

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年4月11日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 中島 敬雄

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 大楽 信雄

【電話番号】 03-3287-3110

【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】 マネックス資産設計ファンド エボリューション

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド エボリューション

なお、「マネックス資産設計ファンド Evolution」という名称を用いる場合があります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド））といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・ 計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：マ資産エボ）

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7)【申込期間】

継続申込期間：平成24年4月12日から平成25年4月11日まで

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付を行いません。

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(9)【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(10)【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）**投資信託振替制度**

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

当ファンドは、追加型株式投資信託に属します。

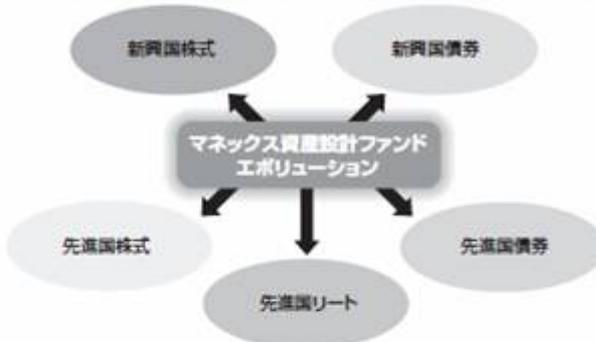
当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

① 世界の株式、債券、リートを実質的な投資対象とし、分散された基本ポートフォリオを構築します。

- 国内資産に偏らないグローバルな視点から資産配分比率を決定します。
- 基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、資産配分の専門家であるイボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。
- 各資産への投資はマザーファンドを通じて行います。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。



<投資対象とするマザーファンド>

先進国株式	国内株式バリュウファンド(国際化法)マザーファンド 外国株式バリュウファンドマザーファンド
新興国株式	エマージング株式バリュウマザーファンド
先進国債券	国内債券バリュウファンドマザーファンド 外国債券バリュウファンドマザーファンド
新興国債券	エマージング債券バリュウマザーファンド
先進国リート	J-REITインデックスファンドマザーファンド グローバルリートバリュウファンドマザーファンド

② 投資対象に新興国資産を加えることで、相対的に高いリターンを狙います。

- 先進国よりも高い経済成長が見込まれる新興国の資産を組み入れることで、先進国だけのポートフォリオよりも相対的に高いリターンが期待できます。

③ 基本ポートフォリオの推定リスク水準は原則として日本株投資と同程度^(*)としつつも、世界の複数資産へ高度な分散投資を行うことにより、効率の良い運用をめざします。

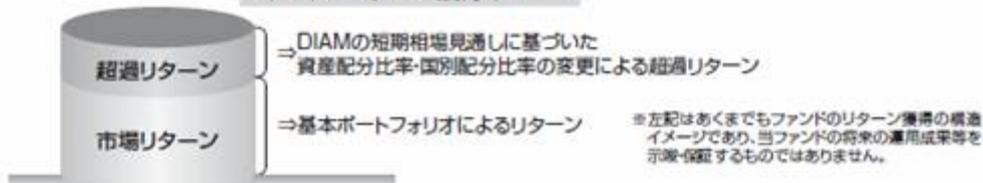
- 基本ポートフォリオのリスク水準を過去の日本株と同程度とし、期待リターンが最大となる資産配分比率を選択することで、分散効果を受けた効率的な運用をめざします。

(*)過去約30年間(1981年～2011年)の日経平均株価の標準偏差は概ね年率20%程度です。

④ 経験豊富な運用者によるアクティブアセットアロケーション運用により、超過収益の獲得をめざします。

- DIAMが短期相場見通しに基づき機動的に配分比率の変更を行うことで、基本ポートフォリオのリターンに加えて超過リターンの獲得を狙います。
- 国別配分比率の変更にあたっては、先物取引を活用します。

ファンドのリターン獲得イメージ



⑤ 信託報酬は1.05%(税込)とし、購入時手数料はノーロードと低コストでご提供します。

投資プロセス ～ポートフォリオができるまで～

①イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言による基本ポートフォリオの決定 見直し頻度:原則として年1回

- 各資産のデータ分析をもとに、長期のリターン、リスク、相関の推計を行い、一定のリスク水準に対して期待リターンの最も高い資産配分比率を決定します。

- ※資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。
- ※基本ポートフォリオの個別配分比率は、各資産の代表的指数の個別配分比率を参考とします。なお、各資産の代表的指数は下記のとおりです。
- ※上記基本ポートフォリオはあくまでもイメージであり、実際のものとは異なります。

基本ポートフォリオ(例)



各資産の定義

- 先道国株式/MSCIワールド・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
- 先道国債券/シティグループ世界国債インデックス(円ベース、為替ヘッジなし)
- 先道国リート/SGP 先道国 REITインデックス(円ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
- 新興国株式/MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
- 新興国債券/JPMERJエマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース、為替ヘッジなし)

②DIAMによる資産配分比率・個別配分比率の変更 見直し頻度:短期の相場見直しに基づき随時

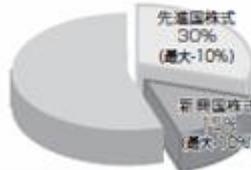
- 超過収益を獲得するために、相場環境の変化に対応し、基本ポートフォリオの資産配分比率・個別配分比率を機動的に変更します。

資産配分比率の変更(例)

株式に強気な見通しの場合



株式に強気な見通しの場合

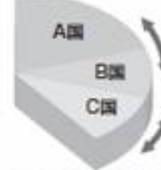


短期の相場見直しに基づき、資産配分比率を変更します。

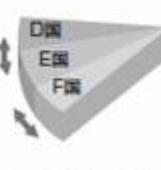
- ※資産配分比率の変更は、原則として基本ポートフォリオの比率から±10%の範囲で行います。ただし、リスクが一定水準を超えた場合には、先道国債券の比率も上記に合わせ、基本ポートフォリオの比率から+10%を超える範囲とすることがあります。

個別配分比率の変更(例)

先道国株式



先道国債券



短期の相場見直しに基づき、先道国株式および先道国債券の個別配分比率を変更します。

- ※個別配分比率の変更は先道国株式、先道国債券を対象とします。
- ※個別配分比率の変更にあたっては先物取引を活用しますが、同一資産内の売り持ち、買い持ちのポジションは合計で0%を基本とします。

- ※上記の資産配分比率・個別配分比率は、あくまでもポートフォリオの決定までのプロセスを説明するためのものであり、実際のポートフォリオとは異なります。また、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。
- ※上記の内容は作成時点のものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。今後予告なく変更される場合があります。

分配方針

年1回の決算時(1月11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

投資対象地域

「内外」とは目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回			
	年4回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	北米	ファミリー ファンド	あり ()
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信		中南米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投信) 資産配分変更型))	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。

決算頻度

「年1回」とは目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

「グローバル（日本を含む）」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズ）にのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

上記の分類は、社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、以下の方法でご確認ください。

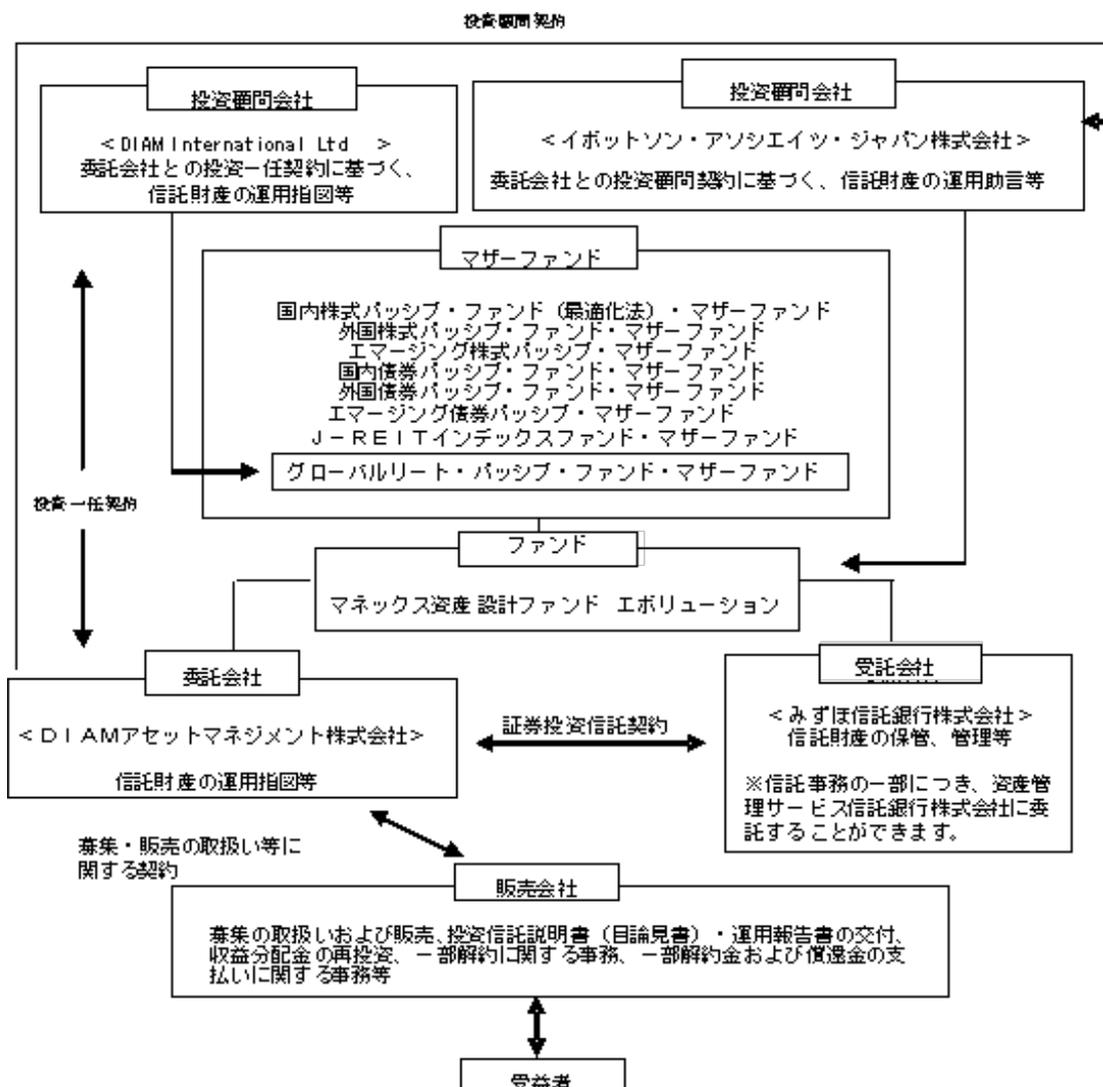
- ・投資信託協会への照会

ホームページ URL <http://www.toushin.or.jp/>

(2)【ファンドの沿革】

平成22年5月28日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。
当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。
当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・「投資顧問契約」の概要

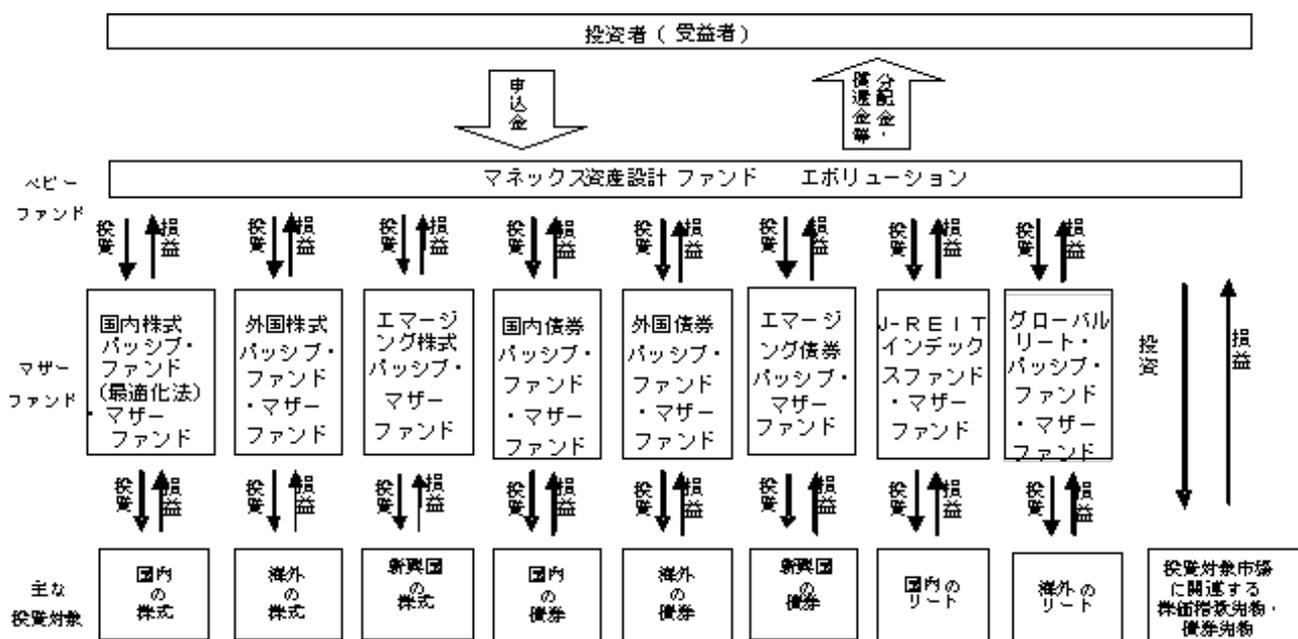
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。
当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。
「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成24年1月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日	会社設立
平成10年 3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年 1月 1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成24年1月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<投資態度>

当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券、投資対象市場に関連する株価指数先物および債券先物に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。

原則として、各資産の長期のヒストリカルデータの分析により、一定のリスク水準において期待リターンが最大となる資産配分比率を基本ポートフォリオとします。

基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき決定し、原則として、年1回見直しを行います。

原則として、基本ポートフォリオの構築にあたっては、8つのパッシブマザーファンド受益証券への投資を通じて行います。

短期的なマクロ分析・市場分析等に基づいて、実際のポートフォリオの資産比率および国別比率を一定の範囲内で基本配分比率から乖離させることにより、超過収益の獲得をめざします。なお、当該配分変更は、月次の定時リバランスに加えて、相場環境の変化に応じ機動的に実施します。

) 資産配分比率の変更

- 先進国株式、新興国株式、先進国債券、新興国債券、先進国リートの5資産クラスに対して相対魅力度を判定し、オーバーウェイト/アンダーウェイトの調整を実施します。
- 配分比率の変更は、原則としてマザーファンド受益証券の売買で調整します。

- ・ 基本配分比率との乖離幅は±10%とします。
- ・ 上記に関わらず、当ファンドのボラティリティが一定水準を超えた場合には、相場急変時と判断し、先進国債券への比率を増加させることがあります。この場合、基本配分比率との乖離幅は以下の通りとします。
先進国債券以外の資産クラス：±10%
先進国債券：制限は設けません

）国別配分比率の変更

- ・ 先進国株式、先進国債券を対象に各構成国別の相対魅力度を判定し、オーバーウェイト/アンダーウェイトの調整を実施します。
- ・ 配分比率の変更は、原則として各国の株価指数先物および債券先物の買い持ち/売り持ちのポジションを構築することで調整します。
- ・ 同一資産クラス内における先物の買い持ち/売り持ちのポジションは合計で0%を基本とします。また、各構成国においてオンバランス資産以上のショートポジションは構築しません。

オフバランス資産のポジションを考慮した実質組入比率は、原則として、純資産総額の範囲内で高位を維持します。

原則として、外貨建資産の為替ヘッジは行いません。また、株価指数先物または債券先物のポジションを構築した場合において、想定元本部分にかかる為替リスクの調整は行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

- a. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り、)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- b. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

2. 運用の指図範囲等（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券のほか次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.から11.の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの
なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

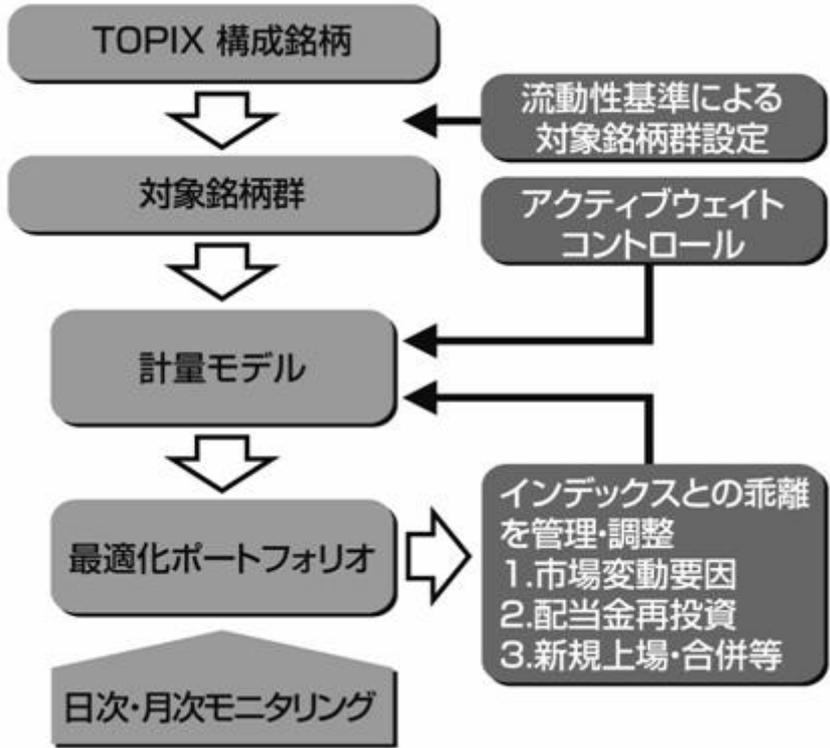
3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>6. 信託財産に属する資産の効率的な運用のため、有価証券先物取引等を行うことがあります。</p>
	<p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>

運用プロセス	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	・株式への投資割合には、制限を設けません。

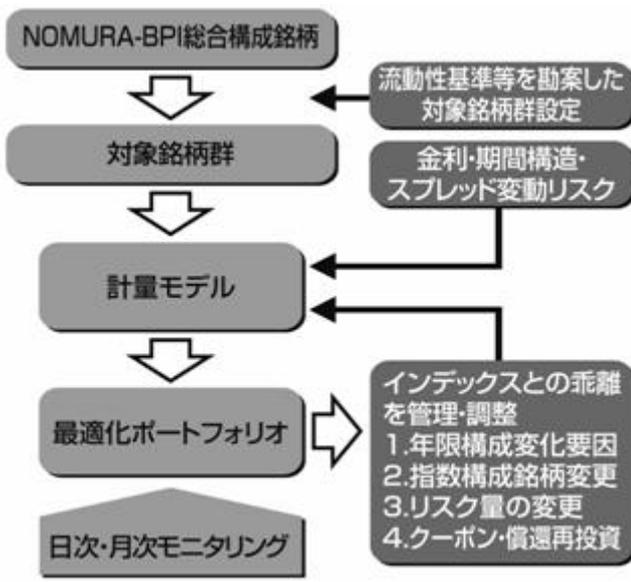
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
<p>運用プロセス</p>	<p>1) 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --- I[1.市場変動要因] H --- J[2.指数構成銘柄変更] H --- K[3.配当金再投資] style F fill:#ccc,stroke:#333 style G fill:#ccc,stroke:#333 style H fill:#ccc,stroke:#333 style I fill:#ccc,stroke:#333 style J fill:#ccc,stroke:#333 style K fill:#ccc,stroke:#333 </pre> </div>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>
--------	---

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1) 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2) 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>
主な投資制限	<p>1) 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <p>NOMURA - B P I 総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p>
運用プロセス	<p>1) 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3) インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 
主な投資制限	<p>1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3) 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4) 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-----------------------

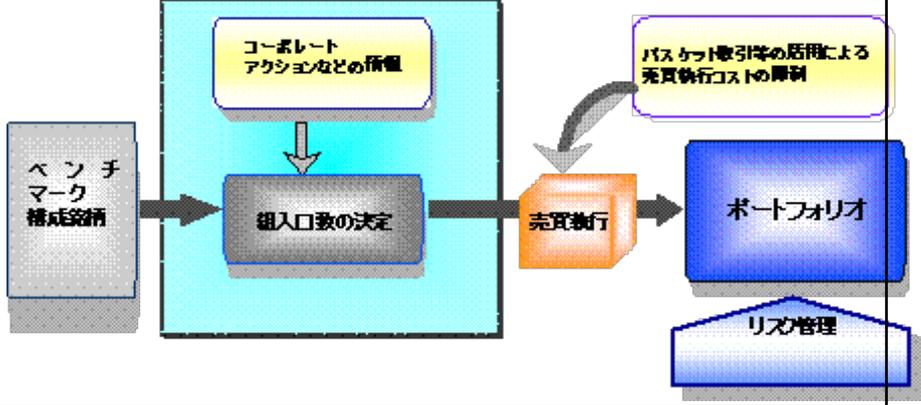
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。</p> <p>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[金利期間構造為替リスク] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理-調整 1. 年限・通貨構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre> </div>

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>
--------	--

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1) 主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2) 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3) 組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' sの外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
	<p>J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ . P . モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p>
主な投資制限	<p>1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2) 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

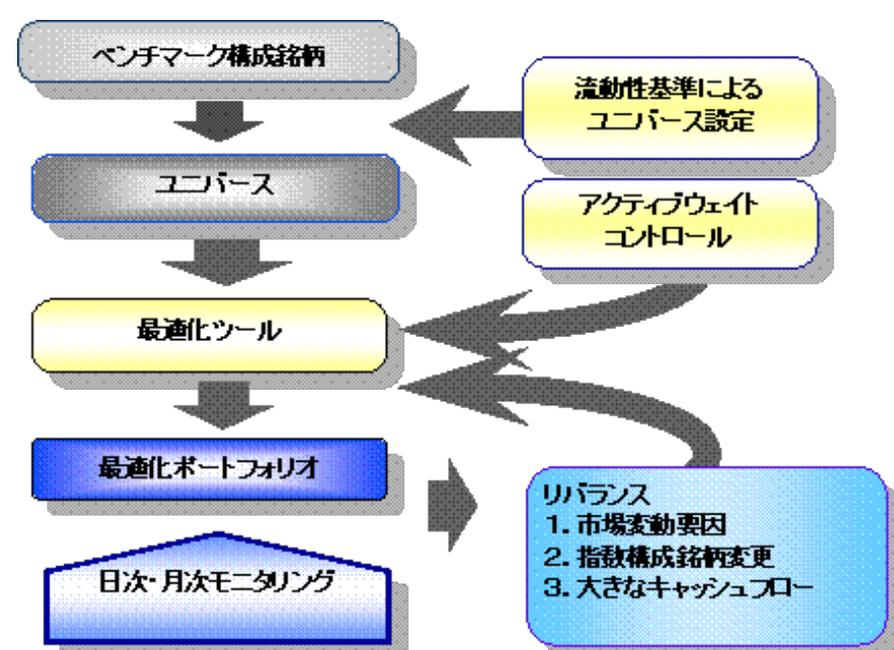
ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。 2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 <p>東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。</p> <p>(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>(株)東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>(株)東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
------	--

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>

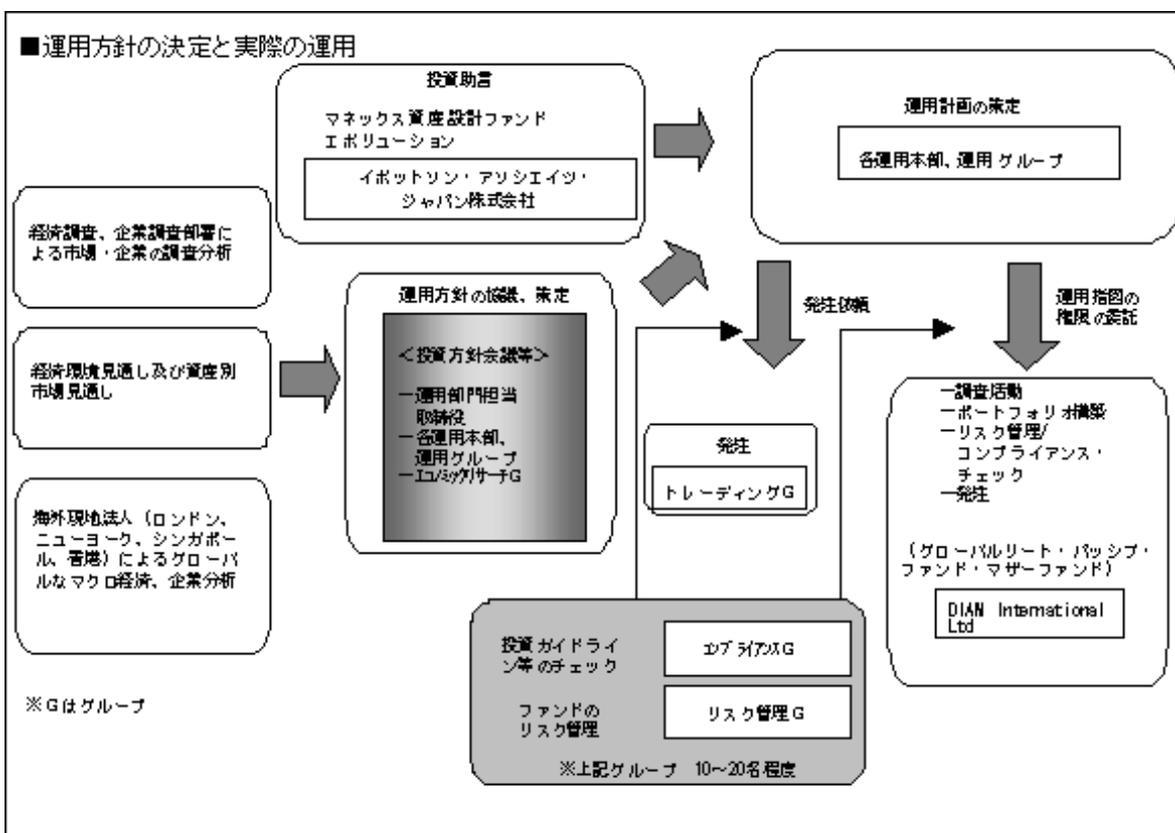
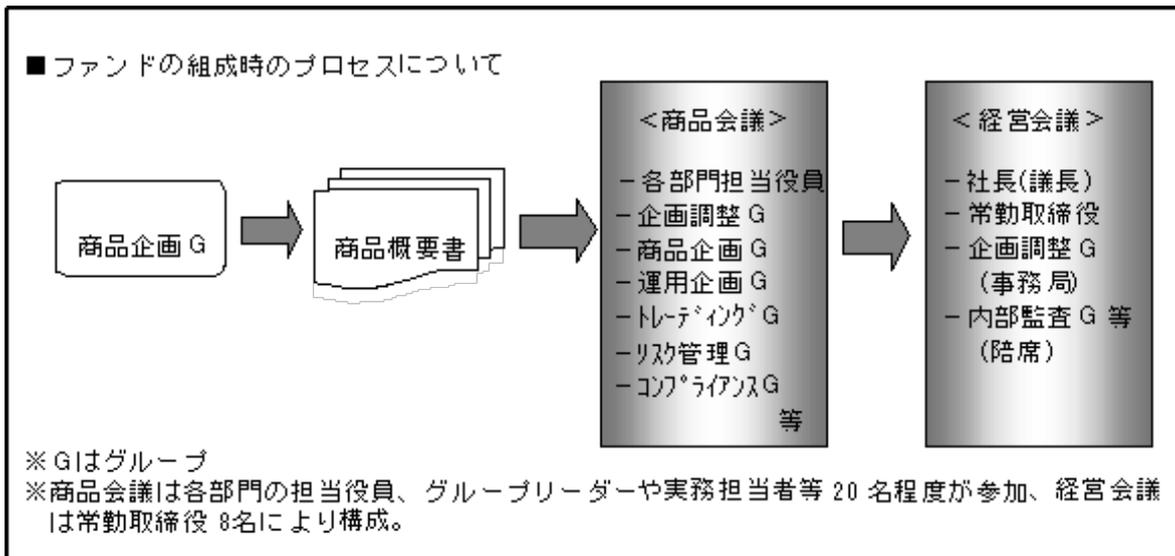
ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。）を主要投資対象とします。

投資態度	<p>日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。</p> <p>(注)「Standard & Poor's」、「S&P」、は、The McGraw-Hill Companies, Inc.の商標であり、DIAMアセットマネジメント株式会社の使用のためにライセンスされているものです。当マザーファンドは、Standard & Poor'sによって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではなく、また、Standard & Poor'sは、当マザーファンドの投資の妥当性を表明するものではありません。当マザーファンドは、The McGraw-Hill Companies, Inc.の一部門であるStandard & Poor's（以下「S&P」という）によって資金提供、保証、売買又は販売促進されるものではありません。S&Pは、当マザーファンドの所有者若しくは一般の者に対して、一般に証券について若しくは特に当マザーファンドに対する投資の妥当性に関して、又はS&P先進国REITインデックスの株式市場の運用成績を追跡する能力に関して、明示的にも黙示的にも、表明又は保証するものではありません。S&Pのライセンシーに対する唯一の関係は、S&Pの特定の商標及び商号についてのライセンスを行うこと、並びにS&Pによりライセンシー又は当マザーファンドと関係なく決定、作成及び計算されたS&P先進国REITインデックスについてライセンスすることです。S&Pは、S&P先進国REITインデックスの決定、作成及び計算において、当マザーファンドのライセンシー又は所有者の要求を考慮に入れる義務を負いません。S&Pは、当マザーファンドの価格及び量の決定、当マザーファンドの発行若しくは販売の時期の決定、又は、当マザーファンドを現金に換算する方程式の決定若しくは計算に、責任を負わず、また関わっていません。S&Pは、当マザーファンドの管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を負うものではありません。S&Pは、S&P先進国REITインデックス、又はそれに含まれるデータの正確性あるいは完全性を保証しません。また、S&Pは、当マザーファンドに含まれる誤り、欠落又は障害に対する責任を負わないものとします。S&Pは、S&P先進国REITインデックス又はそれらに含まれるデータの使用により、ライセンシー、当マザーファンドの所有者又はその他の人や組織に生じた結果に関して、明示的にも黙示的にも保証しないものとします。また、S&Pは、S&P先進国REITインデックス又はそれに含まれるデータに関して、その市場性又は特別な目的若しくは使用への適合性について、明示若しくは黙示の保証を行わず、かつあらゆる保証を放棄します。前述のいずれかを制限することなく、S&Pは、特別な、懲罰的な、間接の又は派生的な損害（逸失利益を含む）の可能性を通知されたとしても、かかる損害に対して何ら責任を負いません。</p>
------	---

運用プロセス	<p>1)流動性基準によるユニバース設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S & P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)リバランス 日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。 リバランス要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの ・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

< 運用方針の決定と実際の運用 >

経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部、運用グループの運用担当者、エコノミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

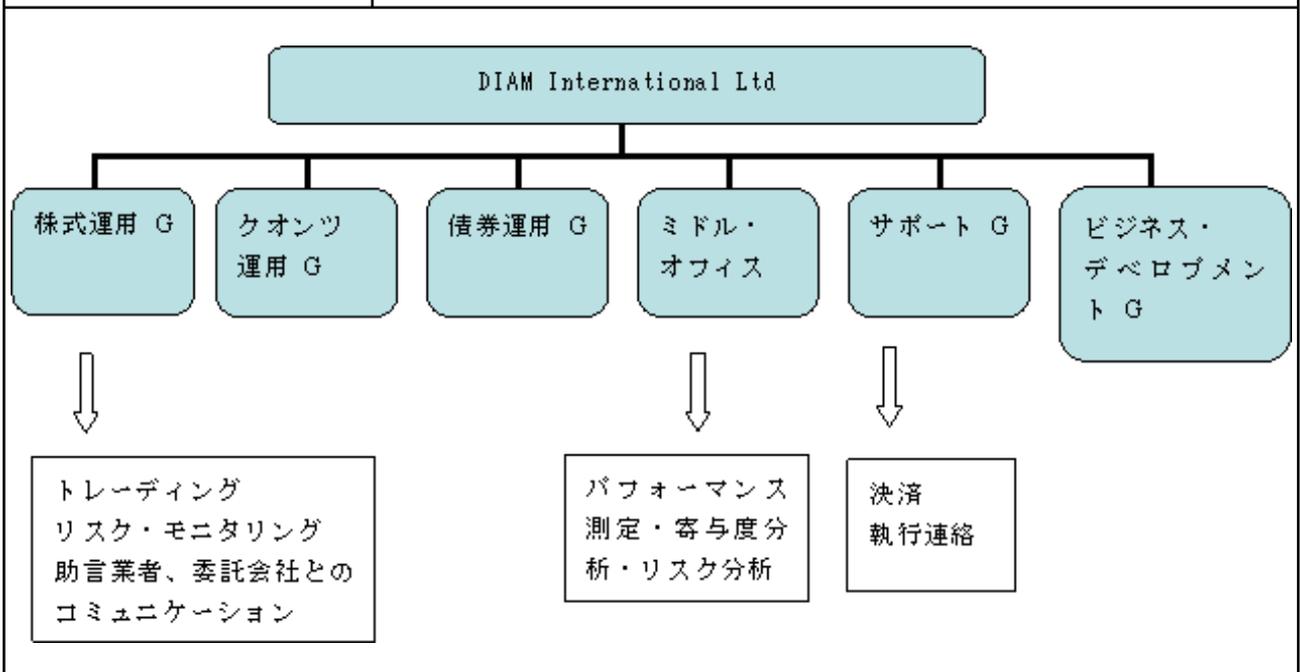
「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

1) 当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

2) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。

クオンツ運用グループ	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用はクオンツ運用グループが担当します。 主に日本を除く株式のクオンツ商品を運用しております。当グループでは、ユニバースの決定を行い、ポートフォリオの最適化、トレーディングを行い、主要なリスク要因はリアル・タイムで把握できる体制を敷いています。
ミドル・オフィス	週次・月次でパフォーマンスを測定し、要因分析を社内CEO以下に向けて報告するとともに、各種リスクをモニターします。
サポート・グループ	決済を主に担当しており、加えて執行された売買につき委託会社や日本の信託銀行への連絡を行います。



上記運用体制は、平成24年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資制限（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第16条第3項）

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（約款第16条第5項）

委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下本項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲（約款第19条）

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

同一銘柄の株式への実質投資割合（約款第20条第1項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第20条第3項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引の指図範囲（約款第21条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.から6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権付社債券の新株予約権(前号に定めるものに限ります。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2. の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2) 上記1) 1. 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図(約款第27条)

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

資金の借入れ(約款第33条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号)

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。)を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動きのほか、為替変動等による影響を受けます

が、これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

当ファンドに組入れられている各資産（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券、国内リートおよび外国リート）の資産配分比率によっては、収益率の悪い資産への配分が大きくなり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。また、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。また、新興国の株式に投資する場合、先進国の株式に比べ株価変動リスクが大きくなる傾向があります。

金利リスク

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リーートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リーートの価格は下落します。当ファンドは実質的に債券・リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。新興国の債券に投資する場合、先進国の債券に比べ金利リスクが大きくなる傾向があります。

リーートの価格変動リスク

一般にリートが投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、国内外の景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リーートの価格および配当は影響を受けることになり、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

実質的に投資対象とするリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には基準価額が下がる要因となります。

リートは、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

リートが投資対象とする建物の用途規制等不動産等にかかる規制の強化や、新たな規制の導入、税制の変更などにより、規制対象となる不動産等の価値が低下する可能性があり、その結果当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。新興国の通貨に投資する場合、先進国の通貨に比べ為替リスクが大きくなる傾向があります。

信用リスク

実質的に投資する有価証券等の発行者が経営不安・倒産等に陥った場合、投資した資金が回収できなくなることがあります。またこうした状況に陥ると予想される場合等には、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。有価証券等への投資にあたっては、発行者において利払いや償還金の支払いが遅延したり、支払いが滞るリスクが生じることがあります。新興国の債券、株式に投資する場合、先進国の債券、株式に比べ信用リスクが大きくなる傾向があります。

また、実質的に投資をするリートが、投資対象とする不動産の収益性悪化または資金繰りの悪化等により、清算される場合には、投資した資金が回収困難になる可能性があります。こうした状況に陥ると予想される場合、当該リーートの価格が下落する可能性があります。

流動性リスク

流動性リスクとは、市場における売買量の欠如等の理由により、最適な時期で有価証券等の売買ができず機会損失を被るリスクをいいます。市場規模が小さい株式等に投資する場合や、投資したリートによっては、資産規模や取引量が少ないため売却時に市場実勢から期待される価格で売却できなかつたり、売買取引が困難となることから、価格の値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。新興国の債券、株式に投資する場合、先進国の債券、株式に比べ流動性リスクが大きくなる傾向があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

有価証券（指数）先物取引に伴うリスク

当ファンドは、有価証券（指数）先物取引を使用するため、有価証券（指数）先物取引の価格変動により基準価額が上下します。先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。また、有価証券（指数）先物取引の値動きと市場全体の値動きは一致しない場合があります。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

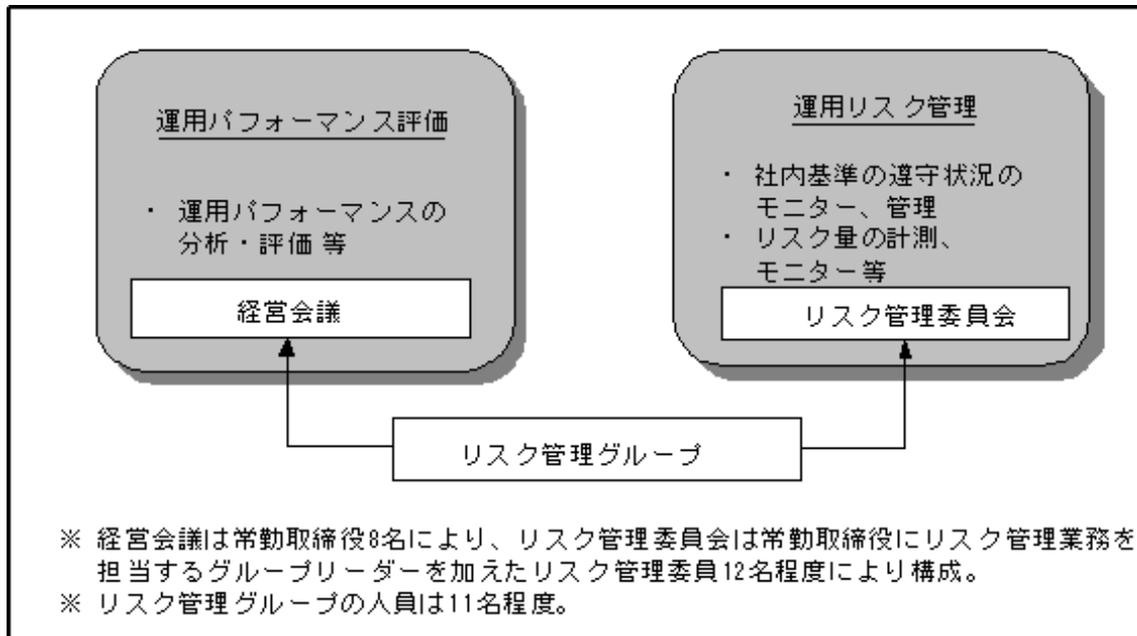
当ファンドは、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合等、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

- ・ 当ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券および値動きのある有価証券（指数）先物（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・ 投資信託は、預金・金融債・保険契約ではありません。また、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

- ・投資信託は、金融機関の預金・金融債あるいは保険契約における保険金額と異なり、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

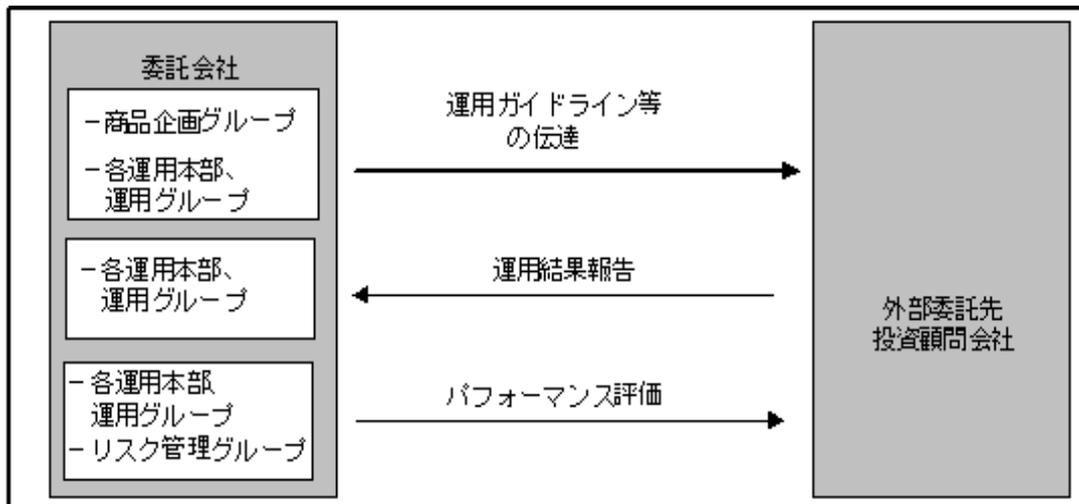
<運用評価・運用リスク管理体制>



運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

< 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成24年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。

時期	項目	費用		
		総額	信託財産の純資産総額に対して年率1.05%(税抜1.00%)	
毎日	信託報酬	配分	委託会社	年率0.5460%(税抜0.52%)～0.6090%(税抜0.58%)
			販売会社	年率0.3675%(税抜0.35%)～0.4305%(税抜0.41%)
			受託会社	年率0.0735%(税抜0.07%)

委託会社と販売会社の配分率は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。

販売会社毎の取扱純資産額	委託会社	販売会社
100億円以下の部分	年率0.6090% (税抜0.58%)	年率0.3675% (税抜0.35%)
100億円超300億円以下の部分	年率0.5775% (税抜0.55%)	年率0.3990% (税抜0.38%)
300億円超の部分	年率0.5460% (税抜0.52%)	年率0.4305% (税抜0.41%)

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。また、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中より支弁します。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資顧問会社（DIAM International Ltd）が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支弁するものとします。その報酬額は、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た金額の合計に、当該マザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属する当該マザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額とします。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの純資産総額	報酬率
25億円以下の部分	年率0.20%
25億円超75億円以下の部分	年率0.18%
75億円超の部分	年率0.15%

当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）が受ける報酬は、当ファンドまたはマザーファンドから直接的に支払われません。同社への投資顧問報酬は、委託会社が受け取った報酬の中から支払うものとします。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日計算し、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の

保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

実質的に投資対象とする不動産投信等には運用報酬等の費用がかかりますが、投資する不動産投信等の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額等を示すことはできません。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、原則として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

平成24年12月31日までの間は、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、10%（所得税7%および地方税3%）の税率での申告分離課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10%の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

上記10%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）となります。

また、上記10.147%の税率は平成26年1月1日からは、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

平成24年12月31日までの間は、収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

上記7%の税率は平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は、7.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。））となります。

また、上記7.147%の税率は平成26年1月1日からは、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））となります。

す。)となる予定です。

買取請求時の課税について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成24年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	424,696,295	98.23
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,643,418	1.77
合 計（純資産総額）		432,339,713	100.00

(注) 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の比率をいいます。

(参考) マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	247,698,726,514	98.78
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,047,879,515	1.22
合 計（純資産総額）		250,746,606,029	100.00

(注) 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の比率をいいます。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
-------	----	---------	---------

株式	米国	141,610,027,822	53.67
	英国	25,821,007,947	9.79
	カナダ	14,833,630,664	5.62
	スイス	11,496,525,772	4.36
	スウェーデン	3,626,797,518	1.37
	デンマーク	1,261,680,757	0.48
	ノルウェー	914,944,286	0.35
	アイルランド	1,692,244,521	0.64
	オランダ	3,107,068,761	1.18
	ベルギー	1,164,361,384	0.44
	ルクセンブルク	567,696,351	0.22
	フランス	10,289,410,715	3.90
	ドイツ	9,889,933,604	3.75
	ポルトガル	235,410,771	0.09
	スペイン	3,796,850,731	1.44
	イタリア	2,746,907,113	1.04
	フィンランド	1,015,890,449	0.39
	オーストリア	309,552,594	0.12
	ギリシャ	116,640,371	0.04
	香港	3,118,727,670	1.18
	中国	20,455,692	0.01
	シンガポール	2,099,094,858	0.80
	イスラエル	806,680,804	0.31
	オーストラリア	9,927,163,763	3.76
	ニュージーランド	127,789,308	0.05
	パナマ	159,884,860	0.06
	バミューダ諸島	604,096,391	0.23
	オランダ領キュラソー	1,235,763,867	0.47
	ケイマン諸島	283,247,888	0.11
	ガーンジー・チャネル諸島	86,864,799	0.03
	ジャージー・チャネル諸島	785,905,953	0.30
	マン島	86,496,342	0.03
	リベリア	46,454,840	0.02
モーリシャス	36,924,666	0.01	
小計	253,922,133,832	96.24	
投資信託受益証券	シンガポール	64,578,481	0.02
	オーストラリア	795,221,694	0.30
	小計	859,800,175	0.33
投資証券	米国	3,392,054,973	1.29
	英国	312,737,220	0.12
	カナダ	102,959,180	0.04
	オランダ	45,423,601	0.02
	フランス	311,017,351	0.12
	香港	112,250,600	0.04
	小計	4,276,442,926	1.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,779,707,886	1.81
合 計（純資産総額）		263,838,084,818	100.00

(注) 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の比率をいいます。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	米国	63,297,111	0.18
	ルクセンブルク	7,899,859	0.02
	ポーランド	454,413,628	1.32
	ハンガリー	109,294,006	0.32
	チェコ	109,466,719	0.32
	トルコ	441,815,464	1.28
	ロシア	2,162,540,232	6.27
	インドネシア	944,407,863	2.74
	フィリピン	243,307,428	0.71
	タイ	627,728,990	1.82
	香港	1,689,938,583	4.90
	韓国	4,941,248,148	14.32
	中国	3,388,209,487	9.82
	台湾	3,492,527,207	10.12
	インド	2,222,505,206	6.44
	マレーシア	1,114,251,009	3.23
	メキシコ	1,333,355,635	3.86
	チリ	563,431,300	1.63
	ペルー	81,771,856	0.24
	ブラジル	5,180,639,135	15.01
	バミューダ諸島	153,321,989	0.44
	ケイマン諸島	760,283,823	2.20
	コロンビア	307,518,437	0.89
	エジプト	104,567,781	0.30
	モロッコ	48,789,697	0.14
	南アフリカ	2,534,076,561	7.34
小計	33,080,607,156	95.86	
投資信託受益証券	米国	1,037,207,251	3.01
	メキシコ	195,987,072	0.57
	小計	1,233,194,323	3.57
投資証券	トルコ	6,779,248	0.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		188,275,136	0.55
合 計（純資産総額）		34,508,855,864	100.00

(注) 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の比率をいいます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	316,740,425,200	76.99
地方債証券	日本	27,694,655,708	6.73
特殊債券	日本	35,178,569,759	8.55
社債券	日本	29,208,091,060	7.10

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2,582,808,193	0.63
合計(純資産総額)	411,404,549,920	100.00

(注) 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の比率をいいます。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	米国	147,777,983,126	40.47
	英国	31,118,157,076	8.52
	カナダ	10,778,387,756	2.95
	スウェーデン	2,187,652,710	0.60
	デンマーク	3,047,840,099	0.83
	ノルウェー	1,127,084,528	0.31
	アイルランド	2,365,846,119	0.65
	オランダ	9,555,503,659	2.62
	ベルギー	9,071,013,232	2.48
	フランス	34,270,614,486	9.39
	ドイツ	34,274,758,392	9.39
	スペイン	15,733,957,964	4.31
	イタリア	31,610,700,159	8.66
	フィンランド	2,191,220,626	0.60
	ポーランド	2,646,507,585	0.72
	オーストリア	6,124,450,979	1.68
	シンガポール	1,482,594,870	0.41
	マレーシア	1,764,058,869	0.48
	オーストラリア	5,276,415,736	1.45
	メキシコ	3,113,241,607	0.85
小計	355,517,989,576	97.37	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	9,612,404,325	2.63	
合計(純資産総額)	365,130,393,901	100.00	

(注) 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の比率をいいます。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	----	---------	---------

国債証券	ブルガリア	172,466,040	0.55
	ハンガリー	611,097,285	1.94
	クロアチア	448,942,545	1.43
	トルコ	3,794,105,467	12.06
	ロシア	4,468,669,423	14.21
	インドネシア	2,218,493,571	7.05
	フィリピン	3,023,509,556	9.61
	メキシコ	4,841,455,142	15.39
	ペルー	1,706,526,260	5.43
	ブラジル	4,834,856,670	15.37
	パナマ	1,552,184,431	4.93
	コロンビア	1,888,979,367	6.01
	南アフリカ	885,438,969	2.81
	小計	30,446,724,726	96.80
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,008,002,397
合 計 （純資産総額）		31,454,727,123	100.00

(注) 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の比率をいいます。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
投資証券	日本	3,324,114,850	98.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		55,640,529	1.65
合 計 （純資産総額）		3,379,755,379	100.00

(注) 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の比率をいいます。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	シンガポール	72,641,582	2.75
	オーストラリア	298,605,254	11.30
	小計	371,246,836	14.04
投資証券	米国	1,702,338,460	64.40
	英国	154,365,099	5.84
	カナダ	87,447,389	3.31
	オランダ	42,167,023	1.60
	ベルギー	22,868,371	0.87
	フランス	126,679,814	4.79
	香港	49,385,930	1.87
	シンガポール	8,374,470	0.32
	ニュージーランド	12,506,889	0.47
	小計	2,206,133,445	83.46
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		65,951,852	2.50
合 計（純資産総額）		2,643,332,134	100.00

(注) 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の比率をいいます。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率（%）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	152,235,975	11,811.75	179,817,290	12,050.00	183,444,349	42.43
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	188,603,540	6,249.38	117,865,478	6,588.00	124,252,012	28.74
3	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	49,531,907	7,313.75	36,226,398	7,574.00	37,515,466	8.68
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	34,897,587	9,932.47	34,661,928	9,975.00	34,810,343	8.05
5	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	20,123,737	9,787.22	19,695,552	10,079.00	20,282,714	4.69
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10,857,123	11,066.78	12,015,338	11,330.00	12,301,120	2.85

7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資 信託受 益証券	日本	8,233,098	11,406.02	9,390,684	11,417.00	9,399,727	2.17
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	親投資 信託受 益証券	日本	3,836,539	6,890.26	2,643,476	7,013.00	2,690,564	0.62

