証券 -	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,001	641,566 655,000	642,207,456 655,655,000	4.20
日本円 日本	投資証券 -	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,038	538,041 544,000	558,486,351 564,672,000	3.62
日本円 日本	投資証券 -	オリックス不動産投資法人 投資証券	1,298	388,018 396,500	503,647,064 514,657,000	3.30
日本円 日本	投資証券 -	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	760	667,526 636,000	507,319,691 483,360,000	3.10
日本円 日本	投資証券 -	DAオフィス投資法人 投資証券	2,041	199,113 229,100	406,389,063 467,593,100	3.00
日本円 日本	投資証券 -	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	874	480,026 457,000	419,542,605 399,418,000	2.56
日本円 日本	投資証券 -	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	805	441,023 488,000	355,023,812 392,840,000	2.52
日本円 日本	投資証券 -	トップリート投資法人 投資証券	799	404,632 450,500	323,301,253 359,949,500	2.31
日本円 日本	投資証券 -	ケネディクス不動産投資法人 投資証券	1,204	265,547 294,000	319,718,441 353,976,000	2.27
日本円 日本	投資証券 -	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	797	445,038 402,000	354,695,114 320,394,000	2.05
日本円 日本	投資証券 -	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	500	582,040 639,000	291,019,776 319,500,000	2.05
日本円 日本	投資証券 -	福岡リート投資法人 投資証券	552	515,046 537,000	284,305,392 296,424,000	1.90
日本円 日本	投資証券 -	ピ・ライフ投資法人 投資証券	612	433,741 437,000	265,449,289 267,444,000	1.71
日本円 日本	投資証券 -	プレミア投資法人 投資証券	723	359,969 364,000	260,257,409 263,172,000	1.69
日本円 日本	投資証券 -	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	647	335,511 352,000	217,075,556 227,744,000	1.46
日本円 日本	投資証券 -	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,194	181,504 170,000	216,716,272 202,980,000	1.30
日本円 日本	投資証券 -	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	6,863	26,607 28,800	182,603,801 197,654,400	1.27
日本円 日本	投資証券 -	積水ハウス・S I投資法人 投資証券	593	239,035 299,600	141,747,678 177,662,800	1.14
日本円 日本	投資証券 -	M I Dリート投資法人 投資証券	947	194,502 181,100	184,193,759 171,501,700	1.10
日本円 日本	投資証券 -	阪急リート投資法人 投資証券	440	358,502 362,000	157,740,943 159,280,000	1.02
日本円 日本	投資証券 -	産業ファンド投資法人 投資証券	408	367,975 302,500	150,133,639 123,420,000	0.79
日本円 日本	投資証券 -	日本コマースリアル投資法人 投資証券	1,327	87,800 86,600	116,510,600 114,918,200	0.74

日本円 日本	投資証券 -	クレッシェンド投資法人 投資証券	680	140,033 163,000	95,222,575 110,840,000	0.71
-----------	-----------	------------------	-----	--------------------	---------------------------	------

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
投資証券	97.95
合計	97.95

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(参考) 海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は平成22年8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
投資証券	16,211,704	99.08
アメリカ	9,879,725	60.38
オーストラリア	2,271,009	13.88
フランス	1,108,789	6.78
イギリス	1,070,943	6.54
シンガポール	547,794	3.35
カナダ	429,699	2.63
オランダ	376,993	2.30
香港	325,893	1.99
ベルギー	118,943	0.73
ニュージーランド	63,092	0.39
ドイツ	9,587	0.06
イタリア	9,230	0.06
為替予約取引(売建)	(22,474)	(0.14)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	151,110	0.92
純資産総額	16,362,814	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 投資証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	129,304	7,476 7,591	966,685,164 981,540,354	6.00
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	WESTFIELD GROUP	937,818	970 952	910,106,979 893,207,311	5.46
ユーロ フランス	投資証券 -	UNIBAIL-RODAMCO SE	40,401	14,426 15,689	582,813,883 633,853,006	3.87
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PUBLIC STORAGE	59,948	7,740 8,232	463,974,906 493,486,900	3.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	124,900	3,824 3,822	477,586,240 477,381,789	2.92
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VORNADO REALTY TRUST	69,721	6,591 6,805	459,503,669 474,419,556	2.90
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	BOSTON PROPERTIES INC	61,494	6,703 6,854	412,175,398 421,506,540	2.58
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HCP INC	137,236	2,834 2,989	388,967,906 410,225,302	2.51
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HOST HOTELS & RESORTS INC	291,244	1,269 1,103	369,695,009 321,143,808	1.96
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	STOCKLAND	1,059,399	297 301	314,976,997 319,011,842	1.95
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,672	8,745 8,699	320,689,890 318,998,257	1.95
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VENTAS INC	69,318	4,134 4,262	286,537,618 295,421,116	1.81
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LAND SECURITIES GROUP PLC	338,784	807 800	273,267,601 271,091,569	1.66
香港ドル 香港	投資証券 -	LINK REIT	971,500	223 245	217,012,213 238,132,623	1.46
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	BRITISH LAND COMPANY PLC	388,214	601 594	233,205,973 230,750,325	1.41
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	KIMCO REALTY CORPORATION	180,364	1,254 1,252	226,168,623 225,875,897	1.38
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HEALTH CARE REIT INC	54,596	3,739 3,842	204,147,722 209,780,020	1.28
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	THE MACERICH COMPANY	57,678	3,517 3,409	202,878,175 196,650,788	1.20
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PROLOGIS	212,475	944 910	200,600,618 193,323,693	1.18
ユーロ オランダ	投資証券 -	CORIO NV	39,699	4,300 4,806	170,702,532 190,798,914	1.17

アメリカドル アメリカ	投資証券 -	DIGITAL REALTY TRUST INC	37,641	5,262 4,919	198,064,233 185,150,629	1.13
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	26,927	6,364 6,628	171,363,040 178,467,115	1.09
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	GPT GROUP	757,697	210 229	158,969,831 173,837,513	1.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	NATIONWIDE HEALTH PROPERTIES INC	52,595	3,071 3,231	161,506,265 169,936,423	1.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	SL GREEN REALTY CORP	34,352	5,267 4,926	180,940,311 169,204,898	1.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AMB PROPERTY CORPORATION	74,317	2,292 1,998	170,330,585 148,496,722	0.91
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	MIRVAC GROUP	1,461,385	104 101	151,651,004 147,789,573	0.90
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	HAMMERSON PLC	313,360	475 469	148,727,707 147,047,862	0.90
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	910,235	150 148	136,362,059 134,643,053	0.82
シンガポールドル シンガポール	投資証券 -	CAPITAMALL TRUST	1,128,200	116 119	130,754,544 134,269,451	0.82

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
投資証券	99.08
合計	99.08

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
<為替予約取引>

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
オーストラリアドル	売建	10,628,580	10,563,400	0.06
シンガポールドル	売建	8,721,860	8,722,000	0.05
アメリカドル	売建	2,536,500	2,536,500	0.02
香港ドル	売建	651,660	652,200	0.00
合計		22,538,600	22,474,100	0.14

（参考）海外コモディティインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は平成22年8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（１）投資状況

投資資産の種類	時価（千円）	投資比率（％）
社債券	18,155	99.21
アメリカ	18,155	99.21
為替予約取引(買建)	(101)	(0.55)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	143	0.79
純資産総額	18,299	100.00

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<社債券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	社債券 -	IPATH Dow Jones-LBS Commodity Index Total Return EIN	0.00000 2036-06-12	270,000	3,227.66 3,362.11	17,429,338 18,155,370	99.21

ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
社債券	99.21
合計	99.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

<為替予約取引>

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカドル	買建	101,170	101,340	0.55
合計		101,170	101,340	0.55

第2【財務ハイライト情報】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 財務ハイライト情報」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

- (1) 以下の情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」から抜粋して記載したものです。
- (2) 「財務諸表」については、あらた監査法人による監査を受けております。また、当該監査法人による監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」に添付されています。