(注1) 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の比率をいいます。

(注2) 簿価単価及び評価単価は1万口当たりの基準価額です。

(注3) 投資有価証券は8銘柄のみです。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.23
合計	98.23

(注)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の比率をいいます。

【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）マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用 機器	3,116,400	3,415.40	10,643,739,800	2,810.00	8,757,084,000	3.49
2	三菱UFJ フィナンシ ヤルG	株式	日本	銀行業	17,955,300	434.17	7,795,662,916	349.00	6,266,399,700	2.50
3	本田技研	株式	日本	輸送用 機器	2,027,600	3,405.41	6,904,808,800	2,666.00	5,405,581,600	2.16
4	キヤノン	株式	日本	電気機 器	1,492,900	3,888.24	5,804,747,916	3,290.00	4,911,641,000	1.96
5	三井住友フ ィナンシャ ルG	株式	日本	銀行業	1,793,700	2,830.76	5,077,536,347	2,425.00	4,349,722,500	1.73
6	日本電信電 話	株式	日本	情報・ 通信業	1,092,200	3,868.22	4,224,867,390	3,810.00	4,161,282,000	1.66
7	みずほフィ ナンシャル G	株式	日本	銀行業	30,466,400	157.10	4,786,340,092	115.00	3,503,636,000	1.40
8	ファナック	株式	日本	電気機 器	250,200	12,386.53	3,099,110,960	12,810.00	3,205,062,000	1.28
9	武田薬品	株式	日本	医薬品	942,900	3,961.82	3,735,600,314	3,310.00	3,120,999,000	1.24
10	三菱商事	株式	日本	卸売業	1,727,400	2,308.59	3,987,856,139	1,739.00	3,003,948,600	1.20
11	三井物産	株式	日本	卸売業	2,047,400	1,466.82	3,003,163,059	1,294.00	2,649,335,600	1.06
12	エヌ・ティ ・ティ・ド コモ	株式	日本	情報・ 通信業	19,544	148,121.25	2,894,881,619	135,400.00	2,646,257,600	1.06
13	小松製作所	株式	日本	機械	1,192,400	2,531.14	3,018,135,765	2,149.00	2,562,467,600	1.02
14	日 立	株式	日本	電気機 器	5,396,000	486.82	2,626,891,320	426.00	2,298,696,000	0.92
15	ソフトバン ク	株式	日本	情報・ 通信業	1,074,500	2,961.43	3,182,056,858	2,123.00	2,281,163,500	0.91
16	日本たばこ 産業	株式	日本	食料品	5,970	335,282.35	2,001,635,605	375,000.00	2,238,750,000	0.89
17	日産自動車	株式	日本	輸送用 機器	3,036,000	844.85	2,564,961,604	719.00	2,182,884,000	0.87
18	セブン&ア イ・HLD GS	株式	日本	小売業	992,100	2,151.21	2,134,215,928	2,146.00	2,129,046,600	0.85

19	ソニー	株式	日本	電気機器	1,499,300	2,653.55	3,978,461,888	1,391.00	2,085,526,300	0.83
20	東日本旅客鉄道	株式	日本	陸運業	417,900	5,218.90	2,180,976,463	4,935.00	2,062,336,500	0.82
21	三菱地所	株式	日本	不動産業	1,660,000	1,564.47	2,597,024,080	1,217.00	2,020,220,000	0.81
22	信越化学	株式	日本	化学	451,400	4,667.06	2,106,712,791	3,960.00	1,787,544,000	0.71
23	KDDI	株式	日本	情報・通信業	3,681	486,319.13	1,790,140,706	483,000.00	1,777,923,000	0.71
24	アステラス製薬	株式	日本	医薬品	558,800	3,206.72	1,791,914,558	3,130.00	1,749,044,000	0.70
25	東京海上HD	株式	日本	保険業	900,400	2,449.15	2,205,216,540	1,909.00	1,718,863,600	0.69
26	国際石油開発帝石	株式	日本	鉱業	3,274	544,245.88	1,781,861,002	520,000.00	1,702,480,000	0.68
27	パナソニック	株式	日本	電気機器	2,745,700	1,055.38	2,897,769,463	617.00	1,694,096,900	0.68
28	三菱電機	株式	日本	電気機器	2,403,000	984.37	2,365,437,300	684.00	1,643,652,000	0.66
29	東芝	株式	日本	電気機器	5,059,000	492.63	2,492,204,760	323.00	1,634,057,000	0.65
30	伊藤忠	株式	日本	卸売業	1,892,300	873.49	1,652,912,935	829.00	1,568,716,700	0.63

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	13.34
	輸送用機器	9.87
	銀行業	9.43
	情報・通信業	6.32
	化学	5.92
	卸売業	5.66
	機械	5.23
	医薬品	4.87
	小売業	4.20
	陸運業	4.08
	食料品	3.54
	電気・ガス業	3.09
	建設業	2.50
	不動産業	2.25
	保険業	2.24
	サービス業	1.89
	鉄鋼	1.80
	その他製品	1.59
	精密機器	1.37
	非鉄金属	1.19
ガラス・土石製品	1.14	

証券、商品先物取引業	1.03
繊維製品	0.94
石油・石炭製品	0.86
その他金融業	0.80
鉱業	0.77
ゴム製品	0.76
金属製品	0.70
パルプ・紙	0.40
海運業	0.37
空運業	0.29
倉庫・運輸関連業	0.24
水産・農林業	0.11
合計	98.78

(注)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の比率をいいます。

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	APPLE INC	株式	米国	コンピ ュータ ・周辺 機器	146,445	27,680.18	4,053,624,613	34,600.90	5,067,129,357	1.92
2	EXXON MOBIL CO RP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	768,734	6,365.67	4,893,510,189	6,529.73	5,019,622,541	1.90
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	米国	情報技 術サー ビス	188,631	12,607.23	2,378,113,659	14,703.15	2,773,469,888	1.05
4	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフト ウェア	1,190,444	2,056.52	2,448,169,465	2,261.61	2,692,322,198	1.02
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	316,981	7,400.30	2,345,755,505	7,898.46	2,503,660,418	0.95
6	GENERAL ELECTR IC CO	株式	米国	コング ロマリ ット	1,674,890	1,560.27	2,613,274,594	1,443.58	2,417,841,056	0.92

7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	520,668	4,295.65	2,236,609,934	4,434.75	2,309,033,454	0.88
8	JOHNSON & JOHNSON	株式	米国	医薬品	433,650	4,670.82	2,025,500,781	5,018.93	2,176,458,908	0.82
9	AT&T INC	株式	米国	各種電気通信サービス	938,099	2,176.76	2,042,020,903	2,240.99	2,102,269,728	0.80
10	PROCTER & GAMBLE CO	株式	米国	家庭用品	433,519	4,907.18	2,127,356,528	4,827.98	2,093,020,975	0.79
11	PFIZER INC	株式	米国	医薬品	1,234,363	1,448.14	1,787,528,191	1,648.28	2,034,576,339	0.77
12	HSBC HOLDINGS PLC	株式	英国	商業銀行	2,814,047	807.36	2,271,957,464	633.37	1,782,330,837	0.68
13	WELLS FARGO & CO	株式	米国	商業銀行	792,899	2,456.52	1,947,770,841	2,234.12	1,771,427,549	0.67
14	GOOGLE INC	株式	米国	インターネットソフトウェア・サービス	40,088	46,733.63	1,873,457,914	44,123.96	1,768,841,397	0.67
15	JPMORGAN CHASE & CO	株式	米国	各種金融サービス	614,581	3,378.52	2,076,373,845	2,826.82	1,737,312,198	0.66
16	INTEL CORP	株式	米国	半導体・半導体製造装置	828,563	1,655.00	1,371,275,674	2,042.40	1,692,258,065	0.64
17	COCA-COLA CO/THE	株式	米国	飲料	326,562	4,870.72	1,590,591,835	5,152.59	1,682,641,663	0.64
18	VODAFONE GROUP PLC	株式	英国	無線通信サービス	8,030,030	213.59	1,715,098,095	206.28	1,656,436,676	0.63
19	BP PLC	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	2,988,566	561.82	1,679,040,390	550.40	1,644,909,356	0.62
20	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL -W/I	株式	米国	タバコ	277,132	4,689.17	1,299,518,353	5,720.86	1,585,433,928	0.60
21	BHP BILLITON LTD	株式	オーストラリア	金属・鉱業	503,068	3,691.72	1,857,184,874	3,056.54	1,537,649,376	0.58
22	NOVARTIS AG-REG SHS	株式	スイス	医薬品	368,120	4,416.47	1,625,792,590	4,153.00	1,528,800,593	0.58
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	英国	石油・ガス・消耗燃料	569,445	2,523.39	1,436,933,321	2,676.36	1,524,039,991	0.58

24	MERCK & CO. INC.	株式	米国	医薬品	487,173	2,510.23	1,222,916,525	2,970.42	1,447,107,546	0.55
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	スイス	医薬品	110,723	11,734.35	1,299,262,590	12,945.81	1,433,398,699	0.54
26	WAL-MART STORES INC	株式	米国	食品・生活必需品小売り	300,767	4,184.36	1,258,516,305	4,682.09	1,408,219,366	0.53
27	ORACLE CORP	株式	米国	ソフトウェア	637,175	2,482.93	1,582,061,188	2,184.47	1,391,888,398	0.53
28	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	英国	医薬品	799,241	1,441.78	1,152,329,644	1,714.00	1,369,898,474	0.52
29	TOTAL SA	株式	フランス	石油・ガス・消耗燃料	334,286	4,195.26	1,402,416,641	4,000.51	1,337,313,450	0.51
30	CISCO SYSTEMS INC	株式	米国	通信機器	864,224	1,402.81	1,212,345,869	1,493.23	1,290,484,339	0.49

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	石油・ガス・消耗燃料	10.64
	商業銀行	7.15
	医薬品	6.54
	金属・鉱業	4.04
	保険	3.89
	各種電気通信サービス	3.02
	化学	2.87
	食品	2.81
	コンピュータ・周辺機器	2.75
	メディア	2.50
	ソフトウェア	2.48
	食品・生活必需品小売り	2.29
	情報技術サービス	2.26
	飲料	2.24
	コングロマリット	2.13
	各種金融サービス	2.11
	機械	1.93
	電力	1.86
	資本市場	1.83
	航空宇宙・防衛	1.78
	半導体・半導体製造装置	1.71
	ホテル・レストラン・レジャー	1.64
	タバコ	1.63
エネルギー設備・サービス	1.63	
家庭用品	1.45	

通信機器	1.45
専門小売り	1.45
総合公益事業	1.35
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.34
ヘルスケア機器・用品	1.29
インターネットソフトウェア・サービス	1.00
繊維・アパレル・贅沢品	0.99
自動車	0.97
バイオテクノロジー	0.91
無線通信サービス	0.90
陸運・鉄道	0.87
電気設備	0.80
不動産管理・開発	0.61
複合小売り	0.60
航空貨物・物流サービス	0.58
インターネット販売・カタログ販売	0.53
消費者金融	0.44
商業サービス・用品	0.43
建設・土木	0.42
専門サービス	0.38
自動車部品	0.37
電子装置・機器・部品	0.32
建設資材	0.31
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.31
パーソナル用品	0.28
商社・流通業	0.23
紙製品・林産品	0.20
運送インフラ	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.18
容器・包装	0.17
建設関連製品	0.16
ガス	0.16
家庭用耐久財	0.16
販売	0.13
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.09
水道	0.08
各種消費者サービス	0.08
レジャー用品	0.07
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
事務用電子機器	0.06
不動産投資信託	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
株式計	96.24
投資信託受益証券	0.33
投資証券	1.62
合計	98.19

(注) 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の比率をいいます。

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	業種	株数又は 口数	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	VANGUARD MSCI EMERGING MARKETS	投資 信託 受益 証券	米国		323,400	3,101.36	1,002,978,242	3,207.20	1,037,207,251	3.01
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	半導体 ・半導 体製造 装置	13,508	59,755.66	807,179,497	75,597.00	1,021,164,276	2.96
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体 ・半導 体製造 装置	3,009,083	178.56	537,289,141	201.47	606,245,970	1.76
4	OAO GAZPROM ADR	株式	ロシア	石油・ ガス・ 消耗燃 料	655,556	1,166.33	764,593,765	918.85	602,358,548	1.75
5	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通 信サー ビス	734,500	723.49	531,406,220	763.38	560,698,938	1.62
6	PETROLEO BRASILEIRO SA	株式	ブラ ジル	石油・ ガス・ 消耗燃 料	513,412	1,099.16	564,322,105	1,072.73	550,750,504	1.60
7	VALE SA-PREF A	株式	ブラ ジル	金属・ 鉱業	245,796	1,946.35	478,405,515	1,817.57	446,750,403	1.29
8	AMERICA MOVIL SAB DE CV	株式	メキ シコ	無線通 信サー ビス	4,900,678	97.78	479,179,370	90.00	441,057,099	1.28
9	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀 行	7,315,530	66.55	486,873,453	59.99	438,833,040	1.27
10	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	株式	ブラ ジル	商業銀 行	277,900	1,565.83	435,144,919	1,549.93	430,725,547	1.25

11	PETROLEO BRASILEIRO SA	株式	ブラ ジル	石油・ ガス・ 消耗燃 料	361,810	1,235.97	447,185,512	1,170.09	423,349,539	1.23
12	IND & COMM BK OF CHINA - H	株式	中国	商業銀 行	7,417,235	60.72	450,398,240	53.39	395,983,925	1.15
13	CNOOC LTD	株式	香港	石油・ ガス・ 消耗燃 料	2,176,000	183.50	399,304,083	155.63	338,650,880	0.98
14	BANCO BRADESCO SA	株式	ブラ ジル	商業銀 行	232,272	1,357.62	315,338,263	1,415.46	328,771,075	0.95
15	VALE SA	株式	ブラ ジル	金属・ 鉱業	157,927	2,186.24	345,266,128	1,898.77	299,867,587	0.87
16	PETRO CHINA CO LTD	株式	中国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	2,560,000	112.63	288,339,119	110.32	282,419,200	0.82
17	LUKOIL SPON ADR	株式	ロシ ア	石油・ ガス・ 消耗燃 料	63,630	5,077.88	323,105,462	4,422.40	281,397,439	0.82
18	HYUNDAI MOTOR CO	株式	韓国	自動車	19,029	14,924.72	284,002,541	14,644.80	278,675,899	0.81
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	台湾	電子装 置・機 器・部 品	1,120,190	234.85	263,077,253	240.13	268,988,984	0.78
20	MTN GROUP LTD	株式	南ア フリ カ	無線通 信サー ビス	206,758	1,327.01	274,370,245	1,275.34	263,686,582	0.76
21	BANK OF CHINA LTD	株式	中国	商業銀 行	8,135,200	39.04	317,637,863	32.31	262,832,042	0.76
22	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	株式	ブラ ジル	飲料	90,675	2,126.58	192,827,919	2,788.13	252,813,470	0.73
23	SASOL LTD	株式	南ア フリ カ	石油・ ガス・ 消耗燃 料	65,210	3,594.98	234,428,505	3,854.22	251,333,947	0.73
24	SBERBANK ADR	株式	ロシ ア	商業銀 行	272,409	1,166.97	317,892,255	903.58	246,142,071	0.71
25	POSCO	株式	韓国	金属・ 鉱業	8,061	31,834.71	256,619,592	28,238.70	227,632,161	0.66
26	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイ マン 諸島	インタ ーネッ トソフ トウェ ア・サ ービス	124,200	1,938.43	240,752,488	1,816.34	225,589,428	0.65

27	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	株式	中国	保険	920,000	270.07	248,461,085	218.18	200,723,300	0.58
28	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	株式	メキ シコ	食品・ 生活必 需品小 売り	791,600	204.86	162,167,997	233.66	184,962,327	0.54
29	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	株式	中国	石油・ ガス・ 消耗燃 料	2,018,000	78.19	157,780,520	90.92	183,467,479	0.53
30	ECOPETROL SA SP ADR	株式	コロ ンビ ア	石油・ ガス・ 消耗燃 料	46,648	3,176.82	148,192,509	3,865.59	180,322,126	0.52

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	商業銀行	16.60
	石油・ガス・消耗燃料	13.99
	金属・鉱業	8.56
	半導体・半導体製造装置	6.53
	無線通信サービス	5.41
	化学	2.99
	自動車	2.68
	保険	2.54
	各種電気通信サービス	2.17
	食品	2.06
	電子装置・機器・部品	1.96
	食品・生活必需品小売り	1.96
	電力	1.94
	コングロマリット	1.63
	各種金融サービス	1.56
	情報技術サービス	1.53
	不動産管理・開発	1.51
	飲料	1.37
	建設・土木	1.27
	建設資材	1.14
	コンピュータ・周辺機器	1.10
	機械	0.98
	インターネットソフトウェア・サービス	0.90
	メディア	0.90
	専門小売り	0.85
	自動車部品	0.82
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.81
家庭用耐久財	0.80	

複合小売り	0.74
タバコ	0.73
資本市場	0.64
医薬品	0.61
運送インフラ	0.60
家庭用品	0.47
ガス	0.46
ホテル・レストラン・レジャー	0.44
貯蓄・抵当・不動産金融	0.44
パーソナル用品	0.43
旅客航空輸送業	0.40
商社・流通業	0.39
通信機器	0.38
電気設備	0.32
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス	0.28
海運業	0.28
紙製品・林産品	0.23
繊維・アパレル・贅沢品	0.21
ソフトウェア	0.18
水道	0.14
航空宇宙・防衛	0.13
エネルギー設備・サービス	0.12
陸運・鉄道	0.11
販売	0.11
総合公益事業	0.10
消費者金融	0.08
航空貨物・物流サービス	0.06
容器・包装	0.05
建設関連製品	0.05
各種消費者サービス	0.05
ヘルスケア機器・用品	0.04
レジャー用品	0.03
商業サービス・用品	0.02
株式 計	95.86
投資信託受益証券	3.57
投資証券	0.02
合計	99.45

(注) 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の比率をいいます。

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。

[次へ](#)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	313回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	6,500,000,000	101.21	6,578,615,000	103.77	6,744,790,000	1.30	2021/ 3/20	1.64
2	293回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	105.90	5,295,100,000	108.27	5,413,300,000	1.80	2018/ 6/20	1.32
3	305回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,100,000,000	101.39	5,170,808,000	104.79	5,344,341,000	1.30	2019/ 12/20	1.30
4	285回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,900,000,000	105.87	5,187,519,000	106.85	5,235,552,000	1.70	2017/ 3/20	1.27
5	315回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	101.52	5,076,125,000	102.68	5,134,100,000	1.20	2021/ 6/20	1.25
6	93回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.02	5,001,182,000	100.90	5,045,050,000	0.50	2015/ 12/20	1.23
7	99回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	5,000,000,000	100.09	5,004,325,000	100.36	5,018,200,000	0.40	2016/ 9/20	1.22
8	70回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,900,000,000	101.14	4,955,860,000	100.76	4,937,338,000	0.80	2013/ 3/20	1.20
9	312回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,700,000,000	99.61	4,681,762,000	103.14	4,847,768,000	1.20	2020/ 12/20	1.18
10	306回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	102.18	4,598,292,000	105.38	4,742,100,000	1.40	2020/ 3/20	1.15
11	75回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,600,000,000	102.03	4,693,334,000	101.59	4,673,186,000	1.10	2013/ 9/20	1.14
12	310回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	97.56	4,390,410,000	101.70	4,576,320,000	1.00	2020/ 9/20	1.11
13	317回利付 国庫債券 (10年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.49	4,522,160,000	101.55	4,569,615,000	1.10	2021/ 9/20	1.11
14	81回利付 国庫債券(5 年)	国債 証券	日本	4,500,000,000	101.28	4,557,600,000	101.41	4,563,315,000	0.80	2014/ 3/20	1.11

15	8 9 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	99.47	4,476,220,000	100.57	4,525,605,000	0.40	2015/ 6/20	1.10
16	9 7 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,500,000,000	100.29	4,512,925,000	100.43	4,519,395,000	0.40	2016/ 6/20	1.10
17	2 8 9 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,100,000,000	104.60	4,288,761,000	106.22	4,355,184,000	1.50	2017/ 12/20	1.06
18	7 2 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	4,200,000,000	102.81	4,317,920,000	101.89	4,279,548,000	1.50	2013/ 6/20	1.04
19	2 9 6 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	4,000,000,000	103.56	4,142,520,000	106.41	4,256,560,000	1.50	2018/ 9/20	1.03
20	3 0 1 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,800,000,000	103.02	3,914,570,000	106.54	4,048,672,000	1.50	2019/ 6/20	0.98
21	2 8 8 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,600,000,000	105.57	3,800,412,000	107.21	3,859,668,000	1.70	2017/ 9/20	0.94
22	8 7 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,800,000,000	100.28	3,810,630,000	100.89	3,833,668,000	0.50	2014/ 12/20	0.93
23	2 6 6 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,700,000,000	103.47	3,828,279,000	103.46	3,828,057,000	1.40	2014/ 12/20	0.93
24	2 8 6 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	106.40	3,723,840,000	107.59	3,765,755,000	1.80	2017/ 6/20	0.92
25	2 8 2 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,400,000,000	105.85	3,598,841,000	106.34	3,615,594,000	1.70	2016/ 9/20	0.88
26	7 8 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	101.62	3,556,545,000	101.45	3,550,785,000	0.90	2013/ 12/20	0.86
27	8 5 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	100.94	3,532,935,000	101.40	3,548,965,000	0.70	2014/ 9/20	0.86
28	8 8 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,500,000,000	99.96	3,498,520,000	100.90	3,531,465,000	0.50	2015/ 3/20	0.86
29	8 3 回 利付 国庫債券（5 年）	国債 証券	日本	3,400,000,000	101.59	3,454,204,000	101.78	3,460,350,000	0.90	2014/ 6/20	0.84
30	2 9 7 回 利 付国庫債券 （10年）	国債 証券	日本	3,200,000,000	102.65	3,284,672,000	105.81	3,385,824,000	1.40	2018/ 12/20	0.82

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.99
地方債証券	6.73
特殊債券	8.55
社債券	7.10
合計	99.37

(注)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の比率をいいます。

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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債 証券	米国	3,055,200,000	108.13	3,303,435,000	107.70	3,290,297,640	4.00	2014/ 2/15	0.90
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債 証券	米国	3,055,200,000	108.55	3,316,297,392	107.23	3,275,968,752	4.25	2013/ 11/15	0.90
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債 証券	米国	3,055,200,000	101.13	3,089,612,497	101.20	3,091,709,640	1.00	2013/ 7/15	0.85
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債 証券	米国	2,673,300,000	110.70	2,959,209,435	110.29	2,948,355,837	4.75	2014/ 5/15	0.81
5	US T N/B 4.25 08/15/13	国債 証券	米国	2,673,300,000	107.98	2,886,736,272	106.32	2,842,252,560	4.25	2013/ 8/15	0.78
6	US T N/B 0.125 08/31/13	国債 証券	米国	2,673,300,000	99.79	2,667,738,390	99.91	2,671,000,962	0.13	2013/ 8/31	0.73
7	US T N/B 3.5 05/31/13	国債 証券	米国	2,444,160,000	105.84	2,586,875,025	104.46	2,553,267,302	3.50	2013/ 5/31	0.70
8	US T N/B 4.25 11/15/14	国債 証券	米国	2,291,400,000	109.63	2,512,107,648	111.01	2,543,614,398	4.25	2014/ 11/15	0.70
9	US T N/B 3.875 02/15/13	国債 証券	米国	2,444,160,000	106.23	2,596,528,934	103.89	2,539,237,824	3.88	2013/ 2/15	0.70
10	US T N/B 2.625 06/30/14	国債 証券	米国	2,291,400,000	103.81	2,378,748,168	105.75	2,423,155,500	2.63	2014/ 6/30	0.66
11	US T N/B 4.25 08/15/14	国債 証券	米国	2,138,640,000	109.34	2,338,282,044	110.09	2,354,492,935	4.25	2014/ 8/15	0.64
12	US T N/B 3.625 05/15/13	国債 証券	米国	2,215,020,000	106.11	2,350,335,572	104.48	2,314,164,295	3.63	2013/ 5/15	0.63
13	US T N/B 0.5 10/15/13	国債 証券	米国	2,291,400,000	98.41	2,255,058,396	100.52	2,303,200,710	0.50	2013/ 10/15	0.63
14	US T N/B 2.375 09/30/14	国債 証券	米国	2,138,640,000	102.64	2,195,185,642	105.58	2,257,933,339	2.38	2014/ 9/30	0.62
15	US T N/B 1.375 03/15/13	国債 証券	米国	2,138,640,000	101.14	2,162,934,950	101.37	2,167,960,754	1.38	2013/ 3/15	0.59
16	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	国債 証券	ドイツ	2,009,800,000	107.04	2,151,336,145	107.86	2,167,770,280	4.25	2014/ 1/4	0.59
17	US T N/B 3.125 05/15/21	国債 証券	米国	1,909,500,000	104.44	1,994,352,435	112.03	2,139,231,945	3.13	2021/ 5/15	0.59

18	US T N/B 3.625 02/15/21	国債 証券	米国	1,833,120,000	102.06	1,870,864,690	116.49	2,135,438,150	3.63	2021/ 2/15	0.58
19	US T N/B 3.25 06/30/16	国債 証券	米国	1,909,500,000	105.54	2,015,243,130	111.57	2,130,429,150	3.25	2016/ 6/30	0.58
20	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債 証券	ドイツ	1,909,310,000	107.72	2,056,708,732	109.67	2,093,940,277	4.25	2014/ 7/4	0.57
21	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	国債 証券	フランス	1,909,310,000	105.39	2,012,279,691	105.43	2,012,985,533	4.00	2013/ 10/25	0.55
22	US T N/B 2.125 11/30/14	国債 証券	米国	1,909,500,000	101.55	1,939,020,870	105.16	2,008,106,580	2.13	2014/ 11/30	0.55
23	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	国債 証券	ドイツ	1,808,820,000	104.61	1,892,116,161	109.61	1,982,647,602	3.25	2015/ 7/4	0.54
24	US T N/B 1.75 03/31/14	国債 証券	米国	1,909,500,000	102.90	1,964,787,178	103.30	1,972,589,880	1.75	2014/ 3/31	0.54
25	US T N/B 3.625 02/15/20	国債 証券	米国	1,680,360,000	101.66	1,708,186,762	116.59	1,959,182,135	3.63	2020/ 2/15	0.54
26	US T N/B 1.75 04/15/13	国債 証券	米国	1,909,500,000	101.96	1,946,926,200	101.93	1,946,334,255	1.75	2013/ 4/15	0.53
27	US T N/B 0.75 12/15/13	国債 証券	米国	1,909,500,000	100.92	1,927,072,365	101.01	1,928,805,045	0.75	2013/ 12/15	0.53
28	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	国債 証券	イタリア	1,909,310,000	102.91	1,964,870,921	100.50	1,918,856,550	4.25	2014/ 8/1	0.53
29	US T N/B 2.625 08/15/20	国債 証券	米国	1,756,740,000	92.67	1,627,988,525	108.44	1,904,956,154	2.63	2020/ 8/15	0.52
30	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	国債 証券	ドイツ	1,708,330,000	106.54	1,820,037,297	109.92	1,877,796,336	3.75	2015/ 1/4	0.51

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.37
合計	97.37

(注)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の比率をいいます。

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。

エマージング債券バッシブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	株数又は 券面総額	帳簿価額		評価額		利率 (%)	償還 期限	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)			
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債 証券	ロシア	2,142,917,280	115.96	2,484,951,751	118.20	2,532,971,083	7.50	2030/ 3/31	8.05
2	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債 証券	メキシコ	542,298,000	114.95	623,367,732	127.11	689,314,988	6.75	2034/ 9/27	2.19
3	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債 証券	ロシア	458,280,000	141.17	646,953,876	138.36	634,053,294	11.00	2018/ 7/24	2.02
4	BRAZIL 10.125 05/15/27	国債 証券	ブラジル	374,262,000	152.98	572,564,339	164.67	616,297,235	10.13	2027/ 5/15	1.96
5	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債 証券	メキシコ	504,108,000	104.32	525,880,119	120.10	605,433,708	6.05	2040/ 1/11	1.92
6	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	国債 証券	ロシア	320,796,000	174.98	561,328,841	174.05	558,345,438	12.75	2028/ 6/24	1.78
7	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	国債 証券	メキシコ	465,918,000	112.86	525,841,929	119.10	554,908,338	5.95	2019/ 3/19	1.76
8	BRAZIL 7.125 01/20/37	国債 証券	ブラジル	404,814,000	120.31	487,037,070	135.30	547,713,342	7.13	2037/ 1/20	1.74

9	PERU 7.35 07/21/25	国債 証券	ペル ー	389,538,000	116.96	455,599,062	130.76	509,359,889	7.35	2025/ 7/21	1.62
10	PERU 8.75 11/21/33	国債 証券	ペル ー	343,710,000	131.95	453,529,928	146.92	504,978,732	8.75	2033/ 11/21	1.61
11	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	国債 証券	メキ シコ	420,090,000	110.02	462,186,837	113.59	477,159,227	5.63	2017/ 1/15	1.52
12	COLOMBIA 7.375 03/18/19	国債 証券	コロ ンビ ア	358,986,000	122.10	438,314,268	127.50	457,707,150	7.38	2019/ 3/18	1.46
13	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	国債 証券	メキ シコ	397,176,000	107.84	428,331,402	113.60	451,191,936	5.13	2020/ 1/15	1.43
14	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債 証券	ロシ ア	427,728,000	101.20	432,845,460	104.51	447,018,533	5.00	2020/ 4/29	1.42
15	BRAZIL 6.0 01/17/17	国債 証券	ブラ ジル	358,986,000	113.15	406,197,242	118.17	424,195,807	6.00	2017/ 1/17	1.35
16	BRAZIL 5.625 01/07/41	国債 証券	ブラ ジル	366,624,000	104.39	382,709,628	115.50	423,450,720	5.63	2041/ 1/7	1.35
17	BRAZIL 8.25 01/20/34	国債 証券	ブラ ジル	282,606,000	132.15	373,462,301	149.73	423,145,964	8.25	2034/ 1/20	1.35
18	PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債 証券	フィ リピ ン	290,244,000	121.10	351,481,665	136.00	394,731,840	7.75	2031/ 1/14	1.25
19	PANAMA 6.7 01/26/36	国債 証券	パナ マ	305,520,000	113.15	345,680,604	127.00	388,010,400	6.70	2036/ 1/26	1.23
20	TURKEY 7.375 02/05/25	国債 証券	トル コ	343,710,000	116.14	399,196,251	111.85	384,439,635	7.38	2025/ 2/5	1.22
21	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	国債 証券	メキ シコ	267,330,000	140.30	375,056,352	141.32	377,790,756	11.38	2016/ 9/15	1.20
22	PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債 証券	フィ リピ ン	305,520,000	103.00	314,685,600	120.63	368,533,500	6.38	2034/ 10/23	1.17
23	INDONESIA 11.625 03/04/19	国債 証券	イン ドネ シア	244,416,000	143.43	350,553,648	149.35	365,023,075	11.63	2019/ 3/4	1.16
24	COLOMBIA 7.375 01/27/17	国債 証券	コロ ンビ ア	294,063,000	119.17	350,439,078	123.25	362,432,648	7.38	2017/ 1/27	1.15
25	BRAZIL 4.875 01/22/21	国債 証券	ブラ ジル	313,158,000	105.97	331,859,643	113.10	354,181,698	4.88	2021/ 1/22	1.13
26	BRAZIL 8.875 04/15/24	国債 証券	ブラ ジル	236,778,000	135.50	320,834,190	148.89	352,538,764	8.88	2024/ 4/15	1.12

27	COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債 証券	コロ ンビ ア	259,692,000	117.55	305,267,946	135.75	352,531,890	7.38	2037/ 9/18	1.12
28	INDONESIA 4.875 05/05/21	国債 証券	イン ドネ シア	313,158,000	106.39	333,171,088	107.75	337,427,745	4.88	2021/ 5/5	1.07
29	TURKEY 7.25 03/15/15	国債 証券	トル コ	305,520,000	113.37	346,368,024	108.92	332,772,384	7.25	2015/ 3/15	1.06
30	PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債 証券	フィ リピン	213,864,000	139.79	298,956,667	155.50	332,558,520	9.50	2030/ 2/2	1.06

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.80
合計	96.80

(注)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の比率をいいます。

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。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	670	785,585.35	526,342,185	684,000.00	458,280,000	13.56
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	539	754,028.55	406,421,391	667,000.00	359,513,000	10.64
3	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	2,070	123,632.34	255,918,952	110,500.00	228,735,000	6.77
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	2,316	91,918.86	212,884,091	83,000.00	192,228,000	5.69
5	森トラスト総合リート投資法人	投資証券	日本	266	775,094.81	206,175,220	656,000.00	174,496,000	5.16
6	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	日本	1,079	163,078.71	175,961,926	137,500.00	148,362,500	4.39
7	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	日本	787	213,142.10	167,742,829	181,900.00	143,155,300	4.24
8	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	日本	336	505,384.62	169,809,231	407,500.00	136,920,000	4.05
9	フロンティア不動産投資法人	投資証券	日本	214	719,295.35	153,929,205	609,000.00	130,326,000	3.86
10	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	日本	214	580,903.27	124,313,299	502,000.00	107,428,000	3.18
11	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	313	398,896.72	124,854,672	325,000.00	101,725,000	3.01
12	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	日本	163	718,094.58	117,049,416	617,000.00	100,571,000	2.98
13	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	177	516,223.99	91,371,647	487,500.00	86,287,500	2.55
14	大和証券オフィス投資法人	投資証券	日本	436	250,250.95	109,109,413	172,000.00	74,992,000	2.22
15	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	日本	187	489,267.82	91,493,082	381,000.00	71,247,000	2.11
16	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	日本	316	288,684.16	91,224,195	224,000.00	70,784,000	2.09
17	福岡リート投資法人	投資証券	日本	135	565,401.36	76,329,183	505,000.00	68,175,000	2.02
18	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	日本	208	407,449.23	84,749,440	318,500.00	66,248,000	1.96
19	森ヒルズリート投資法人	投資証券	日本	255	275,423.37	70,232,959	252,200.00	64,311,000	1.90
20	トップリート投資法人	投資証券	日本	171	446,933.43	76,425,616	350,500.00	59,935,500	1.77
21	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	日本	166	410,901.86	68,209,709	347,000.00	57,602,000	1.70

22	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	日本	107	662,076.60	70,842,196	526,000.00	56,282,000	1.67
23	プレミア投資法人	投資証券	日本	217	314,778.05	68,306,836	252,800.00	54,857,600	1.62
24	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	日本	1,465	35,197.37	51,564,141	35,100.00	51,421,500	1.52
25	産業ファンド投資法人	投資証券	日本	103	417,059.05	42,957,082	391,500.00	40,324,500	1.19
26	積水ハウス・S I 投資法人	投資証券	日本	127	342,358.03	43,479,470	301,000.00	38,227,000	1.13
27	M I D リート投資法人	投資証券	日本	202	223,283.52	45,103,272	184,800.00	37,329,600	1.10
28	阪急リート投資法人	投資証券	日本	94	401,003.37	37,694,317	332,500.00	31,255,000	0.92
29	平和不動産リート投資法人	投資証券	日本	766	45,471.88	34,831,458	39,200.00	30,027,200	0.89
30	いちご不動産投資法人	投資証券	日本	928	33,646.57	31,224,020	30,650.00	28,443,200	0.84

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.35
合計	98.35

(注)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の比率をいいます。

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。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成24年1月31日現在

順位	銘柄名	種類	国名	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	米国	17,484	9,840.80	172,056,533	10,350.25	180,963,837	6.85
2	PUBLIC STORAGE	投資証券	米国	8,678	9,533.75	82,733,896	10,476.28	90,913,165	3.44
3	WESTFIELD GROUP	投資信託受益証券	オーストラリア	116,200	632.89	73,542,050	699.43	81,273,394	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	米国	17,800	4,465.94	79,493,707	4,529.33	80,622,145	3.05
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	フランス	5,230	13,953.04	72,974,381	14,772.03	77,257,717	2.92
6	VENTAS INC	投資証券	米国	17,102	4,147.43	70,929,416	4,434.62	75,840,919	2.87
7	HCP INC	投資証券	米国	22,200	2,903.20	64,451,124	3,180.46	70,606,283	2.67
8	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	米国	8,750	7,547.11	66,037,193	7,832.77	68,536,729	2.59
9	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	米国	10,429	6,148.59	64,123,645	6,095.89	63,574,014	2.41
10	PROLOGIS INC	投資証券	米国	25,729	2,235.64	57,520,848	2,413.61	62,099,720	2.35
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	米国	5,138	9,953.84	51,142,838	10,302.13	52,932,367	2.00
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	米国	41,168	1,110.57	45,719,748	1,247.29	51,348,245	1.94
13	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	米国	11,201	3,819.00	42,776,619	4,339.91	48,611,350	1.84
14	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	投資証券	米国	34,963	1,081.90	37,826,476	1,204.51	42,113,374	1.59
15	LINK REIT/THE	投資証券	香港	135,000	266.94	36,036,225	275.80	37,233,000	1.41
16	THE MACERICH COMPANY	投資証券	米国	8,820	3,837.33	33,845,261	4,157.36	36,667,945	1.39
17	STOCKLAND	投資信託受益証券	オーストラリア	130,140	262.08	34,107,378	271.82	35,374,525	1.34
18	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	英国	43,200	829.68	35,842,336	818.28	35,349,569	1.34

19	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	151,200	205.28	31,038,971	205.28	31,038,971	1.17
20	GPT GROUP	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	121,000	251.53	30,435,614	249.10	30,141,076	1.14
21	KIMCO REALTY	投資 証券	米国	21,199	1,322.90	28,044,191	1,396.99	29,614,795	1.12
22	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資 証券	米国	5,510	4,858.53	26,770,510	5,316.05	29,291,424	1.11
23	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資 証券	米国	4,030	6,819.97	27,484,480	7,255.34	29,239,005	1.11
24	UDR INC	投資 証券	米国	13,779	1,884.29	25,963,695	1,971.37	27,163,477	1.03
25	BRITISH LAND CO PLC	投資 証券	英国	45,200	608.15	27,488,586	587.86	26,571,395	1.01
26	SL GREEN	投資 証券	米国	4,225	5,226.68	22,082,737	5,556.65	23,476,825	0.89
27	GOODMAN GROUP	投資 信託 受益 証券	オーストラリア	445,762	50.31	22,424,860	52.34	23,329,088	0.88
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC	投資 証券	米国	2,060	10,538.15	21,708,586	10,965.88	22,589,706	0.85
29	REALTY INCOME CORP	投資 証券	米国	8,100	2,558.73	20,725,713	2,775.65	22,482,759	0.85
30	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	投資 証券	米国	3,900	5,263.35	20,527,049	5,503.94	21,465,377	0.81

(注)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の比率をいいます。

種類別業種別投資比率

平成24年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	14.04
投資証券	83.46
合計	97.50

(注)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の比率をいいます。

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】**

直近日（平成24年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額 (円)	
	分配落	分配付	分配落	分配付
第1期末（平成23年1月11日現在）	251	251	1.0795	1.0795
第2期末（平成24年1月11日現在）	413	413	0.9400	0.9400
平成23年1月末	274	-	1.0772	-
2月末	313	-	1.0841	-
3月末	349	-	1.1246	-
4月末	383	-	1.1486	-
5月末	399	-	1.1047	-
6月末	412	-	1.0885	-
7月末	411	-	1.0530	-
8月末	379	-	0.9555	-
9月末	360	-	0.8856	-
10月末	415	-	0.9833	-
11月末	390	-	0.9129	-
12月末	407	-	0.9300	-
平成24年1月末	432	-	0.9679	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配額（円）
第1期	-
第2期	-

【収益率の推移】

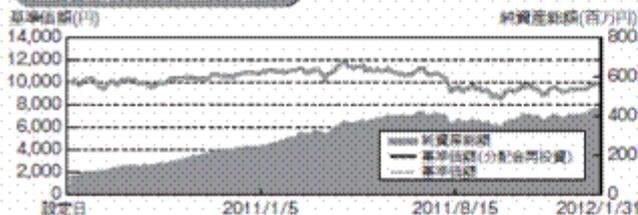
	収益率（％）
第1期	7.95
第2期	12.92

(注) 収益率 = (当期分配付き基準価額 - 前期分配落ち基準価額) ÷ 前期分配落ち基準価額 × 100

<< 参考情報 >>

データの基準日:2012年1月31日

基準価額・純資産の推移 (設定日(2010年5月28日)～2012年1月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2010年5月28日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率(%)
1	外国株式(パッシブファンド)-マザーファンド	42.43
2	エマーゼィング株式(パッシブ)-マザーファンド	28.74
3	グローバルリート(パッシブ)-マザーファンド	8.69
4	エマーゼィング債券(パッシブ)-マザーファンド	8.05
5	国内株式(パッシブ)-マザーファンド	4.89
6	外国債券(パッシブ)-マザーファンド	2.88
7	国内債券(パッシブ)-マザーファンド	2.17
8	ユー・エス・エス・インデックスファンド-マザーファンド	0.82

■国内株式パッシブ-ファンド(最適化法)-マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■ポートフォリオの状況

資産の種類	銘柄	投資比率(%)
株式	日本	88.78
	欧米-開発-その他の開発(含債権証券)	1.22
	合計(純資産総額)	100.00

■組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	自動車製造業	3.45
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.50
3	水産資源	株式	日本	観光業	2.18
4	キヤノン	株式	日本	電気機器	1.96
5	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	1.72

■組入上位5銘柄(株式)

順位	銘柄	投資比率(%)
1	電気通信	13.34
2	観光業	9.87
3	銀行業	9.43
4	情報通信業	6.22
5	化学	5.92

■外国株式パッシブ-ファンド-マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■ポートフォリオの状況

資産の種類	銘柄	投資比率(%)
株式	米国	53.67
	英国	9.79
	カナダ	5.62
	スイス	4.36
	フランス	3.90
	その他の	18.50
小計	96.24	
投資信託	オーストラリア	0.30
	シンガポール	0.02
債券	小計	0.33
	米国	1.29
	英国	0.12
	フランス	0.12
	香港	0.04
	カナダ	0.04
その他の	0.02	
小計	1.82	
欧米-開発-その他の開発(含債権証券)	1.81	
合計(純資産総額)	100.00	

■組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	株式	米国	ソフトウェア業	1.92
2	BOXON MOBIL CORP	株式	米国	石油業	1.90
3	NFL BUSINESS MGMT INC	株式	米国	情報サービス業	1.05
4	MICROSOFT CORP	株式	米国	ソフトウェア業	1.02
5	CHEVRON CORP	株式	米国	石油業	0.95

■組入上位5銘柄(株式)

順位	銘柄	投資比率(%)
1	ソフトウェア業	10.82
2	石油業	7.15
3	医薬品	6.54
4	情報通信業	4.04
5	銀行	3.89

■エマーゼィング株式パッシブ-マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■ポートフォリオの状況

資産の種類	銘柄	投資比率(%)
株式	アジア	15.01
	韓国	14.32
	台湾	10.12
	中国	9.82
	東南アジア	7.34
	その他の	39.25
小計	95.86	
投資信託	米国	3.01
	オーストラリア	0.57
債券	小計	3.57
	トルコ	0.02
欧米-開発-その他の開発(含債権証券)	0.55	
合計(純資産総額)	100.00	

■組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	業種	投資比率(%)
1	VANGUARD MSCI EMERGING MARKETS	投資信託	米国	-	3.01
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	半導体製造業	2.95
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体製造業	1.76
4	QAD GAZPROM ADP	株式	ロシア	石油業	1.75
5	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	通信業	1.62

■組入上位5銘柄(株式)

順位	銘柄	投資比率(%)
1	医薬品	18.60
2	石油業	13.99
3	情報通信業	8.56
4	半導体製造業	6.51
5	情報サービス業	5.41

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2012年1月31日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資比率	日本	78.99
追加債券	日本	8.73
利付債券	日本	8.58
外債	日本	7.10
投資比率その他の資産(負債控除後)		0.63
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還日	投資比率(%)
1	313期 利付国債債券(10年)	国債債券	日本	1.30	2021/3/20	1.64
2	293期 利付国債債券(10年)	国債債券	日本	1.80	2018/8/20	1.32
3	305期 利付国債債券(10年)	国債債券	日本	1.30	2019/12/20	1.30
4	285期 利付国債債券(10年)	国債債券	日本	1.70	2017/3/20	1.27
5	315期 利付国債債券(10年)	国債債券	日本	1.20	2021/8/20	1.25

■外国債券パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債債券	米国	40.47
	ドイツ	9.36
	フランス	9.36
	イタリア	8.66
	英国	8.52
	その他	20.94
外債		97.37
投資比率その他の資産(負債控除後)		2.63
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還日	投資比率(%)
1	US T N/B 4.0 02/15/14	国債債券	米国	4.00	2014/2/15	0.60
2	US T N/B 4.25 11/15/13	国債債券	米国	4.25	2013/11/15	0.60
3	US T N/B 1.0 07/15/13	国債債券	米国	1.00	2013/7/15	0.65
4	US T N/B 4.75 05/15/14	国債債券	米国	4.75	2014/5/15	0.81
5	US T N/B 4.25 05/15/13	国債債券	米国	4.25	2013/5/15	0.78

■エマージング債券パッシブ・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
国債債券	メキシコ	15.39
	ブラジル	15.37
	ロシア	14.21
	トルコ	12.06
	ペルー	9.61
	その他	30.15
外債		98.80
投資比率その他の資産(負債控除後)		3.20
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国名	利率(%)	償還日	投資比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債債券	ロシア	7.50	2030/3/31	8.05
2	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債債券	メキシコ	6.75	2034/9/27	2.19
3	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債債券	ロシア	11.00	2018/7/24	2.02
4	BRAZIL 10.125 05/15/27	国債債券	ブラジル	10.13	2027/5/15	1.96
5	UNITED MEXICAN STATES 6.06 01/11/40	国債債券	メキシコ	6.06	2040/1/11	1.92

■J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資比率	日本	88.35
投資比率その他の資産(負債控除後)		1.65
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	日本	13.58
2	リバーサイドパルクエス・ティート投資法人	日本	10.64
3	日本リバーサイドパルクエス・ティート投資法人	日本	8.77
4	リバーサイドパルクエス・ティート投資法人	日本	5.69
5	森トラスト駅前リート投資法人	日本	5.16

■グローバルリートパッシブ・ファンド・マザー・ファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザー・ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

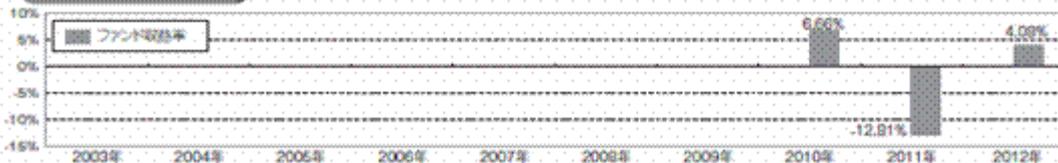
ポートフォリオの状況

資産の種類	国名	投資比率(%)
投資比率	オーストラリア	11.30
	シンガポール	2.75
追加債券	合計	14.04
	米国	64.40
	英国	5.84
	フランス	4.79
	カナダ	3.31
	香港	1.87
	その他	3.25
外債		83.46
投資比率その他の資産(負債控除後)		2.50
合計(純資産総額)		100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	国名	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	米国	6.85
2	PUBLIC STORAGE	米国	3.44
3	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	3.07
4	EQUITY RESIDENTIAL	米国	3.05
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.92

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出してあります。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2010年は設定日から年末までの収益率、および2012年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保障するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が明示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

下記計算期間の設定及び解約口数は次の通りです。

	設定口数	解約口数
第1期	269,849,173	36,948,684
第2期	306,401,840	98,947,769

(注1)本邦外における設定及び解約はございません。

(注2)設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、あらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約を請求をすることができます。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに解約の請求が行われ、かつ、解約の請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の請求の受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとします。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

信託財産留保額は、解約に際して生じる売買手数料等の費用について、受益者間の公平性を確保するため解約者から一定の金額を徴収し、信託財産に繰り入れるものです。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日に計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(2)【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は受益証券を発行しません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成22年5月28日から平成32年1月14日までです。

ただし、下記(5)イ.の場合には信託を終了することがあります。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

各計算期間の終了日が休業日の場合には翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

b. 上記a.の規定にかかわらず、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、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

イ. 償還規定

a. 委託会社は、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合またはやむを得ない事情が発生した場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b. からd. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b. からd. までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、上記b. に規定する書面に付記します。

ロ．信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a. からg. の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。こ

の買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

j.上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。投資一任契約および投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として1月11日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資されます。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属するものとします。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (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）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は、信託約款第36条により、平成22年5月28日から平成23年1月11日までとなっております。
- (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1期計算期間（平成22年5月28日から平成23年1月11日まで）及び第2期計算期間（平成23年1月12日から平成24年1月11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】

【マネックス資産設計ファンド エボリューション】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成23年1月11日現在	第2期 平成24年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,427,893	11,209,690
親投資信託受益証券	246,526,426	405,396,137
流動資産合計	252,954,319	416,605,827
資産合計		
	252,954,319	416,605,827
負債の部		
流動負債		
未払解約金	518,060	612,756
未払受託者報酬	71,533	144,526
未払委託者報酬	950,945	1,920,909
その他未払費用	7,576	14,635
流動負債合計	1,548,114	2,692,826
負債合計		
	1,548,114	2,692,826
純資産の部		
元本等		
元本	232,900,489	440,354,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	* ₃ 18,505,716	* ₃ 26,441,559
(分配準備積立金)	14,843,400	18,291,419
元本等合計	251,406,205	413,913,001
純資産合計		
	251,406,205	413,913,001
負債純資産合計		
	252,954,319	416,605,827

（ ２ ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 1 期	第 2 期
	自 平成22年 5 月28日 至 平成23年 1 月11日	自 平成23年 1 月12日 至 平成24年 1 月11日
営業収益		
受取利息	2,290	4,937
有価証券売買等損益	17,274,426	54,304,289
営業収益合計	17,276,716	54,299,352
営業費用		
受託者報酬	81,776	272,160
委託者報酬	* ₁ 1,087,192	* ₁ 3,617,370
その他費用	8,654	27,546
営業費用合計	1,177,622	3,917,076
営業利益又は営業損失（ ）	16,099,094	58,216,428
経常利益又は経常損失（ ）	16,099,094	58,216,428
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,099,094	58,216,428
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（ ）	1,255,694	8,810,347
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	18,505,716
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,840,461	12,110,593
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,840,461	12,110,593
剰余金減少額又は欠損金増加額	178,145	7,651,787
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	178,145	7,651,787
分配金	* ₂ -	* ₂ -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,505,716	26,441,559

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第 1 期 自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	第 2 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
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、原則として 時価で評価しております。時価評 価にあたっては、親投資信託受益 証券の基準価額に基づいて評価 しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 1 期 平成23年1月11日現在	第 2 期 平成24年1月11日現在
*1 期首元本額	97,078,870円	232,900,489円
期中追加設定元本額	172,770,303円	306,401,840円
期中解約元本額	36,948,684円	98,947,769円
*2 計算期間末日における受益権 の総数	232,900,489口	440,354,560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 26,441,559円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 1 期 自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	第 2 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
*1 当ファンドの主要投資対象 であるグローバルリート・パッ シブ・ファンド・マザーファン ドにおいて、信託財産の運用の指 図に関わる権限を委託する為に 要する費用	18,546円	53,678円
*2 分配金の計算過程		

	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,458,383円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（12,385,017円）、信託約款に規定される収益調整金（3,662,316円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は18,505,716円（1万口当たり794.58円）であります。なお、分配を行っておりませんが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,890,621円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（17,653,375円）及び分配準備積立金（11,400,798円）より分配対象収益は35,944,794円（1万口当たり816.27円）であります。なお、分配を行っておりませんが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>
--	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第 1 期 自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	第 2 期 自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第 1 期 平成23年1月11日現在	第 2 期 平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	第 1 期 平成23年1月11日現在	第 2 期 平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	16,689,140	46,212,885
合計	16,689,140	46,212,885

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第 1 期 平成23年1月11日現在	第 2 期 平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0795円 (10,795円)	0.9400円 (9,400円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	20,312,409	19,879,754	
親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,400,626	10,722,354	
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	2,526,412	1,743,476	
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	152,569,044	180,138,270	
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,413,592	14,842,139	
親投資信託受益証券	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	39,015,043	28,266,398	
親投資信託受益証券	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	185,610,070	115,894,927	
親投資信託受益証券	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	34,140,978	33,908,819	
合 計		456,988,174	405,396,137	

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「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」、「J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,235,740,681	8,167,025,073
株式	*2	273,490,260,816	240,208,368,152
派生商品評価勘定		88,010,774	73,235,934
未収入金		1,809,821	-
未収配当金		242,914,800	275,024,850
流動資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009
資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	49,141,051
前受金		91,270,000	18,071,000
未払金		-	878,667
未払解約金		82,007,000	59,935,000
流動負債合計		173,277,000	128,025,718
負債合計		173,277,000	128,025,718
純資産の部			
元本等			
元本		228,379,687,941	254,010,406,324
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*4	47,505,771,951	5,414,778,033
元本等合計		275,885,459,892	248,595,628,291
純資産合計		275,885,459,892	248,595,628,291
負債純資産合計		276,058,736,892	248,723,654,009

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月9日から平成23年2月7日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月8日から平成24年2月7日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	223,833,095,081円	228,379,687,941円
同期中追加設定元本額	32,937,894,845円	66,418,443,179円
同期中解約元本額	28,391,301,985円	40,787,724,796円
同期末における元本の内訳		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	1,610,616,769円	2,701,746,053円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,041,338,140円	1,057,501,374円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	30,980,898,025円	34,316,155,026円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	722,475,195円	936,995,181円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,771,259,234円	3,425,810,539円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,910,270,200円	3,457,055,475円
D I A M D C バランス3 0 イ ンデックスファンド	444,286,655円	525,549,744円
D I A M D C バランス5 0 イ ンデックスファンド	1,359,305,055円	1,549,301,539円
D I A M D C バランス7 0 イ ンデックスファンド	1,035,187,638円	1,165,543,224円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	148,204,667円	132,245,304円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,331,163,776円	1,452,916,419円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	9,953,804円	20,312,409円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	256,259,608円	280,428,799円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	10,254,954,694円	11,221,617,726円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,750,725,206円	1,825,986,372円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	203,242,674円	221,224,066円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	769,278,546円	846,811,544円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	219,367,345円	231,792,696円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	288,653,665円	305,439,044円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	19,349,603,643円	21,135,260,399円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	6,436,035,294円	6,973,194,770円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	5,022,227,148円	5,515,819,691円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	3,398,318,782円	3,602,818,118円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	7,952,582,764円	8,266,263,783円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A (適格機関投資 家限定)	1,205,187,236円	1,276,613,232円

D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2 (適格機関投資 家限定)	2,530,767,385円	2,798,733,260円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A (適格 機関投資家限定)	2,587,872,007円	2,860,749,528円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	13,926,600,072円	15,940,632,519円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	215,786,345円	222,287,324円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド (適格機関投資家向け)	295,865,972円	円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	4,759,493,521円	5,180,128,773円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	8,845,496,943円	9,604,697,727円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	458,251,539円	488,514,372円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	39,854,696,261円	44,336,116,313円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	2,696,756,649円	2,888,855,576円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	4,823,978,728円	5,478,086,307円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	24,121,903,458円	27,076,022,500円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	276,688,196円	315,394,843円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	91,930円	106,653円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	144,867円	163,481円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	21,026,822,765円	23,768,412,878円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	200,129,538円	267,316,165円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	77,583,539円	98,488,565円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	209,143,853円	241,043,818円

D I A Mバランス40VA（適格機関投資家限定）	86,168円	101,120円
D I A Mバランス60VA（適格機関投資家限定）	132,442円	152,075円
（合計）	228,379,687,941円	254,010,406,324円
*2 差入代用有価証券	株式 1,727,500,000円	株式 1,313,000,000円
*3 本有価証券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受益権の総数	228,379,687,941口	254,010,406,324口
*4 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5,414,778,033円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左
-------------------	--	----

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)株式 同左</p> <p>(2)派生商品評価勘定 同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
3. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)	当期の損益に 含まれた 評価差額(円)
株式	14,689,435,088	60,210,126,168
合計	14,689,435,088	60,210,126,168

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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）

（株式関連）

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	2,266,376,000	-	2,354,580,000	88,010,774
合 計		2,266,376,000	-	2,354,580,000	88,010,774

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物	8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,094,883
合 計		8,302,305,000	-	8,326,880,000	24,094,883

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2080円 (12,080円)	0.9787円 (9,787円)

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	110,000	180	19,800,000	
日本水産	311,300	266	82,805,800	
マルハニチロホールディングス	535,000	139	74,365,000	
ハウスイ	23,000	111	2,553,000	
サカタのタネ	40,200	1,107	44,501,400	
ホクト	27,600	1,670	46,092,000	
ショーボンドHD	24,000	1,835	44,040,000	
ミライト・ホールディングス	77,000	579	44,583,000	
住石ホールディングス	79,400	91	7,225,400	
日鉄鉱業	69,000	318	21,942,000	
三井松島	175,000	152	26,600,000	
国際石油開発帝石	3,274	510,000	1,669,740,000	
日本海洋掘削	6,700	2,203	14,760,100	
関東天然瓦斯	28,000	391	10,948,000	
石油資源開発	38,400	3,080	118,272,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	165,000	3,630,000	
間組	103,100	198	20,413,800	
東急建設	95,320	194	18,492,080	
コムシスホールディングス	131,400	811	106,565,400	
ミサワホーム	26,000	670	17,420,000	
高松コンストラクショング P	20,500	1,235	25,317,500	
東建コーポレーション	10,060	2,574	25,894,440	
ヤマウラ	8,500	230	1,955,000	
大成建設	1,363,000	205	279,415,000	
大 林 組	808,000	355	286,840,000	
清水建設	825,000	336	277,200,000	
飛島建設	165,000	80	13,200,000	
長谷工コーポレーション	1,681,500	54	90,801,000	
松井建設	2,000	308	616,000	
鹿島建設	1,263,000	250	315,750,000	
不動テトラ	190,900	156	29,780,400	
大末建設	93,000	45	4,185,000	
鉄建建設	153,000	110	16,830,000	
安藤建設	91,000	113	10,283,000	
太平工業	47,000	413	19,411,000	
西松建設	353,000	150	52,950,000	
三井住友建設	168,500	56	9,436,000	
大豊建設	80,000	105	8,400,000	
前田建設	167,000	302	50,434,000	
佐田建設	93,000	64	5,952,000	

ナカノフドー建設	20,500	169	3,464,500
奥村組	257,000	319	81,983,000
大和小田急建設	14,000	209	2,926,000
東鉄工業	35,000	699	24,465,000
イチケン	31,000	136	4,216,000
浅沼組	86,000	65	5,590,000
戸田建設	290,000	293	84,970,000
熊谷組	201,000	77	15,477,000
青木あすなろ建設	19,000	410	7,790,000
北野建設	61,000	189	11,529,000
植木組	34,000	197	6,698,000
三井ホーム	35,000	400	14,000,000
矢作建設	33,600	395	13,272,000
ピーエス三菱	17,700	356	6,301,200
大東建託	102,300	6,780	693,594,000
新日本建設	32,200	222	7,148,400
N I P P O	63,000	796	50,148,000
東亜道路	52,000	189	9,828,000
前田道路	78,000	869	67,782,000
日本道路	81,000	262	21,222,000
東亜建設	237,000	149	35,313,000
若築建設	146,000	113	16,498,000
東洋建設	406,000	75	30,450,000
五洋建設	342,000	251	85,842,000
大林道路	34,000	210	7,140,000
世紀東急	81,000	51	4,131,000
福田組	41,000	262	10,742,000
住友林業	185,600	669	124,166,400
日本基礎技術	31,000	278	8,618,000
日成ビルド工業	79,000	193	15,247,000
エス・バイ・エル	137,000	181	24,797,000
バコーボレーション	35,400	283	10,018,200
パナホーム	101,000	534	53,934,000
大和ハウス	672,000	931	625,632,000
ライト工業	57,000	450	25,650,000
積水ハウス	758,000	698	529,084,000
日特建設	66,000	110	7,260,000
北陸電気工事	15,000	209	3,135,000
ユアテック	37,000	399	14,763,000
西部電気工業	1,000	350	350,000
四電工	6,000	322	1,932,000
中電工	39,400	830	32,702,000
関電工	124,000	363	45,012,000
きんでん	180,000	642	115,560,000
東京エネシス	30,000	454	13,620,000
トーエネック	39,000	425	16,575,000
住友電設	19,000	459	8,721,000
日本電設工業	49,000	742	36,358,000

協和エクシオ	88,500	737	65,224,500
新日本空調	22,500	414	9,315,000
日本工営	85,000	282	23,970,000
日本電話施設	47,000	249	11,703,000
九電工	50,000	474	23,700,000
三機工業	62,000	415	25,730,000
日揮	251,000	1,886	473,386,000
中外炉工業	87,000	261	22,707,000
ヤマト	16,000	310	4,960,000
太平電業	35,000	618	21,630,000
高砂熱学	77,700	636	49,417,200
三晃金属	30,000	219	6,570,000
N E C ネットズエスアイ	22,700	1,141	25,900,700
朝日工業社	30,000	335	10,050,000
アタカ大機	18,000	247	4,446,000
大 氣 社	41,400	1,709	70,752,600
ダイダン	25,000	546	13,650,000
日比谷総合設	33,400	829	27,688,600
東芝プラントシステム	44,000	789	34,716,000
日本製粉	170,000	345	58,650,000
日清製粉G本社	244,500	930	227,385,000
日東富士製粉	8,000	294	2,352,000
昭和産業	113,000	243	27,459,000
鳥越製粉	24,500	676	16,562,000
協同飼料	98,000	98	9,604,000
中部飼料	24,300	499	12,125,700
日本配合飼料	83,000	114	9,462,000
東洋精糖	43,000	91	3,913,000
日本甜菜糖	152,000	166	25,232,000
三井製糖	96,000	253	24,288,000
ネクスト	9,700	291	2,822,700
日本M & A センター	50	399,500	19,975,000
ノバレーゼ	49	49,850	2,442,650
アコーディア・ゴルフ	1,019	55,300	56,350,700
パソナグループ	249	71,200	17,728,800
リンクアンドモチベーション	51	39,600	2,019,600
テンプホールディングス	34,400	748	25,731,200
森永製菓	267,000	182	48,594,000
中 村 屋	64,000	394	25,216,000
江崎グリコ	98,000	863	84,574,000
名糖産業	12,500	1,010	12,625,000
不 二 家	155,000	162	25,110,000
山崎製パン	197,000	1,018	200,546,000
第一屋製パン	43,000	83	3,569,000
モロゾフ	43,000	278	11,954,000
カルビー	14,500	3,770	54,665,000
森永乳業	228,000	300	68,400,000
ヤクルト	144,500	2,479	358,215,500

明治ホールディングス	79,900	3,170	253,283,000
雪印メグミルク	58,200	1,450	84,390,000
プリマハム	152,000	130	19,760,000
日本ハム	205,000	937	192,085,000
伊藤ハム	149,000	319	47,531,000
林兼産業	89,000	66	5,874,000
丸大食品	130,000	280	36,400,000
米 久	23,800	755	17,969,000
S F o o d s	17,500	670	11,725,000
学情	8,900	256	2,278,400
スタジオアリス	11,500	1,208	13,892,000
シミックホールディングス	8,200	1,233	10,110,600
システナ	282	54,300	15,312,600
N E C フィールドイング	20,400	997	20,338,800
新日鉄ソリューションズ	15,700	1,541	24,193,700
総合警備保障	91,500	826	75,579,000
日本駐車場開発	2,605	3,555	9,260,775
コア	9,000	668	6,012,000
カカクコム	39,000	2,725	106,275,000
アイロムホールディングス	542	2,822	1,529,524
ルネサンス	11,800	397	4,684,600
新日本科学	15,600	194	3,026,400
エムスリー	197	349,000	68,753,000
ベストプライダル	54	70,000	3,780,000
ディー・エヌ・エー	112,500	1,899	213,637,500
博報堂 D Y H L D G S	31,910	4,400	140,404,000
ぐるなび	17,500	821	14,367,500
一休	182	32,800	5,969,600
ジャパンベストレスキュー S	37	71,700	2,652,900
ジェイコムホールディングス	4,300	720	3,096,000
P G M ホールディングス	350	47,800	16,730,000
サッポロホールディングス	442,000	283	125,086,000
アサヒグループホールディング	505,400	1,711	864,739,400
キリン H D	1,081,000	940	1,016,140,000
宝ホールディングス	228,000	489	111,492,000
オエノンホールディングス	72,000	179	12,888,000
養 命 酒	3,000	745	2,235,000
三国コカ・コ - ラ	29,100	687	19,991,700
コカ・コーラウエスト	91,600	1,346	123,293,600
コカコーラセントラルジャパン	31,000	998	30,938,000
ダイドードリンコ	12,600	3,125	39,375,000
伊 藤 園	82,100	1,326	108,864,600
キーコーヒー	23,900	1,422	33,985,800
ユニカフェ	6,100	353	2,153,300
ジャパンフーズ	4,000	782	3,128,000
日清オイリオグループ	105,000	328	34,440,000
不二製油	65,400	1,075	70,305,000
J - オイルミルズ	102,000	223	22,746,000

ローソン	74,800	4,655	348,194,000
インターニックス	9,800	371	3,635,800
サンエー	8,000	3,065	24,520,000
キリン堂	10,100	498	5,029,800
ダイユーエイト	3,600	923	3,322,800
カワチ薬品	16,500	1,612	26,598,000
エービーシー・マート	33,700	2,811	94,730,700
ハードオフコーポレーション	11,400	563	6,418,200
高千穂交易	10,100	853	8,615,300
アスクル	18,600	1,095	20,367,000
ゲオホールディングス	391	81,000	31,671,000
ポイント	19,990	3,105	62,068,950
シー・ヴィ・エス・バイエリア	5,000	116	580,000
伊藤忠食品	6,000	2,728	16,368,000
くらコーポレーション	12,300	1,024	12,595,200
キャンドゥ	128	83,600	10,700,800
エレマテック	19,000	1,281	24,339,000
バル	6,900	3,385	23,356,500
JALUX	7,700	736	5,667,200
エディオン	94,200	618	58,215,600
サーラコーポレーション	20,500	466	9,553,000
トーマンデバイス	3,500	1,760	6,160,000
あみやき亭	40	189,000	7,560,000
東京エレクトロンデバイス	48	136,400	6,547,200
ひらまつ	100	65,400	6,540,000
双日	1,590,400	123	195,619,200
ゲンキー	1,700	1,650	2,805,000
アルフレッサホールディングス	62,100	3,240	201,204,000
ハニーズ	20,760	1,237	25,680,120
キッコーマン	220,000	878	193,160,000
味の素	710,000	930	660,300,000
キューピー	137,400	1,113	152,926,200
ハウス食品	95,900	1,467	140,685,300
カゴメ	104,600	1,532	160,247,200
焼津水産化工	13,500	706	9,531,000
アリアケジャパン	24,700	1,480	36,556,000
ニチレイ	303,000	374	113,322,000
横浜冷凍	56,000	634	35,504,000
東洋水産	116,000	1,878	217,848,000
日清食品HD	105,300	3,010	316,953,000
永谷園	7,000	878	6,146,000
フジッコ	30,000	968	29,040,000
ロックフィールド	13,600	1,305	17,748,000
日本たばこ産業	5,970	395,500	2,361,135,000
わらべや日洋	15,200	1,049	15,944,800
なとり	13,500	845	11,407,500
片倉工業	31,600	705	22,278,000
ゲンゼ	188,000	221	41,548,000

昭栄	43,300	314	13,596,200
神栄	27,000	153	4,131,000
山下医科器械	2,200	960	2,112,000
ラサ商事	11,500	360	4,140,000
アルペン	15,100	1,389	20,973,900
アルコニックス	6,200	1,500	9,300,000
ビックカメラ	895	42,850	38,350,750
DCMホールディングス	122,500	626	76,685,000
MonotaRO	13,400	835	11,189,000
あいホールディングス	42,100	329	13,850,900
J.フロントリテイリング	560,000	365	204,400,000
ドトール・日レスHD	37,900	1,016	38,506,400
マツモトキヨシHLDS	43,900	1,545	67,825,500
物語コーポレーション	2,500	1,277	3,192,500
ココカラファイン	24,700	1,987	49,078,900
三越伊勢丹HD	471,200	807	380,258,400
東洋紡績	1,064,000	105	111,720,000
ユニチカ	554,000	41	22,714,000
富士紡ホールディングス	110,000	166	18,260,000
日清紡ホールディングス	160,000	675	108,000,000
倉敷紡績	259,000	147	38,073,000
ダイワボウHD	229,000	176	40,304,000
シキボウ	162,000	106	17,172,000
日東紡績	185,000	258	47,730,000
トヨタ紡織	83,900	792	66,448,800
クリエイトSDH	10,000	1,635	16,350,000
バイタルKSKHD	44,700	575	25,702,500
UKCホールディングス	13,900	762	10,591,800
丸善CHIHD	6,700	214	1,433,800
TOKAIホールディングス	115,900	393	45,548,700
日本毛織	86,000	582	50,052,000
大東紡織	38,000	64	2,432,000
トーア紡コーポレーション	106,000	54	5,724,000
ダイドーリミテッド	31,300	689	21,565,700
東京建物不動産販	9,200	210	1,932,000
野村不動産HLDS	113,600	1,100	124,960,000
常和ホールディングス	4,400	1,318	5,799,200
ヒューリック	76,900	879	67,595,100
帝国繊維	23,000	464	10,672,000
ブックオフコーポレーション	14,100	683	9,630,300
日本コークス工業	202,000	108	21,816,000
ミタチ産業	3,800	370	1,406,000
JFE商事HLDS	159,000	317	50,403,000
あさひ	13,700	1,559	21,358,300
サークルKサンクス	51,500	1,293	66,589,500
日本調剤	2,990	2,654	7,935,460
コスモス薬品	11,900	4,015	47,778,500
シップヘルスケアHD	30,800	1,808	55,686,400

ソフトクリエイト	2,600	1,089	2,831,400
セブン&アイ・HLDGS	992,100	2,158	2,140,951,800
ツルハホールディングス	21,200	4,310	91,372,000
サンマルクホールディングス	6,800	2,958	20,114,400
フェリシモ	6,600	1,011	6,672,600
トリドール	20,400	721	14,708,400
クスリのアオキ	3,400	1,416	4,814,400
帝人	1,028,000	227	233,356,000
東レ	1,826,000	550	1,004,300,000
クラレ	400,100	1,092	436,909,200
旭化成	1,465,000	467	684,155,000
サカイオーベックス	70,000	120	8,400,000
稲葉製作所	12,400	936	11,606,400
宮地エンジニアリングG	81,000	207	16,767,000
三協・立山HLDGS	340,000	142	48,280,000
トーカロ	14,100	1,598	22,531,800
アルファCO	8,500	924	7,854,000
SUMCO	153,700	553	84,996,100
川田テクノロジーズ	5,900	1,228	7,245,200
住江織物	69,000	139	9,591,000
日本フェルト	15,000	392	5,880,000
イチカワ	14,000	148	2,072,000
日本バイリン	32,000	326	10,432,000
エコナックホールディングス	73,000	30	2,190,000
日東製網	31,000	147	4,557,000
芦森工業	61,000	107	6,527,000
アツギ	196,000	93	18,228,000
ダイニック	47,000	138	6,486,000
共和レザー	13,400	291	3,899,400
セーレン	62,700	452	28,340,400
東海染工	35,000	85	2,975,000
小松精練	39,000	352	13,728,000
ワコールホールディングス	150,000	971	145,650,000
ホギメディカル	15,900	3,175	50,482,500
レナウン	54,100	141	7,628,100
クラウディア	3,000	1,020	3,060,000
T S Iホールディングス	112,300	391	43,909,300
デジタルハーツ	19	146,800	2,789,200
I Tホールディングス	71,900	882	63,415,800
グリー	103,600	2,282	236,415,200
コーエーテクモHD	47,000	615	28,905,000
三菱総合研究所	9,200	1,408	12,953,600
ボルテージ	2,100	983	2,064,300
特種東海製紙	158,000	177	27,966,000
ドワンゴ	118	127,600	15,056,800
ベリサーブ	13	130,000	1,690,000
マクロミル	27,600	760	20,976,000
ティーガイア	152	142,300	21,629,600

GMOペイメントゲートウェイ	51	319,000	16,269,000
ザッパラス	130	81,100	10,543,000
インターネットイニシアティブ	139	256,500	35,653,500
ソネットエンタテインメント	133	284,900	37,891,700
S R Aホールディングス	12,400	791	9,808,400
J B I Sホールディングス	24,500	234	5,733,000
朝日ネット	20,000	354	7,080,000
王子製紙	1,112,000	385	428,120,000
三菱製紙	362,000	70	25,340,000
北越紀州製紙	156,500	505	79,032,500
中越パルプ	98,000	138	13,524,000
巴川製紙	43,000	163	7,009,000
大王製紙	106,000	515	54,590,000
日本製紙G本社	121,500	1,586	192,699,000
レンゴー	202,000	540	109,080,000
トーモク	79,000	215	16,985,000
ザ・パックス	15,900	1,118	17,776,200
コ - プケミカル	38,000	110	4,180,000
昭和電工	1,564,000	160	250,240,000
住友化学	1,730,000	289	499,970,000
日本化成	49,000	132	6,468,000
住友精化	47,000	319	14,993,000
日産化学	191,500	724	138,646,000
ラサ工業	101,000	121	12,221,000
クレハ	163,000	390	63,570,000
テイカ	43,000	299	12,857,000
石原産業	422,000	91	38,402,000
片倉チツカリン	13,000	191	2,483,000
日本曹達	150,000	335	50,250,000
東ソー	673,000	208	139,984,000
トクヤマ	391,000	243	95,013,000
セントラル硝子	241,000	376	90,616,000
東亜合成	315,000	311	97,965,000
ダイソー	101,000	241	24,341,000
関東電化	56,000	280	15,680,000
電気化学	529,000	281	148,649,000
イビデン	157,500	1,558	245,385,000
信越化学	451,400	3,680	1,661,152,000
日本カ - バイド	77,000	111	8,547,000
堺化学	78,000	286	22,308,000
エア・ウォーター	205,000	1,009	206,845,000
大陽日酸	331,000	536	177,416,000
日本化学工業	102,000	130	13,260,000
日本パ - カライジング	59,000	944	55,696,000
高圧ガス	38,000	493	18,734,000
チタン工業	29,000	383	11,107,000
四国化成	34,000	420	14,280,000
戸田工業	33,000	680	22,440,000

ステラ ケミファ	11,900	2,215	26,358,500
保土谷化学	51,000	237	12,087,000
日本触媒	183,000	842	154,086,000
大日精化	91,000	325	29,575,000
カネカ	314,000	407	127,798,000
協和発酵キリン	345,000	912	314,640,000
三菱瓦斯化学	433,000	408	176,664,000
三井化学	1,068,000	231	246,708,000
J S R	229,100	1,456	333,569,600
東京応化工業	45,200	1,559	70,466,800
三菱ケミカルH L D G S	1,573,500	419	659,296,500
日本合成化学	51,000	450	22,950,000
ダイセル	327,000	464	151,728,000
住友ベ - クライト	216,000	429	92,664,000
積水化学	524,000	643	336,932,000
日本ゼオン	235,000	644	151,340,000
アイカ工業	68,200	1,055	71,951,000
宇部興産	1,055,000	209	220,495,000
積水樹脂	36,000	769	27,684,000
タキロン	59,000	264	15,576,000
旭有機材	91,000	210	19,110,000
日立化成	108,800	1,360	147,968,000
ニチバン	22,000	250	5,500,000
リケンテクノス	44,000	217	9,548,000
大倉工業	61,000	238	14,518,000
積水化成品	65,000	288	18,720,000
群栄化学	70,000	201	14,070,000
タイガース ポリマー	12,300	287	3,530,100
日本カ - リット	20,500	396	8,118,000
日本化薬	177,000	726	128,502,000
イーピーエス	135	138,400	18,684,000
パナソニック電工 I S	5,500	2,013	11,071,500
フェイス	801	8,200	6,568,200
アミューズ	7,200	993	7,149,600
野村総合研究所	134,200	1,689	226,663,800
ドリームインキュベータ	79	57,700	4,558,300
サイバネットシステム	196	19,180	3,759,280
T A C	13,900	163	2,265,700
ケネディクス	2,731	9,590	26,190,290
電通	228,400	2,338	533,999,200
インテージ	7,000	1,427	9,989,000
テイクアンドギヴニーズ	1,235	4,960	6,125,600
びあ	7,600	804	6,110,400
シンプレクスホールディング	394	25,930	10,216,420
イオンファンタジー	8,200	1,310	10,742,000
ソースネクスト	59	14,570	859,630
ネクシィーズ	952	1,894	1,803,088
メディカルシステムネットワーク	3,900	856	3,338,400

日本精化	21,700	516	11,197,200
A D E K A	108,600	756	82,101,600
日油	201,000	385	77,385,000
ミヨシ油脂	88,000	105	9,240,000
ハリマ化成	21,600	620	13,392,000
花 王	667,700	2,107	1,406,843,900
第一工業製薬	46,000	222	10,212,000
三洋化成	79,000	501	39,579,000
武田薬品	942,900	3,275	3,087,997,500
アステラス製薬	558,800	3,125	1,746,250,000
大日本住友製薬	178,500	886	158,151,000
塩野義製薬	393,100	974	382,879,400
田辺三菱製薬	251,400	1,191	299,417,400
わかもと製薬	7,000	223	1,561,000
あすか製薬	30,000	455	13,650,000
日本新薬	53,000	930	49,290,000
中外製薬	292,500	1,204	352,170,000
科研製薬	99,000	1,005	99,495,000
エーザイ	309,900	3,180	985,482,000
ロート製薬	106,000	981	103,986,000
小野薬品	123,200	4,310	530,992,000
久光製薬	78,100	3,275	255,777,500
有機合成薬品	18,000	178	3,204,000
持田製薬	89,000	873	77,697,000
参天製薬	84,500	3,165	267,442,500
扶桑薬品	86,000	200	17,200,000
日本ケミファ	39,000	285	11,115,000
ツムラ	68,700	2,246	154,300,200
日医工	42,600	1,704	72,590,400
テ ル モ	170,000	3,535	600,950,000
みらかホールディングス	65,500	3,035	198,792,500
キッセイ薬品工業	46,800	1,590	74,412,000
生化学工業	48,300	837	40,427,100
栄研化学	19,700	1,052	20,724,400
日水製薬	10,900	693	7,553,700
鳥居薬品	17,300	1,448	25,050,400
東和薬品	12,800	3,105	39,744,000
沢井製薬	16,500	7,930	130,845,000
ゼリア新薬工業	36,000	1,358	48,888,000
第一三共	846,800	1,476	1,249,876,800
キョーリン製薬HD	62,000	1,347	83,514,000
大幸薬品	11,700	789	9,231,300
ダイト	7,000	1,237	8,659,000
大塚ホールディングス	499,500	2,194	1,095,903,000
大正製薬HD	60,500	6,310	381,755,000
大日本塗料	147,000	83	12,201,000
日本ペイント	238,000	548	130,424,000
関西ペイント	285,000	689	196,365,000

トウペ	22,000	90	1,980,000
中国塗料	77,000	491	37,807,000
日本特殊塗料	20,000	307	6,140,000
藤倉化成	31,700	393	12,458,100
太陽ホールディングス	20,700	2,028	41,979,600
D I C	960,000	139	133,440,000
サカタインクス	47,000	337	15,839,000
東洋インキS Cホールディン	227,000	284	64,468,000
アルプス技研	11,400	627	7,147,800
サニックス	36,300	218	7,913,400
ダイオーズ	4,700	490	2,303,000
日本空調サービス	6,700	720	4,824,000
オリエンタルランド	67,900	8,220	558,138,000
ダスキン	75,500	1,506	113,703,000
パーク24	122,500	1,004	122,990,000
明光ネットワークジャパン	22,900	702	16,075,800
ファルコS Dホールディングス	13,600	900	12,240,000
クレスコ	6,000	658	3,948,000
フジ・メディア・HD	2,470	114,200	282,074,000
秀英予備校	4,100	302	1,238,200
田谷	900	663	596,700
ラウンドワン	78,300	471	36,879,300
リゾートトラスト	38,600	1,134	43,772,400
オービック	7,420	14,500	107,590,000
ティーディーシーソフトウェア	4,800	771	3,700,800
ヤフー	17,366	24,420	424,077,720
ビー・エム・エル	16,500	1,811	29,881,500
ワタベウェディング	7,500	703	5,272,500
トレンドマイクロ	104,700	2,228	233,271,600
もしもしホットライン	41,500	692	28,718,000
東急コミュニティー	6,500	2,451	15,931,500
リソー教育	2,585	4,905	12,679,425
日本オラクル	37,900	2,515	95,318,500
アルファシステムズ	6,400	1,233	7,891,200
フューチャーアーキテクト	286	30,050	8,594,300
ウェアハウス	5,500	241	1,325,500
シーエーシー	16,300	623	10,154,900
ソフトバンク・テクノ	5,700	595	3,391,500
トーセ	6,000	520	3,120,000
ユー・エス・エス	32,740	7,140	233,763,600
オービックビジネスC	6,000	3,625	21,750,000
日立ビジネスソリュー	7,700	1,004	7,730,800
伊藤忠テクノソリュー	27,900	3,520	98,208,000
アイティフォー	26,300	264	6,943,200

[次へ](#)

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東京個別指導学院	17,000	140	2,380,000	
東計電算	4,500	1,036	4,662,000	
エクスネット	18	114,000	2,052,000	
テー・オー・ダブリュー	8,500	463	3,935,500	
大塚商会	18,900	5,330	100,737,000	
総合メディカル	5,700	2,565	14,620,500	
サイボウズ	433	22,700	9,829,100	
ソフトブレーン	333	7,830	2,607,390	
アグレックス	6,800	747	5,079,600	
セントラルスポーツ	8,000	1,013	8,104,000	
電通国際情報S	14,600	748	10,920,800	
ウェザーニューズ	7,100	2,007	14,249,700	
C I J	24,200	307	7,429,400	
WOWOW	73	202,500	14,782,500	
フルキャストホールディングス	198	17,240	3,413,520	
富士フイルムHLDGS	537,600	1,889	1,015,526,400	
コニカミノルタHLDGS	634,500	540	342,630,000	
資生堂	418,000	1,401	585,618,000	
ライオン	291,000	461	134,151,000	
高砂香料	83,000	356	29,548,000	
マンダム	25,200	1,977	49,820,400	
ミルボン	13,500	2,382	32,157,000	
ファンケル	63,400	1,048	66,443,200	
コーセー	40,700	1,940	78,958,000	
ドクターシーラボ	151	403,000	60,853,000	
ポーラ・オルビスHD	25,600	2,092	53,555,200	
エステー	15,700	987	15,495,900	
コニシ	18,200	1,021	18,582,200	
長谷川香料	32,200	1,219	39,251,800	
小林製薬	35,000	4,085	142,975,000	
荒川化学工業	20,000	672	13,440,000	
メック	18,500	276	5,106,000	
日本高純度化学	72	202,800	14,601,600	
荏原ユージライト	3,500	1,932	6,762,000	
アース製薬	18,200	2,891	52,616,200	
イハラケミカル	44,000	300	13,200,000	
北興化学	11,000	220	2,420,000	
大成ラミック	7,200	2,429	17,488,800	
クミアイ化学	59,000	303	17,877,000	
日本農薬	58,000	315	18,270,000	
昭和シエル石油	225,000	515	115,875,000	
コスモ石油	696,000	212	147,552,000	
富士興産	89,000	75	6,675,000	

ニチレキ	35,000	382	13,370,000
東燃ゼネラル石油	380,000	772	293,360,000
ユシロ化学	13,700	864	11,836,800
ピーピー・カストロール	9,800	325	3,185,000
AOCホールディングス	58,300	487	28,392,100
MORESCO	5,500	758	4,169,000
出光興産	29,800	8,070	240,486,000
JXホールディングス	2,792,700	451	1,259,507,700
横浜ゴム	307,000	428	131,396,000
東洋ゴム	190,000	181	34,390,000
ブリヂストン	788,700	1,723	1,358,930,100
住友ゴム	196,200	917	179,915,400
藤倉ゴム	15,500	281	4,355,500
オカモト	93,000	302	28,086,000
アキレス	205,000	108	22,140,000
フコク	10,600	673	7,133,800
ニッタ	24,800	1,392	34,521,600
クリエートメディック	7,000	808	5,656,000
東海ゴム工業	46,500	853	39,664,500
三ツ星ベルト	67,000	402	26,934,000
バンドー化学	90,000	291	26,190,000
鬼怒川ゴム	55,000	650	35,750,000
旭硝子	1,239,000	632	783,048,000
日本板硝子	1,079,000	139	149,981,000
石塚硝子	31,000	142	4,402,000
有沢製作所	42,000	287	12,054,000
日本山村硝子	100,000	200	20,000,000
日本電気硝子	483,000	752	363,216,000
オハラ	9,500	774	7,353,000
住友大阪セメント	511,000	225	114,975,000
太平洋セメント	1,478,000	158	233,524,000
デイ・シイ	25,500	249	6,349,500
リゾートソリューション	23,000	145	3,335,000
日本ヒュ-ム	21,000	328	6,888,000
日本コンクリ-ト	40,000	233	9,320,000
東海カーボン	218,000	392	85,456,000
日本カーボン	115,000	205	23,575,000
東洋炭素	13,900	3,090	42,951,000
ノリタケ	130,000	224	29,120,000
TOTO	389,000	623	242,347,000
日本碍子	327,000	902	294,954,000
日本特殊陶業	217,000	948	205,716,000
ダントーホールディングス	39,000	82	3,198,000
MARUWA	7,400	3,415	25,271,000
品川リフラクトリーズ	63,000	234	14,742,000
黒崎播磨	54,000	245	13,230,000
東京窯業	30,000	182	5,460,000
ニッカトー	9,200	474	4,360,800

フジインコーポレーテッド	23,000	943	21,689,000
エーアンドエーマテリアル	53,000	79	4,187,000
ニチアス	112,000	421	47,152,000
新日本製鐵	6,602,000	186	1,227,972,000
住友金属工業	4,661,000	133	619,913,000
神戸製鋼所	3,486,000	119	414,834,000
日新製鋼	890,000	115	102,350,000
中山製鋼所	128,000	80	10,240,000
合同製鐵	140,000	197	27,580,000
J F Eホールディングス	595,900	1,353	806,252,700
東京製鐵	127,100	630	80,073,000
共英製鋼	26,800	1,529	40,977,200
大和工業	57,400	2,266	130,068,400
東京鐵鋼	51,000	249	12,699,000
大阪製鐵	15,700	1,480	23,236,000
淀川製鋼所	179,000	346	61,934,000
東洋鋼鋳	60,000	273	16,380,000
住友鋼管	16,700	618	10,320,600
丸一鋼管	77,200	1,779	137,338,800
モリ工業	40,000	259	10,360,000
大同特殊鋼	421,000	489	205,869,000
日本高周波	99,000	86	8,514,000
日本金属工業	195,000	66	12,870,000
日本冶金工	184,500	121	22,324,500
山陽特殊製鋼	124,000	413	51,212,000
愛知製鋼	133,000	398	52,934,000
日立金属	164,000	841	137,924,000
日本金属	63,000	138	8,694,000
大平洋金属	175,000	367	64,225,000
日本電工	90,000	337	30,330,000
栗本鉄工所	127,000	168	21,336,000
旭テック	225,000	32	7,200,000
日本鑄鉄管	27,000	176	4,752,000
日本製鋼所	388,000	518	200,984,000
三菱製鋼	151,000	202	30,502,000
日亜鋼業	40,000	197	7,880,000
日本精線	19,000	367	6,973,000
日本軽金属	568,000	103	58,504,000
大紀アルミニウム	39,000	342	13,338,000
三井金属	683,000	196	133,868,000
東邦亜鉛	142,000	282	40,044,000
三菱マテリアル	1,569,000	211	331,059,000
住友鋳山	651,000	992	645,792,000
D O W Aホールディングス	300,000	488	146,400,000
古河機金	425,000	65	27,625,000
大阪チタニウム	24,700	3,225	79,657,500
東邦チタニウム	40,800	1,254	51,163,200
住友軽金属	604,000	72	43,488,000

古河スカイ	101,000	175	17,675,000
古河電工	791,000	172	136,052,000
住友電工	888,600	825	733,095,000
フジクラ	377,000	222	83,694,000
昭和電線H L D G S	326,000	75	24,450,000
東京特殊電線	35,000	80	2,800,000
タツタ電線	47,000	351	16,497,000
日立電線	198,000	167	33,066,000
沖 電 線	27,000	158	4,266,000
カナレ電気	3,500	1,200	4,200,000
平河ヒューテック	4,400	721	3,172,400
リヨービ	141,000	277	39,057,000
アサヒHD	35,100	1,543	54,159,300
東洋製罐	177,900	1,017	180,924,300
ホッカンホールディングス	61,000	222	13,542,000
コロナ	11,500	1,180	13,570,000
横河ブリッジH L D G S	52,000	553	28,756,000
日本橋梁	10,350	492	5,092,200
駒井ハルテック	50,000	233	11,650,000
サクラダ	222,000	34	7,548,000
高田機工	23,000	203	4,669,000
三和ホールディングス	251,000	252	63,252,000
文化シャツタ -	66,000	283	18,678,000
東洋シャツタ -	7,500	359	2,692,500
住生活グループ	327,000	1,476	482,652,000
日本ファイルコン	18,800	413	7,764,400
ノーリツ	49,400	1,378	68,073,200
長府製作所	24,300	1,995	48,478,500
リンナイ	40,500	5,480	221,940,000
ユニプレス	38,200	2,252	86,026,400
ダイニチ工業	12,800	712	9,113,600
日東精工	34,000	200	6,800,000
三洋工業	33,000	156	5,148,000
岡 部	50,800	389	19,761,200
日立ツール	14,600	845	12,337,000
中国工業	38,000	88	3,344,000
東 プ レ	48,400	780	37,752,000
高周波熱錬	33,500	626	20,971,000
東京製網	158,000	179	28,282,000
バイオラックス	10,800	1,706	18,424,800
日本発条	181,900	673	122,418,700
中央発條	28,000	281	7,868,000
アドバネクス	51,000	63	3,213,000
三浦工業	37,400	2,156	80,634,400
タ ク マ	85,000	346	29,410,000
ツ ガ ミ	61,000	549	33,489,000
オークマ	151,000	478	72,178,000
東芝機械	137,000	384	52,608,000

アマダ	355,000	480	170,400,000
アイダエンジニア	65,100	360	23,436,000
牧野フライス	125,000	467	58,375,000
オーエスジー	110,700	982	108,707,400
ダイジェット	29,000	145	4,205,000
旭ダイヤモンド	61,700	943	58,183,100
森精機製作所	132,400	676	89,502,400
ディスコ	25,300	4,155	105,121,500
日東工器	14,700	1,809	26,592,300
豊田自動織機	218,800	2,123	464,512,400
豊和工業	130,000	66	8,580,000
大阪機工	98,000	89	8,722,000
石川製作所	55,000	63	3,465,000
東洋機械金属	20,400	199	4,059,600
津田駒工業	60,000	191	11,460,000
エンシュウ	62,000	90	5,580,000
島精機製作所	32,800	1,320	43,296,000
日阪製作所	32,000	836	26,752,000
やまびこ	9,900	868	8,593,200
ペガサスミシン製造	24,700	218	5,384,600
ナプテスコ	104,300	1,397	145,707,100
三井海洋開発	20,800	1,281	26,644,800
レオン自動機	21,000	189	3,969,000
S M C	75,100	12,250	919,975,000
新川	19,600	368	7,212,800
ホソカワミクロン	39,000	344	13,416,000
ユニオンツール	13,800	1,320	18,216,000
オイレス工業	27,900	1,489	41,543,100
サト - ホールディングス	26,400	956	25,238,400
日本エアーテック	6,800	353	2,400,400
日精樹脂工業	20,000	316	6,320,000
ワイエイシイ	10,500	613	6,436,500
小松製作所	1,192,400	1,852	2,208,324,800
住友重機械	642,000	452	290,184,000
日立建機	128,300	1,312	168,329,600
日工	33,000	293	9,669,000
巴工業	9,500	1,355	12,872,500
井関農機	258,000	169	43,602,000
T O W A	23,600	423	9,982,800
丸山製作所	57,000	180	10,260,000
北川鉄工所	115,000	147	16,905,000
シンニッタン	23,200	334	7,748,800
クボタ	1,151,000	642	738,942,000
荏原実業	6,400	1,201	7,686,400
東洋エンジニア	144,000	292	42,048,000
三菱化工機	78,000	134	10,452,000
月島機械	38,000	612	23,256,000
帝国電機製作所	8,500	1,370	11,645,000

東京機械	82,000	51	4,182,000
新東工業	54,900	690	37,881,000
渋谷工業	14,400	848	12,211,200
アイチ コーポレーション	41,800	331	13,835,800
小森コーポレーション	71,600	513	36,730,800
鶴見製作所	14,000	556	7,784,000
住友精密	35,000	458	16,030,000
酒井重工業	49,000	160	7,840,000
荏原製作所	410,000	262	107,420,000
石井鉄工所	37,000	155	5,735,000
西島製作所	29,000	956	27,724,000
千代田化工建	214,000	801	171,414,000
ダイキン工業	306,200	1,996	611,175,200
オルガノ	48,000	587	28,176,000
ト - ヨ - カネツ	135,000	151	20,385,000
栗田工業	138,700	2,026	281,006,200
椿本チエイン	128,000	397	50,816,000
大同工業	51,000	131	6,681,000
日本コンベヤ	80,000	79	6,320,000
日 機 装	78,000	667	52,026,000
木村化工機	22,900	299	6,847,100
新興プランテック	55,100	630	34,713,000
アネスト岩田	42,000	316	13,272,000
ダイフク	110,500	387	42,763,500
加藤製作所	57,000	246	14,022,000
油研工業	44,000	165	7,260,000
タダノ	116,000	471	54,636,000
フジテック	70,000	489	34,230,000
シーケーディ	67,200	555	37,296,000
キトー	102	55,900	5,701,800
平和	52,000	1,337	69,524,000
理想科学工業	17,200	1,066	18,335,200
SANKYO	72,800	3,815	277,732,000
日本金銭機械	22,300	594	13,246,200
マースエンジニアリング	13,600	1,330	18,088,000
福島工業	7,500	935	7,012,500
オーイズミ	8,500	263	2,235,500
ダイコク電機	11,300	741	8,373,300
ア マ ノ	72,900	669	48,770,100
JUKI	144,000	176	25,344,000
サンデン	125,000	225	28,125,000
蛇の目ミシン	233,000	55	12,815,000
ブラザー工業	310,500	958	297,459,000
マックス	38,000	947	35,986,000
モリタホールディングス	40,000	451	18,040,000
グローリー	71,700	1,625	116,512,500
大和冷機工業	35,000	393	13,755,000
セガサミーホールディングス	258,200	1,715	442,813,000

日本ピストンリング	91,000	157	14,287,000
リケン	87,000	289	25,143,000
T P R	26,500	910	24,115,000
ホシザキ電機	48,400	1,796	86,926,400
大豊工業	16,900	688	11,627,200
日本精工	535,000	496	265,360,000
N T N	556,000	295	164,020,000
ジェイテクト	229,700	746	171,356,200
不二越	241,000	329	79,289,000
ミネベア	357,000	320	114,240,000
日本トムソン	77,000	436	33,572,000
T H K	159,700	1,508	240,827,600
ユーシン精機	12,000	1,450	17,400,000
前澤給装工業	9,400	1,048	9,851,200
イーグル工業	30,000	615	18,450,000
前澤工業	17,400	204	3,549,600
日本ピラ - 工業	25,000	579	14,475,000
キッツ	98,700	311	30,695,700
日立	5,396,000	417	2,250,132,000
東芝	5,059,000	314	1,588,526,000
三菱電機	2,403,000	722	1,734,966,000
富士電機	724,000	220	159,280,000
東洋電機製造	42,000	301	12,642,000
安川電機	282,000	635	179,070,000
シンフォニアテクノロジー	145,000	158	22,910,000
明電舎	238,000	261	62,118,000
オリジン電気	35,000	234	8,190,000
デンヨー	22,700	1,027	23,312,900
日立工機	64,400	590	37,996,000
三桜工業	30,600	529	16,187,400
マキタ	156,600	2,454	384,296,400
東芝テック	150,000	279	41,850,000
芝浦メカトロニクス	42,000	197	8,274,000
マブチモーター	32,800	3,215	105,452,000
日本電産	129,900	6,980	906,702,000
宮越ホールディングス	8,400	194	1,629,600
高岳製作所	95,000	175	16,625,000
ダイヘン	142,000	269	38,198,000
J V Cケンウッド	144,800	284	41,123,200
第一精工	5,600	2,052	11,491,200
日新電機	48,000	445	21,360,000
大崎電気	35,000	733	25,655,000
オムロン	267,600	1,580	422,808,000
日東工業	36,200	913	33,050,600
I D E C	31,500	808	25,452,000
エルピーダメモリ	324,400	313	101,537,200
ジーエス・ユアサコーポ	463,000	406	187,978,000
サクサホールディングス	61,000	115	7,015,000

メルコホールディングス	13,200	1,984	26,188,800
テクノメディカ	13	280,100	3,641,300
日本電気	3,303,000	164	541,692,000
富士通	2,317,000	428	991,676,000
沖電気	927,000	73	67,671,000
岩崎通信機	107,000	76	8,132,000
電気興業	74,000	333	24,642,000
サンケン電気	121,000	253	30,613,000
ナカヨ通信機	24,000	282	6,768,000
アイホン	14,000	1,514	21,196,000
ルネサスエレクトロニクス	62,200	448	27,865,600
セイコーエプソン	163,900	985	161,441,500
ワコム	472	119,200	56,262,400
アルバック	44,100	973	42,909,300
アクセル	11,200	1,538	17,225,600
ピクセラ	9,900	171	1,692,900
ナナオ	20,300	1,579	32,053,700
日本信号	56,000	458	25,648,000
京三製作所	52,000	341	17,732,000
能美防災	31,000	520	16,120,000
ホーチキ	19,000	392	7,448,000
日本無線	62,000	216	13,392,000
パナソニック	2,745,700	644	1,768,230,800
シャープ	1,160,000	664	770,240,000
アンリツ	115,000	821	94,415,000
富士通ゼネラル	57,000	458	26,106,000
日立国際電気	55,000	645	35,475,000
ソニー	1,499,300	1,350	2,024,055,000
T D K	125,700	3,280	412,296,000
帝国通信工業	59,000	123	7,257,000
ミツミ電機	84,800	551	46,724,800
タムラ製作所	80,000	184	14,720,000
アルプス電気	189,500	524	99,298,000
池上通信機	76,000	55	4,180,000
パイオニア	340,500	342	116,451,000
日本電波工業	18,500	895	16,557,500
日本トリム	2,750	1,836	5,049,000
ローランド ディー・ジー	10,500	834	8,757,000
日本コロムビア	235,000	28	6,580,000
山水電気	1,498,000	2	2,996,000
フオスタ - 電機	22,700	1,061	24,084,700
クラリオン	147,000	136	19,992,000
S M K	77,000	239	18,403,000
ヨコオ	20,000	354	7,080,000
東光	109,000	136	14,824,000
ティアック	131,000	29	3,799,000
ホシデン	65,200	529	34,490,800
ヒロセ電機	41,800	6,690	279,642,000

日本航空電子	55,000	522	28,710,000
T O A	27,000	474	12,798,000
ユニデン	70,000	251	17,570,000
アルパイン	46,800	865	40,482,000
スミダコーポレーション	14,700	467	6,864,900
アイコム	13,300	1,983	26,373,900
船井電機	21,500	1,970	42,355,000
横河電機	260,800	709	184,907,200
新電元工業	85,000	330	28,050,000
山武	61,700	1,625	100,262,500
日本光電工業	47,900	1,911	91,536,900
チノール	47,000	199	9,353,000
共和電業	3,000	228	684,000
日本電子材料	10,400	366	3,806,400
堀場製作所	44,400	2,283	101,365,200
アドバンテスト	178,600	692	123,591,200
小野測器	23,000	210	4,830,000
エスベック	25,100	482	12,098,200
パナソニック電工SUNX	21,200	381	8,077,200
キーエンス	53,600	18,430	987,848,000
日置電機	11,700	1,325	15,502,500
シスメックス	84,600	2,474	209,300,400
メガチップス	19,700	1,223	24,093,100
O B A R A G R O U P	17,100	863	14,757,300
日本電産コパル電子	24,900	463	11,528,700
ミヤチテクノス	11,700	606	7,090,200
東京電波	7,000	375	2,625,000
澤藤電機	14,000	220	3,080,000
デンソー	593,700	2,115	1,255,675,500
コーセル	35,000	1,129	39,515,000
日立メディコ	18,000	818	14,724,000
新日本無線	18,000	211	3,798,000
オプテックス	16,600	996	16,533,600
千代田インテグレ	11,700	943	11,033,100
東光電気	15,000	292	4,380,000
スタンレー電気	161,100	1,143	184,137,300
岩崎電気	88,000	155	13,640,000
ウシオ電機	145,800	1,095	159,651,000
岡谷電機	12,900	340	4,386,000
ヘリオステクノH	21,900	148	3,241,200
日本セラミック	15,800	1,380	21,804,000
新神戸電機	18,000	1,707	30,726,000
日本デジタル研究所	20,100	774	15,557,400
古河電池	17,000	332	5,644,000
双信電機	11,800	318	3,752,400
山一電機	23,600	173	4,082,800
図研	15,700	521	8,179,700
日本電子	90,000	206	18,540,000