日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）

1 貸借対照表

（単位：円）

科目	期別	第5期	第6期
		平成22年2月15日現在	平成22年8月16日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		633,800	597,119
親投資信託受益証券		27,112,649	61,845,111
未収入金		-	747,000
流動資産合計		27,746,449	63,189,230
資産合計		27,746,449	63,189,230
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		331,256	747,000
未払受託者報酬		7,362	11,286
未払委託者報酬		105,320	161,162
その他未払費用		14,020	34,217
流動負債合計		457,958	953,665
負債合計		457,958	953,665
純資産の部			
元本等			
元本		55,209,496	124,500,145
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,921,005	62,264,580
（分配準備積立金）		507,566	239,222
元本等合計		27,288,491	62,235,565
純資産合計		27,288,491	62,235,565
負債純資産合計		27,746,449	63,189,230

2 損益及び剰余金計算書

（単位：円）

科目	期別	第5期 自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日	第6期 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		4	77
有価証券売買等損益		336,023	489,294
営業収益合計		336,019	489,371
営業費用			
受託者報酬		7,362	11,286
委託者報酬		105,320	161,162
その他費用		14,020	21,486
営業費用合計		126,702	193,934
営業利益又は営業損失（ ）		462,721	295,437
経常利益又は経常損失（ ）		462,721	295,437
当期純利益又は当期純損失（ ）		462,721	295,437
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（ ）		5,917	165,907
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		27,809,432	27,921,005
剰余金増加額又は欠損金減少額		741,397	1,639,200
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		741,397	1,639,200
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,910	35,365,305
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,910	35,365,305
分配金		331,256	747,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,921,005	62,264,580

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期別 項目	第5期 自平成21年8月18日 至平成22年2月15日	第6期 自平成22年2月16日 至平成22年8月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月16日から8月15日まで及び、8月16日から翌年2月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成21年8月18日から平成22年2月15日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月16日から8月15日まで及び、8月16日から翌年2月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成22年2月16日から平成22年8月16日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在			
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成21年8月18日 28,183,553,336 円 1,367,286,885 円 4,699,345,603 円	1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成22年2月16日 24,851,494,618 円 708,367,759 円 3,363,293,785 円
	平成22年2月15日現在の元本の内訳			平成22年8月16日現在の元本の内訳	
	世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月分配型	23,105,370,237 円		世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月分配型	20,103,936,990 円
	日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（代 替資産）	13,290,319 円		日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（代 替資産）	24,571,447 円
	海外先進国REITイン デックスファンド（適格機 関投資家向け）	1,566,178,131 円		海外先進国REITイン デックスファンド（適格機 関投資家向け）	1,939,556,944 円
	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	166,655,931 円		3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	128,503,211 円
	（合計）	24,851,494,618 円		（合計）	22,196,568,592 円
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	24,851,494,618 口	2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	22,196,568,592 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は7,700,999,579円であります。		3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は5,763,394,775円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>
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よった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	16,944,771,508	2,831,703,046
合計	16,944,771,508	2,831,703,046

対象期間（自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	69,075,881
合計	69,075,881

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、為替予約取引であります。
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、為替等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成22年2月15日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	61,748,040	-	61,775,900	27,860
	アメリカドル	40,506,000	-	40,536,000	30,000
	オーストラリアドル	5,603,150	-	5,602,100	1,050
	イギリスポンド	7,053,950	-	7,053,000	950
	ユーロ	8,584,940	-	8,584,800	140
	合計	61,748,040	-	61,775,900	27,860

(単位：円)

区分	種類	平成22年8月16日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,454,120	-	2,412,000	42,120
	ニュージーランドドル	2,454,120	-	2,412,000	42,120
	買建	13,607,200	-	13,589,600	17,600
	アメリカドル	10,300,800	-	10,298,400	2,400
	カナダドル	3,306,400	-	3,291,200	15,200
	合計	16,061,320	-	16,001,600	24,520

(注) 時価の算定方法

- 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いては、以下のように評価しています。
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は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
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は、以下の方法によっています。
 - 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ています。
 - 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ます。
- 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いては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在	
1口当たり純資産額	0.6901 円	1口当たり純資産額	0.7403 円
(1万口当たり純資産額)	(6,901 円)	(1万口当たり純資産額)	(7,403 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(外国投資証券)

外国投資証券（アメリカドル）

（単位：アメリカドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
00163T10	AMB PROPERTY CORPORATION	74,317	1,797,728.23
00423910	ACADIA REALTY TRUST	18,622	326,443.66
00849210	AGREE REALTY CORPORATION	4,799	111,432.78
01475210	ALEXANDER'S INC	917	278,337.01
01527110	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	21,961	1,479,073.35
02483510	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	22,723	648,287.19
03748R10	APARTMENT INVT&MGMT CO -A	51,360	1,040,553.60
04410310	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	21,247	180,387.03
04560410	ASSOCIATED ESTATES REALTY CORPORATION	12,737	164,689.41
05348410	AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,489	3,728,446.02
05564E10	BRE PROPERTIES-CL A	27,379	1,093,517.26
09063H10	BIOMED REALTY TRUST INC	50,055	842,926.20
10112110	BOSTON PROPERTIES INC	61,258	4,963,123.16
10536820	BRANDYWINE REALTY TRUST	57,225	605,440.50
12483010	CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	60,962	748,613.36
13313110	CAMDEN PROPERTY TRUST	29,005	1,310,445.90
14028810	CAPLEASE INC	27,759	133,798.38
15060220	CEDAR SHOPPING CENTERS INC	27,358	150,469.00
19238U10	COGDELL SPENCER INC	23,268	145,425.00
19587210	COLONIAL PROPERTIES TRUST	29,960	460,185.60
20221810	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	36,467	853,327.80
22002T10	CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	25,997	960,069.21
22279510	COUSINS PROPERTIES INC	47,177	302,404.57
23315310	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	92,010	415,885.20
25159110	DEVELOPERS DIVERSIFIED REALTY CORPORATION	97,101	1,028,299.59
25278430	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	68,217	601,673.94
25386810	DIGITAL REALTY TRUST INC	37,641	2,244,909.24
25960P10	DOUGLAS EMMETT INC	54,150	835,534.50
26441150	DUKE REALTY CORPORATION	109,388	1,220,770.08
26613Q10	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	24,969	634,711.98
27727610	EASTGROUP PROPERTIES INC	11,885	422,155.20
28140H10	EDUCATION REALTY TRUST INC	26,780	182,907.40
29380T10	ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	20,492	849,598.32
29472R10	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	13,449	698,137.59
29475210	EQUITY ONE INC	16,019	249,576.02
29476L10	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	124,478	5,586,572.64
29717810	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,206	1,354,671.48
30225T10	EXTRA SPACE STORAGE INC	37,391	558,621.54
31374720	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	26,927	2,088,458.12
31430F10	FELCOR LODGING TRUST INC	42,964	201,501.16
32054K10	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	31,841	148,060.65
33610F10	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	15,871	236,319.19
33740010	WINTHROP REALTY TRUST	9,030	109,353.30
35471R10	FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	31,215	349,608.00
37429710	GETTY REALTY CORPORATION	9,254	224,502.04
37653610	GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,435	56,677.50
37930210	GLIMCHER REALTY TRUST	36,563	221,571.78
40426W10	COMMONWEALTH REIT	28,292	673,632.52
42191510	HCP INC	136,679	4,716,792.29

42194610	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	27,467	644,650.49	
42217K10	HEALTH CARE REIT INC	54,596	2,441,533.12	
42782510	HERSHA HOSPITALITY TRUST	48,798	229,350.60	
43128410	HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,777	958,712.09	
43730610	HOME PROPERTIES INC	15,984	776,342.88	
44106M10	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	54,548	1,100,233.16	
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	289,807	3,964,559.76	
45746110	INLAND REAL ESTATE CORPORATION	31,129	233,156.21	
46173010	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	35,133	288,793.26	
49427F10	KILROY REALTY CORPORATION	23,105	703,547.25	
49446R10	KIMCO REALTY CORPORATION	179,041	2,610,417.78	
49803T10	KITE REALTY GROUP TRUST	28,442	118,318.72	
50217510	LTC PROPERTIES INC	11,375	275,730.00	
51794210	LASALLE HOTEL PROPERTIES	30,639	644,950.95	
52904310	LEXINGTON REALTY TRUST	48,181	306,912.97	
53117210	LIBERTY PROPERTY TRUST	50,031	1,519,941.78	
55438210	THE MACERICH COMPANY	57,200	2,247,388.00	
55448910	MACK-CALI REALTY CORPORATION	35,055	1,080,745.65	
58463J30	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,504	477,767.84	
59522J10	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	13,187	721,988.25	
60520310	MISSION WEST PROPERTIES INC	7,542	49,023.00	
60972010	MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORPORATION	12,473	89,431.41	
63633D10	NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	11,787	449,438.31	
63862010	NATIONWIDE HEALTH PROPERTIES INC	52,595	1,989,142.90	
68193610	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	40,843	863,829.45	
69360J10	PS BUSINESS PARKS INC	7,783	464,956.42	
70159Q10	PARKWAY PROPERTIES INC	10,072	148,763.44	
70910210	PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,324	250,698.52	
73746410	POST PROPERTIES INC	21,314	538,817.92	
74341010	PROLOGIS	210,585	2,175,343.05	
74460D10	PUBLIC STORAGE	59,752	5,865,256.32	
75145220	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES TRUST	17,441	185,572.24	
75610910	REALTY INCOME CORP	45,700	1,484,336.00	
75884910	REGENCY CENTERS CORPORATION	36,170	1,336,843.20	
78440X10	SL GREEN REALTY CORP	34,352	1,958,751.04	
80439510	SAUL CENTERS INC	5,753	238,519.38	
81721M10	SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	56,148	1,276,805.52	
82880610	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	128,976	11,512,397.76	
84610H10	SOVRAN SELF STORAGE INC	12,145	451,551.10	
86272T10	STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	66,694	258,772.72	
86667410	SUN COMMUNITIES INC	7,560	207,748.80	
86789210	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43,472	408,202.08	
87546510	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	17,716	778,618.20	
87666410	TAUBMAN CENTERS INC	13,501	561,911.62	
91019710	UDR INC	71,260	1,435,889.00	
91274F10	U-STORE-IT TRUST	33,596	264,736.48	
91359E10	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	5,664	181,078.08	
91728620	URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,466	160,543.36	
92276F10	VENTAS INC	68,938	3,437,248.68	
92904210	VORNADO REALTY TRUST	69,721	5,647,401.00	
93965310	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,610	795,639.00	
94874110	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	46,260	914,560.20	
アメリカドル 計		4,278,501	115,962,492.45	
(邦貨換算額)			(9,953,060,727)	

外国投資証券(カナダドル)

(単位:カナダドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
AP-U	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,823	176,018.85
AX-U	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,541	138,376.59

BEI-U	BOARDWALK EQUITIES INC	11,298	470,561.70	
BRE-U	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,217	269,838.66	
CAR-U	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,658	256,634.62	
CRR-U	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,853	77,164.78	
CSH-U	CHARTWELL SENIORS HOUSING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	29,039	230,569.66	
CUF-U	COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,638	249,600.50	
CWT-U	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,950	438,301.50	
D-U	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,988	203,134.84	
EXE-U	EXTENDICARE REIT	18,178	171,418.54	
HR-U	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,269	565,968.90	
INN-U	INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,993	138,335.97	
MRT-U	MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,343	149,954.46	
NPR-U	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,359	133,224.74	
REF-U	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,615	434,650.10	
REI-U	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	52,797	1,073,890.98	
カナダドル 計		293,559	5,177,645.39	
(邦貨換算額)			(426,068,439)	

外国投資証券(オーストラリアドル)

(単位:オーストラリアドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
ABP	ABACUS PROPERTY GROUP	578,546	231,418.40	
APZ	ASPEN GROUP	277,579	127,686.34	
BJT	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	218,469	67,725.39	
BWP	BUNNINGS WAREHOUSE PROPERTY TRUST	149,115	287,046.37	
CDI	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	240,957	116,864.14	
CHC	CHARTER HALL GROUP	394,337	236,602.20	
CMW	CROMWELL GROUP	378,825	268,965.75	
CPA	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	880,448	823,218.88	
DRT	DEXUS PROPERTY GROUP	2,094,303	1,696,385.43	
GAN	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	910,235	1,733,997.67	
GPT	GPT GROUP	757,697	2,174,590.39	
IIF	ING INDUSTRIAL FUND	1,156,726	514,743.07	
IOF	ING OFFICE FUND	1,251,964	763,698.04	
MCW	CHARTER HALL RETAIL REIT	618,366	333,917.64	
MGQ	GOODMAN GROUP	2,820,984	1,763,115.00	
MGR	MIRVAC GROUP	1,461,385	1,929,028.20	
MLE	ARDENT LEISURE GROUP	148,126	140,719.70	
MOF	CHARTER HALL OFFICE REIT	1,815,841	453,960.25	
SGP	STOCKLAND	1,053,946	4,089,310.48	
WDC	WESTFIELD GROUP	935,197	11,512,275.07	
オーストラリアドル 計		18,143,046	29,265,268.41	
(邦貨換算額)			(2,232,062,022)	

外国投資証券(イギリスポンド)

(単位:イギリスポンド)

銘柄		券面総額	評価額	備考
BLND	BRITISH LAND COMPANY PLC	385,493	1,732,405.54	
BYG	BIG YELLOW GROUP PLC	50,610	150,817.80	
DLN	DERWENT LONDON PLC	39,145	533,937.80	
GPOR	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	137,497	423,490.76	
HMSO	HAMMERSON PLC	313,360	1,145,017.44	
LAND	LAND SECURITIES GROUP PLC	336,747	2,015,430.79	
LII	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	193,003	629,575.78	
PHP	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	22,936	65,367.60	
SHB	SHAFTESBURY PLC	101,922	405,445.71	
SLOU	SEGRO PLC	329,178	899,643.47	
WKP	WORKSPACE GROUP PLC	370,354	76,848.45	
イギリスポンド 計		2,280,245	8,077,981.14	

(邦貨換算額)		(1,077,683,464)	
---------	--	-----------------	--

外国投資証券(香港ドル)

(単位:香港ドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
1881HK	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	369,000	730,620.00
2778	CHAMPION REIT	892,000	3,496,640.00
435HK	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	522,000	1,090,980.00
625HK	RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00
FRT	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	463,000	1,643,650.00
GZIE	GZI REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	273,000	1,021,020.00
LINK	LINK REIT	971,500	20,595,800.00
PRE	PROSPERITY REIT	417,000	650,520.00
香港ドル計		4,108,500	30,103,580.00
(邦貨換算額)		(332,343,523)	

外国投資証券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
AREIT	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	658,000	1,355,480.00
ART	ASCOTT RESIDENCE TRUST	173,000	205,870.00
CCT	CAPITACOMMERCIAL TRUST	925,600	1,277,328.00
CDREIT	CDL HOSPITALITY TRUSTS	203,000	399,910.00
CRCT	CAPITARETAIL CHINA TRUST	139,000	169,580.00
CREIT	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	366,000	186,660.00
CT	CAPITAMALL TRUST	1,128,200	2,177,426.00
FCT	FRASERS CENTREPOINT TRUST	183,000	254,370.00
KREIT	K-REIT ASIA	136,000	159,120.00
LMRT	LIPPO-MAPLETREE INDONESIA RETAIL TRUST	259,000	121,730.00
MLT	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	469,000	398,650.00
PREIT	PARKWAY LIFE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	169,000	239,980.00
PRM	STARHILL GLOBAL REIT	682,000	381,920.00
SUN	SUNTEC REIT	812,000	1,112,440.00
SZREIT	SAIZEN REIT	256,000	40,960.00
シンガポールドル計		6,558,800	8,481,424.00
(邦貨換算額)		(532,718,241)	

外国投資証券(ニュージーランドドル)

(単位:ニュージーランドドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
APT	AMP NZ OFFICE TRUST	389,711	280,591.92
ING	ING PROPERTY TRUST	209,423	144,501.87
KIP	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	373,451	351,043.94
MGP	GOODMAN PROPERTY TRUST	301,405	277,292.60
ニュージーランドドル計		1,273,990	1,053,430.33
(邦貨換算額)		(63,532,383)	