カシオ	229,000	442	101,218,000	
ファナック	250,200	11,970	2,994,894,000	
日本シイエムケイ	51,800	279	14,452,200	
エンプラス	12,100	1,623	19,638,300	
ローム	118,400	3,620	428,608,000	
浜松ホトニクス	93,800	2,707	253,916,600	
三井ハイテック	31,700	312	9,890,400	
新光電気工業	80,500	553	44,516,500	
京セラ	199,800	6,120	1,222,776,000	
協栄産業	29,000	144	4,176,000	
太陽誘電	107,800	610	65,758,000	
村田製作所	252,100	3,955	997,055,500	
ユーシン	33,400	612	20,440,800	
双葉電子工業	41,200	1,258	51,829,600	
日東電工	207,400	2,824	585,697,600	
北陸電気工業	97,000	108	10,476,000	
東海理化電機	56,200	1,183	66,484,600	
ニチコン	75,600	743	56,170,800	
日本ケミコン	138,000	246	33,948,000	
K O A	30,300	698	21,149,400	
三井造船	929,000	121	112,409,000	
日立造船	950,500	103	97,901,500	
佐世保重工業	156,000	130	20,280,000	
三菱重工業	4,028,000	334	1,345,352,000	
川崎重工業	1,746,000	196	342,216,000	
I H I	1,642,000	188	308,696,000	
日本車輛	88,000	288	25,344,000	
日本輸送機	32,000	209	6,688,000	
近畿車輛	36,000	241	8,676,000	
日産自動車	3,036,000	679	2,061,444,000	
いすゞ自動車	1,519,000	371	563,549,000	
トヨタ自動車	3,116,485	2,626	8,183,889,610	*
日野自動車	343,000	467	160,181,000	
三菱自動車工業	5,374,000	91	489,034,000	
エフテック	8,300	882	7,320,600	
武蔵精密工業	23,200	1,675	38,860,000	
日産車体	70,000	787	55,090,000	
新明和工業	108,000	331	35,748,000	
極東開発工業	41,700	559	23,310,300	
日信工業	43,900	1,085	47,631,500	
トピー工業	180,000	195	35,100,000	
ティラド	87,000	259	22,533,000	
曙ブレーキ	121,800	338	41,168,400	
タチエス	31,300	1,351	42,286,300	
N O K	116,200	1,385	160,937,000	
フタバ産業	67,800	422	28,611,600	
カヤバ工業	166,000	381	63,246,000	
シロキ工業	53,000	211	11,183,000	

市光工業	58,000	131	7,598,000
大同メタル工業	37,000	828	30,636,000
プレス工業	110,000	366	40,260,000
カルソニックカンセイ	143,000	451	64,493,000
太平洋工業	49,000	370	18,130,000
ケーヒン	49,600	1,300	64,480,000
河西工業	29,000	379	10,991,000
アイシン精機	197,800	2,191	433,379,800
富士機工	28,000	198	5,544,000
マ ッ ダ	1,993,000	131	261,083,000
ダイハツ	223,000	1,428	318,444,000
愛知機械	54,000	270	14,580,000
今仙電機製作所	17,500	868	15,190,000
本田技研	2,027,600	2,473	5,014,254,800
スズキ	502,400	1,571	789,270,400
富士重工業	759,000	485	368,115,000
ヤマハ発動機	391,400	970	379,658,000
ショーワ	51,100	451	23,046,100
小糸製作所	120,000	1,104	132,480,000
T B K	24,000	374	8,976,000
エクセディ	32,600	2,293	74,751,800
ミツバ	44,000	589	25,916,000
豊田合成	67,900	1,203	81,683,700
愛三工業	24,900	609	15,164,100
ヨ ロ ズ	14,400	1,759	25,329,600
エフ・シー・シー	39,300	1,581	62,133,300
新家工業	58,000	118	6,844,000
シマノ	91,000	3,625	329,875,000
タカタ	43,400	1,589	68,962,600
テイ・エス テック	50,700	1,228	62,259,600
小 野 建	20,600	646	13,307,600
はるやま商事	11,100	402	4,462,200
佐鳥電機	17,500	456	7,980,000
カップクリエイト	17,450	1,797	31,357,650
エコートレーディング	5,900	707	4,171,300
伯東	14,600	747	10,906,200
コンドーテック	17,400	483	8,404,200
中山福	14,400	597	8,596,800
ライトオン	17,700	584	10,336,800
ナガイレーベン	31,400	1,001	31,431,400
ジーンズメイト	7,800	172	1,341,600
三菱食品	21,700	2,118	45,960,600
良品計画	25,100	3,725	93,497,500
三城ホールディングス	29,300	632	18,517,600
松田産業	17,400	1,206	20,984,400
メディバルHD	255,400	813	207,640,200
アドヴァン	14,300	713	10,195,900
S P K	5,800	1,335	7,743,000

アズワン	15,500	1,580	24,490,000	
スズデン	8,000	520	4,160,000	
尾家産業	6,800	828	5,630,400	

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年1月11日現在

銘柄	株数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
シモジマ	14,600	1,010	14,746,000	
ドウシシャ	11,300	2,324	26,261,200	
コナカ	27,700	611	16,924,700	
高速	14,100	645	9,094,500	
ハウス ローゼ	2,700	1,255	3,388,500	
G - 7ホールディングス	6,000	371	2,226,000	
イオン北海道	17,400	367	6,385,800	
コジマ	31,600	503	15,894,800	
コーナン商事	25,200	1,297	32,684,400	
黒田電気	29,300	809	23,703,700	
ネットワンシステムズ	534	215,900	115,290,600	
エコス	8,400	473	3,973,200	
ワタミ	28,000	1,825	51,100,000	
マルシェ	6,800	705	4,794,000	
ドン・キホーテ	45,900	2,749	126,179,100	
丸文	18,700	324	6,058,800	
メガネトップ	33,900	894	30,306,600	
西松屋チェーン	51,800	601	31,131,800	
ゼンショーホールディングス	90,300	1,040	93,912,000	
ハピネット	12,600	663	8,353,800	
幸楽苑	14,900	1,215	18,103,500	
トーマンエレクトロニクス	10,700	941	10,068,700	
ハークスレイ	6,600	533	3,517,800	
サイゼリヤ	35,000	1,203	42,105,000	
エクセル	11,400	770	8,778,000	
マルカキカイ	7,900	668	5,277,200	
アルゴグラフィックス	8,800	1,024	9,011,200	
ガリバーインターナショナル	7,190	2,725	19,592,750	
日本エム・ディ・エム	20,400	241	4,916,400	
ポプラ	7,600	472	3,587,200	
ユナイテッドアローズ	25,500	1,485	37,867,500	
進和	14,300	880	12,584,000	
エスケイジャパン	5,500	243	1,336,500	
ダイトエレクトロン	10,600	424	4,494,400	
ハイデイ日高	10,500	1,304	13,692,000	
シークス	15,000	983	14,745,000	
京都きもの友禅	16,700	897	14,979,900	
コロワイド	79,000	562	44,398,000	
田中商事	7,400	433	3,204,200	
オーハシテクニカ	13,400	598	8,013,200	
壱番屋	9,600	2,244	21,542,400	
マクニカ	12,100	1,790	21,659,000	
白銅	7,900	783	6,185,700	
トップカルチャー	9,200	359	3,302,800	

スギホールディングス	42,500	2,271	96,517,500
島津製作所	287,000	646	185,402,000
J M S	37,000	236	8,732,000
クボテック	52	21,800	1,133,600
モリテックス	5,300	322	1,706,600
長野計器	17,100	787	13,457,700
ブイ・テクノロジー	34	314,000	10,676,000
スター精密	38,700	692	26,780,400
東京計器	85,000	144	12,240,000
愛知時計	26,000	280	7,280,000
日本電産トーソク	11,600	890	10,324,000
東京精密	43,100	1,512	65,167,200
ニコン	418,700	1,679	702,997,300
トプコン	55,500	377	20,923,500
オリンパス	283,300	1,230	348,459,000
理研計器	19,600	552	10,819,200
大日本スクリーン	227,000	653	148,231,000
キヤノン電子	22,000	1,883	41,426,000
タムロン	21,000	1,885	39,585,000
HOYA	584,300	1,651	964,679,300
ノーリツ鋼機	21,900	361	7,905,900
エー・アンド・デイ	23,400	254	5,943,600
キヤノン	1,492,900	3,285	4,904,176,500
リコー	723,000	640	462,720,000
日本電産コパル	18,900	857	16,197,300
日本電産サンキョー	57,000	509	29,013,000
シチズンホールディングス	287,400	462	132,778,800
リズム時計	117,000	141	16,497,000
大研医器	3,800	826	3,138,800
パラマウントベッドHD	20,600	2,331	48,018,600
SHOBI	3,700	487	1,801,900
SRIスポーツ	15,700	839	13,172,300
バンダイナムコHLDGS	257,400	1,094	281,595,600
共立印刷	28,000	208	5,824,000
フランスベッドHLDGS	162,000	145	23,490,000
パイロットコーポレーション	212	149,300	31,651,600
エイベックス・グループHD	44,800	975	43,680,000
トッパン・フォームズ	51,500	572	29,458,000
フジシールインターナショナル	26,900	1,418	38,144,200
タカラトミー	78,900	534	42,132,600
廣済堂	20,300	195	3,958,500
アーク	81,600	74	6,038,400
レック	7,600	1,225	9,310,000
タカノ	9,800	452	4,429,600
プロネクサス	27,100	383	10,379,300
ホクシン	17,700	153	2,708,100
ウッドワン	40,000	286	11,440,000
大建工業	99,000	248	24,552,000

きもと	20,500	491	10,065,500
凸版印刷	731,000	568	415,208,000
大日本印刷	732,000	761	557,052,000
図書印刷	38,000	130	4,940,000
共同印刷	82,000	180	14,760,000
日本写真印刷	40,300	939	37,841,700
光村印刷	3,000	247	741,000
藤森工業	18,100	1,111	20,109,100
宝印刷	14,200	571	8,108,200
前澤化成工業	18,100	799	14,461,900
アシックス	223,700	843	188,579,100
ツツミ	12,100	1,825	22,082,500
ジェイ エス ピー	16,300	1,181	19,250,300
ニチハ	27,900	840	23,436,000
ローランド	24,800	688	17,062,400
エフピコ	11,100	5,170	57,387,000
小松ウオール工業	9,100	811	7,380,100
ヤマハ	176,600	684	120,794,400
河合楽器	90,000	146	13,140,000
クリナップ	28,300	497	14,065,100
ビジョン	21,200	3,150	66,780,000
天馬	20,300	694	14,088,200
兼松日産農林	38,000	164	6,232,000
キングジム	20,300	594	12,058,200
リンテック	45,600	1,362	62,107,200
田崎真珠	50,000	48	2,400,000
信越ポリマー	49,500	334	16,533,000
東リ	66,000	148	9,768,000
イトーキ	51,600	169	8,720,400
任天堂	137,400	10,500	1,442,700,000
三菱鉛筆	20,500	1,377	28,228,500
タカラスタンダ - ド	111,000	610	67,710,000
コクヨ	125,200	552	69,110,400
ナカバヤシ	52,000	186	9,672,000
ニフコ	56,200	2,119	119,087,800
グローブライド	118,000	87	10,266,000
岡村製作所	84,000	568	47,712,000
日本バルカー	98,000	200	19,600,000
MUTOHホールディングス	29,000	208	6,032,000
伊藤忠	1,892,300	780	1,475,994,000
丸紅	2,075,000	478	991,850,000
スクロール	32,800	277	9,085,600
高島	41,000	195	7,995,000
F & A アクアホールディングス	18,100	770	13,937,000
三陽商会	123,000	182	22,386,000
長瀬産業	134,500	862	115,939,000
ナイガイ	71,000	47	3,337,000
蝶理	141,000	90	12,690,000

豊田通商	264,500	1,359	359,455,500
オンワードホールディングス	155,000	581	90,055,000
三共生興	40,600	274	11,124,400
兼松	504,000	76	38,304,000
美津濃	119,000	405	48,195,000
ツカモトコーポレーション	41,000	93	3,813,000
ファミリーマート	72,800	3,160	230,048,000
ルック	41,000	203	8,323,000
三井物産	2,047,400	1,213	2,483,496,200
日本紙パルプ	123,000	283	34,809,000
東京エレクトロン	202,100	4,075	823,557,500
日立ハイテクノロジーズ	71,900	1,728	124,243,200
カメイ	31,000	793	24,583,000
東都水産	40,000	139	5,560,000
スターゼン	81,000	235	19,035,000
セイコーHD	139,000	152	21,128,000
山善	91,600	572	52,395,200
椿本興業	25,000	211	5,275,000
住友商事	1,400,000	1,049	1,468,600,000
日本ユニシス	57,000	492	28,044,000
内田洋行	55,000	212	11,660,000
三菱商事	1,727,400	1,583	2,734,474,200
第一実業	50,000	337	16,850,000
キヤノンマーケティングJPN	79,000	893	70,547,000
西華産業	89,000	207	18,423,000
佐藤商事	20,900	451	9,425,900
菱洋エレクトロ	26,800	896	24,012,800
東京産業	25,500	245	6,247,500
ユアサ商事	245,000	116	28,420,000
神鋼商事	60,000	185	11,100,000
阪和興業	238,000	345	82,110,000
カナデン	2,000	505	1,010,000
菱電商事	36,000	443	15,948,000
ニプロ	95,700	654	62,587,800
フルサト工業	14,200	642	9,116,400
岩谷産業	265,000	257	68,105,000
すてきなイスグループ	104,000	160	16,640,000
昭光通商	88,000	121	10,648,000
ニチモウ	37,000	170	6,290,000
極東貿易	29,000	213	6,177,000
イワキ	36,000	184	6,624,000
兼松エレクトロニクス	15,200	798	12,129,600
三愛石油	57,000	347	19,779,000
稲畑産業	63,900	470	30,033,000
G S Iクレオス	61,000	105	6,405,000
明和産業	19,200	216	4,147,200
ゴ-ルドウイン	57,000	356	20,292,000
ユニ・チャ-ム	138,900	3,840	533,376,000

デサント	63,000	417	26,271,000
ヤマトインタ - ナショナル	15,500	376	5,828,000
東邦ホールディングス	76,000	1,088	82,688,000
サンゲツ	42,100	2,089	87,946,900
ミツウロコグループ	38,600	486	18,759,600
シナネン	52,000	343	17,836,000
伊藤忠エネクス	52,600	437	22,986,200
サンリオ	59,800	3,965	237,107,000
サンワ テクノス	11,500	706	8,119,000
リョーサン	38,600	1,618	62,454,800
新光商事	26,200	606	15,877,200
トーホー	52,000	315	16,380,000
三信電気	33,900	649	22,001,100
東陽テクニカ	34,900	824	28,757,600
モスフード サービス	31,200	1,538	47,985,600
加賀電子	25,700	807	20,739,900
三益半導体	21,100	668	14,094,800
ソーダニツカ	2,000	338	676,000
立花エレテック	14,500	718	10,411,000
木曾路	27,200	1,448	39,385,600
千 趣 会	42,600	522	22,237,200
タカキュー	18,500	139	2,571,500
ケーヨー	44,600	500	22,300,000
アデランス	30,100	990	29,799,000
上新電機	51,000	849	43,299,000
日本瓦斯	22,700	1,209	27,444,300
ベスト電器	74,000	183	13,542,000
マルエツ	48,000	287	13,776,000
ロイヤルホールディングス	39,900	920	36,708,000
東 天 紅	17,000	116	1,972,000
いなげや	26,700	929	24,804,300
島 忠	53,500	1,773	94,855,500
チヨダ	31,100	1,384	43,042,400
ライフコーポレーション	14,900	1,455	21,679,500
カ ス ミ	48,700	513	24,983,100
リンガーハット	21,600	1,049	22,658,400
さ が 美	20,000	89	1,780,000
MR MAX	24,000	322	7,728,000
テンアライド	18,700	274	5,123,800
A O K Iホールディングス	21,900	1,288	28,207,200
オークワ	34,000	1,209	41,106,000
コメリ	32,400	2,381	77,144,400
青山商事	65,300	1,392	90,897,600
しまむら	27,500	7,980	219,450,000
C F Sコーポレーション	19,000	371	7,049,000
高 島 屋	321,000	553	177,513,000
松 屋	47,700	438	20,892,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	123,000	596	73,308,000

丸 栄	40,000	89	3,560,000
ニッセンHD	47,100	352	16,579,200
パ ル コ	43,000	577	24,811,000
丸井グループ	309,400	589	182,236,600
クレディセゾン	193,700	1,514	293,261,800
原信ナルスHLDGS	13,200	1,320	17,424,000
井 筒 屋	126,000	45	5,670,000
ダイエー	146,750	267	39,182,250
イズミヤ	83,000	400	33,200,000
イオン	836,000	1,016	849,376,000
ユ ニ ー	177,900	694	123,462,600
イ ズ ミ	71,000	1,378	97,838,000
東武ストア	31,000	265	8,215,000
平 和 堂	43,600	982	42,815,200
フ ジ	26,500	1,842	48,813,000
ヤオコー	10,400	2,601	27,050,400
ゼビオ	28,500	1,844	52,554,000
ケーズホールディングス	59,100	3,095	182,914,500
P a l t a c	24,900	1,003	24,974,700
O L Y M P I C	15,800	729	11,518,200
日産東京販売HD	35,000	132	4,620,000
新生銀行	1,848,000	81	149,688,000
あおぞら銀行	739,000	214	158,146,000
三菱UFJフィナンシャルG	17,955,300	336	6,032,980,800
りそなホールディングス	2,064,000	343	707,952,000
三井住友トラストHD	4,650,000	228	1,060,200,000
三井住友フィナンシャルG	1,793,700	2,233	4,005,332,100
第四銀行	309,000	254	78,486,000
北越銀行	248,000	158	39,184,000
西日本シティ銀行	831,000	223	185,313,000
札幌北洋ホール	356,800	276	98,476,800
千葉銀行	935,000	497	464,695,000
横浜銀行	1,523,000	362	551,326,000
常陽銀行	914,000	340	310,760,000
群馬銀行	542,000	418	226,556,000
武蔵野銀行	38,200	2,585	98,747,000
千葉興業銀行	44,800	413	18,502,400
筑波銀行	98,400	257	25,288,800
東京都民銀行	45,000	973	43,785,000
七十七銀行	372,000	324	120,528,000
青森銀行	178,000	236	42,008,000
秋田銀行	163,000	226	36,838,000
山形銀行	145,000	386	55,970,000
岩手銀行	16,000	3,410	54,560,000
東邦銀行	200,000	232	46,400,000
東北銀行	132,000	122	16,104,000
みちのく銀行	119,000	145	17,255,000
ふくおかフィナンシャルG	962,000	324	311,688,000

静岡銀行	716,000	808	578,528,000
十六銀行	298,000	252	75,096,000
スルガ銀行	231,000	706	163,086,000
八十二銀行	437,000	446	194,902,000
山梨中央銀行	145,000	323	46,835,000
大垣共立銀行	316,000	252	79,632,000
福井銀行	205,000	240	49,200,000
北國銀行	284,000	291	82,644,000
清水銀行	8,100	2,909	23,562,900
滋賀銀行	223,000	533	118,859,000
南都銀行	221,000	438	96,798,000
百五銀行	214,000	312	66,768,000
京都銀行	424,000	665	281,960,000
三重銀行	98,000	175	17,150,000
ほくほくフィナンシャルG	1,661,000	153	254,133,000
広島銀行	700,000	364	254,800,000
山陰合同銀行	141,000	588	82,908,000
中国銀行	194,000	1,088	211,072,000
鳥取銀行	75,000	147	11,025,000
伊予銀行	254,000	762	193,548,000
百十四銀行	260,000	366	95,160,000
四国銀行	171,000	300	51,300,000
阿波銀行	210,000	526	110,460,000
鹿児島銀行	153,000	543	83,079,000
大分銀行	153,000	222	33,966,000
宮崎銀行	157,000	193	30,301,000
肥後銀行	184,000	443	81,512,000
佐賀銀行	144,000	190	27,360,000
十八銀行	151,000	204	30,804,000
沖縄銀行	18,000	3,390	61,020,000
琉球銀行	50,000	975	48,750,000
八千代銀行	12,400	1,844	22,865,600
みずほフィナンシャルG	30,466,400	110	3,351,304,000
紀陽ホールディングス	947,000	119	112,693,000
山口フィナンシャルG	237,000	741	175,617,000
フィデック	141	8,350	1,177,350
芙蓉総合リース	22,600	2,711	61,268,600
興銀リース	33,000	1,745	57,585,000
東京センチュリーリース	63,600	1,473	93,682,800
SBIホールディングス	25,031	5,520	138,171,120
日本証券金融	98,000	362	35,476,000
大阪証券金融	28,500	154	4,389,000
アイフル	215,800	108	23,306,400
日本アジア投資	171,000	54	9,234,000
ポケットカード	24,200	262	6,340,400
長野銀行	81,000	157	12,717,000
名古屋銀行	214,000	250	53,500,000
愛知銀行	8,600	4,515	38,829,000

第三銀行	135,000	160	21,600,000
中京銀行	99,000	203	20,097,000
東日本銀行	113,000	164	18,532,000
大光銀行	84,000	257	21,588,000
愛媛銀行	150,000	228	34,200,000
トマト銀行	95,000	129	12,255,000
みなと銀行	215,000	145	31,175,000
京葉銀行	195,000	379	73,905,000
関西アーバン銀行	331,000	126	41,706,000
栃木銀行	119,000	278	33,082,000
北日本銀行	7,400	1,972	14,592,800
東和銀行	236,000	88	20,768,000
福島銀行	284,000	41	11,644,000
大東銀行	154,000	63	9,702,000
リコーリース	16,300	1,732	28,231,600
イオン クレジットサービス	105,400	1,225	129,115,000
アコム	47,660	1,356	64,626,960
ジャックス	144,000	228	32,832,000
オリコ	341,500	70	23,905,000
日立キャピタル	46,600	1,075	50,095,000
オリックス	123,370	6,570	810,540,900
三菱UFJリース	60,130	3,120	187,605,600
ジャフコ	28,800	1,367	39,369,600
トモニホールディングス	182,200	338	61,583,600
大和証券G本社	2,350,000	251	589,850,000
野村ホールディングス	5,133,700	259	1,329,628,300
岡三証券グループ	202,000	249	50,298,000
丸三証券	80,100	245	19,624,500
東洋証券	90,000	106	9,540,000
東海東京HD	272,000	215	58,480,000
光世証券	60,000	57	3,420,000
水戸証券	71,000	96	6,816,000
いちよし証券	53,700	341	18,311,700
松井証券	140,700	379	53,325,300
NK S Jホールディングス	496,000	1,523	755,408,000
だいこう証券ビジ	14,800	258	3,818,400
マネックスG	1,898	11,200	21,257,600
カブドットコム証券	96,600	233	22,507,800
極東証券	32,000	415	13,280,000
岩井コスモホールディング	22,600	235	5,311,000
フィデアホール	136,300	204	27,805,200
池田泉州HD	976,800	113	110,378,400
M S & A D	708,900	1,455	1,031,449,500
SONY F H	227,100	1,160	263,436,000
小林洋行	5,200	177	920,400
第一生命	12,684	75,300	955,105,200
東京海上HD	900,400	1,772	1,595,508,800
アサックス	32	83,200	2,662,400

NECキャピタルソリューション	8,000	1,176	9,408,000
T&Dホールディングス	864,300	725	626,617,500
三井不動産	1,052,000	1,132	1,190,864,000
三菱地所	1,660,000	1,175	1,950,500,000
平和不動産	225,500	156	35,178,000
東京建物	452,000	258	116,616,000
ダイビル	69,900	452	31,594,800
サンケイビル	40,900	300	12,270,000
東急不動産	477,000	293	139,761,000
京阪神ビルディング	28,600	344	9,838,400
住友不動産	568,000	1,349	766,232,000
東宝不動産	25,500	399	10,174,500
太平洋興発	82,000	78	6,396,000
大京	364,000	158	57,512,000
テーオーシー	92,200	359	33,099,800
東京楽天地	27,000	285	7,695,000
レオパレス21	183,200	165	30,228,000
フジ住宅	30,400	373	11,339,200
空港施設	25,000	308	7,700,000
明和地所	13,400	345	4,623,000
住友不動産販売	8,560	3,075	26,322,000
ゴールドクレスト	21,350	1,229	26,239,150
東栄住宅	16,000	818	13,088,000
リコ・ホールディング	7,600	2,015	15,314,000
日本エスリード	10,200	668	6,813,600
東急リバブル	21,500	594	12,771,000
飯田産業	26,800	561	15,034,800
日神不動産	13,800	428	5,906,400
アーネストワン	39,100	822	32,140,200
タカラレーベン	27,100	495	13,414,500
サンヨーハウジ 名古屋	102	77,100	7,864,200
イオンモール	108,100	1,671	180,635,100
フージャースコーポレーション	362	32,150	11,638,300
タクトホーム	124	62,900	7,799,600
ランド	24,700	16	395,200
トーセイ	224	19,770	4,428,480
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,474	52,100	76,795,400
サンフロンティア不動産	211	8,620	1,818,820
ランドビジネス	160	14,450	2,312,000
東武鉄道	1,365,000	400	546,000,000
相鉄ホールディングス	386,000	238	91,868,000
東京急行	1,415,000	380	537,700,000
京浜急行	618,000	705	435,690,000
小田急電鉄	771,000	752	579,792,000
京王電鉄	672,000	543	364,896,000
京成電鉄	387,000	572	221,364,000
富士急行	66,000	456	30,096,000
新京成電鉄	23,000	348	8,004,000

東日本旅客鉄道	417,900	4,835	2,020,546,500
西日本旅客鉄道	209,000	3,345	699,105,000
東海旅客鉄道	2,086	652,000	1,360,072,000
西日本鉄道	312,000	370	115,440,000
ハマキョウレックス	6,800	2,246	15,272,800
サカイ引越センター	4,300	1,630	7,009,000
近畿鉄道	2,172,000	308	668,976,000
阪急阪神HLDGS	1,613,000	325	524,225,000
南海電鉄	502,000	342	171,684,000
京阪電鉄	540,000	377	203,580,000
名糖運輸	10,500	610	6,405,000
名古屋鉄道	840,000	209	175,560,000
日本通運	951,000	298	283,398,000
ヤマトホールディングス	488,900	1,247	609,658,300
山九	291,000	286	83,226,000
日新	91,000	191	17,381,000
丸運	12,500	192	2,400,000
丸全昭和運輸	81,000	249	20,169,000
センコー	96,000	304	29,184,000
トナミホールディングス	50,000	167	8,350,000
日本梱包運輸	71,900	789	56,729,100
日石輸送	28,000	187	5,236,000
福山通運	146,000	471	68,766,000
セイノーホールディングス	186,000	600	111,600,000
神奈川中央交通	25,000	418	10,450,000
日立物流	50,000	1,338	66,900,000
日本郵船	1,903,000	178	338,734,000
商船三井	1,259,000	261	328,599,000
川崎汽船	742,000	126	93,492,000
NSユニテッド海運	103,000	114	11,742,000
乾汽船	27,700	256	7,091,200
明治海運	21,500	224	4,816,000
飯野海運	116,200	329	38,229,800
共栄タンカー	21,000	117	2,457,000
第一中央汽船	156,000	93	14,508,000
全日本空輸	3,204,000	216	692,064,000
パスコ	22,000	275	6,050,000
国際航業HLDGS	14,000	206	2,884,000
三菱倉庫	171,000	825	141,075,000
三井倉庫	112,000	288	32,256,000
住友倉庫	176,000	368	64,768,000
渋沢倉庫	58,000	218	12,644,000
ヤマタネ	118,000	112	13,216,000
東陽倉庫	40,000	170	6,800,000
日本トランスシティ	50,000	255	12,750,000
ケイヒン	45,000	88	3,960,000
安田倉庫	20,700	484	10,018,800
東洋埠頭	72,000	130	9,360,000

宇徳	17,500	243	4,252,500
上組	266,000	655	174,230,000
サンリツ	1,700	510	867,000
キムラユニティー	4,800	679	3,259,200
キューソー流通システム	8,000	852	6,816,000
郵船ロジスティクス	18,800	1,005	18,894,000
近鉄エクスプレス	21,400	2,213	47,358,200
東海運	16,400	216	3,542,400
バンテック	28	231,400	6,479,200
東京放送HD	142,200	995	141,489,000
日本テレビ放送網	20,820	11,650	242,553,000
テレビ朝日	601	125,900	75,665,900
スカパーJ S A T H D	1,803	38,850	70,046,550
テレビ東京HD	15,200	1,025	15,580,000
アイ・ティー・シーネットワーク	20,700	496	10,267,200
イー・アクセス	1,803	17,150	30,921,450
NECモバイリング	8,600	2,608	22,428,800
日本電信電話	1,092,200	3,925	4,286,885,000
KDDI	3,681	496,500	1,827,616,500
光通信	21,800	1,984	43,251,200
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,544	141,900	2,773,293,600
GMOインターネット	70,300	286	20,105,800
学研ホールディングス	72,000	147	10,584,000
ゼンリン	34,300	696	23,872,800
昭文社	14,200	590	8,378,000
角川グループHLDGS	22,400	2,598	58,195,200
インプレスホールディングス	19,300	97	1,872,100
東京電力	1,918,500	202	387,537,000
中部電力	792,000	1,479	1,171,368,000
関西電力	980,800	1,218	1,194,614,400
中国電力	332,200	1,395	463,419,000
北陸電力	235,400	1,456	342,742,400
東北電力	600,500	768	461,184,000
四国電力	221,300	2,274	503,236,200
九州電力	530,800	1,121	595,026,800
北海道電力	224,900	1,123	252,562,700
沖縄電力	14,400	3,240	46,656,000
電源開発	149,000	2,070	308,430,000
東京瓦斯	2,900,000	350	1,015,000,000
大阪瓦斯	2,332,000	306	713,592,000
東邦瓦斯	611,000	489	298,779,000
北海道瓦斯	44,000	272	11,968,000
西部瓦斯	272,000	212	57,664,000
静岡瓦斯	62,500	518	32,375,000
アイネット	10,800	465	5,022,000
松竹	156,000	756	117,936,000
東宝	169,600	1,349	228,790,400
エイチ・アイ・エス	25,500	2,223	56,686,500

東映	99,000	367	36,333,000
葵プロモーション	7,500	406	3,045,000
NTTデータ	1,464	243,800	356,923,200
共立メンテナンス	12,500	1,467	18,337,500
イチネンホールディングス	26,500	399	10,573,500
建設技術研究所	14,000	530	7,420,000
アインファーマシーズ	13,100	3,560	46,636,000
燦ホールディングス	5,800	1,417	8,218,600
スバル興業	3,000	253	759,000
東京テアトル	96,000	104	9,984,000
ホリプロ	9,000	1,046	9,414,000
よみうりランド	55,000	242	13,310,000
東京都競馬	195,000	106	20,670,000
常磐興産	78,000	85	6,630,000
カナモト	32,000	644	20,608,000
東京ドーム	201,000	191	38,391,000
D T S	24,500	945	23,152,500
スクウェア・エニックス・HD	77,400	1,460	113,004,000
シーイーシー	15,700	369	5,793,300
カプコン	45,400	1,630	74,002,000
東海観光	108,000	20	2,160,000
日本空港ビルデング	75,700	1,028	77,819,600
トランス・コスモス	32,600	970	31,622,000
乃村工藝社	48,000	238	11,424,000
ジャステック	15,900	448	7,123,200
S C S K	48,200	1,210	58,322,000
藤田観光	65,000	260	16,900,000
近畿日本ツーリスト	79,000	85	6,715,000
日本管財	9,400	1,431	13,451,400
トーカイ	10,100	1,707	17,240,700
白洋舎	5,000	211	1,055,000
セコム	243,700	3,445	839,546,500
日本システムウエア	9,100	309	2,811,900
セントラル警備保障	11,600	790	9,164,000
アイネス	28,600	539	15,415,400
丹青社	24,000	195	4,680,000
メイテック	39,300	1,500	58,950,000
T K C	20,000	1,607	32,140,000
アサツー ディ・ケイ	43,800	2,059	90,184,200
富士ソフト	32,000	1,380	44,160,000
応用地質	26,600	928	24,684,800
船井総合研究所	26,800	541	14,498,800
N S D	45,800	593	27,159,400
進学会	12,700	285	3,619,500
丸紅建材リース	24,000	153	3,672,000
コナミ	107,100	2,106	225,552,600
ベネッセホールディングス	77,800	3,760	292,528,000
イオンディライト	28,300	1,529	43,270,700

ナック	6,400	1,484	9,497,600
福井コンピュータ	1,500	364	546,000
ニチイ学館	49,000	955	46,795,000
ダイセキ	40,400	1,285	51,914,000
日鐵商事	51,000	205	10,455,000
元気寿司	7,500	976	7,320,000
トラスコ中山	30,000	1,448	43,440,000
ヤマダ電機	115,330	5,200	599,716,000
オートバックスセブン	28,100	3,670	103,127,000
アークランドサカモト	15,400	1,488	22,915,200
ニトリホールディングス	46,950	7,250	340,387,500
グルメ杵屋	15,000	444	6,660,000
愛眼	19,400	370	7,178,000
吉野家ホールディングス	645	107,000	69,015,000
加藤産業	34,200	1,460	49,932,000
イノテック	13,900	515	7,158,500
イエローハット	22,300	1,206	26,893,800
富士エレクトロニクス	12,100	1,106	13,382,600
松屋フーズ	11,500	1,625	18,687,500
J B C Cホールディングス	18,600	520	9,672,000
J Kホールディングス	22,000	362	7,964,000
サガミチェーン	28,000	528	14,784,000
日伝	9,900	2,366	23,423,400
北沢産業	11,000	156	1,716,000
杉本商事	13,200	706	9,319,200
因幡電機産業	28,100	2,190	61,539,000
住金物産	112,000	205	22,960,000
ブレナス	26,600	1,278	33,994,800
ミニストップ	17,600	1,411	24,833,600
アークス	32,500	1,518	49,335,000
バロー	47,100	1,205	56,755,500
ミスミグループ本社	87,600	1,701	149,007,600
江守商事	5,100	883	4,503,300
アルテック	11,500	197	2,265,500
ベルク	11,600	1,245	14,442,000
大庄	11,400	1,050	11,970,000
タキヒヨー	36,000	436	15,696,000
ファーストリテイリング	55,400	14,590	808,286,000
ソフトバンク	1,074,500	2,189	2,352,080,500
スズケン	91,200	2,158	196,809,600
サンドラッグ	45,100	2,346	105,804,600
ジェコス	17,000	316	5,372,000
ヤマザワ	6,200	1,338	8,295,600
やまや	3,600	1,140	4,104,000
ベルーナ	29,350	578	16,964,300
合計	369,223,759		240,208,368,152

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	500,000

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		4,879,699,361	1,772,064,269
コール・ローン		32,888,316	147,974,661
株式		272,428,796,276	256,151,315,535
投資信託受益証券		874,593,729	837,461,150
投資証券		3,408,513,729	4,207,565,600
派生商品評価勘定		65,505,002	65,636,265
未収入金		-	44,393,879
未収配当金		334,311,908	410,545,051
差入委託証拠金		1,546,882,393	665,362,488
流動資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898
資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		38,469,437	530,178
未払金		90,614,999	-
未払解約金		151,113,000	24,364,000
流動負債合計		280,197,436	24,894,178
負債合計		280,197,436	24,894,178
純資産の部			
元本等			
元本		218,946,599,573	223,825,007,857
剰余金			
剰余金又は欠損金()		64,344,393,705	40,452,416,863
元本等合計		283,290,993,278	264,277,424,720
純資産合計		283,290,993,278	264,277,424,720
負債純資産合計		283,571,190,714	264,302,318,898

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 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によって計算しております。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月15日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月16日から平成24年2月15日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	219,137,532,276円	218,946,599,573円
同期中追加設定元本額	38,114,938,913円	58,808,343,556円
同期中解約元本額	38,305,871,616円	53,929,935,272円
同期末における元本の内訳		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	449,309,260円	1,160,905,075円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	28,399,848,603円	32,471,102,298円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	176,140,694円	206,051,376円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	990,180,130円	1,129,874,746円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,235,372,366円	1,349,118,541円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	203,263,880円	218,830,130円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	520,238,727円	556,210,749円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	367,609,658円	395,187,328円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	84,318,046円	73,937,118円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	758,783,644円	810,799,004円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	83,852,177円	152,569,044円
D I A M外国株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	618,457,817円	575,714,000円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,123,852,190円	5,746,716,635円
D I A M為替リスクコントロール型グローバル株式私募ファンド（適格機関投資家限定）	17,296,875,235円	16,543,915,689円
D I A Mワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	99,933,771円	100,143,177円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	9,408,940,283円	9,371,248,475円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	1,600,344,297円	1,524,049,561円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	185,451,338円	184,616,196円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	1,054,945,626円	1,059,991,991円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA（適格機関投資家 限定）	99,908,449円	96,638,946円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA（適格機関投資家 限定）	175,894,362円	169,861,698円
D I A M世界バランスファンド 40VA（適格機関投資家限 定）	17,662,021,759円	17,638,143,945円
D I A M世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限 定）	8,825,117,749円	8,728,538,484円
D I A Mバランスファンド25 VA（適格機関投資家限定）	3,049,289,705円	3,068,245,521円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA（適格機関投資家限 定）	2,715,959,778円	2,630,100,383円
D I A Mバランスファンド50 VA（適格機関投資家限定）	7,271,925,509円	6,896,514,050円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA（適格機関投資 家限定）	5,490,772,309円	5,376,282,397円
D I A Mグローバル・アセット ・バランスVA2（適格機関投 資家限定）	6,930,556,787円	7,067,524,414円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド30VA（適格 機関投資家限定）	4,735,244,023円	4,782,528,160円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA（適格機関投資家 向け）	4,252,778,602円	4,430,149,513円
D I A Mグローバル 私募ファン ド（適格機関投資家向け）	68,116,711円	57,674,003円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	264,757,976円	円
D I A M世界バランスファンド 55VA（適格機関投資家限 定）	19,210,077,485円	19,356,115,653円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド35VA（適格機 関投資家限定）	3,329,303,835円	3,198,492,340円
D I A Mグローバル分散ファン ドVA（適格機関投資家限定）	138,987,345円	145,100,301円

D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	24,321,797,768円	24,662,404,063円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A（適格機関投 資家限定）	2,470,487,028円	2,411,197,220円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A（適格機関投 資家限定）	4,423,500,876円	4,574,947,245円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	14,650,854,548円	15,063,905,369円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	168,745円	179,384円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	264,627円	274,212円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	19,200,854,775円	19,838,954,865円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	79,229円	84,710円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	161,851円	169,848円
（合 計）	218,946,599,573円	223,825,007,857円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	218,946,599,573口	223,825,007,857口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場及び株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p>	<p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左</p> <p>(2)派生商品評価勘定 同左</p>

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	35,359,431,353	15,824,531,452
投資信託受益証券	12,764,072	70,079,991
投資証券	646,973,221	28,825,338
合計	35,993,640,502	15,865,786,105

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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)

(株式関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	283,495,470	-	280,215,690	3,279,780
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	466,412,712	-	467,818,499	1,405,787
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	1,325,999,007	-	1,296,872,623	29,126,384
	英ポンド FTSE 100 INDEX	688,876,255	-	695,188,380	6,312,125
	FUTURE 米ドル S&P 500 FUTURE	3,384,732,390	-	3,435,800,863	51,068,473
	合 計	6,149,515,834	-	6,175,896,055	26,380,221

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	オーストラリアドル SPI 200 FUTURES	130,902,590	-	130,420,080	482,510
	カナダドル S&P/TSE 60 IX FUT	174,080,419	-	179,836,567	5,756,148
	ユーロ DJ EURO STOXX 50	561,166,620	-	576,085,160	14,918,540
	英ポンド FTSE 100 INDEX FUTURE	312,970,197	-	323,399,822	10,429,625
	米ドル S&P 500 FUTURE	1,696,068,454	-	1,730,544,008	34,475,554
	合 計	2,875,188,280	-	2,940,285,637	65,097,357

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（通貨関連）

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	オーストラリアドル	8,277,500	-	8,218,000	59,500
	カナダドル	16,719,800	-	16,674,000	45,800
	ユーロ	53,848,500	-	53,615,000	233,500
	英ポンド	25,788,200	-	25,796,000	7,800
	米ドル	154,617,863	-	154,233,656	384,207
	買建 ノルウェークローネ	87,932,263	-	87,872,400	59,863
合 計	347,184,126	-	346,409,056	655,344	

平成24年1月11日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	19,600,120	-	19,598,000	2,120
	英ポンド	11,888,780	-	11,888,000	780
	米ドル	30,756,000	-	30,752,000	4,000
	買建				
	ユーロ	39,226,920	-	39,196,000	30,920
	英ポンド	11,876,250	-	11,888,000	11,750
	米ドル	53,795,000	-	53,816,000	21,000
合計		167,143,070	-	167,138,000	8,730

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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おります。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買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電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2939円	1.1807円
（1万口当たり純資産額）	（12,939円）	（11,807円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	EVEREST RE GROUP LTD	8,102	86.470	700,579.940	
	PARTNERRE LTD	7,570	65.050	492,428.500	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,784	31.190	398,732.960	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8,493	73.470	623,980.710	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,065	37.430	1,162,762.950	
	BUNGE LTD	19,670	58.860	1,157,776.200	
	INVESCO LTD	81,821	21.620	1,768,970.020	
	ULTRA PETROLEUM CORP	22,514	28.950	651,780.300	
	ACE LTD	52,602	70.800	3,724,221.600	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	73,611	48.930	3,601,786.230	
	WEATHERFORD INTL LTD	134,715	15.950	2,148,704.250	
	NOBLE CORP	40,324	30.960	1,248,431.040	
	GARMIN LTD	20,043	40.760	816,952.680	
	TE CONNECTIVITY LTD	76,170	34.160	2,601,967.200	
	SCHLUMBERGER LTD	220,588	70.750	15,606,601.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY	71,207	18.600	1,324,450.200	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	22,783	56.360	1,284,049.880	
	XL GROUP PLC	53,089	20.290	1,077,175.810	
	INGERSOLL-RAND PLC	59,310	33.130	1,964,940.300	
	ACCENTURE PLC-CL A	104,286	52.630	5,488,572.180	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	33,560	38.990	1,308,504.400	
	WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	27,146	16.760	454,966.960	
	COVIDIEN PLC	75,986	46.120	3,504,474.320	
	HERBALIFE LTD	21,823	54.520	1,189,789.960	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,377	27.020	604,626.540	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	51,048	36.950	1,886,223.600	
	NIELSEN HOLDINGS NV	16,327	29.600	483,279.200	
	CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	80,171	33.480	2,684,125.080	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,408	5.970	659,135.760	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,354	30.650	1,052,950.100	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	1,027,000	0.655	672,685.000	
	AMAZON.COM INC	59,294	179.340	10,633,785.960	
	ABBOTT LABORATORIES	254,338	56.110	14,270,905.180	
	AES CORP	124,754	12.700	1,584,375.800	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	14,815	44.960	666,082.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	194,570	181.310	35,277,486.700	
	ADVANCED MICRO DEVICES	93,282	5.710	532,640.220	
	ADOBE SYSTEMS INC	81,219	29.200	2,371,594.800	

	AGCO CORP	14,077	49.840	701,597.680	
	AIRGAS INC	12,208	79.690	972,855.520	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,175	87.310	2,983,819.250	
	ENERGEN CORP	12,554	52.390	657,704.060	
	ALLERGAN INC	47,692	88.970	4,243,157.240	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	149,018	47.140	7,024,708.520	
	RALPH LAUREN CORP	9,673	147.320	1,425,026.360	
	ALLSTATE CORP	84,600	28.690	2,427,174.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	121,377	56.580	6,867,510.660	
	ALTERA CORPORATION	50,199	37.680	1,891,498.320	
	ALCOA INC	165,402	9.440	1,561,394.880	
	AMGEN INC	127,761	65.670	8,390,064.870	
	HESS CORP	47,762	58.560	2,796,942.720	
	BEAM INC	23,016	51.220	1,178,879.520	
	AMERICAN EXPRESS CO	181,425	48.670	8,829,954.750	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	75,772	41.260	3,126,352.720	
	AFLAC INC	73,710	43.870	3,233,657.700	
	AMERICAN INTL GROUP	82,528	25.070	2,068,976.960	
	ANALOG DEVICES	48,702	36.760	1,790,285.520	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	80,197	80.880	6,486,333.360	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	32,327	74.680	2,414,180.360	
	NABORS INDUSTRIES LTD	49,134	19.700	967,939.800	
	ARCH COAL INC	33,405	15.670	523,456.350	
	TIME WARNER	171,008	36.970	6,322,165.760	
	VALERO ENERGY CORP	88,182	20.080	1,770,694.560	
	APOLLO GROUP INC	22,785	56.920	1,296,922.200	
	APACHE CORP	61,668	98.090	6,049,014.120	
	APPLE INC	150,797	423.240	63,823,322.280	
	APPLIED MATERIALS INC	206,845	11.600	2,399,402.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,776	28.780	2,871,553.280	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	18,364	47.810	877,982.840	
	AMEREN CORP	51,264	32.290	1,655,314.560	
	ARROW ELECTRONICS INC	17,437	37.750	658,246.750	
	AUTOLIV INC	14,963	58.800	879,824.400	
	AUTODESK INC	38,885	32.530	1,264,929.050	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	77,786	54.660	4,251,782.760	
	AUTOZONE INC	4,387	340.140	1,492,194.180	
	AVERY DENNISON CORP	15,202	29.650	450,739.300	
	AVNET INC	22,835	32.160	734,373.600	
	AVON PRODUCTS INC	76,614	17.870	1,369,092.180	
	BMC SOFTWARE INC	28,920	31.650	915,318.000	
	BAKER HUGHES INC	69,228	51.950	3,596,394.600	
	BALL CORP	20,878	36.860	769,563.080	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	151,952	77.420	11,764,123.840	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	31,946	37.520	1,198,613.920	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	196,051	21.300	4,175,886.300	
	CR BARD INC	14,153	85.750	1,213,619.750	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	92,601	50.180	4,646,718.180	

BED BATH & BEYOND INC	38,406	60.640	2,328,939.840
BECTON DICKINSON & CO	34,887	74.220	2,589,313.140
AMETEK INC	25,735	44.030	1,133,112.050
NII HOLDINGS INC	31,218	21.280	664,319.040
VERIZON COMM INC	464,509	38.570	17,916,112.130
WR BERKLEY CORP	18,150	34.990	635,068.500
BEST BUY CO INC	59,621	24.720	1,473,831.120
YUM! BRANDS INC	75,823	59.990	4,548,621.770
FIRSTENERGY CORP	76,736	42.380	3,252,071.680
SLM CORP	92,921	13.770	1,279,522.170
H&R BLOCK INC	55,467	16.250	901,338.750
BOEING CO	112,465	75.000	8,434,875.000
ROBERT HALF INTL INC	24,240	28.900	700,536.000
BORGWARNER INC	16,519	72.250	1,193,497.750
BOSTON SCIENTIFIC CORP	268,520	5.530	1,484,915.600
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	26,111	67.370	1,759,098.070
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272,850	34.620	9,446,067.000
ONEOK INC	15,305	88.160	1,349,288.800
SEMPRA ENERGY	35,687	56.050	2,000,256.350
FEDEX CORP	48,665	88.510	4,307,339.150
VERISIGN INC	30,233	35.720	1,079,922.760
AMPHENOL CORP	24,477	47.980	1,174,406.460
BROWN-FORMAN CORP	13,755	80.300	1,104,526.500
QUANTA SERVICES INC	33,320	22.030	734,039.600
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,732	17.890	460,345.480
SIRIUS XM RADIO INC	614,899	2.050	1,260,542.950
CSX CORP	173,731	23.530	4,087,890.430
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	37,409	14.400	538,689.600
CABOT OIL & GAS CORP	16,699	78.370	1,308,700.630
CAMPBELL SOUP CO	30,602	32.400	991,504.800
WHITING PETROLEUM CORP	17,265	51.500	889,147.500
CONSTELLATION BRANDS INC	30,765	20.700	636,835.500
CARDINAL HEALTH INC	55,062	41.400	2,279,566.800
CATERPILLAR INC	105,480	99.960	10,543,780.800
CELGENE CORP	72,999	70.260	5,128,909.740
CITRIX SYSTEMS INC	30,333	64.110	1,944,648.630
CHESAPEAKE ENERGY CORP	120,200	23.280	2,798,256.000
CENTURYLINK INC	92,807	36.980	3,432,002.860
CERNER CORP	20,155	62.690	1,263,516.950
JPMORGAN CHASE & CO	635,306	36.050	22,902,781.300
CHUBB CORP	49,163	69.310	3,407,487.530
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,516	44.800	1,053,516.800
CIGNA CORP	38,955	45.670	1,779,074.850
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	31.320	745,541.280
CINTAS CORP	13,173	38.040	501,100.920
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	164,569	5.050	831,073.450
CISCO SYSTEMS INC	891,472	18.830	16,786,417.760
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	25,703	68.820	1,768,880.460