外国投資証券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

銘柄	券面総額	評価額	備考
AOX	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	10,428	92,976.04
BEFB	BEFIMMO S.C.A.	6,054	342,051.00
COFIT	COFINIMMO	5,790	534,822.30
CORA	CORIO NV	39,699	1,769,384.43
DREG	FONCIERE DES REGIONS	14,003	983,990.81
EIFF	SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL	2,504	136,968.80
EMGP	ICADE	8,803	644,643.69
GFC	GECINA SA	10,257	763,838.79
IGD	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	76,269	87,709.35
INTO	INTERVEST OFFICES	2,748	58,807.20
LI	KLEPIERRE	38,946	927,888.45
MERY	MERCIALYS	20,012	506,103.48
NSI	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	13,939	196,539.90

SCHIP	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,593	447,519.10	
SIL	SILIC	4,320	367,848.00	
UL	UNIBAIL-RODAMCO SE	40,273	5,883,885.30	
VASTN	VASTNED RETAIL NV	8,058	351,812.28	
VWN	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL NV	9,249	101,739.00	
WDP	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,853	127,534.30	
WEHA	WERELDHAVE NV	9,400	598,592.00	
ユーロ計		340,198	14,924,654.22	
(邦貨換算額)			(1,632,757,172)	

(単位:円)

総合計		(16,250,225,971)	16,250,225,971	
-----	--	------------------	----------------	--

(注1) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率 (%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	投資証券 101銘柄	100.0	61.4
カナダドル	投資証券 17銘柄	100.0	2.6
オーストラリアドル	投資証券 20銘柄	100.0	13.7
イギリスポンド	投資証券 11銘柄	100.0	6.6
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0	2.0
シンガポールドル	投資証券 15銘柄	100.0	3.3
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0	0.4
ユーロ	投資証券 20銘柄	100.0	10.0

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

3. 「海外コモディティインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外コモディティインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成22年2月15日現在	平成22年8月16日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		5,920	37,582
コール・ローン		53,810	244,547
社債券		9,968,999	18,548,550
派生商品評価勘定		73	-
流動資産合計		10,028,802	18,830,679
資産合計		10,028,802	18,830,679
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	6,486
未払解約金		-	129,688
流動負債合計		-	136,174
負債合計		-	136,174
純資産の部			
元本等			
元本		15,990,650	30,991,937
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,961,848	12,297,432
元本等合計		10,028,802	18,694,505
純資産合計		10,028,802	18,694,505
負債純資産合計		10,028,802	18,830,679

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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>(3) 時価が入手できなかった有価証券 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な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在			
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成21年8月18日 15,767,939 円 1,606,516 円 1,383,805 円	1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成22年2月16日 15,990,650 円 18,073,341 円 3,072,054 円
	平成22年2月15日現在の元本の内訳 日興ストラテジック・アロケー ション・ファンド(代替資産) (合計)	15,990,650 円 15,990,650 円		平成22年8月16日現在の元本の内訳 日興ストラテジック・アロケー ション・ファンド(代替資産) (合計)	30,991,937 円 30,991,937 円
2.	本報告書における開示対象ファ ンドの計算期間末日における当 該親投資信託の受益権の総数	15,990,650 口	2.	本報告書における開示対象ファ ンドの計算期間末日における当 該親投資信託の受益権の総数	30,991,937 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は5,961,848円であります。		3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は12,297,432円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ ん。
時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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に関する注記」に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
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よった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
社債券	9,968,999	165,766
合計	9,968,999	165,766

対象期間（自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
社債券	857,442
合計	857,442

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成22年2月15日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	44,952	-	45,025	73
	アメリカドル	44,952	-	45,025	73
合計		44,952	-	45,025	73

(単位：円)

区分	種類	平成22年8月16日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	109,458	-	102,972	6,486
	アメリカドル	109,458	-	102,972	6,486
合計		109,458	-	102,972	6,486

(注)時価の算定方法

- 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いては、以下のように評価しています。
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は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
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は、以下の方法によっています。
 - 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ています。
 - 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ます。
- 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いては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在	
1口当たり純資産額	0.6272 円	1口当たり純資産額	0.6032 円
(1万口当たり純資産額)	(6,272 円)	(1万口当たり純資産額)	(6,032 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(外貨建債券)

外貨建債券（アメリカドル）

（単位：アメリカドル）

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
社債券	536F00	IPATH Dow Jones-UBS Commodity Index Total Return ETN 0% 20360612	270,000.00	216,108.00	
社債券計			270,000.00	216,108.00	
アメリカドル計			270,000.00	216,108.00	
(邦貨換算額)			(23,174,100)	(18,548,550)	

（単位：円）

総合計		(23,174,100)	(18,548,550)	
		23,174,100	18,548,550	

(注) 総合計の()内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	社債券 1銘柄	100.0	100.0

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

第三部【ファンドの詳細情報】

第4【ファンドの経理状況】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

- (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、その後の改正を含みます。）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、その後の改正を含みます。）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、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ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月ごと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、第5期計算期間（平成21年8月18日から平成22年2月15日まで）及び第6期計算期間（平成22年2月16日から平成22年8月16日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科目	期別	第5期	第6期
		平成22年2月15日現在 金額	平成22年8月16日現在 金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		633,800	597,119
親投資信託受益証券		27,112,649	61,845,111
未収入金		-	747,000
流動資産合計		27,746,449	63,189,230
資産合計		27,746,449	63,189,230
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		331,256	747,000
未払受託者報酬		7,362	11,286
未払委託者報酬		105,320	161,162
その他未払費用		14,020	34,217
流動負債合計		457,958	953,665
負債合計		457,958	953,665
純資産の部			
元本等			
元本		55,209,496	124,500,145
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,921,005	62,264,580
（分配準備積立金）		507,566	239,222
元本等合計		27,288,491	62,235,565
純資産合計		27,288,491	62,235,565
負債純資産合計		27,746,449	63,189,230

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

科目	期別	第5期 自平成21年8月18日 至平成22年2月15日	第6期 自平成22年2月16日 至平成22年8月16日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		4	77
有価証券売買等損益		336,023	489,294
営業収益合計		336,019	489,371
営業費用			
受託者報酬		7,362	11,286
委託者報酬		105,320	161,162
その他費用		14,020	21,486
営業費用合計		126,702	193,934
営業利益又は営業損失()		462,721	295,437
経常利益又は経常損失()		462,721	295,437
当期純利益又は当期純損失()		462,721	295,437
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()		5,917	165,907
期首剰余金又は期首欠損金()		27,809,432	27,921,005
剰余金増加額又は欠損金減少額		741,397	1,639,200
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		741,397	1,639,200
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,910	35,365,305
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,910	35,365,305
分配金		331,256	747,000
期末剰余金又は期末欠損金()		27,921,005	62,264,580

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	期別	
	第5期 自平成21年8月18日 至平成22年2月15日	第6期 自平成22年2月16日 至平成22年8月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月16日から8月15日まで及び、8月16日から翌年2月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成21年8月18日から平成22年2月15日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月16日から8月15日まで及び、8月16日から翌年2月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成22年2月16日から平成22年8月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 平成22年2月15日現在		第6期 平成22年8月16日現在	
1. 期首元本額	56,582,435 円	1. 期首元本額	55,209,496 円
期中追加設定元本額	132,065 円	期中追加設定元本額	72,524,881 円
期中解約元本額	1,505,004 円	期中解約元本額	3,234,232 円
2. 計算期間末日における 受益権の総数	55,209,496 口	2. 計算期間末日における 受益権の総数	124,500,145 口
3. 元本の欠損		3. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は27,921,005円であります。		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は62,264,580円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自平成21年8月18日 至平成22年2月15日		第6期 自平成22年2月16日 至平成22年8月16日	
1. 分配金の計算過程		1. 分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	372,056 円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	508,212 円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有 価証券売買等損益	0 円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有 価証券売買等損益	0 円
C 信託約款に定める収益調整金	224,749 円	C 信託約款に定める収益調整金	1,187,994 円
D 信託約款に定める分配準備積立金	466,766 円	D 信託約款に定める分配準備積立金	478,010 円
E 分配対象収益 (A + B + C + D)	1,063,571 円	E 分配対象収益 (A + B + C + D)	2,174,216 円
F 分配対象収益 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0192 円 192 円	F 分配対象収益 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0174 円 174 円
G 分配金額	331,256 円	G 分配金額	747,000 円
H 分配金額 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0060 円 60 円	H 分配金額 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0060 円 60 円
2. その他費用の内訳		2. その他費用の内訳	
信託事務費用	14,020 円	信託事務費用	21,486 円

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

金融商品の時価等に関する事項

	第6期 自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ
時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>
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よつた場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

第5期（自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,112,649	353,857
合計	27,112,649	353,857

第6期（自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	12,364
合計	12,364

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第5期 平成22年2月15日現在		第6期 平成22年8月16日現在	
1口当たり純資産額	0.4943 円	1口当たり純資産額	0.4999 円
（1万口当たり純資産額）	（4,943 円）	（1万口当たり純資産額）	（4,999 円）

(4) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(親投資信託受益証券)

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ - REITマ ザーファンド	34,619,325	24,960,533	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	24,571,447	18,190,242	
	海外コモディティインデックス(ヘッジ なし)マザーファンド	30,991,937	18,694,336	
合計		90,182,709	61,845,111	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「海外コモディティインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」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」は、同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成22年2月15日現在	平成22年8月16日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		19,920,312	121,071,047
投資証券		16,358,541,400	15,128,232,460
未収配当金		332,548,523	163,834,436
流動資産合計		16,711,010,235	15,413,137,943
資産合計		16,711,010,235	15,413,137,943
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	1,721,970
流動負債合計		-	1,721,970
負債合計		-	1,721,970
純資産の部			
元本等			
元本		24,192,884,759	21,374,387,192
剰余金			
剰余金又は欠損金()		7,481,874,524	5,962,971,219
元本等合計		16,711,010,235	15,411,415,973
純資産合計		16,711,010,235	15,411,415,973
負債純資産合計		16,711,010,235	15,413,137,943

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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>(3) 時価が入手できなかった有価証券 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な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在					
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成21年8月18日 22,980,988,795 円 3,126,064,646 円 1,914,168,682 円	1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成22年2月16日 24,192,884,759 円 36,283,570 円 2,854,781,137 円		
	平成22年2月15日現在の元本の内訳			平成22年8月16日現在の元本の内訳			
	J - R E I T インデックス ファンド（適格機関投資家 向け）	159,911,009 円		J - R E I T インデックス ファンド（適格機関投資家 向け）	154,635,683 円		
	世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎 月分配型	23,853,230,809 円		世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎 月分配型	21,053,632,332 円		
	財産3分法ファンド（不動 産・債券・株式）資産成長 型	1,894,706 円		財産3分法ファンド（不動 産・債券・株式）資産成長 型	4,259,944 円		
	日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（代 替資産）	11,454,562 円		日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（代 替資産）	34,619,325 円		
	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	166,393,673 円		3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	127,239,908 円		
	（合計）	24,192,884,759 円		（合計）	21,374,387,192 円		
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	24,192,884,759 円	□	2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	21,374,387,192 円	□
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は7,481,874,524円であります。			3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は5,962,971,219円であります。		

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当期より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませ ん。
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
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よつた場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	16,358,541,400	318,841,692
合計	16,358,541,400	318,841,692

対象期間（自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	84,795,946
合計	84,795,946

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成22年2月15日現在		平成22年8月16日現在	
1口当たり純資産額	0.6907 円	1口当たり純資産額	0.7210 円
（1万口当たり純資産額）	（6,907 円）	（1万口当たり純資産額）	（7,210 円）

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(国内投資証券)

(単位:円)

	銘柄	券面総額	評価額	備考
3226	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	813	400,402,500	
3227	M I Dリート投資法人 投資証券	956	172,366,800	
3229	日本コマース投資法人 投資証券	1,340	122,476,000	
3234	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,205	203,886,000	
3240	野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	653	217,449,000	
3249	産業ファンド投資法人 投資証券	411	126,382,500	
3269	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,100	633,420,000	
8951	日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,821	1,991,626,000	
8952	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,546	1,919,684,000	
8953	日本リテールファンド投資法人 投資証券	8,786	953,281,000	
8954	オリックス不動産投資法人 投資証券	1,310	548,890,000	
8955	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,721	667,547,400	
8956	プレミアム投資法人 投資証券	729	255,150,000	
8957	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	881	403,057,500	
8958	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	504	315,504,000	
8959	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	1,588	701,102,000	
8960	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,048	559,632,000	
8961	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,259	847,307,000	
8963	インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,314	49,014,060	
8964	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,010	628,220,000	
8966	クレッシェンド投資法人 投資証券	686	106,810,200	
8967	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	683	456,927,000	
8968	福岡リート投資法人 投資証券	557	285,184,000	
8970	ジャパン・シングルレジデンス投資法人 投資証券	292	33,580,000	
8972	ケネディクス不動産投資法人 投資証券	1,215	330,723,000	
8973	積水ハウス・S I投資法人 投資証券	599	168,618,500	
8975	F Cレジデンシャル投資法人 投資証券	84	19,824,000	
8976	D Aオフィス投資法人 投資証券	2,060	483,894,000	
8977	阪急リート投資法人 投資証券	444	157,620,000	
8981	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人 投資証券	550	105,435,000	
8982	トップリート投資法人 投資証券	807	334,905,000	
8983	ジャパン・オフィス投資法人 投資証券	1,065	84,987,000	
8984	ピ・ライフ投資法人 投資証券	618	279,027,000	
8985	日本ホテルファンド投資法人 投資証券	220	50,380,000	
8986	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	6,926	193,928,000	
8987	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	804	319,992,000	
	合計	57,605	15,128,232,460	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2. 「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成22年2月15日現在	平成22年8月16日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		108,442,385	149,510,291
コール・ローン		19,462,456	29,267,933
投資証券		16,944,771,508	16,250,225,971
派生商品評価勘定		37,780	42,120
未収入金		430,955	392,041
未収配当金		88,486,545	73,613,117
流動資産合計		17,161,631,629	16,503,051,473
資産合計			
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,920	17,600
未払金		11,126,670	44,747,298
未払解約金		-	25,112,758
流動負債合計		11,136,590	69,877,656
負債合計			
純資産の部			
元本等			
元本		24,851,494,618	22,196,568,592
剰余金			
剰余金又は欠損金()		7,700,999,579	5,763,394,775
元本等合計		17,150,495,039	16,433,173,817
純資産合計			
負債純資産合計			
		17,161,631,629	16,503,051,473

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成21年8月18日 至 平成22年2月15日	自 平成22年2月16日 至 平成22年8月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供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>(3) 時価が入手できなかった有価証券 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な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

[次へ](#)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成22年8月31日現在です。

純資産額計算書

資産総額	62,228,038	円
負債総額	22,863	円
純資産総額（ - ）	62,205,175	円
発行済数量	124,586,613	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4993	円

（参考）日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	15,721,979,592	円
負債総額	120,122,632	円
純資産総額（ - ）	15,601,856,960	円
発行済数量	21,267,999,101	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7336	円

（参考）海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	16,426,915,562	円
負債総額	64,100,955	円
純資産総額（ - ）	16,362,814,607	円
発行済数量	22,218,164,127	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7365	円

（参考）海外コモディティインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	18,307,425	円
負債総額	8,190	円
純資産総額（ - ）	18,299,235	円
発行済数量	30,991,937	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.5905	円

第5【設定及び解約の実績】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第5 設定及び解約の実績」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間（2007年10月31日～2008年2月15日）	56,118,285	3,864,049
第2計算期間（2008年2月16日～2008年8月15日）	92,877,537	19,000,076
第3計算期間（2008年8月16日～2009年2月16日）	54,141,001	33,785,986
第4計算期間（2009年2月17日～2009年8月17日）	5,875,464	95,779,741
第5計算期間（2009年8月18日～2010年2月15日）	132,065	1,505,004
第6計算期間（2010年2月16日～2010年8月16日）	72,524,881	3,234,232