	CLOROX COMPANY	21,099	67.960	1,433,888.040	
	COCA-COLA CO/THE	338,528	69.340	23,473,531.520	
	COCA-COLA ENTERPRISES INC	49,318	25.720	1,268,458.960	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	78,864	89.450	7,054,384.800	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,730	32.700	1,397,271.000	
	AON CORP	46,043	46.740	2,152,049.820	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	110,849	24.890	2,759,031.610	
	COMERICA INC	31,637	28.490	901,338.130	
	NRG ENERGY, INC.	31,248	17.630	550,902.240	
	COMCAST CORP-CL A	337,071	25.400	8,561,603.400	
	CA INC	53,086	20.940	1,111,620.840	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,064	24.410	562,992.240	
	CONAGRA FOODS INC	66,889	26.970	1,803,996.330	
	CONSOLIDATED EDISON INC	47,195	59.340	2,800,551.300	
	SARA LEE CORP	90,891	18.910	1,718,748.810	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	38,217	52.260	1,997,220.420	
	MOLSON COORS BREWING CO	24,801	44.660	1,107,612.660	
	CORNING INC	249,781	13.990	3,494,436.190	
	DIRECTV	123,996	43.030	5,335,547.880	
	COVANCE INC	10,195	49.240	502,001.800	
	CREE INC	21,128	23.060	487,211.680	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	28,393	29.770	845,259.610	
	SEALED AIR CORP	30,348	17.480	530,483.040	
	BROADCOM CORP-CL A	76,142	31.230	2,377,914.660	
	CUMMINS INC	29,309	98.730	2,893,677.570	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,299	67.970	971,903.030	
	DR HORTON INC	39,483	13.480	532,230.840	
	DANAHER CORP	91,324	49.740	4,542,455.760	
	MOODY'S CORP	30,243	36.330	1,098,728.190	
	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	48,164	69.760	3,359,920.640	
	TARGET CORP	109,960	48.790	5,364,948.400	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	15,093	56.810	857,433.330	
	DEERE & CO	66,793	83.750	5,593,913.750	
	DELL INC	271,070	15.820	4,288,327.400	
	MORGAN STANLEY	246,338	16.890	4,160,648.820	
	REPUBLIC SERVICES INC	53,213	27.780	1,478,257.140	
	DEVRY INC	12,485	41.870	522,746.950	
	THE WALT DISNEY CO	286,288	39.630	11,345,593.440	
	DOLLAR TREE INC	18,954	82.700	1,567,495.800	
	RR DONNELLEY & SONS CO	36,360	14.620	531,583.200	
	DOVER CORP	27,697	59.180	1,639,108.460	
	DOW CHEMICAL	190,281	30.980	5,894,905.380	
	OMNICOM GROUP	42,885	45.300	1,942,690.500	
	DTE ENERGY CO	28,132	53.760	1,512,376.320	
	DUKE ENERGY CORP	213,159	21.470	4,576,523.730	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	50,667	46.130	2,337,268.710	

FLOWERVE CORP	8,844	105.270	931,007.880
DARDEN RESTAURANTS INC	21,227	44.380	942,054.260
EBAY INC	186,649	31.200	5,823,448.800
EMC CORP/MASS	330,575	21.880	7,232,981.000
BANK OF AMERICA CORP	1,630,623	6.630	10,811,030.490
EL PASO CORP	120,489	26.220	3,159,221.580
CITIGROUP INC	472,863	30.000	14,185,890.000
EASTMAN CHEMICAL CO	23,682	43.260	1,024,483.320
EATON CORP	51,780	47.740	2,471,977.200
EATON VANCE CORP	11,913	24.870	296,276.310
DISH NETWORK CORP	30,117	28.880	869,778.960
ECOLAB INC	54,723	58.880	3,222,090.240
ELECTRONIC ARTS INC	52,870	19.455	1,028,585.850
SALESFORCE.COM INC	22,101	104.790	2,315,963.790
EMERSON ELECTRIC CO	119,595	48.700	5,824,276.500
ENTERGY CORP	27,589	72.000	1,986,408.000
EOG RESOURCES INC	42,985	105.520	4,535,777.200
EQUIFAX INC	15,777	39.580	624,453.660
EQT CORP	21,454	53.680	1,151,650.720
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,944	112.100	2,123,622.400
EXPEDITORS INTERNATIONAL	34,083	42.510	1,448,868.330
EXPRESS SCRIPTS INC	78,777	49.670	3,912,853.590
EXXON MOBIL CORP	792,090	85.720	67,897,954.800
FMC CORP	9,929	89.050	884,177.450
NEXTERA ENERGY INC	67,434	59.250	3,995,464.500
FAMILY DOLLAR STORES	18,264	53.800	982,603.200
ASSURANT INC	14,771	40.530	598,668.630
FASTENAL CO	45,490	45.010	2,047,504.900
FIFTH THIRD BANCORP	148,746	13.850	2,060,132.100
M&T BANK CORP	20,397	80.140	1,634,615.580
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	18,192	35.970	654,366.240
FISERV INC	23,158	59.190	1,370,722.020
FLIR SYSTEMS INC	30,904	25.610	791,451.440
MACY'S INC	75,831	34.870	2,644,226.970
FORD MOTOR CO	572,755	11.800	6,758,509.000
FOREST LABORATORIES INC	51,204	31.060	1,590,396.240
FOSSIL INC	8,025	80.670	647,376.750
FRANKLIN RESOURCES INC	24,134	101.800	2,456,841.200
FREEMONT-MCMORAN COPPER&GOLD	154,165	40.600	6,259,099.000
GAP INC/THE	60,675	18.140	1,100,644.500
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	22,388	35.520	795,221.760
GENERAL DYNAMICS CORP	49,345	69.930	3,450,695.850
GENERAL MILLS INC	105,604	40.330	4,259,009.320
GENUINE PARTS CO	24,938	62.810	1,566,355.780
GILEAD SCIENCES INC	124,643	44.250	5,515,452.750
STARWOOD HOTELS&RESORTS	31,505	51.940	1,636,369.700
GOODRICH CORP	19,092	124.150	2,370,271.800
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,681	14.010	513,900.810

	MCKESSON CORP	40,111	79.680	3,196,044.480	
	NVIDIA CORP	106,802	14.480	1,546,492.960	
	GENERAL ELECTRIC CO	1,726,383	18.720	32,317,889.760	
	VW GRAINGER INC	8,547	191.260	1,634,699.220	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	22,545	47.990	1,081,934.550	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,927	46.170	1,104,709.590	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	41,880	28.250	1,183,110.000	
	HALLIBURTON CO	146,529	36.330	5,323,398.570	
	MONSTER BEVERAGE CORP	14,485	95.250	1,379,696.250	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,841	98.330	7,457,445.530	
	HARLEY-DAVIDSON INC	36,670	40.330	1,478,901.100	
	HARRIS CORP	21,855	37.900	828,304.500	
	CONSOL ENERGY INC	36,761	37.210	1,367,876.810	
	HASBRO INC	17,406	32.910	572,831.460	
	HENRY SCHEIN INC	13,991	66.700	933,199.700	
	DENBURY RESOURCES INC	68,370	18.080	1,236,129.600	
	HJ HEINZ CO	52,070	53.110	2,765,437.700	
	HELMERICH & PAYNE INC	15,984	65.130	1,041,037.920	
	HERSHEY FOODS CORP	25,491	61.000	1,554,951.000	
	HEWLETT-PACKARD CO	334,130	26.690	8,917,929.700	
	F5 NETWORKS INC	14,109	109.610	1,546,487.490	
	CROWN HOLDINGS INC NPR	29,491	33.820	997,385.620	
	REYNOLDS AMERICAN INC	62,992	41.150	2,592,120.800	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	18,519	44.250	819,465.750	
	JUNIPER NETWORKS INC	85,477	21.340	1,824,079.180	
	HOLLYFRONTIER CORP	35,010	26.060	912,360.600	
	HOLOGIC INC	49,195	18.750	922,406.250	
	UNUM GROUP	49,083	21.840	1,071,972.720	
	HOME DEPOT INC	256,367	43.530	11,159,655.510	
	HORMEL FOODS CORP	24,530	29.290	718,483.700	
	HUDSON CITY BANCORP INC	86,651	7.240	627,353.240	
	CENTERPOINT ENERGY INC	69,448	19.550	1,357,708.400	
	HUMANA INC	25,341	94.310	2,389,909.710	
	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	13,732	46.030	632,083.960	
	RED HAT INC	34,463	42.960	1,480,530.480	
	BIOGEN IDEC INC	36,831	114.880	4,231,145.280	
	ILLINOIS TOOL WORKS	70,431	48.680	3,428,581.080	
	INTUIT INC	44,821	54.750	2,453,949.750	
	INTEL CORP	859,574	25.590	21,996,498.660	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,144	54.060	710,564.640	
	INTL GAME TECH	44,449	17.300	768,967.700	
	INTERNATIONAL PAPER CO	67,397	31.320	2,110,874.040	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88,192	10.590	933,953.280	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,580	41.680	816,094.400	
	JOHNSON & JOHNSON	447,344	65.200	29,166,828.800	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	63,376	17.650	1,118,586.400	
	JOHNSON CONTROLS INC	100,080	34.360	3,438,748.800	

	KLA-TENCOR CORP	24,993	48.570	1,213,910.010	
	DEVON ENERGY CORP	65,607	65.700	4,310,379.900	
	NSTAR	17,088	44.530	760,928.640	
	KELLOGG CO	38,305	51.400	1,968,877.000	
	KEYCORP	176,901	8.140	1,439,974.140	
	KIMBERLY-CLARK CORP	62,968	72.880	4,589,107.840	
	BLACKROCK INC/NEW YORK	14,451	183.090	2,645,833.590	
	KOHL'S CORP	40,351	46.030	1,857,356.530	
	KROGER CO	94,372	24.320	2,295,127.040	
	LSI CORP	89,888	6.690	601,350.720	
	LAM RESEARCH CORP	20,796	39.000	811,044.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	33,115	33.140	1,097,431.100	
	LEGG MASON INC	22,970	25.500	585,735.000	
	LEGGETT & PLATT INC	19,896	22.410	445,869.360	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	30,757	25.230	775,999.110	
	ELI LILLY & CO	177,048	40.330	7,140,345.840	
	LIMITED BRANDS	42,413	39.240	1,664,286.120	
	LINCOLN NATIONAL CORP	59,469	21.190	1,260,148.110	
	LINEAR TECH CORP	29,706	30.840	916,133.040	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	118,780	74.190	8,812,288.200	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,045	39.100	2,269,559.500	
	LOCKHEED MARTIN CORP	50,289	80.620	4,054,299.180	
	LOEWS CORP	61,921	38.480	2,382,720.080	
	RANGE RESOURCES CORP	23,850	58.020	1,383,777.000	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	19,286	49.470	954,078.420	
	LOWE'S COS INC	206,337	26.430	5,453,486.910	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	88,598	51.290	4,544,191.420	
	IRON MOUNTAIN INC	33,638	32.080	1,079,107.040	
	SCANA CORP	15,400	44.300	682,220.000	
	MDU RESOURCES GROUP INC	32,188	21.500	692,042.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	66,033	11.440	755,417.520	
	MCCORMICK & CO INC	19,813	51.190	1,014,227.470	
	MCDONALD'S CORPORATION	170,451	99.700	16,993,964.700	
	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	45,478	47.750	2,171,574.500	
	MANPOWER INC	13,462	37.820	509,132.840	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	21,403	74.390	1,592,169.170	
	MARSH & MCLENNAN COS	85,095	31.030	2,640,497.850	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	11,343	78.200	887,022.600	
	MASCO CORP	58,195	11.460	666,914.700	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	74.770	381,476.540	
	MATTEL INC	56,682	28.840	1,634,708.880	
	METLIFE INC	170,890	34.550	5,904,249.500	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	52,075	26.310	1,370,093.250	
	MEDTRONIC INC	169,366	39.100	6,622,210.600	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	85,641	12.450	1,066,230.450	
	CVS CAREMARK CORP	217,764	41.950	9,135,199.800	

MERCK & CO. INC.	502,391	38.520	19,352,101.320
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,651	87.700	1,372,592.700
MICROSOFT CORP	1,227,806	27.840	34,182,119.040
MICRON TECH INC	164,842	7.250	1,195,104.500
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	35.990	965,179.820
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	94,204	15.620	1,471,466.480
3M CO	108,342	84.300	9,133,230.600
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,958	60.310	540,256.980
PROGRESS ENERGY INC	50,830	54.540	2,772,268.200
MOTOROLA SOLUTIONS INC	48,368	46.290	2,238,954.720
KANSAS CITY SOUTHERN	20,502	72.600	1,488,445.200
MURPHY OIL CORPORATION	30,207	59.200	1,788,254.400
MYLAN LABORATORIES	60,562	22.190	1,343,870.780
ILLUMINA INC	20,615	33.010	680,501.150
XCEL ENERGY INC	76,360	27.440	2,095,318.400
NATIONAL OILWELL VARCO INC	69,693	73.890	5,149,615.770
NETAPP INC	56,606	35.130	1,988,568.780
SEARS HOLDINGS CORP	6,881	30.460	209,595.260
NEWFIELD EXPLORATION CO	20,264	39.490	800,225.360
NEWELL RUBBERMAID INC	50,723	17.190	871,928.370
DUN & BRADSTREET CORP	8,370	77.570	649,260.900
NEWMONT MINING CORP	79,243	62.650	4,964,573.950
NIKE INC-CL B	58,194	98.470	5,730,363.180
NOBLE ENERGY INC	29,400	98.730	2,902,662.000
NORDSTROM INC	26,726	49.360	1,319,195.360
NORFOLK SOUTHERN CORP	56,818	77.720	4,415,894.960
NORTHEAST UTILITIES	29,133	34.470	1,004,214.510
NISOURCE INC	44,250	22.800	1,008,900.000
COACH INC	45,740	62.320	2,850,516.800
NORTHERN TRUST CORP	31,465	42.000	1,321,530.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	48,456	58.620	2,840,490.720
WELLS FARGO & CO	820,034	29.410	24,117,199.940
NUCOR CORP	49,784	41.580	2,070,018.720
MONSANTO CO	85,459	79.200	6,768,352.800
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	79,591	47.680	3,794,898.880
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	132,129	97.880	12,932,786.520
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22,143	80.900	1,791,368.700
OMNICARE INC	18,060	33.780	610,066.800
ORACLE CORP	658,279	26.970	17,753,784.630
OWENS-ILLINOIS INC	23,621	21.650	511,394.650
PACCAR INC	52,618	42.050	2,212,586.900
PALL CORP	19,300	58.020	1,119,786.000
EXELON CORP	102,041	41.120	4,195,925.920
PARKER HANNIFIN CORP	26,410	81.220	2,145,020.200
PATTERSON COS INC	12,490	29.670	370,578.300
PAYCHEX INC	46,374	31.100	1,442,231.400
JC PENNEY CO INC HOLDING CO	25,588	34.420	880,738.960
PPL CORPORATION	90,174	28.750	2,592,502.500

	PEPSICO INC	258,974	65.660	17,004,232.840	
	PENTAIR INC	14,352	36.080	517,820.160	
	PERRIGO CO	13,145	99.580	1,308,979.100	
	PFIZER INC	1,272,209	21.940	27,912,265.460	
	CONOCOPHILLIPS	214,603	73.280	15,726,107.840	
	PETSMART INC	18,380	52.370	962,560.600	
	PG&E CORP	62,245	41.130	2,560,136.850	
	PITNEY BOWES INC	40,682	19.180	780,280.760	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,254	97.660	1,685,025.640	
	ALTRIA GROUP INC	336,357	28.910	9,724,080.870	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	84,364	61.570	5,194,291.480	
	AETNA INC	56,047	44.320	2,484,003.040	
	FLUOR CORP (NEW)	31,879	53.010	1,689,905.790	
	PPG INDUSTRIES INC	25,285	86.140	2,178,049.900	
	PRAXAIR INC	47,744	107.580	5,136,299.520	
	PRECISION CASTPARTS CORP	25,232	175.160	4,419,637.120	
	COSTCO WHOLESALE CORP	72,742	79.150	5,757,529.300	
	T ROWE PRICE GROUP INC	40,535	60.410	2,448,719.350	
	QUEST DIAGNOSTICS	24,069	57.450	1,382,764.050	
	PROCTER & GAMBLE CO	449,329	66.330	29,803,992.570	
	PROGRESSIVE CORP	97,111	19.620	1,905,317.820	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79,277	31.570	2,502,774.890	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	70,124	13.220	927,039.280	
	QUALCOMM INC	271,677	55.750	15,145,992.750	
	US BANCORP	311,086	28.260	8,791,290.360	
	RALCORP HOLDINGS INC	9,036	86.790	784,234.440	
	ROSS STORES INC	38,750	50.310	1,949,512.500	
	ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,158	63.940	649,502.520	
	ROPER INDUSTRIES INC	16,209	91.650	1,485,554.850	
	ROWAN COS INC	21,239	31.780	674,975.420	
	PEABODY ENERGY CORP	41,483	36.050	1,495,462.150	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,328	74.860	1,746,334.080	
	RAYTHEON COMPANY	61,426	48.700	2,991,446.200	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	16,767	77.200	1,294,412.400	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,505	104.960	892,684.800	
	FMC TECHNOLOGIES INC	36,804	52.630	1,936,994.520	
	KRAFT FOODS INC-A	268,447	38.020	10,206,354.940	
	SANDISK CORP	38,624	50.780	1,961,326.720	
	SAFeway INC	56,305	21.400	1,204,927.000	
	ROCKWELL COLLINS INC	23,945	57.200	1,369,654.000	
	ST JUDE MEDICAL INC	49,860	35.490	1,769,531.400	
	THE TRAVELERS COMPANIES INC	68,088	60.100	4,092,088.800	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	44,008	27.170	1,195,697.360	
	PRICELINE.COM INC	7,926	484.280	3,838,403.280	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	165,176	12.310	2,033,316.560	
	JOY GLOBAL INC	16,611	81.890	1,360,274.790	

ZIMMER HOLDINGS INC	30,008	55.520	1,666,044.160	
SPX CORP	7,436	66.730	496,204.280	
SEI INVESTMENTS CO	31,573	18.120	572,102.760	
WELLPOINT INC	55,584	72.210	4,013,720.640	
AMERISOURCEBERGEN CORP	44,825	39.010	1,748,623.250	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,798	25.970	1,267,284.060	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,042	94.500	1,421,469.000	
SIGMA-ALDRICH	20,592	63.420	1,305,944.640	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	74,340	53.420	3,971,242.800	
ADVANCE AUTO PARTS	12,466	71.540	891,817.640	
UNITED STATES STEEL CORP	20,827	27.290	568,368.830	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	55,432	32.510	1,802,094.320	
EDISON INTERNATIONAL	46,526	40.490	1,883,837.740	
SOUTHERN CO	145,483	44.790	6,516,183.570	
BB&T CORP	102,369	26.730	2,736,323.370	
SOUTHWEST AIRLINES	47,976	8.710	417,870.960	
AT&T INC	968,742	29.760	28,829,761.920	
CHEVRON CORP	327,303	109.060	35,695,665.180	
MEADWESTVACO CORP	27,873	29.950	834,796.350	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29,304	71.850	2,105,492.400	

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	STAPLES INC	126,463	15.020	1,899,474.260	
	STATE STREET CORP	82,469	43.170	3,560,186.730	
	STARBUCKS CORP	116,933	46.820	5,474,803.060	
	STRYKER CORP	44,084	52.260	2,303,829.840	
	NETFLIX INC	7,832	95.830	750,540.560	
	SUNOCO INC	17,700	41.160	728,532.000	
	STERICYCLE INC	12,270	79.810	979,268.700	
	SUNTRUST BANKS INC	96,662	20.470	1,978,671.140	
	SYMANTEC CORP	108,592	15.910	1,727,698.720	
	SYNOPSYS INC	22,281	27.470	612,059.070	
	SYSCO CORP	92,867	29.200	2,711,716.400	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,872	450.190	2,643,515.680	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	185,622	30.670	5,693,026.740	
	TEXTRON INC	42,770	20.170	862,670.900	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	59,991	49.070	2,943,758.370	
	TIFFANY & CO	19,250	59.940	1,153,845.000	
	TOLL BROTHERS INC	20,812	22.500	468,270.000	
	TORCHMARK CORP	13,057	43.890	573,071.730	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	20.250	493,431.750	
	DAVITA INC	18,022	78.620	1,416,889.640	
	TYSON FOODS INC	47,556	20.330	966,813.480	
	URS CORP	17,162	37.350	641,000.700	
	MARATHON OIL CORP	110,823	31.080	3,444,378.840	
	UNION PACIFIC CORP	80,006	111.360	8,909,468.160	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	141,651	76.030	10,769,725.530	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	176,372	52.620	9,280,694.640	
	SPRINT NEXTEL CORP	516,213	2.230	1,151,154.990	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,206	69.510	1,265,499.060	
	VF CORP	12,611	133.990	1,689,747.890	
	CBS CORP	100,965	28.610	2,888,608.650	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,939	36.320	1,305,304.480	
	VULCAN MATERIALS CO	20,011	39.700	794,436.700	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,027	29.410	559,584.070	
	WALGREEN CO	146,465	34.400	5,038,396.000	
	WAL-MART STORES INC	311,734	59.040	18,404,775.360	
	WASTE MANAGEMENT INC	64,451	33.420	2,153,952.420	
	WATERS CORP	12,959	74.140	960,780.260	
	WASHINGTON POST	998	388.130	387,353.740	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	24,662	64.580	1,592,671.960	
	JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,084	78.800	1,425,019.200	
	WALTER INDUSTRIES INC	10,524	57.440	604,498.560	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	66,265	61.390	4,068,008.350	
	WESTERN DIGITAL CORP	42,329	33.530	1,419,291.370	
	WEYERHAEUSER CO	88,971	19.210	1,709,132.910	

	WHIRLPOOL CORP	11,190	51.830	579,977.700	
	WYNN RESORTS LTD	12,936	107.530	1,391,008.080	
	WHOLE FOODS MARKET INC	21,819	72.680	1,585,804.920	
	NASDAQ STOCK MARKET INC	18,704	25.170	470,779.680	
	CME GROUP INC	11,219	227.530	2,552,659.070	
	WILLIAMS COS INC	102,537	28.330	2,904,873.210	
	PEPCO HOLDINGS INC	36,572	20.110	735,462.920	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,827	43.420	774,048.340	
	WISCONSIN ENERGY CORP	35,977	34.510	1,241,566.270	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	23,108	37.740	872,095.920	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,983	52.930	687,190.190	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	40,324	16.810	677,846.440	
	CARMAX INC	38,348	30.930	1,186,103.640	
	XEROX CORP	243,920	8.110	1,978,191.200	
	XILINX INC	36,827	32.930	1,212,713.110	
	YAHOO! INC	204,636	15.510	3,173,904.360	
	CIMAREX ENERGY CO	12,720	61.190	778,336.800	
	TJX COMPANIES INC	62,811	65.560	4,117,889.160	
	HOSPIRA INC	25,220	30.350	765,427.000	
	GENWORTH FINANCIAL INC	73,428	7.270	533,821.560	
	CBRE GROUP INC	50,310	16.570	833,636.700	
	LIBERTY GLOBAL INC	17,272	42.510	734,232.720	
	REGIONS FINANCIAL CORP	233,614	4.700	1,097,985.800	
	GOOGLE INC	41,260	623.140	25,710,756.400	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	48,345	8.300	401,263.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	62,799	43.790	2,749,968.210	
	MOSAIC CO/THE	49,222	54.850	2,699,826.700	
	NEWS CORP CLASS B	72,381	18.920	1,369,448.520	
	NEWS CORP INC CLASS A	294,557	18.650	5,493,488.050	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	11,212	32.600	365,511.200	
	CELANESE CORP	24,956	45.750	1,141,737.000	
	WINDSTREAM CORP	100,523	11.760	1,182,150.480	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	37,286	21.330	795,310.380	
	IHS INC-CLASS A	8,495	91.110	773,979.450	
	DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	17,131	42.350	725,497.850	
	EXPEDIA INC	14,880	29.500	438,960.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,523	166.210	1,915,237.830	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	40,711	51.900	2,112,900.900	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	27,877	41.010	1,143,235.770	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	50,710	16.210	822,009.100	
	GAMESTOP CORP. - CL. A	23,332	24.230	565,334.360	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	13,552	113.910	1,543,708.320	
	VIACOM INC-CLASS B	84,583	46.930	3,969,480.190	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,315	341.120	1,471,932.800	
	UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	17,227	17.480	301,127.960	
	NYSE EURONEXT	43,767	27.790	1,216,284.930	
	VIRGIN MEDIA INC	47,938	22.850	1,095,383.300	

	MASTERCARD INC	18,319	348.830	6,390,216.770	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP	92,772	16.920	1,569,702.240	
	PHARMASSET INC	11,721	136.250	1,596,986.250	
	WESTERN UNION CO	102,998	18.600	1,915,762.800	
	SAIC INC	52,491	12.960	680,283.360	
	KBR INC	23,562	29.380	692,251.560	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	37,702	12.650	476,930.300	
	FIRST SOLAR INC	11,035	38.770	427,826.950	
	SPECTRA ENERGY CORP	100,338	30.600	3,070,342.800	
	TIME WARNER CABLE INC	53,147	64.300	3,417,352.100	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	59,253	13.440	796,360.320	
	DELTA AIR LINES INC	41,454	8.270	342,824.580	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	75.380	464,265.420	
	DISCOVER FINANCIAL	85,015	25.650	2,180,634.750	
	CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,891	102.410	1,524,987.310	
	LULULEMON ATHLETICA INC	16,598	59.870	993,722.260	
	VMWARE INC	15,614	85.300	1,331,874.200	
	TERADATA CORP	26,391	48.490	1,279,699.590	
	CALPINE CORP NPR	39,169	15.590	610,644.710	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL-W/I	287,035	77.320	22,193,546.200	
	VISA INC	83,874	99.800	8,370,625.200	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	39,931	38.620	1,542,135.220	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,725	31.390	901,677.750	
	LORILLARD INC	23,305	113.860	2,653,507.300	
	SCRIPPS NETWORKS INTERAC-W/I	17,233	44.880	773,417.040	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	22,552	38.140	860,133.280	
	MARATHON PETROLEUM CORP	60,615	31.830	1,929,375.450	
	CAREFUSION CORP	34,028	22.990	782,303.720	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	22,125	33.180	734,107.500	
	XYLEM INC	31,066	25.580	794,668.280	
	HCA HOLDINGS INC	33,601	22.460	754,678.460	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	48,273	38.270	1,847,407.710	
	VERISK ANALYTICS INC	25,396	39.770	1,009,998.920	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	33,053	71.830	2,374,196.990	
	CIT GROUP INC	30,698	37.110	1,139,202.780	
	DOLLAR GENERAL CORP	20,592	40.500	833,976.000	
	QEP RESOURCES INC	35,396	30.890	1,093,382.440	
	LIBERTY MEDIA CORP - LIBERTY CAPITAL	12,979	82.130	1,065,965.270	
	GENERAL MOTORS CO	116,861	23.240	2,715,849.640	
	ORCHARD SUPPLY PREFERRED	310	1.510	468.100	
米ドル小計	銘柄数 : 566	50,292,703		1,937,364,044.440	
	組入時価比率 : 56.37%			(148,963,921,377)	
	合計時価比率 : 57.03%				

英ポンド	XSTRATA PLC	332,865	10.430	3,471,781.950	
	AMEC PLC	62,610	9.920	621,091.200	
	ANTOFAGASTA PLC	58,006	12.960	751,757.760	
	SEVERN TRENT PLC	38,266	15.390	588,913.740	
	BHP BILLITON PLC	342,236	20.140	6,892,633.040	
	BARCLAYS PLC	1,948,510	1.883	3,669,044.330	
	BALFOUR BEATTY PLC	141,722	2.797	396,396.430	
	BT GROUP PLC	1,312,092	1.995	2,617,623.540	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	192,735	7.165	1,380,946.270	
	AGGREKO PLC	36,191	21.230	768,334.930	
	TULLOW OIL PLC	157,693	14.370	2,266,048.410	
	BUNZL PLC	38,195	9.065	346,237.670	
	CAPITA PLC	102,099	6.490	662,622.510	
	AVIVA PLC	441,178	3.070	1,354,416.460	
	DIAGEO PLC	398,398	14.160	5,641,315.680	
	SCHRODERS PLC	22,293	12.710	283,344.030	
	NATIONAL GRID PLC	559,198	6.315	3,531,335.370	
	LONMIN	24,209	9.750	236,037.750	
	GKN PLC	312,603	1.962	613,327.080	
	KINGFISHER PLC	332,300	2.550	847,365.000	
	BAE SYSTEMS PLC	506,678	3.041	1,540,807.790	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	321,407	30.285	9,733,810.990	
	MAN GROUP PLC	309,687	1.083	335,391.020	
	COBHAM PLC	215,276	1.845	397,184.220	
	NEXT PLC	28,133	25.900	728,644.700	
	REXAM PLC	138,079	3.715	512,963.480	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	161,212	24.150	3,893,269.800	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,474	20.000	609,480.000	
	SABMILLER PLC	152,390	23.395	3,565,164.050	
	ANGLO AMERICAN PLC	213,378	25.185	5,373,924.930	
	COMPASS GROUP PLC	297,929	6.125	1,824,815.120	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,905,537	5.047	14,664,245.230	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	911,820	1.070	975,647.400	
	ARM HOLDINGS PLC	215,348	6.040	1,300,701.920	
	CENTRICA PLC	793,221	2.875	2,280,510.370	
	UNILEVER PLC	207,565	21.510	4,464,723.150	
	MEGGITT PLC	151,642	3.577	542,423.430	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	359,061	3.097	1,112,011.910	
	INTL POWER PLC	244,870	3.470	849,698.900	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	105,557	6.140	648,119.980	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	442,155	1.090	481,948.950	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,767	11.320	642,602.440	
	PEARSON PLC	125,455	12.370	1,551,878.350	
	PRUDENTIAL PLC	406,510	6.520	2,650,445.200	
	RIO TINTO PLC	226,674	34.285	7,771,518.090	
	VODAFONE GROUP PLC	8,292,120	1.787	14,818,018.440	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,980	33.550	3,287,229.000	
	REED ELSEVIER PLC	180,949	5.175	936,411.070	

	OLD MUTUAL PLC	836,251	1.396	1,167,406.390	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	322,993	7.690	2,483,816.170	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,068,711	0.211	647,498.020	
	SSE PLC	153,744	13.010	2,000,209.440	
	SERCO GROUP PLC	72,250	5.120	369,920.000	
	BP PLC	3,080,901	4.796	14,776,001.190	
	SAGE GROUP PLC(THE)	220,158	3.004	661,354.630	
	INVENSYS PLC	163,653	2.148	351,526.640	
	SMITHS GROUP PLC	59,731	9.435	563,561.980	
	STANDARD CHARTERED PLC	384,438	14.325	5,507,074.350	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,572,100	0.273	1,794,183.300	
	TATE & LYLE PLC	87,522	7.130	624,031.860	
	BG GROUP PLC	548,796	14.780	8,111,204.880	
	TESCO PLC	1,284,831	3.900	5,010,840.900	
	3I GROUP PLC	187,027	1.745	326,362.110	
	SMITH & NEPHEW PLC	149,006	5.990	892,545.940	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	824,294	14.200	11,704,974.800	
	WEIR GROUP	34,823	21.920	763,320.160	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,945	8.010	239,859.450	
	BABCOCK INT'L GROUP	60,664	7.355	446,183.720	
	ASTRAZENECA PLC	219,774	30.245	6,647,064.630	
	WHITBREAD PLC	33,917	16.450	557,934.650	
	CARNIVAL PLC	30,375	21.930	666,123.750	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	284,440	3.177	903,665.880	
	INTERTEK GROUP PLC	28,006	21.010	588,406.060	
	BURBERRY GROUP PLC	78,941	12.790	1,009,655.390	
	INVESTEC PLC	74,705	3.411	254,818.750	
	CAIRN ENERGY	224,914	2.704	608,167.450	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	49,316	12.300	606,586.800	
	VEDANTA RESOURCES PLC	24,021	10.270	246,695.670	
	ICAP PLC	87,128	3.212	279,855.130	
	ITV PLC	657,334	0.718	471,965.810	
	SAINSBURY (J) PLC	190,870	3.059	583,871.330	
	G4S PLC	231,452	2.762	639,270.420	
	ADMIRAL GROUP PLC	44,675	8.435	376,833.620	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	589,874	24.020	14,168,773.480	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	437,493	24.890	10,889,200.770	
	INMARSAT PLC	80,402	4.240	340,904.480	
	KAZAKHMYS PLC	34,134	10.370	353,969.580	
	STANDARD LIFE PLC	325,057	2.037	662,141.100	
	EXPERIAN PLC	162,080	8.765	1,420,631.200	
	TUI TRAVEL PLC	100,036	1.595	159,557.420	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	46,617	7.195	335,409.310	
	FRESNILLO PLC NPR	33,218	17.320	575,335.760	
	RESOLUTION LTD	265,877	2.545	676,656.960	
	SHIRE PLC	89,740	21.800	1,956,332.000	
	WPP PLC	189,654	7.245	1,374,043.230	

	WOLSELEY PLC	51,052	21.100	1,077,197.200	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	14,969	72.200	1,080,761.800	
	PETROFAC LTD	43,902	15.700	689,261.400	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	141,303	4.017	567,614.150	
英債券小計	銘柄数 : 99	47,958,387		233,644,744.190	
	組入時価比率 : 10.51%			(27,778,023,637)	
	合計時価比率 : 10.63%				
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES LTD	27,787	38.890	1,080,636.430	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	24,971	30.500	761,615.500	
	BARRICK GOLD CORP	159,936	49.220	7,872,049.920	
	TMX GROUP INC	14,916	41.850	624,234.600	
	TALISMAN ENERGY INC	167,312	12.490	2,089,726.880	
	BANK OF MONTREAL	102,997	58.240	5,998,545.280	
	BANK OF NOVA SCOTIA	173,004	51.870	8,973,717.480	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,510	71.960	1,835,699.600	
	BCE INC	45,085	41.830	1,885,905.550	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	96,756	28.790	2,785,605.240	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	50,390	50.490	2,544,191.100	
	BOMBARDIER INC 'B'	240,632	4.160	1,001,029.120	
	SAPUTO INC	23,636	38.300	905,258.800	
	RESEARCH IN MOTION LTD	79,152	15.770	1,248,227.040	
	CGI GROUP INC	29,163	18.420	537,182.460	
	CAE INC	53,145	10.150	539,421.750	
	CAMECO CORP	69,632	19.070	1,327,882.240	
	ROGERS COMM-CL B	65,502	38.730	2,536,892.460	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,175	74.930	4,658,772.750	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	179,282	39.510	7,083,431.820	
	NEXEN INC	86,198	18.400	1,586,043.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	12,753	65.380	833,791.140	
	CANADIAN UTILITIES LTD	13,725	60.300	827,617.500	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,527	79.150	5,740,512.050	
	AGRIUM INC	22,588	75.160	1,697,714.080	
	YAMANA GOLD INC	115,290	15.550	1,792,759.500	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,729	20.960	497,359.840	
	OPEN TEXT CORP	9,281	50.600	469,618.600	
	ELDORADO GOLD CORP	89,925	14.600	1,312,905.000	
	OSISKO MINING CORP	52,038	11.080	576,581.040	
	EMPIRE CO LTD	6,539	57.700	377,300.300	
	KINROSS GOLD CORP	173,556	13.020	2,259,699.120	
	FINNING INTERNATIONAL INC	30,080	23.020	692,441.600	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	17,487	22.110	386,637.570	
	FORTIS INC	29,702	33.040	981,354.080	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,329	23.100	1,624,599.900	
	TELUS CORP-NON VOTE	31,757	53.610	1,702,492.770	
	GREAT WEST LIFECO INC	50,480	20.770	1,048,469.600	
	IAMGOLD CORP	65,070	17.680	1,150,437.600	
	IMPERIAL OIL LTD	50,996	47.080	2,400,891.680	

	ENBRIDGE INC	118,128	37.420	4,420,349.760	
	IGM FINANCIAL INC	19,774	44.050	871,044.700	
	IVANHOE MINES LTD/CA	49,079	18.950	930,047.050	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	268,208	11.570	3,103,166.560	
	LOBLAW CO LTD	17,526	37.000	648,462.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,573	21.980	935,754.540	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	18,285	25.740	470,655.900	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	36,714	38.320	1,406,880.480	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	83,291	19.940	1,660,822.540	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,579	430.490	1,540,723.710	
	INMET MINING CORPORATION	10,004	65.630	656,562.520	
	METRO INC	13,859	52.930	733,556.870	
	HUSKY ENERGY INC	57,774	24.420	1,410,841.080	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,557	45.610	1,621,754.770	
	NIKO RESOURCES LTD	9,961	48.600	484,104.600	
	ONEX CORP	17,569	33.410	586,980.290	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	21,311	23.300	496,546.300	
	GOLDCORP INC	132,052	45.830	6,051,943.160	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	137,099	44.360	6,081,711.640	
	POWER CORP OF CANADA	48,941	23.490	1,149,624.090	
	POWER FINANCIAL CORP	43,517	25.320	1,101,850.440	
	ROYAL BANK OF CANADA	235,240	52.430	12,333,633.200	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	53.480	1,122,331.280	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,563	68.670	1,686,741.210	
	SHAW COMM INC-B	56,820	20.580	1,169,355.600	
	SINO-FOREST CORP	38,862	4.810	186,926.220	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	34,176	41.480	1,417,620.480	
	NEW GOLD INC	62,801	11.210	703,999.210	
	SUNCOR ENERGY INC	250,475	32.820	8,220,589.500	
	ENCANA CORP	112,909	18.860	2,129,463.740	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	91,181	38.650	3,524,145.650	
	THOMSON REUTERS CORP	62,106	28.370	1,761,947.220	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	146,225	76.830	11,234,466.750	
	TRANSCANADA CORP	113,590	42.790	4,860,516.100	
	TRANSALTA CORP	34,014	21.020	714,974.280	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,627	65.960	503,076.920	
	CENTERRA GOLD INC	34,094	19.150	652,900.100	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	34,783	12.560	436,874.480	
	INTACT FINANCIAL CORP	25,325	55.840	1,414,148.000	
	SILVER WHEATON CORP	66,626	31.590	2,104,715.340	
	VITERRA INC NPR	46,498	10.720	498,458.560	
	PRECISION DRILLING CORP	49,510	11.400	564,414.000	
	BELL ALIANT INC	14,926	27.960	417,330.960	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	19,093	40.500	773,266.500	

	CI FINANCIAL CORP	26,281	20.740	545,067.940	
	TOURMALINE OIL CORP	15,696	26.360	413,746.560	
	PEMBINA PIPELINE CORP	31,058	29.310	910,309.980	
	TIM HORTONS INC	28,835	47.840	1,379,466.400	
	BAYTEX ENERGY CORP	18,200	57.350	1,043,770.000	
	MEG ENERGY CORP	24,271	40.830	990,984.930	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	60,247	11.920	718,144.240	
	GENOVUS ENERGY INC W/I	118,611	34.950	4,145,454.450	
	ENERPLUS CORP	28,113	25.910	728,407.830	
	VERMILION ENERGY INC	10,515	46.630	490,314.450	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	74,986	21.170	1,587,453.620	
	ARC RESOURCES LTD	42,391	24.300	1,030,101.300	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	76,612	23.730	1,818,002.760	
	BONAVISTA ENERGY CORP	22,644	25.630	580,365.720	
	PENGROWTH ENERGY CORP	55,901	11.180	624,973.180	
カナダドル小計	銘柄数 : 99	6,116,625		196,051,093.850	
	組入時価比率 : 5.60%			(14,809,699,629)	
	合計時価比率 : 5.67%				
スイスフラン	GAM HOLDING LTD	38,728	10.000	387,280.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	181,466	21.520	3,905,148.320	
	SYNGENTA AG	14,963	285.000	4,264,455.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	540,194	54.800	29,602,631.200	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	83,325	51.000	4,249,575.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	113,908	163.200	18,589,785.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,515	109.300	930,689.500	
	SIKA INHABER	363	1,877.000	681,351.000	
	SGS SOC GEN SURVEILLANCE HLD	861	1,620.000	1,394,820.000	
	SULZER AG-REG	4,948	107.000	529,436.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	378,588	54.150	20,500,540.200	
	BALOISE HOLDING AG -R	8,984	64.300	577,671.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	928.000	361,920.000	
	SWISSCOM AG-REG	4,052	356.600	1,444,943.200	
	ABB LTD	350,365	18.750	6,569,343.750	
	ADECCO SA-REG	19,348	42.160	815,711.680	
	GEBERIT AG	4,882	185.600	906,099.200	
	LONZA GROUP AG-REG	9,112	59.150	538,974.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	183	2,747.000	502,701.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	31,400.000	628,000.000	
	UBS AG-REGISTERED	578,179	11.080	6,406,223.320	
	GIVAUDAN-REG	1,382	870.000	1,202,340.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	23,106	217.400	5,023,244.400	
	HOLCIM LTD-REG	37,527	50.850	1,908,247.950	
	ACTELION	19,725	32.600	643,035.000	
	SONOVA HOLDING AG	8,743	93.800	820,093.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,380	105.800	675,004.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	2,017	160.500	323,728.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,734	374.400	2,146,809.600	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	904	65.100	58,850.400	
	SCHINDLER NAMEN	3,701	108.900	403,038.900	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,331	83.900	531,170.900	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,737	158.000	432,446.000	
	ARYZTA AG	13,689	45.900	628,325.100	
	JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	35.940	1,109,575.620	
	SWISS RE LTD	56,205	49.330	2,772,592.650	
	TRANSOCEAN LTD	54,450	37.740	2,054,943.000	
	SYNTHESE INC	12,220	158.300	1,934,426.000	
スイスフラン 小計	銘柄数 : 38	2,627,098		126,455,171.390	
	組入時価比率 : 3.87%			(10,223,900,607)	
	合計時価比率 : 3.91%				
スウェーデン クローネ	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	13,005	697.000	9,064,485.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	119,574	157.700	18,856,819.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,097	139.300	8,928,712.100	
	ERICSSON LM-B SHS	501,760	67.900	34,069,504.000	
	GETINGE AB-B SHS	31,964	173.000	5,529,772.000	
	SKF AB-B SHS	55,959	150.100	8,399,445.900	
	SANDVIK AB	161,874	92.000	14,892,408.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	214,074	40.490	8,667,856.260	
	SKANSKA AB-B SHS	58,507	118.500	6,933,079.500	
	SWEDBANK AB	125,939	95.400	12,014,580.600	
	SSAB AB-A	32,561	69.200	2,253,221.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	75,229	105.200	7,914,090.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,081	188.300	14,137,752.300	
	VOLVO AB-B SHS	241,404	81.400	19,650,285.600	
	HOLMEN AB-B SHS	13,305	202.500	2,694,262.500	
	SCANIA AB	49,676	110.300	5,479,262.800	
	SWEDISH MATCH AB	38,399	243.000	9,330,957.000	
	TELE2 AB-B SHS	49,717	133.400	6,632,247.800	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	9,101	323.200	2,941,443.200	
	NORDEA AB	446,262	54.000	24,098,148.000	
	INDUSTRIVARDEN C	26,391	88.000	2,322,408.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	38,584	113.500	4,379,284.000	
	SECURITAS AB-B SHS	53,055	62.950	3,339,812.250	
	INVESTOR AB-B SHS	81,125	132.700	10,765,287.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	162,271	221.100	35,878,118.100	
	ASSA ABLOY AB-B	43,425	177.500	7,707,937.500	
	TELIASONERA AB	311,185	45.560	14,177,588.600	
	LUNDIN PETROLEUM AB	40,808	184.000	7,508,672.000	
	BOLIDEN AB	44,557	113.000	5,034,941.000	
	ALFA LAVAL AB	45,040	135.300	6,093,912.000	
	KINNEVIK INVESTMENT B	33,473	135.300	4,528,896.900	
	HUSQVARNA AB-B SHS	91,308	34.960	3,192,127.680	
	RATOS AB	34,246	84.700	2,900,636.200	
	HEXAGON AB	45,953	113.100	5,197,284.300	

スウェーデン クローネ小計	銘柄数 : 34	3,428,909		335,515,240.390	
	組入時価比率 : 1.41%			(3,730,929,473)	
	合計時価比率 : 1.43%				
ユーロ	TELEKOM AUSTRIA AG	59,022	9.066	535,093.450	
	OMV AG	24,898	24.285	604,647.930	
	VERBUND AG	15,466	20.090	310,711.940	
	VOEST-ALPINE AG	17,613	23.505	413,993.560	
	ERSTE GROUP BANK AG	33,508	12.365	414,326.420	
	IMMOFINANZ AG	152,609	2.231	340,470.670	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	19.145	174,200.350	
	UMICORE	18,212	33.955	618,388.460	
	DELHAIZE GROUP	18,413	45.600	839,632.800	
	KBC BANKVERZEKERINGSHOLDING	27,003	9.300	251,127.900	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	128,599	47.930	6,163,750.070	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
	SOLVAY SA	8,874	65.010	576,898.740	
	MOBISTAR SA	5,958	40.005	238,349.790	
	AGEAS	411,212	1.246	512,370.150	
	UCB SA	18,529	32.515	602,470.430	
	COLRUYT NV	14,070	29.575	416,120.250	
	BEKAERT NV	7,702	27.470	211,573.940	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,830	52.950	679,348.500	
	GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.002	1.030	
	BELGACOM SA	23,896	24.350	581,867.600	
	ADIDAS AG	36,120	53.520	1,933,142.400	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	52,537	58.720	3,084,972.640	
	COMMERZBANK AG	605,908	1.235	748,296.380	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	19,745	74.980	1,480,480.100	
	UNITED INTERNET	18,350	14.020	257,267.000	
	MAN SE	10,044	74.720	750,487.680	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	12,421	38.405	477,028.500	
	GEA GROUP AG	28,135	23.060	648,793.100	
	CONTINENTAL AG	13,432	56.370	757,161.840	
	DEUTSCHE POST AG-REG	142,801	12.545	1,791,438.540	
	AXEL SPRINGER AG	6,021	35.000	210,735.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	25,205	41.965	1,057,727.820	
	MERCK KGAA	9,951	77.650	772,695.150	
	RWE AG	77,047	28.550	2,199,691.850	
	SAP AG	152,859	42.065	6,430,013.830	
	E.ON AG	289,445	16.865	4,881,489.920	
	HENKEL AG & CO KGAA	20,540	37.905	778,568.700	
	METRO AG	22,519	29.310	660,031.890	
	SIEMENS AG-REG	132,214	75.750	10,015,210.500	
	BAYER AG	131,788	53.890	7,102,055.320	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31,566	45.485	1,435,779.510	

	DAIMLER AG	143,802	38.260	5,501,864.520	
	BASF SE	147,554	57.490	8,482,879.460	
	CELESIO AG	16,256	13.445	218,561.920	
	BEIERSDORF AG	17,671	44.435	785,210.880	
	HOCHTIEF AG	7,587	45.360	344,146.320	
	HEIDELBERGCEMENT AG	21,539	34.955	752,895.740	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	31,792	54.940	1,746,652.480	
	ALLIANZ SE	72,704	76.020	5,526,958.080	
	PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	13,630	14.895	203,018.850	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,971	8.938	357,260.790	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	29,962	95.790	2,870,059.980	
	SALZGITTER	7,018	41.385	290,439.930	
	VOLKSWAGEN AG	5,402	112.150	605,834.300	
	VOLKSWAGEN AG PFD	23,174	125.700	2,912,971.800	
	THYSSENKRUPP AG	55,869	19.460	1,087,210.740	
	LINDE AG	29,120	119.750	3,487,120.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	148,629	27.480	4,084,324.920	

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	BMW VORZUG	11,145	40.425	450,536.620	
	K & S	30,163	36.830	1,110,903.290	
	SUEDZUCKER AG	11,866	24.715	293,268.190	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	447,100	8.963	4,007,357.300	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	191,316	6.294	1,204,142.900	
	FRAPORT AG	6,165	39.790	245,305.350	
	LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	14,055	45.410	638,237.550	
	WACKER-CHEMIE GMBH	3,025	70.000	211,750.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG NEW	32,038	41.655	1,334,542.890	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	15,026	41.385	621,851.010	
	BRENNTAG AG	6,654	76.730	510,561.420	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	63,071	12.655	798,163.500	
	IBERDROLA SA	658,233	4.688	3,085,796.300	
	INDRA SISTEMAS SA	16,340	10.140	165,687.600	
	REPSOL YPF SA	118,170	23.540	2,781,721.800	
	TELEFONICA S.A	658,705	13.360	8,800,298.800	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,133	22.505	520,608.160	
	BANKINTER S.A.	34,675	4.764	165,191.700	
	ACERINOX SA	16,481	10.375	170,990.370	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	728,423	6.285	4,578,138.550	
	ACCIONA S.A.	5,285	63.120	333,589.200	
	GAS NATURAL SDG SA	57,849	12.950	749,144.550	
	BANCO SANTANDER SA	1,354,682	5.740	7,775,874.680	
	RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	20,735	33.525	695,140.870	
	ZARDOYA OTIS	20,589	10.910	224,625.990	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	8,715	18.880	164,539.200	
	BANCO POPULAR ESPANOL	146,617	3.392	497,324.860	
	BANCO SABADELL	179,119	2.687	481,292.750	
	INDITEX	36,724	65.450	2,403,585.800	
	MAPFRE SA	135,413	2.541	344,084.430	
	ENAGAS	25,191	14.295	360,105.340	
	GRIFOLS SA	24,523	13.020	319,289.460	
	FERROVIAL SA	63,117	9.424	594,814.600	
	CAIXABANK	149,185	3.769	562,278.260	
	AMADEUS IT HOLDING SA	52,881	12.895	681,900.490	
	IBERDROLA SA	658,233	0.147	96,760.250	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	151,868	1.775	269,565.700	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	111,285	3.654	406,635.390	