（注）第1計算期間の設定数量には、当初設定数量を含みません。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

(1) 資本金の額

平成22年9月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後(変更前)
平成18年7月6日	16,223,228,400円(16,174,272,500円)
平成19年4月13日	16,287,728,400円(16,223,228,400円)
平成20年6月23日	16,403,045,900円(16,287,728,400円)
平成21年10月1日	17,363,045,900円(16,403,045,900円)

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行いません。

毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

10名以内の取締役で構成され、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を任期とします。

取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。また、取締役中より取締役会長および取締役社長各1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を定めることができます。

・監査役会

5名以内の監査役で構成され、選任後4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最終の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

(平成22年9月末現在)

(3) 運用の意思決定プロセス

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

- ・「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なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成22年9月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	387	65,731
株式投資信託	315	53,496
単位型	42	1,600
追加型	273	51,895
公社債投資信託	72	12,235
単位型	55	838
追加型	17	11,396
投資法人合計	1	35

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

1. 当社の財務諸表は、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、改正前の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第50期 (平成21年3月31日)		第51期 (平成22年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		27,759	3	23,445
前払費用		393		359
未収入金		3,869		2
未収委託者報酬		5,506		6,451
未収収益	3	582	3	592
立替金		222		177
繰延税金資産		862		1,644
その他	2	30	2	30
流動資産合計		39,226		32,703
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	313	1	134
器具備品	1	346	1	215
有形固定資産合計		660		350
無形固定資産				
ソフトウェア		73		52
電話加入権等		21		-
無形固定資産合計		94		52
投資その他の資産				
投資有価証券		1,243		11,021
関係会社株式		7,719		8,659
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		1,037		1,042
繰延税金資産		1,218		1,031
その他		0		-
子会社投資損失引当金		576		576
投資その他の資産合計		10,702		21,239
固定資産合計		11,458		21,642
資産合計		50,684		54,345

(単位：百万円)

	第50期 (平成21年 3月31日)		第51期 (平成22年 3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		181		645
未払金		2,811		3,478
未払収益分配金		7		8
未払償還金		187		194
未払手数料		2,391	3	2,872
その他未払金		225		402
未払費用	3	3,701	3	3,804
未払法人税等		-		404
未払消費税等		-		129
賞与引当金		1,821		2,015
特別賞与引当金		-		1,204
役員賞与引当金		191		235
役員特別賞与引当金		-		106
その他		16		5
流動負債合計		8,723		12,028
固定負債				
退職給付引当金		612		743
その他		102		102
固定負債合計		714		846
負債合計		9,438		12,875
純資産の部				
株主資本				
資本金		16,403		17,363
資本剰余金				
資本準備金		4,272		5,220
その他資本剰余金		4		4
資本剰余金合計		4,277		5,225
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		20,593		18,814
利益剰余金合計		20,593		18,814
自己株式		-		53
株主資本合計		41,273		41,349
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		26		121
評価・換算差額等合計		26		121
純資産合計		41,246		41,470
負債純資産合計		50,684		54,345

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	56,567	49,510
その他営業収益	2,962	2,788
営業収益計	59,529	52,298
営業費用		
支払手数料	27,877	24,262
広告宣伝費	1,298	878
公告費	17	11
調査費	12,861	11,406
調査費	854	699
委託調査費	11,990	10,689
図書費	15	17
委託計算費	491	450
営業雑経費	714	585
通信費	190	167
印刷費	340	310
協会費	49	42
諸会費	7	6
その他	126	58
営業費用計	43,260	37,594
一般管理費		
給料	7,124	6,920
役員報酬	228	239
役員賞与引当金繰入額	191	235
給料・手当	4,879	4,343
賞与	4	86
賞与引当金繰入額	1,821	2,015
交際費	79	76
寄付金	33	55
旅費交通費	264	253
租税公課	255	225
不動産賃借料	921	921
退職給付費用	336	315
退職金	14	5
固定資産減価償却費	801	358
諸経費	2,992	2,710
一般管理費計	12,824	11,842
営業利益	3,444	2,862

	(単位：百万円)	
	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	2
受取配当金	1 710	1 714
有価証券売却益	160	-
有価証券償還益	73	13
時効成立分配金・償還金	106	23
その他	122	123
営業外収益計	1,176	876
営業外費用		
支払利息	15	9
有価証券売却損	51	-
有価証券償還損	200	-
時効成立後支払分配金・償還金	129	56
支払源泉所得税	-	71
為替差損	-	53
弁護士報酬等	37	37
その他	2	111
営業外費用計	438	340
経常利益	4,182	3,397
特別利益		
投資有価証券売却益	38	84
特別利益計	38	84
特別損失		
投資有価証券売却損	226	12
投資有価証券評価損	569	-
関係会社株式評価損	454	-
固定資産処分損	0	7
特別賞与引当金繰入額	-	3,742
役員特別賞与引当金繰入額	-	355
割増退職金	433	29
その他	-	246
特別損失計	1,685	4,393
税引前当期純利益又は税引前当期純損失()	2,535	911
法人税、住民税及び事業税	273	482
法人税等調整額	568	697
法人税等合計	842	214
当期純利益又は当期純損失()	1,693	696

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,287	16,403
当期変動額		
新株の発行	115	960
当期変動額合計	115	960
当期末残高	16,403	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,157	4,272
当期変動額		
新株の発行	115	948
当期変動額合計	115	948
当期末残高	4,272	5,220
其他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,161	4,277
当期変動額		
新株の発行	115	948
当期変動額合計	115	948
当期末残高	4,277	5,225
利益剰余金		
其他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	21,660	20,593
当期変動額		
剰余金の配当	2,760	1,082
当期純利益又は当期純損失	1,693	696
当期変動額合計	1,067	1,779
当期末残高	20,593	18,814
利益剰余金合計		
前期末残高	21,660	20,593
当期変動額		
剰余金の配当	2,760	1,082
当期純利益又は当期純損失	1,693	696
当期変動額合計	1,067	1,779
当期末残高	20,593	18,814

(単位：百万円)

	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月 31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月 31日)
自己株式		
前期末残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	-	223
自己株式の処分	-	170
当期変動額合計	-	53
当期末残高	-	53
株主資本合計		
前期末残高	42,109	41,273
当期変動額		
新株の発行	230	1,908
剰余金の配当	2,760	1,082
当期純利益又は当期純損失	1,693	696
自己株式の取得	-	223
自己株式の処分	-	170
当期変動額合計	836	75
当期末残高	41,273	41,349
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	99	26
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	126	148
当期変動額合計	126	148
当期末残高	26	121
評価・換算差額等合計		
前期末残高	99	26
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	126	148
当期変動額合計	126	148
当期末残高	26	121
純資産合計		
前期末残高	42,208	41,246
当期変動額		
新株の発行	230	1,908
剰余金の配当	2,760	1,082
当期純利益又は当期純損失	1,693	696
自己株式の取得	-	223
自己株式の処分	-	170
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	126	148
当期変動額合計	962	224
当期末残高	41,246	41,470

重要な会計方針

	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末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) 時価のないもの 総平均法による原価法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)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。	(1) 有形固定資産 同左 (2) 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払見込額に基づき当事業 年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払見込額に基づき当事業年 度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。	(1) 賞与引当金 同左 (2) 役員賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左

	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
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>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>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、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>	<p>(4) 子会社投資損失引当金 同左</p> <p>(5) 特別賞与引当金 従業員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(6) 役員特別賞与引当金 役員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>消費税等の会計処理 同左</p>

会計方針の変更

第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
-	<p>(「退職給付に係る会計基準」の一部改正)</p> <p>当事業年度より、「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。これにより退職給付債務の差額が26百万円(増加)発生しておりますが、翌事業年度から費用処理されるため当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

第50期 (平成21年3月31日)	第51期 (平成22年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 704百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 424百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 28百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 272百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務64百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 905百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 502百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、NCT信託銀行株式会社に信託しております。なお、日興シティ信託銀行株式会社は平成22年3月1日付でNCT信託銀行株式会社に社名変更を行っております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">現金・預金 10,095百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 33百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払手数料 4百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 256百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務32百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務240百万円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">受取配当金 703百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">受取配当金 712百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第50期（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	184,047,500	965,000	-	185,012,500

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加965,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
			前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
提出会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,000,000	-	670,000	5,330,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,140,000	-	300,000	2,840,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,470,000	-	150,000	1,320,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,140,000	-	530,000	3,610,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計			26,780,000	-	1,650,000	25,130,000	-

(注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しております。

2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来していません。

3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年5月23日 取締役会	普通株式	2,760	15	平成20年3月31日	平成20年6月10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当事業年度後となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,082	5.85	平成21年3月31日	平成21年6月30日

第51期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	185,012,500	12,000,000	-	197,012,500

(注) 平成21年10月1日、当社は、当社取締役から取得した新株予約権を行使した住友信託銀行株式会社に対し、12,000,000株の普通株式を発行いたしました。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	-	357,000	272,000	85,000

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
			前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
提出会社	平成16年度ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	6,000,000	-	-
	平成16年度ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	6,000,000	-	-
	平成16年度ストックオプション(3)	普通株式	5,330,000	-	5,330,000	-	-
	平成17年度ストックオプション	普通株式	2,840,000	-	2,840,000	-	-
	平成18年度ストックオプション	普通株式	1,320,000	-	1,320,000	-	-
	平成19年度ストックオプション(1)	普通株式	3,610,000	-	3,610,000	-	-
	平成19年度ストックオプション(2)	普通株式	30,000	-	30,000	-	-
	平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	-	19,724,100	165,000	19,559,100	-
合計			25,130,000	19,724,100	25,295,000	19,559,100	-

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社へ譲渡され、同日にて同社による行使が行われております。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、当事業年度中に消却されております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)の増加及び減少は、新株予約権の発行及び失効によるものであります。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 取締役会	普通株式	1,082	5.85	平成21年3月31日	平成21年6月30日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年5月20日 取締役会	普通株式	利益剰余金	305	1.55	平成22年3月31日	平成22年6月23日

(リース取引関係)

第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)				第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)			
1 オペレーティング・リース取引				1 オペレーティング・リース取引			
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	906百万円	1年内	906百万円	1年内	906百万円	1年内	906百万円
1年超	942百万円	1年超	35百万円	1年超	35百万円	1年超	35百万円
合計	1,849百万円	合計	942百万円	合計	942百万円	合計	942百万円

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(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、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

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、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（（注）2を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	23,445	23,445	-
(2) 未収委託者報酬	6,451	6,451	-
(3) 未収収益	592	592	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	10,873	10,873	-
(5) 関係会社株式 子会社株式	1,404	1,734	329
(6) 未払金	(3,478)	(3,478)	-
(7) 未払費用	(3,804)	(3,804)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(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

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらはほとんど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。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）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ため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額4,362百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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ため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,445	-	-	-
未収委託者報酬	6,451	-	-	-
未収収益	592	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9,907	354	448
合計	30,489	9,907	354	448

(有価証券関係)

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	7	12	5
	その他	273	299	25
	小計	280	312	31
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	836	759	76
	小計	836	759	76
合計		1,117	1,072	45

(注) 表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。当事業年度については、269百万円の減損処理を行っております。減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,196	199	278

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	121
その他 投資証券	50
合計	171

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない投資証券につき、投資証券の実質価額の低下を考慮し、50百万円の減損処理を行っております。

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
その他有価証券 その他 投資信託	-	-	504	442
合計	-	-	504	442

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	500	499	1
合計	500	499	1

(注) 当事業年度において、時価のある子会社株式につき、時価が著しく下落し回復する見込があると認められないため、404百万円の減損処理を行っております。

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	1,404	1,734	329
合計	1,404	1,734	329

(注) 子会社株式（貸借対照表計上額4,362百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	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	株式	21	7	14
	その他	9,873	9,637	235
	小計	9,894	9,644	250
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	979	1,024	45
	小計	979	1,024	45
合計		10,873	10,669	204

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	11	-	12
その他	230	84	0
合計	242	84	12

(持分法損益等)

第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,495 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,019	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,852 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,336

（退職給付関係）

第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)																								
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度、キャッシュバラン スプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一 時金制度を設けております。</p>	<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。なお当 社は、当事業年度末に適格退職年金制度を終了して おります。制度終了による影響額は、22百万円の損失で、 内訳は退職給付債務と年金資産の消滅による利益3 百万円及び数理計算上の未認識差異の一括償却によ る損失26百万円であります。</p>																								
<p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,429</td> </tr> <tr> <td>ロ 年金資産</td> <td style="text-align: right;">676</td> </tr> <tr> <td>ハ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">753</td> </tr> <tr> <td>ニ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">141</td> </tr> <tr> <td>ホ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">612</td> </tr> </table>	イ 退職給付債務	1,429	ロ 年金資産	676	ハ 未積立退職給付債務	753	ニ 未認識数理計算上の差異	141	ホ 退職給付引当金残高	612	<p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">838</td> </tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">838</td> </tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">94</td> </tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">743</td> </tr> </table>	イ 退職給付債務	838	ロ 未積立退職給付債務	838	ハ 未認識数理計算上の差異	94	ニ 退職給付引当金残高	743						
イ 退職給付債務	1,429																								
ロ 年金資産	676																								
ハ 未積立退職給付債務	753																								
ニ 未認識数理計算上の差異	141																								
ホ 退職給付引当金残高	612																								
イ 退職給付債務	838																								
ロ 未積立退職給付債務	838																								
ハ 未認識数理計算上の差異	94																								
ニ 退職給付引当金残高	743																								
<p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">107</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">30</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">34</td> </tr> <tr> <td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">169</td> </tr> <tr> <td>ヘ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">336</td> </tr> </table>	イ 勤務費用	107	ロ 利息費用	30	ハ 期待運用収益	5	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	34	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	169	ヘ 退職給付費用合計	336	<p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">28</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">33</td> </tr> <tr> <td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">162</td> </tr> <tr> <td>ヘ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">315</td> </tr> </table>	イ 勤務費用	96	ロ 利息費用	28	ハ 期待運用収益	5	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162	ヘ 退職給付費用合計	315
イ 勤務費用	107																								
ロ 利息費用	30																								
ハ 期待運用収益	5																								
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	34																								
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	169																								
ヘ 退職給付費用合計	336																								
イ 勤務費用	96																								
ロ 利息費用	28																								
ハ 期待運用収益	5																								
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33																								
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162																								
ヘ 退職給付費用合計	315																								
<p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td> <td style="text-align: right;">勤続期間比例</td> </tr> <tr> <td>ロ 割引率</td> <td style="text-align: right;">2.0%</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益率</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td> <td style="text-align: right;">10年</td> </tr> </table>	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	2.0%	ハ 期待運用収益率	0.7%	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年	<p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td> <td style="text-align: right;">勤続期間比例</td> </tr> <tr> <td>ロ 割引率</td> <td style="text-align: right;">1.7%</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益率</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td> <td style="text-align: right;">10年</td> </tr> </table>	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.7%	ハ 期待運用収益率	0.7%	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年								
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																								
ロ 割引率	2.0%																								
ハ 期待運用収益率	0.7%																								
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																								
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																								
ロ 割引率	1.7%																								
ハ 期待運用収益率	0.7%																								
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																								
<p>5 割増退職金に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>イ 流動負債</td> <td style="text-align: right;">16</td> </tr> <tr> <td>ロ 割増退職金</td> <td style="text-align: right;">433</td> </tr> </table>	イ 流動負債	16	ロ 割増退職金	433																					
イ 流動負債	16																								
ロ 割増退職金	433																								

(ストックオプション等関係)

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役 1名	当社の取締役 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 6,070,000株	普通株式 6,070,000株
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定条件	平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定	平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定
対象勤務期間	平成16年8月31日から平成19年3月23日まで	平成16年8月31日から平成19年7月7日まで
権利行使期間	平成16年8月31日から平成26年3月24日まで	平成16年8月31日から平成26年7月8日まで
	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 97名	当社の従業員及び関係会社の取締役・従業員 147名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 7,640,000株	普通株式 3,710,000株
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成18年6月24日から平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から平成27年6月22日まで