	BANKIA SAU	140,798	3.550	499,832.900	
	KESKO OYJ-B	13,297	26.280	349,445.160	
	WARTSILA OYJ	26,436	24.560	649,268.160	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	21,730	26.650	579,104.500	
	UPM-KYMMENE OYJ	93,053	9.000	837,477.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	108,663	5.165	561,244.390	
	SAMPO OYJ-A SHS	59,871	18.970	1,135,752.870	
	FORTUM OYJ	79,645	16.240	1,293,434.800	
	NOKIA OYJ	597,512	4.248	2,538,230.970	
	ELISA CORP	25,398	16.420	417,035.160	
	METSO OYJ	21,261	30.400	646,334.400	
	NESTE OIL OYJ	23,509	8.510	200,061.590	
	KONE OYJ	28,457	41.650	1,185,234.050	
	ORION OYJ	17,482	15.350	268,348.700	
	AIR LIQUIDE	45,890	97.960	4,495,384.400	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,253	25.030	1,658,312.590	
	AXA	266,452	10.265	2,735,129.780	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	68,396	8.198	560,710.400	
	DANONE	92,643	48.890	4,529,316.270	
	SAFRAN SA	25,102	23.520	590,399.040	
	ACCOR SA	26,806	19.755	529,552.530	
	BOUYGUES	30,754	23.240	714,722.960	
	BNP PARIBAS	154,692	29.585	4,576,562.820	
	THALES SA	19,494	23.890	465,711.660	
	CAP GEMINI SA	24,414	25.295	617,552.130	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	64.480	423,440.160	
	CHRISTIAN DIOR	9,796	98.120	961,183.520	
	COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	23,542	20.075	472,605.650	
	ALCATEL-LUCENT	384,592	1.269	488,047.240	
	NATIXIS	164,630	1.890	311,150.700	
	EIFFAGE	8,253	19.850	163,822.050	
	PUBLICIS GROUPE	25,533	37.460	956,466.180	
	IMERYS SA	7,765	37.220	289,013.300	
	LAFARGE SA	28,285	27.700	783,494.500	
	L'OREAL	38,417	82.950	3,186,690.150	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	40,582	115.200	4,675,046.400	
	LAGARDERE S.C.A.	21,125	21.030	444,258.750	
	MICHELIN(CGDE)-B	27,685	47.995	1,328,741.570	
	PERNOD-RICARD	34,206	74.330	2,542,531.980	
	PEUGEOT SA	30,300	12.920	391,476.000	
	RENAULT SA	35,257	29.495	1,039,905.210	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,891	30.900	1,912,431.900	
	SOCIETE GENERALE-A	111,856	15.745	1,761,172.720	
	VINCI S.A.	67,944	35.000	2,378,040.000	
	SODEXO	11,780	56.210	662,153.800	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	77,535	44.560	3,454,959.600	

VIVENDI SA	197,714	16.280	3,218,783.920
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	15,942	73.870	1,177,635.540
TELEVISION FRANCAISE(T.F.1)	24,183	7.693	186,039.810
TOTAL SA	344,864	40.440	13,946,300.160
VALLOUREC	20,400	52.690	1,074,876.000
FRANCE TELECOM SA	295,145	11.875	3,504,846.870
BIC	6,136	67.790	415,959.440
DASSAULT SYSTEMES SA	9,862	62.310	614,501.220
PPR	11,855	118.000	1,398,890.000
NEOPOST SA	6,482	53.720	348,213.040
CARREFOUR SA	85,148	16.850	1,434,743.800
ATOS	9,475	35.335	334,799.120
SANOFI	185,780	56.750	10,543,015.000
STMICROELECTRONICS NV	97,120	5.060	491,427.200
JC DECAUX INTERNATIONAL	11,841	17.795	210,710.590
ESSILOR INTL	31,399	56.360	1,769,647.640
CREDIT AGRICOLE SA	172,905	4.117	711,849.880
WENDEL	6,630	52.980	351,257.400
ILIAD SA	3,765	97.670	367,727.550
GDF SUEZ	198,651	21.360	4,243,185.360
ALSTOM	33,600	23.195	779,352.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	29.850	520,882.500
ELECTRICITE DE FRANCE	44,581	18.025	803,572.520
ARKEMA SA	9,569	56.470	540,361.430
LEGRAND SA	41,030	25.500	1,046,265.000
ADP	6,435	53.570	344,722.950
SCOR SE	35,430	17.850	632,425.500
BUREAU VERITAS SA	7,690	57.200	439,868.000
GROUPE EUROTUNNEL SA	89,249	5.299	472,930.450
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	58,532	8.667	507,296.840
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310
EDENRED	27,224	19.210	522,973.040
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	32,274	12.970	418,593.780
NATIONAL BANK OF GREECE	170,555	1.310	223,427.050
OPAP SA	41,034	6.250	256,462.500
CRH PLC	121,874	15.285	1,862,844.090
KERRY GROUP PLC-A	24,173	29.170	705,126.410
ELAN CORPORATION PLC	89,094	10.800	962,215.200
IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.132	12,053.710
ASSICURAZIONI GENERALI	177,127	11.930	2,113,125.110
INTESA SANPAOLO	1,783,476	1.174	2,093,800.820
UNICREDIT SPA	226,755	2.424	549,654.120
ENI SPA	384,840	16.600	6,388,344.000
MEDIOBANCA SPA	81,452	3.978	324,016.050
PIRELLI & C	48,668	6.940	337,755.920
SAIPEM	41,590	35.330	1,469,374.700
LUXOTTICA GROUP SPA	22,387	22.620	506,393.940
MEDIASET SPA	117,464	2.080	244,325.120

AUTOGRILL SPA	20,544	7.645	157,058.880
A2A SPA	273,914	0.729	199,683.300
FIAT SPA	119,079	3.936	468,694.940
ENEL SPA	1,035,843	3.124	3,235,973.530
FINMECCANICA SPA	70,788	2.790	197,498.520
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	804,540	0.197	158,494.380
SNAM SPA	270,029	3.372	910,537.780
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	137,041	2.846	390,018.680
TELECOM ITALIA SPA	1,374,164	0.845	1,161,168.580
TELECOM ITALIA-RNC	1,110,927	0.708	786,536.310
ATLANTIA SPA	54,105	12.350	668,196.750
TERNA SPA	234,235	2.756	645,551.660
EXOR SPA	9,585	15.860	152,018.100
PRYSMIAN SPA	37,609	10.230	384,740.070
BANCO POPOLARE SPA	305,979	0.847	259,164.210
ENEL GREEN POWER SPA	319,809	1.620	518,090.580
FIAT INDUSTRIAL SPA	119,079	7.080	843,079.320
UNICREDIT SPA RTS	226,755	0.850	192,741.750
ARCELOR MITTAL (NL)	147,189	15.040	2,213,722.560
TENARIS SA	82,125	15.280	1,254,870.000
SES FDR	46,853	18.205	852,958.860
BOSKALIS WESTMINSTER CT	13,745	28.690	394,344.050
REED ELSEVIER NV	112,391	8.972	1,008,372.050
KONINKLIJKE DSM NV	19,732	37.140	732,846.480
SBM OFFSHORE NV	23,374	15.750	368,140.500
ING GROEP NV-CVA	639,027	5.787	3,698,049.240
RANDSTAD HOLDINGS	21,850	24.495	535,215.750
KONINKLIJKE AHOLD NV	179,713	10.355	1,860,928.110
HEINEKEN NV	43,858	36.930	1,619,675.940
AKZO NOBEL	35,469	39.020	1,384,000.380
ASML HOLDING NV	68,040	32.480	2,209,939.200
AEGON NV	277,959	3.274	910,037.760
UNILEVER NV-CVA	264,948	26.585	7,043,642.580
PHILIPS ELECTRONICS NV	158,542	14.910	2,363,861.220
WOLTERS KLUWER-CVA	49,896	13.395	668,356.920
QIAGEN N.V.	39,540	11.550	456,687.000
VOPAK (KON.)	11,504	42.790	492,256.160
KONINKLIJKE KPN NV	251,126	8.635	2,168,473.010
HEINEKEN HOLDING NV-A	18,770	32.335	606,927.950
FUGRO CERT	10,228	48.245	493,449.860
TNT EXPRESS NV W/I	61,074	5.974	364,856.070
DELTA LLOYD NV	19,898	12.570	250,117.860
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	112,619	1.180	132,890.420
JERONIMO MARTINS	40,183	13.020	523,182.660
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	120,094	4.270	512,801.380

	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,886	2.352	740,611.870	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	43,777	12.790	559,907.830	
ユーロ小計	銘柄数 : 238	28,597,028		330,305,204.100	
	組入時価比率 : 12.25%			(32,369,910,002)	
	合計時価比率 : 12.39%				
デンマーク ローネ	CARLSBERG AS-B	17,266	441.300	7,619,485.800	
	A P MOLLER A/S	215	38,520.000	8,281,800.000	
	AP MOLLER MAERSK A	100	36,900.000	3,690,000.000	
	DANSKE BANK A/S	108,499	75.950	8,240,499.050	
	NOVOZYMES-B SHS	40,415	177.200	7,161,538.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	67,866	692.000	46,963,272.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35,696	61.150	2,182,810.400	
	TDC A/S	58,423	46.070	2,691,547.610	
	COLOPLAST-B	4,175	844.000	3,523,700.000	
	DSV A/S	29,112	112.400	3,272,188.800	
	WILLIAM DEMANT	4,646	471.900	2,192,447.400	
	TRYG A/S	4,793	317.900	1,523,694.700	
デンマーク ローネ小計	銘柄数 : 12	371,206		97,342,983.760	
	組入時価比率 : 0.49%			(1,282,980,526)	
	合計時価比率 : 0.49%				
ノルウェー ローネ	SEADRILL LTD	46,984	208.400	9,791,465.600	
	ACERGY SA	53,986	120.100	6,483,718.600	
	DNB ASA	136,403	60.600	8,266,021.800	
	NORSK HYDRO ASA	138,196	29.500	4,076,782.000	
	TELENOR ASA	123,877	96.300	11,929,355.100	
	ORKLA ASA	129,845	44.590	5,789,788.550	
	STATOIL ASA	181,422	155.000	28,120,410.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,891	255.500	7,381,650.500	
	AKER SOLUTIONS ASA	36,670	68.550	2,513,728.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	43,012	68.450	2,944,171.400	
ノルウェー ローネ小計	銘柄数 : 10	919,286		87,297,092.050	
	組入時価比率 : 0.42%			(1,117,402,778)	
	合計時価比率 : 0.43%				
香港ドル	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	136,000	25.000	3,400,000.000	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	43,000	43.500	1,870,500.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS	408,000	4.710	1,921,680.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	358,000	23.400	8,377,200.000	
	BANK OF EAST ASIA	262,660	29.000	7,617,140.000	
	CLP HOLDINGS LTD	311,500	66.700	20,777,050.000	
	PCCW LTD	734,000	2.360	1,732,240.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	13.800	2,911,800.000	

	LI & FUNG LTD	964,400	15.660	15,102,504.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	223,000	94.100	20,984,300.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	95,000	45.800	4,351,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	156,400	123.200	19,268,480.000	
	MTR CORP	245,000	25.250	6,186,250.000	
	FIRST PACIFIC CO	380,000	8.800	3,344,000.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	44.200	5,967,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	132,400	93.350	12,359,540.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	173,000	39.950	6,911,350.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	246,500	58.150	14,333,975.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	267,750	37.750	10,107,562.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	834,050	18.360	15,313,158.000	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	343,000	67.000	22,981,000.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	127,000	26.250	3,333,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	237,000	14.440	3,422,280.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	137,000	26.050	3,568,850.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	644,500	18.820	12,129,490.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	668,700	6.840	4,573,908.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.400	3,312,000.000	
	SINO LAND CO	389,400	11.340	4,415,796.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	224,000	98.400	22,041,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	128,000	77.150	9,875,200.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	162,000	20.550	3,329,100.000	
	SJM HOLDINGS LTD	290,000	12.960	3,758,400.000	
	AIA GROUP LTD	1,348,600	24.000	32,366,400.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	15,956	4.730	75,471.880	
	ASM PACIFIC TECH	37,600	93.650	3,521,240.000	
	WYNN MACAU LTD	273,200	18.380	5,021,416.000	
	SANDS CHINA LTD	361,200	23.100	8,343,720.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 37	11,933,816		328,906,351.380	
	組入時価比率 : 1.23%			(3,256,172,879)	
	合計時価比率 : 1.25%				
シンガポール・ドル	GENTING SINGAPORE PLC	887,400	1.540	1,366,596.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.740	608,013.600	
	SINGAPORE TECH ENG	261,000	2.730	712,530.000	
	SEMCORP INDUSTRIES	182,000	4.220	768,040.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	261,000	3.700	965,700.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	272,000	11.880	3,231,360.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	88,000	9.220	811,360.000	
	SEMCORP MARINE	166,000	4.190	695,540.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	49.870	897,660.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	6.160	868,560.000	
	CAPITALAND LTD	471,000	2.350	1,106,850.000	
	FRASER & NEAVE LTD-ORD	105,500	6.430	678,365.000	

	KEPPEL CORP LTD	250,500	9.940	2,489,970.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.440	478,080.000	
	NEPTUNE ORIENT	215,750	1.170	252,427.500	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	646,763	1.095	708,205.480	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	431,200	8.040	3,466,848.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,264,867	3.110	3,933,736.370	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	91,400	10.480	957,872.000	
	KEPPEL LAND LTD	164,000	2.390	391,960.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	202,000	15.400	3,110,800.000	
	STARHUB LTD	110,000	2.870	315,700.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	302,800	2.200	666,160.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	322,000	5.100	1,642,200.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	390,000	0.945	368,550.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	288,000	1.190	342,720.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	253,000	1.790	452,870.000	
シンガポール ・ドル小計	銘柄数 : 27	8,938,820		32,288,673.950	
	組入時価比率 : 0.73%			(1,921,176,100)	
	合計時価比率 : 0.74%				
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	207,413	13.200	2,737,851.600	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	236,029	11.920	2,813,465.680	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	282,651	6.910	1,953,118.410	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	193,818	5.392	1,045,066.650	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	81,827	41.120	3,364,726.240	
	NICE SYSTEMS LTD	11,709	133.000	1,557,297.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	155,807	171.200	26,674,158.400	
	ISRAEL CORP LTD/THE	489	2,375.000	1,161,375.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	32,363	31.320	1,013,609.160	
イスラエル・ シュケル小計	銘柄数 : 9	1,202,106		42,320,668.140	
	組入時価比率 : 0.32%			(848,952,603)	
	合計時価比率 : 0.33%				
オーストラリ アドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	24,976	19.560	488,530.560	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	423,264	20.750	8,782,728.000	
	AMCOR LTD	210,271	7.270	1,528,670.170	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	489,112	20.200	9,880,062.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	212,072	4.570	969,169.040	
	TELSTRA CORP LTD	677,536	3.390	2,296,847.040	

BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	8.230	462,369.630
AMP LTD	449,927	4.220	1,898,691.940
LYNAS CORP LTD	315,096	1.030	324,548.880
ASX LTD	30,082	30.810	926,826.420
BHP BILLITON LTD	520,479	35.660	18,560,281.140
CALTEX AUSTRALIA LTD	24,948	12.150	303,118.200
CAMPBELL BROTHERS LTD	12,052	48.990	590,427.480
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	1.925	195,866.820
COMPUTERSHARE LT	75,518	8.140	614,716.520
CSL LIMITED	87,717	32.050	2,811,329.850
TRANSURBAN GROUP	220,888	5.560	1,228,137.280
COCA-COLA AMATIL LTD	93,286	11.770	1,097,976.220
COCHLEAR LTD	10,605	59.310	628,982.550
ORIGIN ENERGY LTD	180,178	13.430	2,419,790.540
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	252,854	49.780	12,587,072.120
BORAL LIMITED	107,619	3.720	400,342.680
RIO TINTO LIMITED	73,221	63.200	4,627,567.200
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	378,109	2.970	1,122,983.730
ONESTEEL LIMITED	213,885	0.710	151,858.350
OZ MINERALS LTD	55,513	10.330	573,449.290
ORICA LTD	63,650	23.940	1,523,781.000
FAIRFAX MEDIA LTD	373,327	0.740	276,261.980
LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	19.710	428,830.470
SYDNEY AIRPORT	66,175	2.730	180,657.750
MACQUARIE GROUP LTD	58,487	23.750	1,389,066.250
WORLEYPARSONS LTD	28,202	26.910	758,915.820
SUNCORP GROUP LTD	211,551	8.350	1,766,450.850
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	354,370	23.500	8,327,695.000
NEWCREST MINING LTD	121,376	32.180	3,905,879.680
INCITEC PIVOT LTD	270,689	3.090	836,429.010
TOLL HOLDINGS LTD	118,338	4.390	519,503.820
QANTAS AIRWAYS LIMITED	186,960	1.550	289,788.000
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	169,191	13.150	2,224,861.650
SANTOS LTD	140,142	12.630	1,769,993.460
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	28,753	13.200	379,539.600
SONIC HEALTHCARE	64,654	11.740	759,037.960
TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	2.850	368,168.700
WESFARMERS LTD	156,607	30.640	4,798,438.480
ALUMINA LIMITED	397,286	1.170	464,824.620
ILUKA RESOURCES LIM I	71,975	16.090	1,158,077.750
WOODSIDE PETROLEUM LTD	111,229	31.420	3,494,815.180
WOOLWORTHS LTD	192,530	25.500	4,909,515.000
METCASH LTD	147,295	4.150	611,274.250
TATTS GROUP LTD	225,953	2.390	540,027.670
AGL ENERGY LTD	65,010	14.780	960,847.800

	BRAMBLES LTD	217,633	7.230	1,573,486.590	
	ASCIANO LTD	161,903	4.580	741,515.740	
	CROWN LTD	81,029	8.150	660,386.350	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	116,369	3.660	425,910.540	
	QR NATIONAL LTD	278,184	3.520	979,207.680	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	83,754	6.910	578,740.140	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 57	10,010,699		123,074,272.840	
	組入時価比率 : 3.68%			(9,735,174,982)	
	合計時価比率 : 3.73%				
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	177,042	5.800	1,026,843.600	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	407,280	2.030	826,778.400	
ニュージーランドドル小計	銘柄数 : 2	584,322		1,853,622.000	
	組入時価比率 : 0.04%			(113,070,942)	
	合計時価比率 : 0.04%				
合計				256,151,315,535	
				(256,151,315,535)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	294,800.00	517,374.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.00	577,016.700	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 2	590,706.00	1,094,390.700	
	組入時価比率 : 0.02%		(65,116,247)	
	合計時価比率 : 0.02%			
	MIRVAC GROUP	612,711.00	762,825.190	
	CFS RETAIL PROPERTY	338,821.00	604,795.480	
	GPT GROUP	292,236.00	905,931.600	
	LEND LEASE GROUP	97,048.00	711,361.840	
	STOCKLAND	357,887.00	1,206,079.190	
	WESTFIELD GROUP	354,089.00	3,002,674.720	
	DEXUS PROPERTY GROUP	873,123.00	763,982.620	
	GOODMAN GROUP	1,183,581.00	727,902.310	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	418,064.00	1,078,605.120	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 9	4,527,560.00	9,764,158.070	
	組入時価比率 : 0.29%		(772,344,903)	
	合計時価比率 : 0.30%			
投資信託受益証券計			837,461,150	
			(837,461,150)	
投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	24,635.00	2,453,153.300	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	144,552.00	2,353,306.560	
	PROLOGIS INC	75,195.00	2,203,965.450	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,805.00	1,768,558.550	
	DUKE REALTY TRUST	38,117.00	465,027.400	
	EQUITY RESIDENTIAL	44,402.00	2,450,546.380	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,146.00	926,532.720	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	72,923.00	1,086,552.700	
	HCP INC	66,067.00	2,715,353.700	
	HEALTH CARE REIT INC	24,501.00	1,355,395.320	
	RAYONIER INC	14,915.00	672,368.200	
	KIMCO REALTY	65,111.00	1,082,795.930	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.00	522,762.500	
	THE MACERICH COMPANY	19,817.00	1,033,258.380	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	130,521.00	2,023,075.500	
	PLUM CREEK TIMBER CO	29,979.00	1,135,904.310	
	REGENCY	15,096.00	571,534.560	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	49,355.00	6,291,775.400	
	PUBLIC STORAGE	21,726.00	2,903,245.380	
	VENTAS INC	40,444.00	2,199,749.160	
	VORNADO REALTY TRUST	24,478.00	1,921,767.780	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,583.00	1,109,402.700	

	AMERICAN TOWER REIT INC	63,741.00	3,907,960.710	
米ドル小計	銘柄数 : 23	1,022,359.00	43,153,992.590	
	組入時価比率 : 1.26%		(3,318,110,490)	
	合計時価比率 : 1.27%			
	BRITISH LAND CO PLC	155,704.00	733,054.430	
	HAMMERSON PLC	101,418.00	372,305.470	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.00	683,295.630	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	115,270.00	357,221.730	
	SEGRO PLC	153,729.00	311,762.410	
英ポンド小計	銘柄数 : 5	634,323.00	2,457,639.670	
	組入時価比率 : 0.11%		(292,188,780)	
	合計時価比率 : 0.11%			
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	49,605.00	795,664.200	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	17,922.00	414,894.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	27,441.00	722,795.940	
カナダドル小計	銘柄数 : 3	94,968.00	1,933,354.440	
	組入時価比率 : 0.06%		(146,045,594)	
	合計時価比率 : 0.06%			
	GECINA SA	4,806.00	297,299.160	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	14,804.00	2,031,108.800	
	KLEPIERRE	21,188.00	450,033.120	
	FONCIERE DES REGIONS	5,785.00	261,771.250	
	CORIO NV	12,621.00	404,629.260	
ユーロ小計	銘柄数 : 5	59,204.00	3,444,841.590	
	組入時価比率 : 0.13%		(337,594,476)	
	合計時価比率 : 0.13%			
	LINK REIT/THE	407,000.00	11,477,400.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 1	407,000.00	11,477,400.000	
	組入時価比率 : 0.04%		(113,626,260)	
	合計時価比率 : 0.04%			
投資証券計			4,207,565,600	
			(4,207,565,600)	
合計			5,045,026,750	
			(5,045,026,750)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 566銘柄	56.37%	57.03%
米ドル	投資証券 23銘柄	1.26%	1.27%
英ポンド	株式 99銘柄	10.51%	10.63%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.11%	0.11%
カナダドル	株式 99銘柄	5.60%	5.67%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.06%	0.06%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.87%	3.91%
スウェーデンクローネ	株式 34銘柄	1.41%	1.43%
ユーロ	株式 238銘柄	12.25%	12.39%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.13%	0.13%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	0.49%	0.49%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.42%	0.43%
香港ドル	株式 37銘柄	1.23%	1.25%
香港ドル	投資証券 1銘柄	0.04%	0.04%
シンガポール・ドル	株式 27銘柄	0.73%	0.74%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.02%	0.02%
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.32%	0.33%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	3.68%	3.73%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 9銘柄	0.29%	0.30%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	0.04%	0.04%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		94,897,579	69,057,723
コール・ローン		5,561,484	22,274,034
株式		45,788,572,264	31,366,782,491
投資信託受益証券		846,522,229	1,515,163,451
投資証券		-	5,858,953
未収入金		614,935	-
未収配当金		40,077,720	37,608,498
流動資産合計		46,776,246,211	33,016,745,150
資産合計		46,776,246,211	33,016,745,150
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	3,000,000
流動負債合計		-	3,000,000
負債合計		-	3,000,000
純資産の部			
元本等			
元本		59,215,892,563	52,868,790,729
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	12,439,646,352	19,855,045,579
元本等合計		46,776,246,211	33,013,745,150
純資産合計		46,776,246,211	33,013,745,150
負債純資産合計		46,776,246,211	33,016,745,150

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券及び投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年4月20日から平成23年4月18日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年4月19日から平成24年4月18日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,685,636,348円	59,215,892,563円
同期中追加設定元本額	15,632,925,551円	21,219,556,618円
同期中解約元本額	8,102,669,336円	27,566,658,452円
同期末における元本の内訳		
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C年金>	円	65,751,056円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	110,780,147円	185,610,070円
エマージング株式パッシブファンドV A（適格機関投資家専用）	8,821,315,314円	10,147,794,555円
新興国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	14,785,547,641円	2,925,901,998円
エマージング株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,494,000,459円	1,582,728,858円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	19,931,758,393円	23,574,132,255円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	12,072,490,609円	14,386,871,937円
（合計）	59,215,892,563円	52,868,790,729円
*2 本有価証券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受益権の総数	59,215,892,563口	52,868,790,729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12,439,646,352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19,855,045,579円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)株式及び投資信託受益証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 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。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	3,660,700,278	3,834,246,933
投資信託受益証券	35,742,226	15,015,243
投資証券	-	3,043,732
合計	3,696,442,504	3,852,305,908

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7899円 (7,899円)	0.6244円 (6,244円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	CREDICORP LTD	8,849	109.220	966,487.780	
	LAN AIRLINES SA SPON ADR	32,701	23.570	770,762.570	
	BANCO SANTANDER CHILE ADR	13,201	77.000	1,016,477.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS ADR	8,528	62.930	536,667.040	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR	22,116	45.660	1,009,816.560	
	ENERSIS SA SPONS ADR	53,696	17.730	952,030.080	
	CORPBANCA SA ADR	27,965	20.710	579,155.150	
	QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR	18,546	55.170	1,023,182.820	
	BANCO DE CHILE-ADR	8,400	84.720	711,648.000	
	VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR	12,700	40.050	508,635.000	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	63,600	5.093	323,914.800	
	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR	27,336	58.590	1,601,616.240	
	ECOPETROL SA SP ADR	46,648	48.220	2,249,366.560	
	ORASCOM CONSTRUCTION INDUSTRIES GDR	14,228	35.200	500,825.600	
	ORASCOM TELECOM HOLDING SAE GDR(EG/USD)	63,932	3.349	214,108.260	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	81,181	3.290	267,085.490	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	34,060	3.371	114,816.260	
	TELECOM EGYPT -GDR REG S	13,015	10.920	142,123.800	
	INFOSYS LTD ADR	39,922	55.920	2,232,438.240	
	ICICI BANK LTD ADR	13,535	29.950	405,373.250	
	WIPRO LTD ADR	41,828	10.230	427,900.440	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD ADR	8,334	31.570	263,104.380	
	HDFC BANK LTD ADR	33,530	27.850	933,810.500	
	GAIL INDIA LTD GDR	6,538	44.650	291,921.700	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD GDR	3,700	20.280	75,036.000	

	STATE BANK OF INDIA LTD GDR	2,322	66.250	153,832.500	
	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	17,502	19.880	347,939.760	
	AXIS BANK LTD GDR	15,521	17.150	266,185.150	
	LARSEN & TOUBRO LTD GDR	18,011	21.790	392,459.690	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD GDR	22,705	13.200	299,706.000	
	RANBAXY LABORATORIES LTD GDR	4,433	8.620	38,212.460	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD GDR	50,887	28.430	1,446,717.410	
	STERLITE INDUSTRIES INDIA ADR	33,942	7.450	252,867.900	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	24,973	40.230	1,004,663.790	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	83,900	5.280	442,992.000	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	68,625	15.730	1,079,471.250	
	LUKOIL SPON ADR	63,630	56.300	3,582,369.000	
	OAO GAZPROM ADR	655,556	11.320	7,420,893.920	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	95,392	8.380	799,384.960	
	MECHEL ADR	20,465	9.560	195,645.400	
	SISTEMA JSFC GDR	15,826	18.300	289,615.800	
	NOVATEK OAO GDR	11,413	138.000	1,574,994.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,210	22.350	272,893.500	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	60,714	16.600	1,007,852.400	
	ROSTELECOM SPON ADR	29,106	29.470	857,753.820	
	ROSNEFT OIL CO GDR	205,465	7.150	1,469,074.750	
	URALKALI -SPON GDR	35,682	35.590	1,269,922.380	
	TMK OAO GDR	7,851	10.540	82,749.540	
	SEVERSTAL GDR	29,821	12.960	386,480.160	
	TATNEFT GDR	31,007	33.140	1,027,571.980	
	VTB BANK OJSC GDR	182,578	3.929	717,348.960	
	LSR GROUP OJSC GDR	26,457	3.390	89,689.230	
	MAGNIT OJSC GDR	31,684	22.400	709,721.600	
	FEDERAL HYDROGENERATING ADR	154,086	3.340	514,647.240	
	SBERBANK ADR	272,409	11.000	2,996,499.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	23,841	32.000	762,912.000	
米ドル小計	銘柄数 : 56	3,006,103		49,871,371.070	
	組入時価比率 : 11.62%			(3,834,609,721)	
	合計時価比率 : 11.66%				
ユーロ	MAROC TELECOM	14,789	12.400	183,383.600	
ユーロ小計	銘柄数 : 1	14,789		183,383.600	
	組入時価比率 : 0.05%			(17,971,593)	
	合計時価比率 : 0.05%				

ポーランドズ ロチ	KERNEL HOLDING SA	4,994	69.800	348,581.200	
	BANK MILLENNIUM SA	43,160	3.750	161,850.000	
	BRE BANK SA	1,540	245.300	377,762.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	5,071	67.050	340,010.550	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	17,769	114.000	2,025,666.000	
	BANK PEKAO SA	13,427	140.400	1,885,150.800	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	82,940	17.150	1,422,421.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	35,522	34.600	1,229,061.200	
	ASSECO POLAND SA	8,822	48.000	423,456.000	
	GETIN HOLDING SA	34,932	6.810	237,886.920	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,725	31.400	2,440,565.000	
	SYNTHOS SA	60,398	4.250	256,691.500	
	GRUPA LOTOS SA	5,604	21.520	120,598.080	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	177,841	4.020	714,920.820	
	GLOBE TRADE CENTRE SA	17,828	8.200	146,189.600	
	TVN SA	18,215	9.590	174,681.850	
	CYFROWY POLSAT SA	32,978	12.800	422,118.400	
	ENEA SA	14,186	18.990	269,392.140	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	88,544	20.320	1,799,214.080	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	148,166	5.400	800,096.400	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	6,533	308.200	2,013,470.600	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,474	88.300	571,654.200	
ポーランドズ ロチ小計	銘柄数 : 22	902,669		18,181,438.340	
	組入時価比率 : 1.21%			(400,173,458)	
	合計時価比率 : 1.22%				
ハンガリー フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	1,894	35,800.000	67,805,200.000	
	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICATIONS PLC	81,562	515.000	42,004,430.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	4,669	17,400.000	81,240,600.000	
	OTP BANK NYRT	29,163	3,220.000	93,904,860.000	
ハンガリー フォリント小 計	銘柄数 : 4	117,288		284,955,090.000	
	組入時価比率 : 0.27%			(90,017,313)	

	合計時価比率： 0.27%				
チェコ コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,841	3,245.000	5,974,045.000	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	12,716	390.000	4,959,240.000	
	CEZ	21,218	798.000	16,931,964.000	
チェコ コルナ 小計	銘柄数： 3	35,775		27,865,249.000	
	組入時価比率： 0.32%			(106,166,599)	
	合計時価比率： 0.32%				
トルコ・リラ	AKBANK TAS	147,362	5.840	860,594.080	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	26,181	23.500	615,253.500	
	ARCELIK	22,574	6.980	157,566.520	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	44,420	4.430	196,780.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	58,034	3.390	196,735.260	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	12,097	15.100	182,664.700	
	KOC HOLDING AS	65,520	5.960	390,499.200	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	62,769	2.920	183,285.480	
	TURK HAVA YOLLARI	40,682	2.020	82,177.640	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	101,476	8.860	899,077.360	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	257,838	5.600	1,443,892.800	
	TURKIYE IS BANKASI	173,518	3.270	567,403.860	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,304	39.900	530,829.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	114,380	2.590	296,244.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	59,255	5.560	329,457.800	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,817	21.900	149,292.300	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,444	53.500	558,754.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	87,008	2.260	196,638.080	
	ASYA KATILIM BANKASI AS	62,028	1.550	96,143.400	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	7.800	130,143.000	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	39,994	9.620	384,742.280	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	68,485	7.140	488,982.900	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	6,581	26.100	171,764.100	
トルコ・リラ 小計	銘柄数： 23	1,497,452		9,108,922.660	
	組入時価比率： 1.13%			(374,467,810)	

	合計時価比率： 1.14%				
インドネシア ルピア	BUMI RESOURCES TBK PT	1,880,500	2,450.000	4,607,225,000.000	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	583,500	1,660.000	968,610,000.000	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	40,500	21,650.000	876,825,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	218,701	28,300.000	6,189,238,300.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	529,000	4,950.000	2,618,550,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	201,000	19,800.000	3,979,800,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	249,000	76,950.000	19,160,550,000.000	
	TELEKOMUNIKASI TBK	1,250,000	7,100.000	8,875,000,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	903,500	2,325.000	2,100,637,500.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	69,000	61,450.000	4,240,050,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	179,000	18,500.000	3,311,500,000.000	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	19,050.000	1,781,175,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	429,916	4,650.000	1,999,109,400.000	
	BANK MANDIRI	1,134,000	6,850.000	7,767,900,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,334,000	7,050.000	9,404,700,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,447,500	3,250.000	4,704,375,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	806,500	3,750.000	3,024,375,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	487,000	3,500.000	1,704,500,000.000	
	SEMEN GRESIK PERSERO TBK PT	386,500	11,150.000	4,309,475,000.000	
	INDOSAT TBK PT	155,000	5,450.000	844,750,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,474,000	8,150.000	12,013,100,000.000	
	INTERNATIONAL NICKEL INDONESIA TBK PT	368,000	3,425.000	1,260,400,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	4,800.000	902,400,000.000	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	46,000	40,000.000	1,840,000,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,537,000	1,820.000	2,797,340,000.000	
インドネシア ルピア小計	銘柄数： 25	15,990,617		111,281,585,200.000	
	組入時価比率： 2.87%			(945,893,474)	
	合計時価比率： 2.88%				
フィリピン ペソ	AYALA LAND INC	640,500	16.400	10,504,200.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	266,700	41.250	11,001,375.000	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	76,309	57.950	4,422,106.550	
	AYALA CORP	25,243	342.000	8,633,106.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	478,700	10.860	5,198,682.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,108.000	3,900,160.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	114,790	56.800	6,520,072.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,790	92.900	4,532,591.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	48,621	75.500	3,670,885.500	
	BDO UNIBANK INC	120,180	61.200	7,355,016.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	5,385	2,698.000	14,528,730.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	577,500	13.820	7,981,050.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	106,480	52.650	5,606,172.000	
	SM INVESTMENTS CORP	25,360	570.000	14,455,200.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	873,100	6.320	5,517,992.000	
	ABOITIZ POWER CORP	178,800	31.000	5,542,800.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	30,950	257.600	7,972,720.000	
	SAN MIGUEL CORP	52,930	119.200	6,309,256.000	
フィリピンペソ小計	銘柄数 : 18	3,673,858		133,652,114.050	
	組入時価比率 : 0.71%			(233,891,199)	
	合計時価比率 : 0.71%				
タイパーツ	BANGKOK BANK PCL	108,600	159.000	17,267,400.000	
	BANK OF AYUDHYA	263,000	21.100	5,549,300.000	
	BEC WORLD PLC	138,200	43.000	5,942,600.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	274,000	14.700	4,027,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	178,300	112.500	20,058,750.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	76,900	116.000	8,920,400.000	
	IRPC PCL NVDR	1,080,200	4.420	4,774,484.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	15,900	576.000	9,158,400.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	59,700	148.500	8,865,450.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	323,900	35.000	11,336,500.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	103,200	154.000	15,892,800.000	
	PTT PCL	105,100	324.000	34,052,400.000	
	SIAM CEMENT PCL	39,400	376.000	14,814,400.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	146,100	116.500	17,020,650.000	
	THAI OIL PCL NVDR	87,000	62.000	5,394,000.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	62,000	57.000	3,534,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	306,800	54.250	16,643,900.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	131,500	181.000	23,801,500.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	68,122	31.750	2,162,873.500	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	128,333	31.750	4,074,572.750	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	215,808	63.000	13,595,904.000	
タイパーツ小計	銘柄数 : 21	3,912,063		246,888,084.250	
	組入時価比率 : 1.81%			(597,469,164)	
	合計時価比率 : 1.82%				
香港ドル	CHINA GAS HOLDINGS LTD	336,000	3.670	1,233,120.000	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	252,000	4.000	1,008,000.000	
	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,292,240	1.960	2,532,790.400	
	SINOCHEM HONG KONG HOLDING LTD	208,000	2.210	459,680.000	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	4.750	902,500.000	
	HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	120,000	7.900	948,000.000	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	198,000	2.720	538,560.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD	185,000	17.580	3,252,300.000	
	JIANGSU EXPRESS	128,000	7.110	910,080.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	164,000	4.430	726,520.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	128,000	5.750	736,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	162,500	23.650	3,843,125.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	332,000	2.540	843,280.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	446,000	4.440	1,980,240.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	91,000	72.200	6,570,200.000	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE CON	74,400	9.390	698,616.000	
	CSG HOLDING CO LTD	103,600	5.680	588,448.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	196,000	3.850	754,600.000	
	LENOVO GROUP LTD	776,000	5.890	4,570,640.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,560,000	10.740	27,494,400.000	
	DONGFANG ELECTRICAL MACHINERY	40,800	24.250	989,400.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,018,000	9.020	18,202,360.000	

ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	510,000	3.530	1,800,300.000	
BYD CO LTD	56,500	18.660	1,054,290.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	190,000	12.420	2,359,800.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	327,800	10.360	3,396,008.000	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	200,000	3.260	652,000.000	
GREAT WALL AUTOMOBILE HOLDING	109,500	11.400	1,248,300.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	920,000	19.460	17,903,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	753,000	3.010	2,266,530.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	204,000	6.750	1,377,000.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,219,000	0.375	832,125.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	54,800	38.500	2,109,800.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	140,000	4.640	649,600.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	242,000	2.910	704,220.000	
CHINA VANKE CO LTD	136,740	7.790	1,065,204.600	
TINGYI HOLDING CORP	238,000	23.950	5,700,100.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	42.500	1,615,000.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	550,000	1.780	979,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	214,500	51.950	11,143,275.000	
AIR CHINA / HONG KONG	244,000	5.950	1,451,800.000	
ZTE CORP	81,040	24.400	1,977,376.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	340,000	3.840	1,305,600.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	413,000	35.200	14,537,600.000	
COSCO HOLDINGS	365,500	3.900	1,425,450.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	811,205	5.680	4,607,644.400	
CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	151,000	11.740	1,772,740.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,315,530	5.630	41,186,433.900	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	334,000	14.180	4,736,120.000	
WUMART STORES INC	76,000	15.960	1,212,960.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	366,000	8.310	3,041,460.000	
BANK OF CHINA LTD	8,135,200	2.990	24,324,248.000	

GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	102,000	6.410	653,820.000	
CHINA BLUECHEMICAL LTD	232,000	6.050	1,403,600.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	483,927	16.540	8,004,152.580	
IND & COMM BK OF CHINA - H	7,417,235	4.930	36,566,968.550	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	92,000	12.460	1,146,320.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	318,000	3.670	1,167,060.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	569,000	6.570	3,738,330.000	
CHINA COAL ENERGY CO	494,000	9.120	4,505,280.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	56,000	16.160	904,960.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	140,000	3.410	477,400.000	
CHINA CITIC BANK-H	819,800	4.640	3,803,872.000	
FOSUN INTERNATIONAL	163,000	3.990	650,370.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	490,000	2.380	1,166,200.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	223,000	4.390	978,970.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	220,000	22.650	4,983,000.000	
CSR CORP LTD - H	227,000	4.450	1,010,150.000	
BBMG CORP	131,000	5.090	666,790.000	
SINOPHARM GROUP CO	87,600	18.080	1,583,808.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	363,000	1.650	598,950.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	243,805	7.100	1,731,015.500	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	241,000	4.110	990,510.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,500	12.260	913,370.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	143,080	9.140	1,307,751.200	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	433,400	6.970	3,020,798.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,263,000	3.440	7,784,720.000	
CHINA MOBILE LIMITED	734,500	77.000	56,556,500.000	
BEIJING ENTERPRISES	58,000	44.200	2,563,600.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	234,000	17.580	4,113,720.000	
CNOOC LTD	2,176,000	15.180	33,031,680.000	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	248,000	8.970	2,224,560.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	513,120	13.040	6,691,084.800	
CHINA RESOURCES LAND LTD	268,000	12.600	3,376,800.000	
CITIC PACIFIC	170,000	13.800	2,346,000.000	
POLY HONG KONG INVESTMENT LTD	217,000	3.200	694,400.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	250,000	3.270	817,500.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	718,742	16.440	11,816,118.480	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	82,400	13.800	1,137,120.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	276,000	11.380	3,140,880.000	
COSCO PACIFIC LTD	176,000	10.100	1,777,600.000	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LTD	316,000	2.840	897,440.000	
GUANGZHOU INVESTMENT CO LTD	564,000	1.140	642,960.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	144,000	24.850	3,578,400.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	138,000	11.600	1,600,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	94,000	10.740	1,009,560.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,702,000	4.280	7,284,560.000	
MINMETALS RESOURCES LTD	172,000	3.290	565,880.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	209,200	14.920	3,121,264.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	21.800	1,264,400.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	4.750	1,263,500.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	164,000	27.600	4,526,400.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	166,000	5.180	859,880.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	148,000	19.980	2,957,040.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	166,000	5.860	972,760.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	402,000	1.460	586,920.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	456,500	3.430	1,565,795.000	
DAH CHONG HONG HOLDINGS LTD	114,000	8.570	976,980.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	260,000	9.780	2,542,800.000	

CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	225,000	5.890	1,325,250.000	
FAR EAST HORIZON LTD	160,000	6.740	1,078,400.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	94,000	24.400	2,293,600.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	76,500	23.250	1,778,625.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	415,000	1.890	784,350.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	202,000	2.630	531,260.000	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	126,000	8.150	1,026,900.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	124,200	161.200	20,021,040.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	158,000	5.600	884,800.000	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	198,000	9.170	1,815,660.000	
LONKING HOLDINGS LTD	237,000	2.620	620,940.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	180,000	7.020	1,263,600.000	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD	77,000	15.700	1,208,900.000	
SHUI ON LAND LTD	259,200	2.370	614,304.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	166,500	6.620	1,102,230.000	
HENGDELI HOLDINGS LTD	280,000	2.390	669,200.000	
INTIME DEPARTMENT STORE GROUP CO LTD	105,500	8.100	854,550.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	438,000	3.010	1,318,380.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	584,000	13.040	7,615,360.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	109,000	8.660	943,940.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	260,000	2.400	624,000.000	
SOHO CHINA LTD	278,000	5.140	1,428,920.000	
CHINA DONGXIANG GROUP CO	332,000	1.320	438,240.000	
ALIBABA.COM LTD	144,000	8.740	1,258,560.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	761,000	2.200	1,674,200.000	
DONGYUE GROUP	128,000	5.990	766,720.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	727,000	7.470	5,430,690.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	654,000	3.220	2,105,880.000	

	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP LTD	247,000	4.910	1,212,770.000	
	RENHE COMMERCIAL HOLDINGS CO LTD	1,282,000	0.830	1,064,060.000	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	168,000	2.850	478,800.000	
	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICES HOLDINGS LTD	130,500	7.340	957,870.000	
	CHINA RESOURCES CEMENT	300,000	5.450	1,635,000.000	
	YINGDE GASES	115,500	8.130	939,015.000	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	97,000	6.590	639,230.000	
	LONGFOR PROPERTIES CO LTD	135,500	8.400	1,138,200.000	
	CHINA RONGSHENG HEAVY INDUSTRY GROUP CO LTD	200,500	2.260	453,130.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	83,000	12.560	1,042,480.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 147	73,684,564		565,520,166.410	
	組入時価比率 : 16.96%			(5,598,649,647)	
	合計時価比率 : 17.02%				
韓国ウォン	HANKOOK TIRE CO LTD	11,540	44,350.000	511,799,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,253	67,300.000	286,226,900.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	4,463	209,500.000	934,998,500.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	5,788	50,600.000	292,872,800.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	5,870	37,650.000	221,005,500.000	
	KT&G CORP	13,452	78,300.000	1,053,291,600.000	
	S1 CORP/KOREA	1,928	58,200.000	112,209,600.000	
	KOREA GAS CORP	2,854	44,650.000	127,431,100.000	
	CJ CORP	2,019	75,500.000	152,434,500.000	
	CHEIL INDUSTRIES INC	5,780	106,500.000	615,570,000.000	
	DOOSAN INFRACORE CO., LTD	13,290	17,850.000	237,226,500.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	10,720	23,800.000	255,136,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,520	137,000.000	345,240,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	3,097	94,800.000	293,595,600.000	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	11,000.000	224,070,000.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,887	278,000.000	524,586,000.000	
	DONGKUK STEEL MILL CO LTD	4,240	20,850.000	88,404,000.000	
	LG UPLUS CORP	33,020	6,840.000	225,856,800.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,714	65,600.000	309,238,400.000	

DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	10,700.000	133,750,000.000	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	27,350.000	118,999,850.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	1,153	494,000.000	569,582,000.000	
LG CHEM LTD	5,749	324,000.000	1,862,676,000.000	
LG CHEM LTD	791	107,500.000	85,032,500.000	
LS CORP	2,436	80,100.000	195,123,600.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,800	68,300.000	122,940,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	52,011	39,400.000	2,049,233,400.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	6,713	17,650.000	118,484,450.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,630	25,350.000	117,370,500.000	
S-OIL CORP	5,418	112,000.000	606,816,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,951	25,100.000	224,670,100.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	7,376	49,850.000	367,693,600.000	
HONAM PETROCHEMICAL CORP	1,751	313,000.000	548,063,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	5,198	284,000.000	1,476,232,000.000	
HYUNDAI MOBIS	8,378	318,500.000	2,668,393,000.000	
HYNIX SEMICONDUCTOR INC	62,310	24,350.000	1,517,248,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,372	70,000.000	586,040,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,475	66,100.000	163,597,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	19,029	226,500.000	4,310,068,500.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	1,506	110,500.000	166,413,000.000	
HYUNDAI HYSKO	3,580	38,200.000	136,756,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,078	96,700.000	684,442,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,220	11,500.000	209,530,000.000	
KCC CORP	490	288,000.000	141,120,000.000	
KIA MOTORS CORP	29,327	68,100.000	1,997,168,700.000	
KOREA EXCHANGE BANK	28,330	7,330.000	207,658,900.000	
KOREA ZINC CO LTD	934	320,000.000	298,880,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	32,787	27,400.000	898,363,800.000	
HANWHA CORP	4,426	33,300.000	147,385,800.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,541	42,900.000	151,908,900.000	
OCI COMPANY LTD	1,924	221,000.000	425,204,000.000	
HYUNDAI SECURITIES CO	13,010	8,930.000	116,179,300.000	
KOREA KUMHO PETROCHEMICAL	1,067	160,500.000	171,253,500.000	
KT CORP	4,568	33,750.000	154,170,000.000	

	KP CHEMICAL CORP	5,110	14,950.000	76,394,500.000	
	LG ELECTRONICS INC	12,939	76,900.000	995,009,100.000	
	WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	43,827	9,500.000	416,356,500.000	
	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,681,000.000	119,351,000.000	
	LG CORP	12,090	66,100.000	799,149,000.000	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	14,043	11,300.000	158,685,900.000	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,535	98,300.000	445,790,500.000	
	NHN CORP	5,082	216,000.000	1,097,712,000.000	
	HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,669	159,500.000	266,205,500.000	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,660	35,350.000	164,731,000.000	
	DOOSAN CORP	1,137	142,500.000	162,022,500.000	
	KANGWON LAND INC	10,680	25,900.000	276,612,000.000	
	POSCO	8,061	382,500.000	3,083,332,500.000	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,777	206,500.000	779,950,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	15,756	67,200.000	1,058,803,200.000	
	SAMSUNG SDI CO LTD	4,227	133,500.000	564,304,500.000	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	6,793	84,300.000	572,649,900.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	13,508	1,026,000.000	13,859,208,000.000	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	20,150	29,800.000	600,470,000.000	
	SAMSUNG TECHWIN CO LTD	4,198	53,300.000	223,753,400.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2,495	664,000.000	1,656,680,000.000	
	SHINSEGAE CO LTD	1,044	251,500.000	262,566,000.000	
	HYOSUNG CORP	2,374	54,200.000	128,670,800.000	
	ORION CORP	451	635,000.000	286,385,000.000	
	YUHAN CORP	952	128,500.000	122,332,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,224	127,500.000	411,060,000.000	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	8,210	33,000.000	270,930,000.000	
	GS HOLDINGS CORP	5,448	53,700.000	292,557,600.000	
	LG DISPLAY CO LTD	28,768	26,100.000	750,844,800.000	
	SK NETWORKS CO LTD	13,330	10,350.000	137,965,500.000	
	CELLTRION INC	8,753	34,600.000	302,853,800.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	26,870	34,150.000	917,610,500.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,680	200,000.000	336,000,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,981	31,600.000	94,199,600.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,297	334,500.000	433,846,500.000	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,692	81,200.000	462,190,400.000	
	AMOREPACIFIC CORP	398	1,000,000.000	398,000,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	4,848	40,000.000	193,920,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	7,377	159,000.000	1,172,943,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	808	293,500.000	237,148,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	11,270	6,100.000	68,747,000.000	
	LG INNOTEK CO LTD	945	69,800.000	65,961,000.000	
	SK C&C CO LTD	1,592	133,000.000	211,736,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	44,984	36,250.000	1,630,670,000.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,624	133,500.000	216,804,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,560	37,750.000	209,890,000.000	
	BS FINANCIAL GROUP INC	22,870	11,100.000	253,857,000.000	
	MANDO CORP	1,617	199,000.000	321,783,000.000	
	KOREA LIFE INSURANCE CO LTD	19,670	7,410.000	145,754,700.000	
	E-MART CO LTD	2,741	268,500.000	735,958,500.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	14,380	13,200.000	189,816,000.000	
韓国ウォン小計	銘柄数 : 105	970,551		69,199,814,000.000	
	組入時価比率 : 13.92%			(4,594,867,650)	
	合計時価比率 : 13.97%				
新台幣ドル	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	44,035	164.500	7,243,757.500	
	TPK HOLDING CO LTD	12,500	381.000	4,762,500.000	
	ACER INC	331,069	38.650	12,795,816.850	
	ASUSTEK COMPUTER INC	76,554	229.500	17,569,143.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,659	49.600	2,363,886.400	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	586,394	27.700	16,243,113.800	
	ASIA CEMENT CORP	289,473	34.500	9,986,818.500	
	EVERLIGHT ELECTRONICS CO LTD	42,991	52.100	2,239,831.100	
	TAIWAN BUSINESS BANK	241,771	9.190	2,221,875.490	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	3,872	371.500	1,438,448.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	85,000	70.500	5,992,500.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	138,210	37.350	5,162,143.500	
	WINTEK CORP	175,987	21.850	3,845,315.950	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	49,359	50.500	2,492,629.500	
	QUANTA COMPUTER INC	307,858	65.400	20,133,913.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	42,000	43.800	1,839,600.000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成24年1月11日現在