	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員 115名	当社及び関係会社の従業員 11名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 1,270,000株	普通株式 340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から平成28年4月27日まで	同左

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 124名	当社の従業員 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 4,250,000株	普通株式 30,000株
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年7月19日から平成29年7月18日まで	平成22年3月19日から平成30年3月18日まで

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8月31日	平成16年 8月31日
権利確定前(株)		
期首	-	-
付与	-	-
失効	-	-
権利確定	-	-
権利未確定残	-	-
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	6,000,000
権利確定	0	0
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1月11日、平成17年 1月28日 平成17年 5月24日、平成17年 6月22日	平成18年 2月14日
権利確定前(株)		
期首	6,000,000	3,140,000
付与	0	0
失効	670,000	300,000
権利確定	0	0
権利未確定残	5,330,000	2,840,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

付与日	平成18年度ストックオプション	
	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,140,000	330,000
付与	0	0
失効	120,000	30,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,020,000	300,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

付与日	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	4,140,000	30,000
付与	0	0
失効	530,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	3,610,000	30,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	-	-

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	-	-

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年 4 月28日	平成18年 7 月18日
権利行使価格(円) (注) 1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	-	0

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年 7 月27日	平成20年 3 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	450	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	0	0

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 4 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 169百万円

第51期(自 平成21年4月1日至 平成22年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役 1名	当社の取締役 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 6,070,000株	普通株式 6,070,000株
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定条件	平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定	平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定
対象勤務期間	平成16年8月31日から 平成19年3月23日まで	平成16年8月31日から 平成19年7月7日まで
権利行使期間	平成16年8月31日から 平成26年3月24日まで	平成16年8月31日から 平成26年7月8日まで

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 97名	当社の従業員及び 関係会社の取締役・従業員 147名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 7,640,000株	普通株式 3,710,000株
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成18年6月24日から 平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から 平成27年6月22日まで

	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員 115名	当社及び関係会社の従業員 11名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 1,270,000株	普通株式 340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から 平成28年4月27日まで	同左

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 124名	当社の従業員 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 4,250,000株	普通株式 30,000株
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年7月19日から平成29年7月18日まで	平成22年3月19日から平成30年3月18日まで

	平成21年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 271名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 19,724,100株
付与日	平成22年2月8日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から平成32年1月21日まで

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8月31日	平成16年 8月31日
権利確定前(株)		
期首	-	-
付与	-	-
失効	-	-
権利確定	-	-
権利未確定残	-	-
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	6,000,000
権利確定	0	0
権利行使	6,000,000	6,000,000
失効	0	0
権利未行使残	0	0

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1月11日、平成17年 1月28日 平成17年 5月24日、平成17年 6月22日	平成18年 2月14日
権利確定前(株)		
期首	5,330,000	2,840,000
付与	0	0
失効	5,330,000	2,840,000
権利確定	0	0
権利未確定残	0	0
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,020,000	300,000
付与	0	0
失効	1,020,000	300,000
権利確定	0	0
権利未確定残	0	0
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	3,610,000	30,000
付与	0	0
失効	3,610,000	30,000
権利確定	0	0
権利未確定残	0	0
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成21年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年2月8日
権利確定前(株)	
期首	0
付与	19,724,100
失効	165,000
権利確定	0
権利未確定残	19,559,100
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社へ譲渡され、同日にて同社による行使が行われております。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、当事業年度中に消却されております。

単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2	-	-

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2	-	-

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年 4 月28日	平成18年 7 月18日
権利行使価格(円) (注) 1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	-	0

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年 7 月27日	平成20年 3 月31日
権利行使価格(円)	450	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 3	0	0

	平成21年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 2 月 8 日
権利行使価格(円)	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 4	0

- (注) 1 当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 5 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

（税効果会計関係）

第50期 (平成21年3月31日)	第51期 (平成22年3月31日)
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：百万円)	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：百万円)
繰延税金資産(流動)	繰延税金資産(流動)
賞与引当金繰入超過額 895	賞与引当金繰入超過額 1,309
その他 182	その他 334
1,078	1,644
繰延税金資産(固定)	繰延税金資産(固定)
投資有価証券等評価損 171	投資有価証券等評価損 79
関係会社株式評価損 185	関係会社株式評価損 185
退職給付引当金超過額 249	退職給付引当金超過額 302
子会社投資損失引当金 234	子会社投資損失引当金 234
固定資産減価償却超過額 215	固定資産減価償却超過額 249
その他 162	その他 64
1,218	1,115
繰延税金資産合計 2,297	繰延税金資産合計 2,759
繰延税金負債(流動)	繰延税金負債(流動)
事業税中間納付還付予定額 216	その他有価証券評価差額金 83
繰延税金負債合計 216	繰延税金負債合計 83
繰延税金資産の純額 2,080	繰延税金資産の純額 2,676
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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 40.6%	法定実効税率 40.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 3.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目 30.3%
外国税額控除の影響額等 11.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 27.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.2%	海外子会社の留保利益の影響額等 13.9%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 23.5%

(関連当事者情報)

第50期(自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注)1	13,541	未払手数料	1,406

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税等が含まれておりません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成20年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計	6,747百万円
負債合計	1,977百万円
純資産合計	4,769百万円
営業収益	10,700百万円
税引前当期純利益	3,968百万円
当期純利益	3,255百万円

第51期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社	大阪市中央区	342,037	信託銀行業	(被所有) 直接 98.59		ストックオプション(新株予約権)の行使	1,908	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1 平成21年10月1日、当社は、当社取締役から取得した新株予約権（権利行使価格：1株当たり159円）を行使した住友信託銀行株式会社に対し12,000,000株の普通株式を発行しております。
- 2 議決権等の被所有割合は、自己株式（85,000株）を控除して計算しております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	149,594	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払 (注)1 (注)2	5,068

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。
- 2 平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社が当社の親会社となり、日興コーディアル証券株式会社は当社の関連当事者ではなくなりました。上記の金額は、平成21年4月1日から平成21年9月30日までの期間の取引金額であります。また、資本金又は出資金の金額は、平成21年9月30日の資本金額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成21年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	10,090百万円
負債合計	1,626百万円
純資産合計	8,464百万円
営業収益	10,606百万円
税引前当期純利益	4,405百万円
当期純利益	3,482百万円

(1株当たり情報)

第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	222円93銭	1株当たり純資産額	210円58銭
1株当たり当期純利益	9円16銭	1株当たり当期純損失	3円64銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、当事業年度は1株当たり当期純損失であるため、記載しておりません。	

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第50期 (平成21年3月31日)	第51期 (平成22年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	41,246	41,470
普通株式に係る純資産額(百万円)	41,246	41,470
差額の主な内訳(百万円)		
新株予約権	-	-
普通株式の発行済株式数(千株)	185,013	197,013
普通株式の自己株式数(千株)	-	85
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株)	185,013	196,928

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

項目	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
損益計算書上の当期純利益又は当期純損失() (百万円)	1,693	696
普通株式に係る当期純利益又は当期純損失() (百万円)	1,693	696
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式の期中平均株式数(千株)	184,790	190,975
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3) 5,330,000株、平成17年度ストックオプション2,840,000株、平成18年度ストックオプション1,320,000株、平成19年度ストックオプション(1) 3,610,000株、平成19年度ストックオプション(2) 30,000株、	平成21年度ストックオプション(1) 19,559,100株

（重要な後発事象）

第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
1 投資有価証券の繰上償還 当社が投資有価証券として保有しているグローバルコレクション（隔月分配型）（121百万円 当事業年度末現在）が平成21年 5月14日に繰上償還されることを、平成21年 5月11日に金融庁に届出ております。	-

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「第四部 特別情報 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」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成22年7月20日現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	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。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成22年3月末現在)	事業の内容
日興コーディアル証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(3) (略)

独立監査人の監査報告書

平成22年3月25日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）の平成21年8月18日から平成22年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）の平成22年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

日興アセットマネジメント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、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年9月22日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）の平成22年2月16日から平成22年8月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（代替資産）の平成22年8月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

日興アセットマネジメント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、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻村和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

(注) 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

(注) 上記は、当社が、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。