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	CAPITAL SECURITIES CORP	444,162	10.650	4,730,325.300	
	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY CO LTD	41,868	62.700	2,625,123.600	
	EVA AIRWAYS CORP	158,227	19.750	3,124,983.250	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	62,760	158.000	9,916,080.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	494,820	16.250	8,040,825.000	
	CHINA AIRLINES	211,402	13.600	2,875,067.200	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	197,671	67.100	13,263,724.100	
	CHINA STEEL CORP	1,393,859	29.000	40,421,911.000	
	CHINA MOTORS CO	67,000	30.250	2,026,750.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	182,986	24.100	4,409,962.600	
	ADVANTECH CO LTD	31,251	84.900	2,653,209.900	
	FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	32,000	50.100	1,603,200.000	
	CLEVO CO	52,218	47.950	2,503,853.100	
	CHINA PETROCHEMICAL DEVELOPMENT CORP	180,000	29.850	5,373,000.000	
	KGI SECURITIES CO LTD	508,147	10.850	5,513,394.950	
	COMPAL ELECTRONICS INC	523,304	32.250	16,876,554.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	205,448	75.600	15,531,868.800	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	466,327	98.500	45,933,209.500	
	AU OPTRONICS CORP	954,194	13.700	13,072,457.800	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	190,800	94.000	17,935,200.000	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	42,144	73.700	3,106,012.800	
	ETERNAL CHEMICAL CO LTD	57,750	23.900	1,380,225.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	232,399	16.800	3,904,303.200	
	FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	101,551	36.350	3,691,378.850	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	378,775	36.100	13,673,777.500	
	FENG HSIN IRON & STEEL CO	57,150	47.050	2,688,907.500	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUCTS INC	40,227	48.850	1,965,088.950	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	71,285	79.300	5,652,900.500	
	FORMOSA PLASTICS CORP	482,840	82.900	40,027,436.000	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	28.450	2,532,050.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	343,140	82.100	28,171,794.000	

	TRANSCEND INFORMATION INC	35,897	78.200	2,807,145.400	
	EPISTAR CORP	90,149	63.100	5,688,401.900	
	GIANT MANUFACTURING	32,151	120.000	3,858,120.000	
	MEDIATEK INC	128,570	270.000	34,713,900.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	584,407	32.200	18,817,905.400	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	569,281	16.300	9,279,280.300	
	HOTAI MOTOR CO LTD	35,000	141.000	4,935,000.000	
	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	214,000	56.200	12,026,800.000	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	26,444	177.500	4,693,810.000	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,049,600	15.850	16,636,160.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	860,403	32.250	27,747,996.750	
	CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,118,403	8.280	9,260,376.840	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	365,391	13.150	4,804,891.650	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,120,190	86.400	96,784,416.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	874,800	20.700	18,108,360.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	596.000	6,091,120.000	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	616,054	10.200	6,283,750.800	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	643,108	8.590	5,524,297.720	
	INVENTEC CO LTD	353,257	11.900	4,203,758.300	
	LCY CHEMICAL CORP	44,057	44.400	1,956,130.800	
	HTC CORPORATION	89,832	449.500	40,379,484.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	273,717	37.400	10,237,015.800	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	55,000	92.000	5,060,000.000	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	731,037	8.910	6,513,539.670	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	1,075,936	19.100	20,550,377.600	
	MACRONIX INTERNATIONAL	456,524	11.950	5,455,461.800	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	672,948	18.000	12,113,064.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	94,560	63.300	5,985,648.000	
	MOTECH INDUSTRIES INC	33,245	58.000	1,928,210.000	

	NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	61,636	46.000	2,835,256.000	
	NAN YA PLASTIC CORP	569,840	63.200	36,013,888.000	
	WISTRON CORP	218,124	41.500	9,052,146.000	
	KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	82.000	2,543,640.000	
	RICHTEK TECHNOLOGY CORP	15,803	128.500	2,030,685.500	
	POU CHEN CORP	305,990	25.900	7,925,141.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	472,918	45.500	21,517,769.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	77,392	169.000	13,079,248.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	137,480	93.000	12,785,640.000	
	PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	180.500	2,645,769.000	
	E INK HOLDINGS INC	107,000	34.000	3,638,000.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,907	35.050	2,590,440.350	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	48,139	52.600	2,532,111.400	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,995	100.000	7,699,500.000	
	SILICONWARE PRECISION INDS	331,743	29.750	9,869,354.250	
	STANDARD FOODS CORP	28,000	93.600	2,620,800.000	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	171,666	74.600	12,806,283.600	
	TAIWAN CEMENT CORP	450,874	35.500	16,006,027.000	
	TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	99,891	31.400	3,136,577.400	
	TSRC CORP	53,900	75.600	4,074,840.000	
	TATUNG CO LTD	220,260	7.810	1,720,230.600	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	202,000	18.100	3,656,200.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	3,009,083	76.500	230,194,849.500	
	TUNG HO STEEL ENTERPRISE CORP	88,952	27.150	2,415,046.800	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	44,000	45.000	1,980,000.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,557,525	13.300	20,715,082.500	
	WAN HAI LINES LTD	122,587	15.200	1,863,322.400	
	WALSIN LIHWA CORP	565,000	8.940	5,051,100.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	278,668	13.400	3,734,151.200	
	YULON MOTOR CO	93,149	54.900	5,113,880.100	
	INOTERA MEMORIES INC	206,229	4.970	1,024,958.130	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	693,197	12.750	8,838,261.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	160,526	36.050	5,786,962.300	

	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	18,972	63.800	1,210,413.600	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,510	231.000	4,044,810.000	
	PEGATRON CORP	185,554	36.250	6,726,332.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	450,130	17.800	8,012,314.000	
新台湾ドル小計	銘柄数 : 113	34,283,936		1,331,491,321.800	
	組入時価比率 : 10.37%			(3,421,932,697)	
	合計時価比率 : 10.40%				
インド・ルピー	RELIANCE IND	56,938	736.200	41,917,755.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,438	482.700	4,073,022.600	
	ASIAN PAINTS LTD	3,644	2,656.550	9,680,468.200	
	BANK OF INDIA	10,312	303.250	3,127,114.000	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	1,417	399.100	565,524.700	
	HDFC BANK LTD	82,728	459.700	38,030,061.600	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11,666	689.200	8,040,207.200	
	ICICI BANK LTD	24,432	774.500	18,922,584.000	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	4,900	760.900	3,728,410.000	
	INDUSIND BANK LTD	15,474	260.900	4,037,166.600	
	STATE BANK OF INDIA LTD	10,607	1,702.600	18,059,478.200	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	30,059	230.900	6,940,623.100	
	RELIANCE CAPITAL LTD	11,830	281.300	3,327,779.000	
	TATA STEEL LTD	34,054	371.750	12,659,574.500	
	TATA MOTORS LTD	103,434	205.100	21,214,313.400	
	JSW STEEL LTD	9,507	630.050	5,989,885.350	
	TATA POWER CO LTD	146,245	94.000	13,747,030.000	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	75,250	264.650	19,914,912.500	
	GAIL INDIA LTD	10,255	380.800	3,905,104.000	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	30,554	466.500	14,253,441.000	
	SESA GOA LTD	47,629	167.600	7,982,620.400	
	AXIS BANK LTD	9,535	894.750	8,531,441.250	
	TITAN INDUSTRIES LTD	24,340	180.850	4,401,889.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	85,131	261.200	22,236,217.200	
	LUPIN LTD	16,882	439.900	7,426,391.800	
	ACC LTD	9,589	1,116.050	10,701,803.450	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	131,468	684.000	89,924,112.000	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	65,062	116.000	7,547,192.000	
	INFOSYS LTD	13,178	2,863.600	37,736,520.800	
	WIPRO LTD	22,480	403.550	9,071,804.000	

	SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	71,198	74.600	5,311,370.800	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	108,558	395.450	42,929,261.100	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	13,288	419.900	5,579,631.200	
	DABUR INDIA LTD	45,589	97.500	4,444,927.500	
	HERO MOTOCORP LTD	5,092	1,775.400	9,040,336.800	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD	2,870	1,618.100	4,643,947.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	70,231	330.350	23,200,810.850	
	UNITED SPIRITS LTD	8,867	523.200	4,639,214.400	
	CANARA BANK	8,703	412.600	3,590,857.800	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	34,021	516.350	17,566,743.350	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,170	986.350	9,044,829.500	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	49,221	499.550	24,588,350.550	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	498.550	6,703,004.750	
	CIPLA LTD/INDIA	43,779	345.800	15,138,778.200	
	LARSEN & TOUBRO LTD	8,794	1,133.800	9,970,637.200	
	JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	108,818	55.100	5,995,871.800	
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,515	1,164.950	13,414,399.250	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	57,877	1,165.400	67,449,855.800	
	ADANI ENTERPRISES LTD	29,682	283.350	8,410,394.700	
	NTPC LTD	78,135	158.000	12,345,330.000	
	PIRAMAL HEALTHCARE LTD	6,805	399.300	2,717,236.500	
	AMBUJA CEMENTS LTD	95,410	152.100	14,511,861.000	
	INFRASTRUCTURE DEVELOPMENT FINANCE CO LTD	106,653	102.000	10,878,606.000	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	8,562	440.800	3,774,129.600	
	SUZLON ENERGY LTD	83,021	19.650	1,631,362.650	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	150,580	123.150	18,543,927.000	
	ITC LTD	270,424	205.150	55,477,483.600	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	20,689	145.300	3,006,111.700	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	55,596	81.050	4,506,055.800	
	STERLITE INDUSTRIES INDIA LTD	35,689	95.850	3,420,790.650	
	SIEMENS INDIA LTD	10,427	707.150	7,373,453.050	
	UNITECH LTD	145,720	22.700	3,307,844.000	
	GMR INFRASTRUCTURE LTD	105,546	25.600	2,701,977.600	
	IDEA CELLULAR LTD	85,719	82.100	7,037,529.900	
	POWER FINANCE CORP LTD	41,212	147.800	6,091,133.600	
	DLF LTD	45,392	184.750	8,386,172.000	

	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	119,116	102.600	12,221,301.600	
	MUNDRA PORT AND SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD	44,144	136.450	6,023,448.800	
	RELIANCE POWER LTD	63,381	79.750	5,054,634.750	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	34,322	162.650	5,582,473.300	
	BAJAJ AUTO LTD	10,957	1,429.500	15,663,031.500	
	COAL INDIA LTD	53,960	318.050	17,161,978.000	
インド・ル ピー小計	銘柄数 : 72	3,479,216		966,775,542.600	
	組入時価比率 : 4.39%			(1,450,163,314)	
	合計時価比率 : 4.41%				
マレーシアリ ンギット	PARKSON HOLDINGS BHD	73,239	5.530	405,011.670	
	AMMB HOLDINGS BHD	235,100	5.820	1,368,282.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,900	8.890	123,571.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	550,400	7.290	4,012,416.000	
	DIGI.COM BHD	405,200	3.900	1,580,280.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	73,000	5.730	418,290.000	
	RHB CAPITAL BHD	64,500	7.270	468,915.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	129,042	4.440	572,946.480	
	GAMUDA BHD	263,900	3.530	931,567.000	
	GENTING BHD	258,300	10.900	2,815,470.000	
	YTL CORP BHD	512,360	1.490	763,416.400	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	11.700	215,280.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,200	10.860	686,352.000	
	IJM CORP BHD	147,480	5.490	809,665.200	
	IOI CORP BHD	358,213	5.390	1,930,768.070	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	56,800	24.840	1,410,912.000	
	MALAYAN BANKING BHD	375,675	8.240	3,095,562.000	
	LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	82,700	6.750	558,225.000	
	MMC CORP BHD	88,700	2.730	242,151.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	76,400	3.880	296,432.000	
	MISC BHD	132,480	5.940	786,931.200	
	PPB GROUP BHD	48,800	17.200	839,360.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	24,900	17.400	433,260.000	
	PETRONAS GAS BHD	97,500	15.340	1,495,650.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	381,900	3.880	1,481,772.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	13,900	49.900	693,610.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	4.910	515,550.000	
	SP SETIA BHD	128,100	3.870	495,747.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	342,250	6.070	2,077,457.500	

	UMW HOLDINGS BHD	75,900	7.030	533,577.000	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	3,600	13.200	47,520.000	
	PUBLIC BANK BHD	121,100	13.160	1,593,676.000	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	366,732	1.860	682,121.520	
	AIRASIA BHD	92,200	3.700	341,140.000	
	BURSA MALAYSIA BHD	56,600	6.790	384,314.000	
	BERJAYA CORP BHD	311,800	0.930	289,974.000	
	SIME DARBY BERHAD	328,500	9.080	2,982,780.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	286,700	4.990	1,430,633.000	
	UEM LAND HOLDINGS BHD	236,100	2.300	543,030.000	
	MALAYSIA MARINE AND HEAVY ENGINEERING BHD	61,200	5.650	345,780.000	
	BUMI ARMADA BHD	123,900	4.130	511,707.000	
	MAXIS BHD	296,600	5.600	1,660,960.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	282,100	6.360	1,794,156.000	
マレーシアリ ンギット小計	銘柄数 : 43	7,764,371		44,666,219.040	
	組入時価比率 : 3.31%			(1,092,089,055)	
	合計時価比率 : 3.32%				
メキシコ ペソ	ALFA SAB DE CV	32,700	160.400	5,245,080.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	27,000	129.640	3,500,280.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	30,000	101.050	3,031,500.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	297,800	58.730	17,489,794.000	
	GRUPO MODELO SAB DE CV	75,500	89.440	6,752,720.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	194,900	29.040	5,659,896.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	88,800	34.890	3,098,232.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	200,900	46.660	9,373,994.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	87,534	42.160	3,690,433.440	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	16,885	620.760	10,481,532.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	67,000	77.080	5,164,360.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	474,252	37.870	17,959,923.240	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,900,678	15.440	75,666,468.320	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	225,000	26.070	5,865,750.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	36,000	59.760	2,151,360.000	
	GRUPO ELEKTRA SA DE CV	8,485	1,412.680	11,986,589.800	
	URBI DESARROLLOS URBANOS SAB D	64,900	18.250	1,184,425.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	791,600	37.590	29,756,244.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	66,600	47.960	3,194,136.000	
	MINERA FRISCO SAB DE CV	70,900	53.450	3,789,605.000	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	130,900	16.130	2,111,417.000	
メキシコ ペソ 小計	銘柄数 : 21	7,888,334		227,153,740.400	
	組入時価比率 : 3.87%			(1,276,604,021)	
	合計時価比率 : 3.88%				
ブラジル・レ アル	BRF - BRASIL FOODS SA	79,792	34.500	2,752,824.000	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	35,130	15.640	549,433.200	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	23,500	17.300	406,550.000	
	VALE SA	157,927	41.400	6,538,177.800	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	13,718	38.000	521,284.000	
	VALE SA-PREF A	245,796	39.510	9,711,399.960	
	RAIA DROGASIL SA	22,200	13.200	293,040.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	93,700	9.900	927,630.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	27,450	26.630	730,993.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	36,549	17.870	653,130.630	
	TAM SA	6,200	35.270	218,674.000	
	BANCO DO BRASIL SA	63,600	23.890	1,519,404.000	
	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	90,675	63.500	5,757,862.500	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	49,662	10.940	543,302.280	
	CIA DE TRANSMISSAO DE ENERGIA ELETRICA PAULISTA	4,123	59.350	244,700.050	
	AES TIETE SA	15,500	26.000	403,000.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	280,916	11.760	3,303,572.160	
	LOJAS AMERICANAS SA	41,395	15.330	634,585.350	
	GERDAU SA	110,830	16.340	1,810,962.200	
	METALURGICA GERDAU SA	31,000	20.350	630,850.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	13,993	68.300	955,721.900	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	361,810	24.820	8,980,124.200	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	513,412	22.900	11,757,134.800	
	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA	16,800	21.040	353,472.000	
	KLABIN SA	54,100	8.090	437,669.000	
	SOUZA CRUZ SA	46,200	22.720	1,049,664.000	
	CCR SA	109,920	12.110	1,331,131.200	
	BANCO BRADESCO SA	232,272	31.750	7,374,636.000	

	CIA HERING	16,100	37.880	609,868.000	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	50,200	9.660	484,932.000	
	NATURA COSMETICOS SA	21,200	37.250	789,700.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	93,506	16.450	1,538,173.700	
	GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES SA	10,200	12.370	126,174.000	
	BRADSPAR SA	29,500	32.760	966,420.000	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	24,875	6.860	170,642.500	
	TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA	6,400	22.150	141,760.000	
	TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA	29,351	18.100	531,253.100	
	TELEMAR NORTE LESTE SA	5,200	50.000	260,000.000	
	CPFL ENERGIA SA	24,940	25.400	633,476.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	277,900	35.600	9,893,240.000	
	DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	30,200	15.540	469,308.000	
	PORTO SEGURO SA	13,800	21.070	290,766.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	30,590	14.750	451,202.500	
	BRASKEM SA	14,130	12.910	182,418.300	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	15,970	30.520	487,404.400	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,100	26.580	348,198.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,228	50.700	1,836,759.600	
	LOJAS RENNER SA	15,600	54.890	856,284.000	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	10,800	41.150	444,420.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	37,252	33.220	1,237,511.440	
	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,900	27.760	330,344.000	
	LIGHT SA	10,800	30.620	330,696.000	
	ROSSI RESIDENCIAL SA	19,300	9.000	173,700.000	
	TOTVS SA	11,900	30.400	361,760.000	
	EMBRAER SA	63,660	11.750	748,005.000	
	CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	20,100	32.000	643,200.000	
	ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE DE SAO PAULO SA	10,100	37.120	374,912.000	
	MMX MINERACAO E METALICOS SA	34,400	6.870	236,328.000	
	OGX PETROLEO E GAS PARTICIPACOES SA	160,700	13.980	2,246,586.000	

	BROOKFIELD INCORPORACOES SA	29,156	5.720	166,772.320	
	ODONTOPREV SA	10,000	27.890	278,900.000	
	PDG REALTY SA EMPREENDIMENTOS E PARTICIPACOES	144,500	6.630	958,035.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	51,800	18.200	942,760.000	
	JBS SA	99,400	5.850	581,490.000	
	BRASIL TELECOM SA	33,769	11.260	380,238.940	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	48,612	32.550	1,582,320.600	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	14,466	53.650	776,100.900	
	REDECARD SA	42,200	28.950	1,221,690.000	
	MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA	34,600	12.520	433,192.000	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	36.200	285,980.000	
	BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	19.150	350,445.000	
	DURATEX SA	33,930	9.000	305,370.000	
	SUL AMERICA SA	17,200	15.000	258,000.000	
	AMIL PARTICIPACOES SA	13,800	16.330	225,354.000	
	HYPERMARCAS SA	35,430	10.680	378,392.400	
	BM&FBOVESPA SA	244,800	10.510	2,572,848.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	600	388.000	232,800.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	73,100	15.660	1,144,746.000	
	CETIP SA - BALCAO ORGANIZADO	25,438	26.070	663,168.660	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	20,600	13.280	273,568.000	
	GOL LINHAS AEREAS INTELIGENTES SA RTS	508	0.080	40.640	
	CIELO SA	30,640	48.150	1,475,316.000	
ブラジル・レ アル小計	銘柄数 : 82	4,958,821		114,073,899.730	
	組入時価比率 : 14.77%			(4,875,518,474)	
	合計時価比率 : 14.82%				
モロッコ・ ディルハム	ATTIJARIWafa BANK	3,476	363.800	1,264,568.800	
	MAROC TELECOM	6,482	139.300	902,942.600	
	DOUJA PROMOTION GROUPE ADDOHA SA	16,875	72.200	1,218,375.000	

モロッコ・ ディルハム小 計	銘柄数 : 3	26,833		3,385,886.400	
	組入時価比率 : 0.09%			(29,965,095)	
	合計時価比率 : 0.09%				
南アフリカ・ ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	95,339	34.590	3,297,776.010	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	13,589	175.000	2,378,075.000	
	BARLOWORLD LTD	28,254	79.600	2,249,018.400	
	BIDVEST GROUP LTD	39,724	163.920	6,511,558.080	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	58,314	77.700	4,530,997.800	
	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	132,901	23.900	3,176,333.900	
	AVENG LTD	56,294	33.840	1,904,988.960	
	DISCOVERY HOLDINGS LTD	32,316	43.500	1,405,746.000	
	ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA LTD	21,384	68.370	1,462,024.080	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	318,740	7.530	2,400,112.200	
	MASSMART HOLDINGS LTD	16,630	179.500	2,985,085.000	
	GOLD FIELDS LTD	87,028	128.200	11,156,989.600	
	REMGRO LTD	52,282	122.200	6,388,860.400	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,077	107.310	2,476,392.870	
	NORTHAM PLATINUM LTD	30,837	31.000	955,947.000	
	MMI HOLDINGS LTD	132,687	18.000	2,388,366.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	197,059	19.350	3,813,091.650	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	47,393	99.000	4,691,907.000	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,063	173.560	2,440,774.280	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	15,051	81.650	1,228,914.150	
	MTN GROUP LTD	206,758	135.700	28,057,060.600	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	45,937	354.520	16,285,585.240	
	TELKOM SA LTD	35,055	28.950	1,014,842.250	
	FIRSTRAND LTD	353,952	21.350	7,556,875.200	
	NASPERS LTD	47,307	367.000	17,361,669.000	
	NEDBANK GROUP LTD	22,441	149.000	3,343,709.000	
	NETCARE LTD	107,183	13.360	1,431,964.880	
	PICK'N PAY STORES LTD	43,573	46.990	2,047,495.270	
	REUNERT LTD	27,813	65.610	1,824,810.930	
	RMB HOLDINGS LTD	65,616	28.210	1,851,027.360	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	7,563	547.000	4,136,961.000	
	SAPPI LTD	77,806	23.950	1,863,453.700	
	SASOL LTD	65,210	394.900	25,751,429.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	55,550	136.640	7,590,352.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	138,335	100.500	13,902,667.500	

	SPAR GROUP LTD/THE	24,486	108.150	2,648,160.900	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	87,713	40.880	3,585,707.440	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	19,769	126.800	2,506,709.200	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	30,562	101.200	3,092,874.400	
	ABSA GROUP LTD	31,143	145.610	4,534,732.230	
	TIGER BRANDS LTD	19,506	246.000	4,798,476.000	
	SANLAM LTD	199,453	30.020	5,987,579.060	
	INVESTEC LTD	36,918	44.120	1,628,822.160	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	62,101	171.250	10,634,796.250	
	KUMBA IRON ORE LTD	9,139	518.000	4,734,002.000	
	PRETORIA PORTLAND CEMENT CO LTD	86,489	26.900	2,326,554.100	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	66,533	20.980	1,395,862.340	
	RMI HOLDINGS	151,682	14.700	2,229,725.400	
	VODACOM GROUP PTY LTD	45,328	91.500	4,147,512.000	
	ARROWHEAD PROPERTIES LTD-A	10,052	5.660	56,894.320	
	ARROWHEAD PROPERTIES LTD-B	10,052	4.100	41,213.200	
南アフリカ・ ランド小計	銘柄数 : 51	3,603,987		256,212,482.310	
	組入時価比率 : 7.35%			(2,426,332,207)	
	合計時価比率 : 7.38%				
合計				31,366,782,491	
				(31,366,782,491)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	VANGUARD MSCI EMERGING MARKETS	435,900.00	17,327,025.000	
米ドル小計	銘柄数： 1	435,900.00	17,327,025.000	
	組入時価比率： 4.04%		(1,332,274,952)	
	合計時価比率： 4.05%			
	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	235,000.00	22,339,100.000	
	CEMEX SAB DE CV	1,384,442.00	10,203,337.540	
メキシコ ペソ小計	銘柄数： 2	1,619,442.00	32,542,437.540	
	組入時価比率： 0.55%		(182,888,499)	
	合計時価比率： 0.56%			
投資信託受益証券計			1,515,163,451	
			(1,515,163,451)	
投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	73,844.00	142,518.920	
トルコ・リラ小計	銘柄数： 1	73,844.00	142,518.920	
	組入時価比率： 0.02%		(5,858,953)	
	合計時価比率： 0.02%			
投資証券計			5,858,953	
			(5,858,953)	
合計			1,521,022,404	
			(1,521,022,404)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 56銘柄	11.62%	11.66%
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.04%	4.05%
ユーロ	株式 1銘柄	0.05%	0.05%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	1.21%	1.22%
ハンガリー フォリント	株式 4銘柄	0.27%	0.27%
チェコ コルナ	株式 3銘柄	0.32%	0.32%
トルコ・リラ	株式 23銘柄	1.13%	1.14%
トルコ・リラ	投資証券 1銘柄	0.02%	0.02%
インドネシアルピア	株式 25銘柄	2.87%	2.88%
フィリピンペソ	株式 18銘柄	0.71%	0.71%
タイバーツ	株式 21銘柄	1.81%	1.82%
香港ドル	株式 147銘柄	16.96%	17.02%
韓国ウォン	株式 105銘柄	13.92%	13.97%
新台湾ドル	株式 113銘柄	10.37%	10.40%
インド・ルピー	株式 72銘柄	4.39%	4.41%
マレーシアリングgit	株式 43銘柄	3.31%	3.32%
メキシコ ペソ	株式 21銘柄	3.87%	3.88%
メキシコ ペソ	投資信託受益証券 2銘柄	0.55%	0.56%
ブラジル・レアル	株式 82銘柄	14.77%	14.82%
モロッコ・ディルハム	株式 3銘柄	0.09%	0.09%
南アフリカ・ランド	株式 51銘柄	7.35%	7.38%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,397,911,926	873,647,571
国債証券		322,573,919,600	310,960,050,900
地方債証券		28,262,974,448	27,599,541,199
特殊債券		40,170,595,634	36,028,802,468
社債券		33,525,809,740	28,803,244,940
未収利息		1,248,628,767	1,197,897,440
前払費用		61,692,067	40,940,020
流動資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538
資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538
負債の部			
流動負債			
未払解約金		175,433,000	49,249,000
流動負債合計		175,433,000	49,249,000
負債合計		175,433,000	49,249,000
純資産の部			
元本等			
元本		382,815,805,870	355,473,910,842
剰余金			
剰余金又は欠損金()		44,250,293,312	49,980,964,696
元本等合計		427,066,099,182	405,454,875,538
純資産合計		427,066,099,182	405,454,875,538
負債純資産合計		427,241,532,182	405,504,124,538

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月16日から平成23年2月14日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月15日から平成24年2月14日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	393,327,506,035円	382,815,805,870円
同期中追加設定元本額	36,365,847,352円	45,298,515,774円
同期中解約元本額	46,877,547,517円	72,640,410,802円
同期末における元本の内訳		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	3,206,343,130円	5,155,256,189円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	7,362,564,589円	8,922,325,995円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	2,527,472,340円	2,726,495,700円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	4,021,199,991円	4,167,936,865円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,630,226,006円	1,613,401,322円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,160,677,732円	1,162,260,661円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,144,755,923円	1,144,513,455円

D I A M D C バランス70インデックスファンド	141,655,342円	143,628,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	223,569,498円	187,546,557円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,022,475,991円	2,054,399,443円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	1,113,051円	9,400,626円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	10,126,042円	10,126,042円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	17,824,993,618円	19,646,256,891円
D I A M国内債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定)	111,008,492円	110,129,562円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	880,631,582円	786,265,876円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	12,866,521,066円	11,483,027,617円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	731,575,501円	621,814,679円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	495,928,416円	440,076,924円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,206,613,436円	1,083,119,886円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	573,513,324円	494,258,303円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	402,399,684円	347,099,993円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,348,959,090円	27,029,746,082円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,094,541,385円	8,918,132,672円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	13,990,484,377円	12,545,486,322円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,327,235,731円	4,608,440,444円

D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	8,316,169,080円	7,044,247,918円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	1,890,509,761円	1,633,954,855円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	6,625,226,349円	5,968,970,466円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	8,112,251,131円	7,324,395,966円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	14,562,601,859円	13,597,303,957円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	711,652,567円	708,137,610円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	595,564,015円	円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	14,947,846,567円	13,259,924,844円
D I A Mアイエヌジー世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	7,370,232,806円	6,699,998,806円
D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	1,543,769,952円	1,421,114,722円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	111,216,690,515円	100,827,988,739円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	2,820,350,588円	2,463,053,761円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	10,098,797,743円	9,343,943,979円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	33,627,817,936円	30,791,603,401円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	2,329,762,532円	2,155,530,686円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	241,057円	228,742円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	150,296円	139,716円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	36,630,963,943円	33,787,052,960円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	689,313,902円	749,365,188円

D I A M国内バランス30VA （適格機関投資家限定）	189,363,623円	196,036,686円
D I A Mバランス20VA（適 格機関投資家限定）	2,199,536,122円	2,059,389,385円
D I A Mバランス40VA（適 格機関投資家限定）	316,732円	304,419円
D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	230,618円	216,500円
（合 計）	382,815,805,870円	355,473,910,842円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	382,815,805,870口	355,473,910,842口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,663,133,300	6,918,869,400
地方債証券	102,062,963	269,324,504
特殊債券	49,332,711	328,958,769
社債券	862,770	563,869,500
合計	2,815,391,744	6,953,283,173

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1156円	1.1406円
（1万口当たり純資産額）	（11,156円）	（11,406円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	3 0 1 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,720,000	
	3 0 2 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,001,840,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,501,485,000	
	3 0 4 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,100,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券（2年）	3,000,000,000	3,003,360,000	
	3 0 6 回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	2,002,380,000	
	3 0 7 回 利付国庫債券（2年）	2,200,000,000	2,202,772,000	
	3 0 8 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,490,000	
	3 0 9 回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,499,475,000	
	3 1 0 回 利付国庫債券（2年）	500,000,000	500,730,000	
	7 0 回 利付国庫債券（5年）	4,900,000,000	4,939,004,000	
	7 2 回 利付国庫債券（5年）	4,200,000,000	4,282,404,000	
	7 5 回 利付国庫債券（5年）	4,600,000,000	4,675,394,000	
	7 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,552,115,000	
	8 1 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,564,800,000	
	8 3 回 利付国庫債券（5年）	3,400,000,000	3,461,574,000	
	8 5 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,549,875,000	
	8 7 回 利付国庫債券（5年）	3,800,000,000	3,834,808,000	
	8 8 回 利付国庫債券（5年）	3,500,000,000	3,532,515,000	
	8 9 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,526,730,000	
	9 1 回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,709,588,000	
	9 2 回 利付国庫債券（5年）	3,000,000,000	3,006,000,000	
	9 3 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,045,650,000	
	9 5 回 利付国庫債券（5年）	2,000,000,000	2,025,960,000	
	9 6 回 利付国庫債券（5年）	1,500,000,000	1,513,290,000	
	9 7 回 利付国庫債券（5年）	4,500,000,000	4,518,630,000	
	9 9 回 利付国庫債券（5年）	5,000,000,000	5,018,400,000	
	2 回 利付国庫債券（40年）	600,000,000	620,292,000	
	3 回 利付国庫債券（40年）	1,000,000,000	1,029,910,000	
	4 回 利付国庫債券（40年）	700,000,000	718,130,000	
	2 4 7 回 利付国庫債券（10年）	700,000,000	705,572,000	
	2 5 0 回 利付国庫債券（10年）	2,060,000,000	2,071,124,000	
	2 5 4 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,757,807,000	
	2 5 6 回 利付国庫債券（10年）	2,500,000,000	2,561,225,000	
	2 5 8 回 利付国庫債券（10年）	1,000,000,000	1,025,230,000	
	2 6 0 回 利付国庫債券（10年）	2,100,000,000	2,173,563,000	
	2 6 3 回 利付国庫債券（10年）	2,700,000,000	2,803,248,000	

266回	利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,831,387,000
269回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,005,000
270回	利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,969,407,000
272回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,188,767,000
274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,515,656,000
277回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,163,320,000
280回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,996,924,000
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,617,838,000
284回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,305,840,000
285回	利付国庫債券(10年)	4,900,000,000	5,236,042,000
286回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,766,140,000
288回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,860,820,000
289回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,611,242,000
290回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,382,560,000
293回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,414,700,000
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,257,040,000
297回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,384,832,000
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,258,162,000
301回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,045,936,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,957,864,000
305回	利付国庫債券(10年)	5,100,000,000	5,341,791,000
306回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,739,805,000
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,878,444,000
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,053,840,000
310回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,572,990,000
312回	利付国庫債券(10年)	5,700,000,000	5,872,824,000
313回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,737,380,000
315回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,128,050,000
317回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,563,855,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,205,844,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	117,506,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	111,226,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	219,074,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,680,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	215,652,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,422,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	328,194,000
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	503,815,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	394,728,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	316,998,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	311,388,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	555,465,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	225,976,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	452,372,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	222,360,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	896,571,600
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	218,638,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	338,799,000

2 1 回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	545,455,000
2 2 回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	530,775,700
2 3 回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	452,104,000
2 4 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	678,138,000
2 5 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	654,432,000
2 6 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,110,670,000
2 7 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,018,674,000
2 8 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	906,072,000
2 9 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,668,210,000
3 0 回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,636,845,000
3 1 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,282,740,000
3 2 回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,741,392,000
3 3 回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,836,810,000
3 4 回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,126,580,000
3 5 回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,728,968,000
3 7 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	690,684,000
3 9 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	452,056,000
4 0 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	803,728,800
4 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	914,112,000
4 3 回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	1,005,150,800
4 5 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,019,844,000
4 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	558,145,000
4 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,060,523,000
4 8 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	571,070,000
5 0 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	849,724,200
5 1 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	659,070,000
5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	609,031,500
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	781,844,000
5 5 回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	888,910,200
5 7 回	利付国庫債券(20年)	830,000,000	902,218,300
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	652,092,000
6 0 回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,023,452,100
6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	792,432,000
6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	965,630,000
6 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	865,776,000
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,405,937,000
6 7 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,402,609,000
7 0 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,419,087,500
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,375,287,500
7 3 回	利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,510,207,200
7 5 回	利付国庫債券(20年)	1,340,000,000	1,469,645,000
7 8 回	利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,658,190,000
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,513,792,000
8 3 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,745,776,000
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,907,272,500
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,892,695,000
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,760,112,000
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,844,636,000

	9 3 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,069,730,000	
	9 4 回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	866,824,000	
	9 5 回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,886,898,000	
	9 7 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,641,600,000	
	9 9 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,725,616,000	
	1 0 0 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,963,980,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,789,760,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,932,462,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,144,600,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,082,220,000	
	1 1 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,386,362,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,136,320,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,133,360,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(20年)	2,600,000,000	2,811,692,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,258,452,000	
	1 1 9 回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,526,385,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,270,400,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,339,392,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,588,472,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,235,040,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,013,120,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,529,400,000	
国債証券計			310,960,050,900	
地方債証券	6 0 2 回 東京都公募公債	148,000,000	151,214,560	
	6 1 1 回 東京都公募公債	200,000,000	207,910,000	
	6 1 2 回 東京都公募公債	161,500,000	167,417,360	
	6 1 4 回 東京都公募公債	200,000,000	206,732,000	
	6 1 6 回 東京都公募公債	100,000,000	103,413,000	
	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	206,768,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	208,026,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	206,888,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	110,433,336	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	207,008,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	104,446,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	104,954,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	515,785,400	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	123,214,192	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	106,741,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	213,244,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	214,156,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	160,215,000	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	106,956,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	217,311,545	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	316,197,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	319,824,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	209,626,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	512,435,000	

6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	201,286,000	
1 5 年度 2 回 北海道公募公債	203,000,000	205,608,550	
1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	257,417,500	
1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	203,604,495	
1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	107,516,000	
1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	323,439,000	
2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	212,116,000	
1 2 5 回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,636,000	
1 2 6 回 神奈川県公募公債	178,870,000	184,168,129	
1 2 7 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,003,000	
1 2 8 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,430,000	
1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	161,582,652	
1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	209,636,000	
1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	104,575,000	
1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	314,574,000	
2 6 1 回 大阪府公募公債	129,000,000	132,121,800	
2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	206,342,000	
2 8 5 回 大阪府公募公債	100,000,000	104,321,000	
2 8 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	208,766,000	
2 8 9 回 大阪府公募公債	200,000,000	211,676,000	
2 9 3 回 大阪府公募公債	200,000,000	215,122,000	
3 0 1 回 大阪府公募公債	100,000,000	106,934,000	
3 1 0 回 大阪府公募公債	240,000,000	254,767,200	
3 3 6 回 大阪府公募公債	200,000,000	209,446,000	
1 回 大阪府公募公債 7 年	500,000,000	512,560,000	
1 5 年度 3 回 京都府公募公債	219,300,000	224,881,185	
1 6 年度 2 回 京都府公募公債	100,000,000	103,409,000	
1 8 年度 1 回 京都府公募公債	100,000,000	106,329,000	
1 4 年度 5 回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,642,000	
1 5 年度 1 回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,589,000	
1 6 年度 4 回 兵庫県公募公債	251,970,000	259,899,495	
1 6 年度 8 回 兵庫県公募公債	111,500,000	116,196,380	
1 7 年度 2 回 兵庫県公募公債	200,000,000	206,932,000	
1 7 年度 9 回 兵庫県公募公債	306,000,000	320,351,400	
1 7 年度 1 3 回 兵庫県公募公債	105,000,000	110,630,100	
1 8 年度 1 回 兵庫県公募公債	120,000,000	127,058,400	
1 5 年度 3 回 静岡県公募公債	116,130,000	118,643,053	
1 8 年度 5 回 静岡県公募公債	129,800,000	138,740,624	
2 1 年度 5 回 静岡県公募公債	197,000,000	206,286,580	
1 5 年度 1 回 愛知県公募公債	303,600,000	310,169,904	
1 6 年度 2 回 愛知県公募公債	200,000,000	207,572,000	
1 8 年度 2 回 愛知県公募公債	160,300,000	171,870,454	
2 0 年度 4 回 愛知県公募公債	100,000,000	106,650,000	
2 2 年度 6 回 愛知県公募公債	200,000,000	205,388,000	
1 6 年度 2 回 広島県公募公債	200,000,000	207,738,000	
2 2 年度 1 回 広島県公募公債	200,000,000	208,618,000	
1 5 年度 3 回 埼玉県公募公債	100,000,000	102,407,000	
1 7 年度 2 回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,780,000	

1 8 年度 1 回	埼玉県公募公債	200,000,000	212,258,000	
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	464,802,800	
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	203,932,000	
1 6 年度 3 回	福岡県公募公債	131,040,000	135,237,211	
1 7 年度 1 回	福岡県公募公債	100,000,000	103,922,000	
1 7 年度 5 回	福岡県公募公債	100,000,000	104,648,000	
1 8 年度 1 回	福岡県公募公債	104,000,000	112,194,160	
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	212,540,000	
1 5 年度 4 回	千葉県公募公債	100,000,000	102,432,000	
1 6 年度 3 回	千葉県公募公債	100,000,000	104,361,000	
1 6 年度 8 回	千葉県公募公債	200,000,000	206,412,000	
1 7 年度 2 回	千葉県公募公債	200,000,000	206,868,000	
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	323,229,000	
2 1 年度 6 回	千葉県公募公債	200,000,000	210,386,000	
1 8 年度 2 回	新潟県公募公債	169,000,000	180,851,970	
2 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,565,000	
3 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,456,000	
8 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,516,000	
9 回	共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,331,900	
1 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,975,000	
1 2 回	共同発行市場公募地方債	130,000,000	133,416,400	
1 3 回	共同発行市場公募地方債	221,000,000	227,508,450	
1 8 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,681,000	
1 9 回	共同発行市場公募地方債	130,000,000	134,907,500	
2 0 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,578,000	
2 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,116,000	
2 3 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,206,000	
2 5 回	共同発行市場公募地方債	304,000,000	315,071,680	
2 8 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,988,000	
2 9 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,838,000	
3 1 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,854,000	
3 2 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,748,000	
3 3 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,868,000	
3 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,246,000	
3 6 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,195,000	
3 7 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,181,500	
3 8 回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	182,064,900	
3 9 回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	155,879,820	
4 0 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	161,643,000	
4 7 回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	172,865,136	
5 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,486,000	
5 7 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,360,000	
6 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	318,693,000	
6 5 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,763,000	
7 5 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	534,990,000	
8 0 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	742,763,000	
9 4 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,671,000	
1 7 年度 3 回	大阪市公募公債	100,000,000	103,233,000	

	17年度7回 大阪市公募公債	200,000,000	207,434,000	
	17年度8回 大阪市公募公債	200,000,000	209,042,000	
	17年度11回 大阪市公募公債	100,000,000	104,797,000	
	18年度2回 大阪市公募公債	100,000,000	106,846,000	
	18年度3回 大阪市公募公債	150,000,000	161,118,000	
	19年度5回 大阪市公募公債	135,000,000	145,682,550	
	12回さ号 名古屋市公募公債	100,000,000	100,569,000	
	12回ひ号 名古屋市公募公債	200,000,000	206,972,000	
	12回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	373,811,695	
	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	103,826,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	109,173,933	
	16年度5回 神戸市公募公債	200,000,000	206,586,000	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	108,160,300	
	15年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,650,000	
	16年度1回 横浜市公募公債	200,000,000	206,094,000	
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	309,759,000	
	14年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	100,646,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	103,869,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	106,396,000	
	19回 川崎市公募公債 5年	100,000,000	101,743,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	106,582,000	
	16年度1回 広島市公募公債	100,000,000	103,293,000	
	16年度2回 千葉市公募公債	100,000,000	103,412,000	
地方債証券計			27,599,541,199	
特殊債券	8回 政保日本政策投資銀行債券	102,000,000	106,246,260	
	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	130,075,000	
	16回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,238,000	
	7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,228,000	
	9回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,221,000	
	13回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,857,000	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,056,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,176,000	
	34回 日本道路・機構承継債	200,000,000	207,084,000	
	319回 政保道路債	132,000,000	133,569,480	
	322回 政保道路債	106,000,000	108,651,060	
	323回 政保道路債	200,000,000	205,142,000	
	324回 政保道路債	200,000,000	204,968,000	
	328回 政保道路債	200,000,000	206,244,000	
	329回 政保道路債	100,000,000	103,448,000	
	333回 政保道路債	300,000,000	311,541,000	
	335回 政保道路債	237,000,000	245,164,650	
	338回 政保道路債	264,000,000	274,536,240	
	339回 政保道路債	301,000,000	312,254,390	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	429,396,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	321,198,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	425,396,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	748,622,000	

	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,274,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	219,936,970	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	113,725,080	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,547,000	
	16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	323,349,250	
	17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	131,212,220	
	19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,701,000	
	21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	400,826,250	
	23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,362,000	
	29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,626,000	
	30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,977,000	
	33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	316,982,160	
	36回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	371,265,440	
	40回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	357,671,980	
	47回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,882,000	
	56回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,934,000	
	66回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,961,380	
	67回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	428,324,140	
	71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	632,880,000	
	78回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,966,000	
	82回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,161,000	
	89回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,647,000	
	16回 日本道路・機構承継債	430,000,000	433,663,600	
	26回 日本道路・機構承継債	200,000,000	205,460,000	
	41回 日本道路・機構承継債	300,000,000	311,109,000	
	832回 政保公営企業債券	298,000,000	304,544,080	
	834回 政保公営企業債券	207,000,000	212,371,650	

	8 3 7 回 政保公営企業債券	432,000,000	443,581,920	
	8 3 8 回 政保公営企業債券	600,000,000	618,018,000	
	8 3 9 回 政保公営企業債券	260,000,000	268,065,200	
	8 4 3 回 政保公営企業債券	100,000,000	103,482,000	
	8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	207,074,000	
	8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,566,000	

[前](#) [次](#)

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
	8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	271,353,870	
	8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	310,599,000	
	8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	210,599,400	
	8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	316,132,640	
	8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	209,030,000	
	8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	216,824,220	
	8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	253,849,070	
	8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	214,396,000	
	8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	213,340,000	
	8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	107,827,600	
	8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	108,989,040	
	8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	514,737,440	
	8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	691,342,470	
	3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,176,150	
	5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,760,000	
	8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,080,000	
	1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,165,000	
	1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,804,000	
	2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,899,000	
	1 2 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,179,000	
	1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	103,625,000	
	1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,242,000	
	1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	104,477,000	
	2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	214,484,000	
	2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	321,909,000	
	1 9 1 回 政保首都高速道路債券	113,000,000	117,592,320	
	1 4 2 回 政保阪神高速道路債	100,000,000	103,422,000	
	1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	110,953,650	
	5 回 阪神高速道路・機構承継債	100,000,000	103,292,000	
	1 7 6 回 政保中小企業債券	100,000,000	102,398,000	
	1 8 0 回 政保中小企業債券	142,000,000	147,709,820	
	1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	107,820,960	
	2 6 回 中小企業債券	400,000,000	410,004,000	
	1 5 回 国際協力銀行債券	200,000,000	207,096,000	
	8 回 国際協力銀行債券	300,000,000	301,416,000	
	1 2 回 国際協力銀行債券	200,000,000	205,802,000	
	2 回 都市再生債券	100,000,000	104,389,000	
	1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	216,772,000	
	2 3 回 都市再生機構債券	200,000,000	203,628,000	
	2 回 本州四国連絡・機構承継債券	100,000,000	103,039,000	
	6 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	102,676,000	
	1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,524,000	

3 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,798,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,734,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	124,638,000	132,450,309	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	86,258,000	91,084,135	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	129,114,000	136,889,245	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	150,030,000	158,923,778	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	65,906,000	69,516,330	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	338,025,000	352,499,230	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,409,000	83,631,792	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,019,000	64,892,486	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	237,304,000	252,709,775	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	190,224,000	200,834,694	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	323,285,000	339,698,179	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	413,395,000	431,658,791	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	726,512,000	751,620,254	
1 4 回 政保国民生活債券	132,000,000	136,540,800	
7 0 4 号 利附商工債	200,000,000	204,472,000	
7 0 6 号 利付商工債	300,000,000	307,203,000	
7 1 4 号 利付商工債	300,000,000	305,133,000	
7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	301,446,000	
7 3 2 号 利付商工債	200,000,000	201,588,000	
6 9 4 号 利附農林債	400,000,000	404,232,000	
6 9 5 号 利附農林債	200,000,000	202,258,000	
6 9 8 号 利附農林債	300,000,000	305,670,000	
7 0 1 号 利附農林債	200,000,000	204,176,000	
7 0 9 号 利附農林債	400,000,000	408,292,000	
7 1 3 号 利附農林債	300,000,000	303,942,000	
7 1 7 号 利附農林債	300,000,000	303,666,000	
7 2 1 号 利附農林債	120,000,000	120,900,000	
2 2 2 回 利附信金中金債	200,000,000	203,146,000	
2 2 3 回 利附信金中金債	300,000,000	305,445,000	
2 2 6 回 利附信金中金債	300,000,000	305,616,000	
2 2 9 回 利附信金中金債	400,000,000	408,924,000	
2 3 3 回 利附信金中金債	300,000,000	307,356,000	
2 3 6 回 利附信金中金債	300,000,000	304,641,000	
2 4 1 回 利附信金中金債	300,000,000	303,384,000	
1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	106,003,540	
2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	105,680,340	
4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,974,300	

	8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	182,693,900	
	21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	321,972,000	
	5回 中日本高速道路債券	200,000,000	215,376,000	
	1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	210,957,540	
	5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	277,111,870	
	6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	125,294,130	
	2回 鉄道建設運輸施設債	300,000,000	311,952,000	
特殊債券計			36,028,802,468	
社債券	345回 東京地下鉄社債	100,000,000	100,501,000	
	9回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,505,000	
	12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,133,000	
	14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,561,000	
	2回 JPMorgan・チェース劣後債	100,000,000	98,641,000	
	4回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	99,235,000	
	16回 シティグループ円貨社債	100,000,000	97,937,000	
	22回 シティグループ円貨社債	200,000,000	200,680,000	
	7回 ウエストパック銀行円貨社債	100,000,000	99,584,000	
	1回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	102,433,000	
	1回 キリンホールディングス社債	100,000,000	100,983,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	105,935,000	
	5回 日本たばこ産業社債	100,000,000	101,978,000	
	25回 住友化学工業社債	100,000,000	102,332,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	105,254,000	
	25回 三菱化学社債	100,000,000	101,600,000	
	34回 三井化学社債	100,000,000	105,374,000	
	2回 花王社債	100,000,000	102,340,000	
	24回 新日本石油社債	100,000,000	103,614,000	
	8回 旭硝子社債	100,000,000	100,569,000	
	29回 新日本製鐵社債	100,000,000	114,197,000	
	48回 新日本製鐵社債	100,000,000	101,003,000	
	52回 新日本製鐵社債	100,000,000	103,018,000	
	13回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	101,547,000	
	15回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,637,000	
	12回 日立製作所社債	100,000,000	100,602,000	
	25回 富士通社債	100,000,000	103,655,000	
	7回 パナソニック社債	200,000,000	204,702,000	
	10回 パナソニック社債	200,000,000	202,066,000	
	11回 パナソニック社債	100,000,000	102,247,000	
	24回 シャープ社債	200,000,000	202,466,000	
	17回 ソニー社債	100,000,000	103,806,000	
	19回 ソニー社債	100,000,000	101,469,000	
	3回 パナソニック電工社債	100,000,000	104,180,000	
	19回 三菱重工業社債	100,000,000	107,029,000	

4 9 回	日産自動車社債	100,000,000	103,985,000	
5 1 回	日産自動車社債	100,000,000	101,044,000	
7 回	トヨタ自動車社債	300,000,000	306,222,000	
9 回	トヨタ自動車社債	200,000,000	203,790,000	
4 9 回	伊藤忠商事社債	100,000,000	109,553,000	
7 7 回	丸紅社債	100,000,000	101,105,000	
4 5 回	三井物産社債	100,000,000	100,630,000	
2 9 回	住友商事社債	100,000,000	101,235,000	
1 6 回	三菱商事社債	100,000,000	105,439,000	
1 4 回	クレディセゾン社債	100,000,000	100,758,000	
1 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	200,000,000	205,756,000	
7 回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	107,772,000	
1 3 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	203,304,000	
1 4 回	みずほコーポレート銀行社債	100,000,000	102,317,000	
1 5 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	204,288,000	
1 8 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,648,000	
2 0 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	202,062,000	
2 4 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,146,000	
1 0 0 回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	203,368,000	
1 0 6 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	304,638,000	
1 1 2 回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,018,000	
1 1 4 回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	202,096,000	
3 回 2 号	三菱東京UFJ銀行社債 (劣後)	200,000,000	202,340,000	
6 回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	103,331,000	
8 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,824,000	
1 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,640,000	
2 8 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	202,810,000	
1 1 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,738,000	
4 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,052,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,861,000	
4 回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,871,000	
7 回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	104,866,000	
5 回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,709,000	
4 5 回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,882,000	
4 7 回	三井住友銀行社債	200,000,000	203,116,000	
5 0 回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,898,000	
5 1 回	三井住友銀行社債	200,000,000	199,700,000	
6 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	101,855,000	
7 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,994,000	
8 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,714,000	
9 回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,792,000	
1 1 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,750,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,984,000	
1 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,795,000	
6 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,013,000	
1 0 回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,544,000	

14回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,846,000
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,978,000
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,909,000
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	106,590,000
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	320,649,000
40回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,863,000
118回	オリックス社債	100,000,000	103,262,000
144回	オリックス社債	100,000,000	100,924,000
148回	オリックス社債	200,000,000	200,256,000
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,410,000
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	105,050,000
15回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,954,000
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,466,000
20回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,229,000
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,010,000
24回	三井不動産社債	100,000,000	104,699,000
31回	三井不動産社債	100,000,000	103,500,000
66回	三菱地所社債	100,000,000	100,723,000
79回	三菱地所社債	200,000,000	213,144,000
90回	三菱地所社債	100,000,000	106,280,000
73回	住友不動産社債	100,000,000	100,852,000
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	107,877,000
2回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	228,220,000
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,146,000
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,541,000
25回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	301,824,000
31回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,598,000
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,231,000
3回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,414,000
10回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,949,000
1回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,188,000
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	229,716,000
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,842,000
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	199,064,900
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,321,000
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	106,660,000
48回	日本電信電話社債	400,000,000	413,912,000
50回	日本電信電話社債	100,000,000	104,341,000
51回	日本電信電話社債	200,000,000	214,198,000
58回	日本電信電話社債	100,000,000	101,719,000
5回	KDDI社債	100,000,000	113,726,000
16回	NTTドコモ社債	200,000,000	203,934,000
18回	NTTドコモ社債	200,000,000	201,834,000
455回	東京電力社債	200,000,000	135,328,000
511回	東京電力社債	100,000,000	85,570,000
516回	東京電力社債	100,000,000	79,751,000
519回	東京電力社債	372,000,000	285,275,640
542回	東京電力社債	500,000,000	337,095,000

407回	中部電力社債	100,000,000	109,154,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	339,957,000	
463回	中部電力社債	200,000,000	200,894,000	
467回	中部電力社債	100,000,000	102,490,000	
468回	中部電力社債	100,000,000	102,231,000	
471回	中部電力社債	300,000,000	305,910,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	106,725,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	104,722,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	208,830,000	
484回	中部電力社債	200,000,000	203,958,000	
487回	中部電力社債	140,000,000	141,590,400	
496回	中部電力社債	500,000,000	497,390,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	317,532,000	
427回	関西電力社債	100,000,000	101,427,000	
433回	関西電力社債	200,000,000	203,578,000	
441回	関西電力社債	200,000,000	204,876,000	
446回	関西電力社債	200,000,000	207,970,000	
298回	中国電力社債	200,000,000	222,478,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	224,750,000	
341回	中国電力社債	100,000,000	102,209,000	
350回	中国電力社債	200,000,000	204,974,000	
245回	北陸電力社債	200,000,000	220,934,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	108,222,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	211,462,000	
289回	北陸電力社債	300,000,000	306,432,000	
368回	東北電力社債	300,000,000	327,735,000	
375回	東北電力社債	100,000,000	109,852,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	336,786,000	
420回	東北電力社債	100,000,000	101,370,000	
427回	東北電力社債	200,000,000	204,202,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	524,780,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	106,299,000	
257回	四国電力社債	200,000,000	204,280,000	
374回	九州電力社債	300,000,000	304,914,000	
382回	九州電力社債	100,000,000	102,293,000	
383回	九州電力社債	100,000,000	102,438,000	
387回	九州電力社債	200,000,000	207,274,000	
257回	北海道電力社債	200,000,000	225,412,000	
282回	北海道電力社債	200,000,000	203,302,000	
284回	北海道電力社債	500,000,000	513,670,000	
286回	北海道電力社債	100,000,000	102,378,000	
2回	電源開発社債	100,000,000	101,590,000	
4回	電源開発社債	200,000,000	202,678,000	
6回	電源開発社債	100,000,000	102,266,000	
14回	電源開発社債	100,000,000	102,646,000	
17回	電源開発社債	100,000,000	104,884,000	
14回	東京ガス社債	100,000,000	112,086,000	
24回	東京瓦斯社債	200,000,000	204,306,000	

	9回 大阪ガス社債	100,000,000	113,708,000	
	24回 大阪瓦斯社債	100,000,000	103,532,000	
	27回 大阪瓦斯社債	100,000,000	101,744,000	
	20回 NTTデータ社債	100,000,000	101,189,000	
社債券計			28,803,244,940	
合計			403,391,639,507	

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		8,022,524,784	3,821,539,025
コール・ローン		880,906,590	1,479,680,769
国債証券		384,733,019,200	346,635,059,718
派生商品評価勘定		103,677	756,767
未収利息		4,842,963,020	4,092,985,592
前払費用		220,292,547	173,177,455
流動資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326
資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,736,569	376,064
未払金		4,283,669,735	1,730,575,372
未払解約金		31,598,000	26,875,000
流動負債合計		4,320,004,304	1,757,826,436
負債合計		4,320,004,304	1,757,826,436
純資産の部			
元本等			
元本		350,943,197,818	320,315,770,753
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		43,436,607,696	34,129,602,137
元本等合計		394,379,805,514	354,445,372,890
純資産合計		394,379,805,514	354,445,372,890
負債純資産合計		398,699,809,818	356,203,199,326

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年2月23日から平成23年2月21日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年2月22日から平成24年2月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中解約元本額	339,613,935,374円 32,957,377,043円 21,628,114,599円	350,943,197,818円 34,916,229,537円 65,543,656,602円
同期末における元本の内訳 D I A M外国債券パッシブ・ファンド D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金> D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型 D I A M DC バランス30インデックスファンド D I A M DC バランス50インデックスファンド D I A M DC バランス70インデックスファンド マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	4,574,134,629円 3,580,764,901円 297,183,514円 1,081,861,380円 1,177,346,407円 323,613,584円 632,799,046円 414,382,579円 178,030,226円	1,999,508,906円 3,985,025,882円 336,613,649円 1,167,060,872円 1,182,837,108円 337,866,678円 657,766,156円 401,779,916円 161,278,829円

マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,606,931,925円	1,764,418,944円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,175,814円	13,413,592円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	9,015,830,509円	6,140,558,650円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,150,240,749円	8,280,258,279円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,629,093,022円	6,776,955,433円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	948,036,288円	946,676,260円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	269,744,724円	240,836,858円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	51,933,106,616円	46,312,994,177円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,944,918,247円	2,510,570,901円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	498,993,629円	443,974,690円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	809,273,188円	727,637,617円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	230,874,683円	199,244,006円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	101,038,275円	87,637,321円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,549,846,148円	27,250,002,344円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,769,830,622円	5,992,515,436円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	12,341,497,659円	11,070,345,668円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,814,032,741円	5,030,172,400円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,376,189,817円	7,104,841,199円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	3,179,473,611円	2,746,963,331円

D I A Mグローバル・アセット ・バランスV A 2（適格機関投資 家限定）	9,356,072,523円	8,428,452,355円
D I A M アクサ グローバル バ ランスファンド3 0 V A（適格 機関投資家限定）	10,858,768,967円	9,873,989,080円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A（適格機関投資家 向け）	53,494,918,132円	50,572,642,858円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	229,613,168円	267,315,107円
D I A M為替フルヘッジ型グ ローバルアセット私募ファンド （適格機関投資家向け）	562,278,813円	円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A（適格機関投資家限 定）	7,410,654,771円	6,625,486,509円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A（適格機 関投資家限定）	16,259,741,187円	14,994,966,188円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A（適格機関投資家限定）	285,986,643円	290,931,174円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定）	27,943,466,960円	25,427,832,054円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定）	33,836,231,153円	31,042,712,077円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	880,604,875円	813,502,633円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	243,618円	230,982円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	151,623円	140,632円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	29,514,006,257円	27,256,172,658円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	211,562,092円	229,549,307円
D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定）	665,284,710円	621,742,683円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	227,931円	218,810円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	139,862円	130,544円
（合 計）	350,943,197,818円	320,315,770,753円
*2 本有価証券報告書における開 示対象ファンドの計算期間末日 における受益権の総数	350,943,197,818口	320,315,770,753口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	554,332,068	14,933,279,836
合計	554,332,068	14,933,279,836

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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)

(通貨関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	メキシコ ペソ	65,510,955	-	65,427,000	83,955
	買建				
	ユーロ	268,039,814	-	265,179,790	2,860,024
	英ポンド	66,920,898	-	66,940,620	19,722
	米ドル	334,597,005	-	332,720,460	1,876,545
	合 計	735,068,672	-	730,267,870	4,632,892

平成24年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	ユーロ	93,786,574	-	93,776,430	10,144
	買建				
	オーストラリアドル	12,843,112	-	12,891,670	48,558
	カナダドル	25,775,421	-	25,906,790	131,369
	ポーランドズロチ	38,758,424	-	38,984,000	225,576
	ユーロ	477,097,414	-	476,721,350	376,064
	英ポンド	90,259,500	-	90,348,800	89,300
	米ドル	645,078,900	-	645,330,720	251,820
	合 計	1,383,599,345	-	1,383,959,760	380,703

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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おります。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買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電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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口当たり情報に関する注記)

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1238円	1.1065円
(1万口当たり純資産額)	(11,238円)	(11,065円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US T N/B 0.625 01/31/13	20,000,000.00	20,100,000.000	
	US T N/B 3.875 02/15/13	32,000,000.00	33,299,840.000	
	US T N/B 1.375 03/15/13	28,000,000.00	28,393,680.000	
	US T N/B 1.75 04/15/13	25,000,000.00	25,496,000.000	
	US T N/B 3.625 05/15/13	29,000,000.00	30,341,250.000	
	US T N/B 3.5 05/31/13	32,000,000.00	33,467,200.000	
	US T N/B 1.0 07/15/13	40,000,000.00	40,476,400.000	
	US T N/B 4.25 08/15/13	35,000,000.00	37,244,900.000	
	US T N/B 0.125 08/31/13	35,000,000.00	34,950,650.000	
	US T N/B 0.5 10/15/13	30,000,000.00	30,139,200.000	
	US T N/B 4.25 11/15/13	40,000,000.00	42,940,400.000	
	US T N/B 0.75 12/15/13	25,000,000.00	25,242,000.000	
	US T N/B 4.0 02/15/14	40,000,000.00	43,115,600.000	
	US T N/B 1.75 03/31/14	25,000,000.00	25,813,250.000	
	US T N/B 4.75 05/15/14	35,000,000.00	38,644,900.000	
	US T N/B 2.625 06/30/14	30,000,000.00	31,702,500.000	
	US T N/B 4.25 08/15/14	28,000,000.00	30,832,760.000	
	US T N/B 2.375 09/30/14	28,000,000.00	29,535,520.000	
	US T N/B 0.25 09/15/14	20,000,000.00	19,955,400.000	
	US T N/B 4.25 11/15/14	30,000,000.00	33,292,800.000	
	US T N/B 2.125 11/30/14	25,000,000.00	26,257,750.000	
	US T N/B 2.625 12/31/14	12,000,000.00	12,796,800.000	
	US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.00	22,203,000.000	
	US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.00	24,405,990.000	
	US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.00	21,347,600.000	
	US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.00	20,190,780.000	
	US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.00	15,719,400.000	
	US T N/B 1.75 07/31/15	8,000,000.00	8,350,880.000	
	US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.00	16,990,950.000	
	US T N/B 1.25 08/31/15	15,000,000.00	15,400,650.000	
	US T N/B 1.25 09/30/15	13,000,000.00	13,342,160.000	
	US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.00	20,678,760.000	
	US T N/B 1.375 11/30/15	15,000,000.00	15,454,650.000	
	US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.00	18,494,880.000	
	US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.00	21,418,600.000	
	US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.00	12,812,500.000	
	US T N/B 1.75 05/31/16	20,000,000.00	20,910,000.000	

	US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.00	27,771,250.000	
	US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.00	20,162,170.000	
	US T N/B 1.0 08/31/16	10,000,000.00	10,106,200.000	
	US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.00	22,039,000.000	
	US T N/B 1.0 10/31/16	15,000,000.00	15,135,300.000	
	US T N/B 7.5 11/15/16	14,000,000.00	18,443,880.000	
	US T N/B 2.75 11/30/16	20,000,000.00	21,825,000.000	
	US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.00	22,318,600.000	
	US T N/B 4.625 02/15/17	12,000,000.00	14,227,440.000	
	US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.00	22,095,200.000	
	US T N/B 3.125 04/30/17	10,000,000.00	11,124,200.000	
	US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.00	9,855,230.000	
	US T N/B 2.5 06/30/17	13,000,000.00	14,044,030.000	
	US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.00	18,050,250.000	
	US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.00	8,359,360.000	
	US T N/B 1.875 09/30/17	8,000,000.00	8,349,360.000	
	US T N/B 4.25 11/15/17	14,000,000.00	16,503,480.000	
	US T N/B 2.25 11/30/17	14,000,000.00	14,906,640.000	
	US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.00	15,922,760.000	
	US T N/B 2.875 03/31/18	5,000,000.00	5,506,600.000	
	US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.00	9,310,000.000	
	US T N/B 2.375 06/30/18	18,000,000.00	19,234,620.000	
	US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.00	14,095,200.000	
	US T N/B 1.375 09/30/18	12,000,000.00	12,033,720.000	
	US T N/B 3.75 11/15/18	11,000,000.00	12,751,310.000	
	US T N/B 1.375 11/30/18	15,000,000.00	15,005,850.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.00	6,046,840.000	
	US T N/B 2.75 02/15/19	15,000,000.00	16,376,850.000	
	US T N/B 3.125 05/15/19	16,000,000.00	17,883,680.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.00	5,925,600.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	15,000,000.00	17,302,650.000	
	US T N/B 3.375 11/15/19	14,000,000.00	15,897,560.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	22,000,000.00	25,397,900.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	19,000,000.00	21,746,070.000	
	US T N/B 8.75 08/15/20	7,000,000.00	10,975,230.000	
	US T N/B 2.625 08/15/20	23,000,000.00	24,667,500.000	
	US T N/B 2.625 11/15/20	22,000,000.00	23,534,720.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	24,000,000.00	27,665,520.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	25,000,000.00	27,699,000.000	
	US T N/B 2.125 08/15/21	20,000,000.00	20,345,200.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.00	9,307,020.000	
	US T N/B 2.0 11/15/21	2,000,000.00	2,005,000.000	
	US T N/B 7.25 08/15/22	3,000,000.00	4,502,790.000	
	US T N/B 7.125 02/15/23	3,000,000.00	4,495,770.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	7,000,000.00	9,921,940.000	
	US T N/B 7.5 11/15/24	2,000,000.00	3,158,420.000	
	US T N/B 7.625 02/15/25	2,000,000.00	3,197,960.000	
	US T N/B 6.875 08/15/25	3,500,000.00	5,323,815.000	

	US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.00	5,689,040.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	3,000,000.00	4,487,790.000	
	US T N/B 6.625 02/15/27	1,000,000.00	1,517,650.000	
	US T N/B 6.375 08/15/27	2,000,000.00	2,988,580.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	6,000,000.00	8,792,760.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	3,000,000.00	4,172,790.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.00	4,073,430.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	3,000,000.00	4,080,000.000	
	US T N/B 6.125 08/15/29	2,000,000.00	2,985,000.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	4,000,000.00	6,086,560.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,000,000.00	7,007,800.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	8,000,000.00	10,256,240.000	
	US T N/B 4.75 02/15/37	4,000,000.00	5,317,480.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	4,000,000.00	5,505,600.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	5,000,000.00	6,319,500.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	6,000,000.00	7,728,240.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	8,000,000.00	8,779,360.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	9,500,000.00	11,797,005.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	10,000,000.00	12,912,500.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	13,000,000.00	16,476,460.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	12,000,000.00	15,806,160.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	13,000,000.00	16,480,490.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	13,000,000.00	15,194,660.000	
	US T N/B 4.25 11/15/40	14,000,000.00	17,415,720.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	15,000,000.00	20,176,050.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	14,000,000.00	17,786,440.000	
	US T N/B 3.75 08/15/41	13,000,000.00	14,894,100.000	
	US T N/B 3.125 11/15/41	6,000,000.00	6,114,360.000	
米ドル小計	銘柄数 : 113	1,709,000,000.00	1,905,155,050.000	
	組入時価比率 : 41.33%		(146,487,371,795)	
	合計時価比率 : 42.26%			
	UK TREASURY 4.5 03/07/13	6,000,000.00	6,281,400.000	
	UK TREASURY 8.0 09/27/13	3,000,000.00	3,386,400.000	
	UK TREASURY 2.25 03/07/14	10,000,000.00	10,391,000.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	9,000,000.00	10,076,400.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	9,000,000.00	9,593,100.000	
	UK TREASURY 4.75 09/07/15	8,000,000.00	9,183,200.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	3,000,000.00	3,841,500.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	10,500,000.00	10,995,600.000	
	UK TREASURY 4.0 09/07/16	8,000,000.00	9,116,800.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	5,000,000.00	5,164,000.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	3,000,000.00	4,245,300.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.00	6,705,050.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	7,000,000.00	8,405,600.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	9,000,000.00	10,345,500.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	6,500,000.00	7,973,550.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	9,000,000.00	10,345,500.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	4,000,000.00	6,080,800.000	

	UK TREASURY 3.75 09/07/21	8,000,000.00	9,175,360.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	4,500,000.00	5,265,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	6,000,000.00	7,748,400.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	6,000,000.00	7,276,200.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	4,000,000.00	5,847,200.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	6,000,000.00	7,713,000.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	6,000,000.00	7,266,000.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	5,500,000.00	6,888,200.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	7,000,000.00	8,502,200.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	6,000,000.00	7,887,000.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	6,000,000.00	7,305,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	7,000,000.00	8,529,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	6,000,000.00	7,657,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	6,000,000.00	7,429,200.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	5,000,000.00	6,227,500.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,000,000.00	1,134,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	6,000,000.00	7,593,000.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,500,000.00	5,478,750.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 35	216,000,000.00	257,054,610.000	
	組入時価比率 : 8.62%		(30,561,222,583)	
	合計時価比率 : 8.82%			
	CANADA 5.25 06/01/13	7,500,000.00	7,940,625.000	
	CANADA 2.5 09/01/13	13,000,000.00	13,321,880.000	
	CANADA 1.5 11/01/13	7,000,000.00	7,067,760.000	
	CANADA 2.0 03/01/14	3,000,000.00	3,065,190.000	
	CANADA 5.0 06/01/14	10,000,000.00	10,946,000.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	7,000,000.00	7,190,610.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.00	8,896,560.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	4,000,000.00	4,273,880.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	7,500,000.00	8,373,900.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.00	4,261,080.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,000,000.00	2,013,240.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.00	3,973,200.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.00	4,080,860.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	6,500,000.00	7,422,025.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	5,000,000.00	5,629,650.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,000,000.00	4,429,400.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,000,000.00	1,060,820.000	
	CANADA 8.0 06/01/23	1,200,000.00	1,912,044.000	
	CANADA 9.0 06/01/25	1,200,000.00	2,137,788.000	
	CANADA 8.0 06/01/27	1,700,000.00	2,943,499.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	4,500,000.00	6,604,740.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	4,500,000.00	6,873,255.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	5,200,000.00	7,535,476.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	5,500,000.00	7,155,500.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,000,000.00	1,213,620.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 25	121,300,000.00	140,322,602.000	
	組入時価比率 : 2.99%		(10,599,969,355)	

	合計時価比率： 3.06%			
	SWEDEN 6.75 05/05/14	26,000,000.00	29,470,220.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	23,000,000.00	25,832,910.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	18,000,000.00	19,480,500.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	19,000,000.00	21,282,850.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	25,000,000.00	29,697,500.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	27,000,000.00	34,604,010.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	11,000,000.00	12,841,730.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	16,000,000.00	20,360,800.000	
スウェーデンクローネ 小計	銘柄数： 8	165,000,000.00	193,570,520.000	
	組入時価比率： 0.61%		(2,152,504,182)	
	合計時価比率： 0.62%			
	AUSTRIA 3.8 10/20/13	2,500,000.00	2,625,000.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	6,000,000.00	6,435,600.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	3,000,000.00	3,154,500.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	5,000,000.00	5,260,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,500,000.00	4,815,000.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,000,000.00	1,028,200.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	4,000,000.00	4,310,000.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	4,000,000.00	4,370,000.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	4,000,000.00	4,323,600.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	5,000,000.00	5,232,500.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,500,000.00	4,592,250.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,500,000.00	2,555,000.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,800,000.00	3,200,260.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	2,500,000.00	3,276,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	4,300,000.00	4,626,800.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/13	4,000,000.00	4,110,800.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/13	5,000,000.00	5,100,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/14	5,000,000.00	5,163,000.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/14	5,000,000.00	5,157,500.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	5,000,000.00	5,063,500.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	5,000,000.00	5,092,000.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.00	2,922,300.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	5,000,000.00	4,964,000.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	5,500,000.00	5,643,000.000	
	BELGIUM 5.5 09/28/17	3,500,000.00	3,741,150.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	4,000,000.00	4,106,800.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	3,500,000.00	3,526,250.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	6,500,000.00	6,293,300.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	4,500,000.00	4,465,350.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	5,000,000.00	4,819,500.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.00	1,553,550.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	5,500,000.00	6,296,950.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	5,500,000.00	5,773,790.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,500,000.00	3,340,750.000	
	DEUTSCHLAND 4.5 01/04/13	10,000,000.00	10,443,500.000	

	BUNDESSCHAT 1.5 03/15/13	5,000,000.00	5,087,250.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 07/04/13	14,500,000.00	15,286,625.000	
	BUNDESSCHAT 0.75 09/13/13	6,000,000.00	6,063,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 01/04/14	20,000,000.00	21,617,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	19,000,000.00	20,884,800.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	17,000,000.00	18,705,100.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	18,000,000.00	19,725,300.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	14,000,000.00	15,609,300.000	
	BUNDESOBL 2.75 04/08/16	13,000,000.00	14,138,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	10,000,000.00	11,447,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	8,000,000.00	9,126,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.00	8,215,200.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	7,000,000.00	8,171,100.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	8,000,000.00	9,509,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	8,000,000.00	9,279,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	9,000,000.00	10,298,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	8,000,000.00	9,019,200.000	
	DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	7,000,000.00	7,756,000.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	6,000,000.00	6,280,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	7,000,000.00	7,462,000.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	6,500,000.00	7,326,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	6,000,000.00	6,226,800.000	
	DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.00	2,528,750.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	3,500,000.00	5,022,500.000	
	DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	4,000,000.00	6,128,000.000	
	DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	5,000,000.00	7,107,500.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	4,000,000.00	5,228,000.000	
	DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	3,500,000.00	5,381,250.000	
	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	6,100,000.00	8,826,700.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	7,000,000.00	9,662,800.000	
	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	8,000,000.00	10,204,480.000	
	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	5,000,000.00	6,740,000.000	
	DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	5,800,000.00	8,447,700.000	
	DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,300,000.00	5,019,390.000	
	SPAIN 6.15 01/31/13	6,000,000.00	6,223,200.000	
	SPAIN 4.2 07/30/13	10,000,000.00	10,134,300.000	
	SPAIN 4.25 01/31/14	12,000,000.00	12,159,000.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	7,500,000.00	7,673,250.000	
	SPAIN 3.3 10/31/14	5,500,000.00	5,440,600.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	7,000,000.00	7,070,000.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.00	5,834,100.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	6,000,000.00	5,763,000.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	5,000,000.00	4,784,000.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	3,000,000.00	2,977,920.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.00	5,772,000.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,000,000.00	5,197,400.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	6,000,000.00	5,768,700.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	5,000,000.00	4,881,500.000	

	SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.00	5,249,750.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	7,000,000.00	6,485,500.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	6,000,000.00	5,829,600.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	7,500,000.00	7,427,250.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,000,000.00	1,005,870.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	5,500,000.00	4,972,550.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,000,000.00	4,375,500.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.00	2,444,750.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	6,500,000.00	6,367,400.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,000,000.00	4,725,850.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,500,000.00	4,162,015.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,500,000.00	3,642,750.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,800,000.00	3,032,400.000	
	FINLAND 5.375 07/04/13	2,500,000.00	2,685,875.000	
	FINLAND 3.125 09/15/14	1,500,000.00	1,599,825.000	
	FINLAND 4.25 07/04/15	2,500,000.00	2,773,250.000	
	FINLAND 1.75 04/15/16	3,000,000.00	3,075,450.000	
	FINLAND 3.875 09/15/17	2,000,000.00	2,219,000.000	
	FINLAND 4.375 07/04/19	2,000,000.00	2,309,600.000	
	FINLAND 3.375 04/15/20	2,000,000.00	2,172,100.000	
	FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.00	1,645,575.000	
	FINLAND 4.0 07/04/25	2,800,000.00	3,199,420.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/13	16,000,000.00	16,692,800.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/13	19,000,000.00	19,991,800.000	
	FR TREASURY 2.5 01/12/14	10,000,000.00	10,199,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/14	14,000,000.00	14,907,200.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/14	14,000,000.00	14,926,800.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/15	16,000,000.00	16,908,800.000	
	FRANCE OAT 3.0 10/25/15	17,000,000.00	17,846,600.000	
	FRANCE OAT 3.25 04/25/16	17,000,000.00	18,008,100.000	
	FR TREASURY 2.5 07/25/16	6,500,000.00	6,589,310.000	
	FRANCE OAT 5.0 10/25/16	10,000,000.00	11,185,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	10,000,000.00	10,744,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.00	8,689,600.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.00	9,801,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.00	8,694,400.000	
	FRANCE OAT 4.25 04/25/19	10,500,000.00	11,299,050.000	
	FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.00	4,132,500.000	
	FRANCE OAT 3.75 10/25/19	9,000,000.00	9,580,500.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/20	11,000,000.00	11,438,900.000	
	FRANCE OAT 2.5 10/25/20	10,000,000.00	9,506,000.000	
	FRANCE OAT 3.75 04/25/21	11,000,000.00	11,394,900.000	
	FRANCE OAT 3.25 10/25/21	8,000,000.00	8,080,000.000	
	FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	4,000,000.00	5,814,000.000	
	FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,000,000.00	11,830,500.000	
	FRANCE OAT 6.0 10/25/25	6,000,000.00	7,541,400.000	
	FRANCE OAT 3.5 04/25/26	8,000,000.00	7,804,800.000	
	FRANCE OAT 5.5 04/25/29	9,000,000.00	10,800,000.000	

	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,000,000.00	10,053,600.000	
	FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,000,000.00	7,043,400.000	
	FRANCE OAT 4.0 10/25/38	8,300,000.00	8,490,070.000	
	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	6,000,000.00	6,618,000.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/55	5,500,000.00	5,437,300.000	
	FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,800,000.00	2,778,440.000	
	IRISH 5.0 04/18/13	3,000,000.00	2,945,580.000	
	IRISH 4.0 01/15/14	3,000,000.00	2,822,850.000	
	IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.00	2,699,760.000	
	IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.00	2,474,430.000	
	IRISH 4.4 06/18/19	3,000,000.00	2,404,260.000	
	IRISH 5.9 10/18/19	3,000,000.00	2,644,500.000	
	IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.00	2,416,170.000	
	IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.00	1,619,800.000	
	IRISH 5.4 03/13/25	3,000,000.00	2,465,700.000	
	ITALY BTPS 4.75 02/01/13	11,000,000.00	11,079,200.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/13	16,000,000.00	15,948,960.000	
	ITALY BTPS 3.75 12/15/13	18,000,000.00	17,640,000.000	
	ITALY BTPS 3.5 06/01/14	4,000,000.00	3,847,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 08/01/14	19,000,000.00	18,593,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/15	8,000,000.00	7,712,000.000	
	ITALY BTPS 3.0 04/15/15	9,000,000.00	8,289,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.00	14,022,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.00	9,200,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.00	12,740,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/17	9,000,000.00	8,164,800.000	
	ITALY BTPS 5.25 08/01/17	8,000,000.00	7,605,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/18	9,000,000.00	8,148,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 08/01/18	9,000,000.00	8,096,400.000	
	ITALY BTPS 4.25 02/01/19	8,000,000.00	7,005,600.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/19	8,500,000.00	7,510,600.000	
	ITALY BTPS 4.25 09/01/19	8,000,000.00	6,890,400.000	
	ITALY BTPS 4.5 02/01/20	7,500,000.00	6,522,750.000	
	ITALY BTPS 4.25 03/01/20	9,000,000.00	7,713,900.000	
	ITALY BTPS 4.0 09/01/20	8,000,000.00	6,655,200.000	
	ITALY BTPS 3.75 03/01/21	8,000,000.00	6,500,000.000	
	ITALY BTPS 3.75 08/01/21	10,000,000.00	7,962,000.000	
	ITALY BTPS 4.75 09/01/21	9,000,000.00	7,738,200.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,000,000.00	3,433,200.000	
	ITALY BTPS 4.75 08/01/23	8,000,000.00	6,566,400.000	
	ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.00	4,395,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 03/01/25	7,500,000.00	6,112,200.000	
	ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,000,000.00	4,611,000.000	
	ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.00	3,524,150.000	
	ITALY BTPS 6.5 11/01/27	9,000,000.00	8,378,100.000	
	ITALY BTPS 5.25 11/01/29	10,000,000.00	8,103,000.000	
	ITALY BTPS 6.0 05/01/31	10,500,000.00	9,141,300.000	
	ITALY BTPS 5.75 02/01/33	5,000,000.00	4,184,500.000	

	ITALY BTPS 5.0 08/01/34	8,000,000.00	6,156,000.000	
	ITALY BTPS 4.0 02/01/37	9,000,000.00	6,124,500.000	
	ITALY BTPS 5.0 08/01/39	6,500,000.00	4,968,600.000	
	ITALY BTPS 5.0 09/01/40	7,000,000.00	5,334,000.000	
	NETHERLANDS 1.75 01/15/13	2,500,000.00	2,544,500.000	
	NETHERLANDS 4.25 07/15/13	7,000,000.00	7,421,400.000	
	NETHERLANDS 1.0 01/15/14	4,000,000.00	4,046,000.000	
	NETHERLANDS 3.75 07/15/14	7,000,000.00	7,561,400.000	
	NETHERLANDS 2.75 01/15/15	5,000,000.00	5,293,000.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.00	6,478,200.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	5,000,000.00	5,608,000.000	
	NETHERLANDS 2.5 01/15/17	3,000,000.00	3,158,400.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.00	5,762,500.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	6,000,000.00	6,798,600.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	4,500,000.00	5,132,250.000	
	NETHERLANDS 3.5 07/15/20	6,000,000.00	6,633,600.000	
	NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.00	5,428,000.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,500,000.00	6,699,150.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,500,000.00	6,187,950.000	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,500,000.00	5,629,500.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,500,000.00	4,372,550.000	
	PORTUGUESE 5.45 09/23/13	3,000,000.00	2,756,400.000	
	PORTUGUESE 3.35 10/15/15	2,000,000.00	1,478,760.000	
	PORTUGUESE 4.2 10/15/16	5,000,000.00	3,387,500.000	
	PORTUGUESE 4.35 10/16/17	2,000,000.00	1,145,000.000	
	PORTUGUESE 4.45 06/15/18	3,000,000.00	1,789,470.000	
	PORTUGUESE 3.85 04/15/21	3,000,000.00	1,446,420.000	
	PORTUGUESE 4.95 10/25/23	3,000,000.00	1,533,000.000	
	PORTUGUESE 4.1 04/15/37	3,000,000.00	1,394,100.000	
ユーロ小計	銘柄数 : 208	1,386,500,000.00	1,419,620,225.000	
	組入時価比率 : 39.25%		(139,122,782,050)	
	合計時価比率 : 40.14%			
	DENMARK 5.0 11/15/13	30,000,000.00	32,686,500.000	
	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.00	6,280,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	35,000,000.00	39,592,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	21,000,000.00	24,714,900.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	33,000,000.00	39,435,000.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	15,000,000.00	16,770,000.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	9,000,000.00	14,174,100.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	36,500,000.00	53,498,415.000	
デンマーククローネ小計	銘柄数 : 8	185,500,000.00	227,151,715.000	
	組入時価比率 : 0.84%		(2,993,859,604)	
	合計時価比率 : 0.86%			
	NORWAY 6.5 05/15/13	20,000,000.00	21,383,000.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	20,000,000.00	22,517,400.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	13,000,000.00	14,903,200.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	10,000,000.00	11,890,000.000	

	NORWAY 3.75 05/25/21	10,500,000.00	12,076,050.000	
ノルウェークローネ小計	銘柄数 : 5	73,500,000.00	82,769,650.000	
	組入時価比率 : 0.30%		(1,059,451,520)	
	合計時価比率 : 0.31%			
	POLAND 5.25 04/25/13	14,000,000.00	14,104,020.000	
	POLAND 5.0 10/24/13	15,000,000.00	15,060,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/14	13,000,000.00	13,244,400.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,500,000.00	4,565,475.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	17,000,000.00	17,680,000.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	4,000,000.00	3,971,800.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.00	11,809,200.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.00	8,913,060.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	7,500,000.00	7,243,500.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.00	2,488,500.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	9,000,000.00	8,892,000.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.00	2,920,500.000	
ポーランドズロチ小計	銘柄数 : 12	110,500,000.00	110,892,455.000	
	組入時価比率 : 0.69%		(2,440,742,935)	
	合計時価比率 : 0.70%			
	SINGAPORE 2.25 07/01/13	1,500,000.00	1,543,920.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	4,000,000.00	4,317,600.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	3,000,000.00	3,244,170.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	3,000,000.00	3,422,430.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	2,500,000.00	2,962,475.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	2,800,000.00	3,192,952.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,200,000.00	2,491,676.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,000,000.00	2,340,200.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.00	878,872.000	
シンガポール・ドル小計	銘柄数 : 9	21,800,000.00	24,394,295.000	
	組入時価比率 : 0.41%		(1,451,460,553)	
	合計時価比率 : 0.42%			
	MALAYSIA 3.702 02/25/13	9,000,000.00	9,081,360.000	
	MALAYSIA 5.094 04/30/14	13,000,000.00	13,611,780.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	6,000,000.00	6,143,220.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.00	7,292,180.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.00	7,151,270.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	7,000,000.00	7,318,500.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	8,000,000.00	8,468,240.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.00	4,165,240.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,000,000.00	4,753,000.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.00	2,307,940.000	
マレーシアリングット小計	銘柄数 : 10	68,000,000.00	70,292,730.000	
	組入時価比率 : 0.48%		(1,718,657,249)	
	合計時価比率 : 0.50%			
	AUSTRALIAN 6.5 05/15/13	6,500,000.00	6,768,905.000	

	AUSTRALIAN 6.25 06/15/14	8,500,000.00	9,100,440.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	8,000,000.00	8,749,600.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,500,000.00	4,766,265.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	6,500,000.00	7,298,330.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,000,000.00	3,323,580.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	6,000,000.00	6,620,040.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,500,000.00	5,809,430.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,000,000.00	5,766,000.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,000,000.00	3,474,210.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,000,000.00	2,269,080.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,000,000.00	1,063,820.000	
オーストラリアドル小計	銘柄数 : 12	59,500,000.00	65,009,700.000	
	組入時価比率 : 1.45%		(5,142,267,270)	
	合計時価比率 : 1.48%			
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	145,000,000.00	162,049,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.00	77,483,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	70,000,000.00	78,537,200.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	25,000,000.00	25,293,750.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.00	71,480,750.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	50,000,000.00	56,338,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	42,000,000.00	45,681,300.000	
メキシコ ペソ小計	銘柄数 : 7	457,000,000.00	516,863,100.000	
	組入時価比率 : 0.82%		(2,904,770,622)	
	合計時価比率 : 0.84%			
合計			346,635,059,718	
			(346,635,059,718)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 113銘柄	41.33%	42.26%
英ポンド	国債証券 35銘柄	8.62%	8.82%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.99%	3.06%
スウェーデンクローネ	国債証券 8銘柄	0.61%	0.62%
ユーロ	国債証券 208銘柄	39.25%	40.14%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	0.84%	0.86%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.30%	0.31%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.69%	0.70%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	0.41%	0.42%
マレーシアリングット	国債証券 10銘柄	0.48%	0.50%
オーストラリアドル	国債証券 12銘柄	1.45%	1.48%
メキシコ ペソ	国債証券 7銘柄	0.82%	0.84%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		1,240,454,868	1,036,803,036
コール・ローン		56,738,372	29,794,897
国債証券		33,221,518,467	29,849,717,738
派生商品評価勘定		-	3,720
未収入金		-	31,967,018
未収利息		663,933,473	577,326,850
前払費用		37,573,736	14,566,677
流動資産合計		35,220,218,916	31,540,179,936
資産合計		35,220,218,916	31,540,179,936
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		233,750	25,040
未払金		759,614,773	672,172,380
未払解約金		-	2,444,000
流動負債合計		759,848,523	674,641,420
負債合計		759,848,523	674,641,420
純資産の部			
元本等			
元本		34,864,096,002	31,076,824,958
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	*3	403,725,609	211,286,442
元本等合計		34,460,370,393	30,865,538,516
純資産合計		34,460,370,393	30,865,538,516
負債純資産合計		35,220,218,916	31,540,179,936

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年4月20日から平成23年4月18日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年4月19日から平成24年4月18日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	33,722,541,161円	34,864,096,002円
同期中追加設定元本額	3,617,084,133円	3,746,579,911円
同期中解約元本額	2,475,529,292円	7,533,850,955円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド エボリューション	10,672,480円	34,140,978円
グローバル債券ファンド（適格機関投資家限定）	427,528,729円	376,440,550円
為替フルヘッジ型エマージング債券ファンド（適格機関投資家限定）	1,644,729,087円	1,531,716,135円
エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	6,942,965,005円	6,246,669,230円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	16,089,979,071円	14,213,155,565円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	9,748,221,630円	8,674,702,500円
（合計）	34,864,096,002円	31,076,824,958円
*2 本有価証券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受益権の総数	34,864,096,002口	31,076,824,958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403,725,609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211,286,442円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)派生商品評価勘定 「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)国債証券 同左 (2)派生商品評価勘定 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	601,308,834	977,053,245
合 計	601,308,834	977,053,245

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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)

(通貨関連)

平成23年1月11日現在					
区分	種 類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	41,678,750	-	41,445,000	233,750
	合 計	41,678,750	-	41,445,000	233,750

平成24年1月11日現在					
区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	202,061,960	-	202,040,640	21,320
合計		202,061,960	-	202,040,640	21,320

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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おります。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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おります。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買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電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.9884円	0.9932円
（1万口当たり純資産額）	（9,884円）	（9,932円）

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	BULGARIA 8.25 01/15/15	2,000,000.00	2,217,000.000	
	BRAZIL 10.25 06/17/13	1,000,000.00	1,124,100.000	
	BRAZIL 10.5 07/14/14	1,000,000.00	1,220,000.000	
	BRAZIL 7.875 03/07/15	2,100,000.00	2,381,400.000	
	BRAZIL 6.0 01/17/17	4,700,000.00	5,481,845.000	
	BRAZIL 8.0 01/15/18	2,166,666.68	2,518,641.650	
	BRAZIL 5.875 01/15/19	3,200,000.00	3,787,200.000	
	BRAZIL 8.875 10/14/19	2,200,000.00	3,008,500.000	
	BRAZIL 4.875 01/22/21	3,800,000.00	4,227,500.000	
	BRAZIL 8.875 04/15/24	3,100,000.00	4,605,360.000	
	BRAZIL 8.75 02/04/25	2,400,000.00	3,565,440.000	
	BRAZIL 10.125 05/15/27	4,600,000.00	7,578,040.000	
	BRAZIL 12.25 03/06/30	800,000.00	1,521,840.000	
	BRAZIL 8.25 01/20/34	3,700,000.00	5,596,250.000	
	BRAZIL 7.125 01/20/37	4,700,000.00	6,380,250.000	
	BRAZIL 11.0 08/17/40	2,300,000.00	3,036,690.000	
	BRAZIL 5.625 01/07/41	4,800,000.00	5,599,200.000	
	COLOMBIA 8.25 12/22/14	1,900,000.00	2,225,755.000	
	COLOMBIA 7.375 01/27/17	3,850,000.00	4,716,250.000	
	COLOMBIA 7.375 03/18/19	4,700,000.00	5,933,750.000	
	COLOMBIA 11.75 02/25/20	1,500,000.00	2,331,750.000	
	COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,000,000.00	2,745,200.000	
	COLOMBIA 7.375 09/18/37	3,400,000.00	4,627,400.000	
	COLOMBIA 6.125 01/18/41	1,700,000.00	2,033,200.000	
	CROATIA 6.75 11/05/19	2,500,000.00	2,365,000.000	
	CROATIA 6.625 07/14/20	2,000,000.00	1,863,500.000	
	CROATIA 6.375 03/24/21	1,700,000.00	1,526,600.000	
	HUNGARY 6.25 01/29/20	2,700,000.00	2,362,500.000	
	HUNGARY 6.375 03/29/21	4,300,000.00	3,730,250.000	
	HUNGARY 7.625 03/29/41	1,600,000.00	1,376,000.000	
	INDONESIA 10.375 05/04/14	1,600,000.00	1,873,520.000	
	INDONESIA 6.875 03/09/17	1,550,000.00	1,808,772.500	
	INDONESIA 6.875 01/17/18	2,500,000.00	2,967,000.000	
	INDONESIA 11.625 03/04/19	3,200,000.00	4,725,600.000	
	INDONESIA 5.875 03/13/20	2,700,000.00	3,062,070.000	
	INDONESIA 4.875 05/05/21	3,800,000.00	4,061,250.000	
	INDONESIA 8.5 10/12/35	2,200,000.00	3,163,270.000	

	INDONESIA 6.625 02/17/37	2,100,000.00	2,520,315.000	
	INDONESIA 7.75 01/17/38	2,900,000.00	3,890,205.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.875 01/15/14	2,000,000.00	2,156,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.875 02/17/14	2,700,000.00	2,932,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.625 03/03/15	2,500,000.00	2,803,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	3,500,000.00	4,884,075.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	5,200,000.00	5,886,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	6,100,000.00	7,219,350.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.125 12/30/19	2,200,000.00	3,080,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	4,900,000.00	5,541,900.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.0 09/24/22	1,000,000.00	1,341,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	2,700,000.00	4,009,770.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,900,000.00	2,654,110.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,500,000.00	8,412,950.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	6,600,000.00	8,094,900.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	3,000,000.00	3,180,000.000	
	PANAMA 7.25 03/15/15	3,300,000.00	3,795,627.000	
	PANAMA 5.2 01/30/20	2,200,000.00	2,508,000.000	
	PANAMA 7.125 01/29/26	1,900,000.00	2,484,250.000	
	PANAMA 8.875 09/30/27	2,100,000.00	3,136,875.000	
	PANAMA 9.375 04/01/29	1,800,000.00	2,861,100.000	
	PANAMA 6.7 01/26/36	3,700,000.00	4,782,250.000	
	PERU 8.375 05/03/16	1,200,000.00	1,480,680.000	
	PERU 7.125 03/30/19	2,000,000.00	2,523,000.000	
	PERU 7.35 07/21/25	4,500,000.00	5,917,950.000	
	PERU 8.75 11/21/33	4,500,000.00	6,693,300.000	
	PERU 6.55 03/14/37	2,400,000.00	3,010,080.000	
	PERU 5.625 11/18/50	2,000,000.00	2,155,420.000	
	PHILIPPINES 8.25 01/15/14	3,000,000.00	3,375,000.000	
	PHILIPPINES 8.875 03/17/15	2,000,000.00	2,420,000.000	
	PHILIPPINES 8.0 01/15/16	1,000,000.00	1,210,000.000	
	PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.00	2,090,625.000	
	PHILIPPINES 8.375 06/17/19	1,700,000.00	2,239,750.000	
	PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,500,000.00	1,798,125.000	
	PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,700,000.00	2,760,399.000	
	PHILIPPINES 10.625 03/16/25	2,600,000.00	4,104,750.000	
	PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,000,000.00	2,235,000.000	
	PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,800,000.00	4,319,000.000	
	PHILIPPINES 7.75 01/14/31	3,800,000.00	5,101,500.000	
	PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,200,000.00	2,601,500.000	
	PHILIPPINES 6.375 10/23/34	4,000,000.00	4,760,000.000	
	RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15	3,500,000.00	3,544,800.000	
	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	6,000,000.00	8,213,700.000	
	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	5,600,000.00	5,831,000.000	
	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	4,200,000.00	7,094,640.000	
	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	27,221,000.00	31,623,452.150	
	TURKEY 9.5 01/15/14	3,000,000.00	3,304,500.000	
	TURKEY 7.25 03/15/15	4,000,000.00	4,334,400.000	

	TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.00	3,217,800.000	
	TURKEY 7.5 07/14/17	3,300,000.00	3,646,500.000	
	TURKEY 6.75 04/03/18	3,000,000.00	3,120,000.000	
	TURKEY 7.0 03/11/19	2,000,000.00	2,160,000.000	
	TURKEY 7.5 11/07/19	2,200,000.00	2,447,500.000	
	TURKEY 7.0 06/05/20	3,100,000.00	3,326,610.000	
	TURKEY 5.625 03/30/21	3,200,000.00	3,144,000.000	
	TURKEY 7.375 02/05/25	4,500,000.00	4,909,500.000	
	TURKEY 11.875 01/15/30	2,200,000.00	3,450,260.000	
	TURKEY 8.0 02/14/34	2,200,000.00	2,492,380.000	
	TURKEY 6.875 03/17/36	3,600,000.00	3,517,920.000	
	TURKEY 7.25 03/05/38	1,300,000.00	1,384,500.000	
	TURKEY 6.75 05/30/40	2,600,000.00	2,600,000.000	
	TURKEY 6.0 01/14/41	1,500,000.00	1,372,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 06/02/14	1,500,000.00	1,642,800.000	
	SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	3,000,000.00	3,555,000.000	
	SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	3,000,000.00	3,285,000.000	
	SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,400,000.00	1,550,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	1,000,000.00	1,125,000.000	
米ドル小計	銘柄数 : 104	319,287,666.68	388,213,262.300	
	組入時価比率 : 96.71%		(29,849,717,738)	
	合計時価比率 : 100.00%			
合計			29,849,717,738	
			(29,849,717,738)	

(注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 104銘柄	96.71%	100.00%

(注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

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

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		259,280,233	2,257,853
投資証券		4,135,148,100	3,460,690,650
未収入金		628,000	-
未収配当金		42,511,113	52,047,544
流動資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047
資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047
負債の部			
流動負債			
未払金		256,059,290	-
未払解約金		185,000	241,000
流動負債合計		256,244,290	241,000
負債合計		256,244,290	241,000
純資産の部			
元本等			
元本		4,718,941,254	5,093,136,025
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	537,618,098	1,578,380,978
元本等合計		4,181,323,156	3,514,755,047
純資産合計		4,181,323,156	3,514,755,047
負債純資産合計		4,437,567,446	3,514,996,047

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券 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	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年6月8日から平成23年6月6日までとなっております。	計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年6月7日から平成24年6月6日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における 当該親投資信託の元本額	4,070,499,471円	4,718,941,254円
同期中追加設定元本額	4,038,463,118円	4,892,978,114円
同期中解約元本額	3,390,021,335円	4,518,783,343円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	73,447,417円	43,781,811円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	660,693,969円	480,093,400円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	1,625,990円	2,526,412円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	2,376,575,088円	3,750,397,262円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	399,241,647円	363,475,224円
D I A M為替フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド（適格機関投資家向け）	789,057,681円	円
D I A Mグローバル分散ファンドV A（適格機関投資家限定）	418,299,462円	452,861,916円
（合計）	4,718,941,254円	5,093,136,025円

*2 本有価証券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受益権の総数	4,718,941,254口	5,093,136,025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537,618,098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1,578,380,978円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3. 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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	651,763,217	653,145,923
合計	651,763,217	653,145,923

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8861円 (8,861円)	0.6901円 (6,901円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

株 式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種 類	銘 柄	口数	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	228	119,700,000	
	M I Dリート投資法人	215	39,345,000	
	森ヒルズリート投資法人	271	69,213,400	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	176	59,664,000	
	産業ファンド投資法人	109	41,093,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,145	165,567,000	
	日本ビルファンド投資法人	676	436,020,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	572	354,068,000	
	日本リテールファンド投資法人	2,197	247,382,200	
	オリックス不動産投資法人	332	108,066,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	836	149,142,400	
	プレミアム投資法人	230	58,006,000	
	東急リアル・エステート投資法人	198	79,992,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	113	57,404,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	357	143,692,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,458	208,438,400	
	森トラスト総合リート投資法人	283	177,158,000	
	インヴィンシブル投資法人	1,576	9,771,200	
	フロンティア不動産投資法人	227	141,875,000	
	平和不動産リート投資法人	813	30,731,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	173	115,218,000	
	福岡リート投資法人	144	73,440,000	
	ケネディクス不動産投資法人	335	75,341,500	
	積水ハウス・S I投資法人	134	39,972,200	
	いちご不動産投資法人	985	30,288,750	
	大和証券オフィス投資法人	463	75,330,100	
	阪急リート投資法人	100	33,150,000	
	スターツプロシード投資法人	126	12,726,000	
	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	124	21,576,000	
	トップリート投資法人	181	63,531,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	188	91,368,000	

	日本ホテルファンド投資法人	68	13,511,600	
	日本賃貸住宅投資法人	1,555	52,248,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	220	66,660,000	
合計		17,808	3,460,690,650	

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

科目	注記 番号	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
		金額 (円)	金額 (円)
資産の部			
流動資産			
預金		47,581,715	24,403,112
コール・ローン		4,902,723	13,859,446
投資信託受益証券		611,982,793	362,196,875
投資証券		3,103,364,098	2,104,604,573
未収配当金		18,345,081	10,714,409
流動資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415
資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415
負債の部			
流動負債			
未払解約金		89,000	175,000
流動負債合計		89,000	175,000
負債合計		89,000	175,000
純資産の部			
元本等			
元本		5,089,591,953	3,472,218,155
剰余金			
剰余金又は欠損金()	*3	1,303,504,543	956,614,740
元本等合計		3,786,087,410	2,515,603,415
純資産合計		3,786,087,410	2,515,603,415
負債純資産合計		3,786,176,410	2,515,778,415

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資信託受益証券及び投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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によって計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成22年11月9日から平成23年11月7日までとなっております。	(1)外貨建取引等の処理基準 同左 (2)計算期間の取扱い 当該親投資信託の計算期間は本有価証券報告書における開示対象ファンドと異なり、平成23年11月8日から平成24年11月6日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
*1 本有価証券報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,771,116,854円	5,089,591,953円
同期中追加設定元本額	396,903,224円	66,409,391円
同期中解約元本額	2,078,428,125円	1,683,783,189円
同期末における元本の内訳		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	58,724,937円	46,062,427円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	529,055,653円	503,071,359円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,660,568円	39,015,043円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	4,273,962,787円	2,708,943,679円
D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	200,188,008円	175,125,647円
（合計）	5,089,591,953円	3,472,218,155円
*2 本有価証券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受益権の総数	5,089,591,953口	3,472,218,155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1,303,504,543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956,614,740円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成22年5月28日 至平成23年1月11日	自平成23年1月12日 至平成24年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券及び投資証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)投資信託受益証券及び投資証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

3. 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。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
種 類	当期の損益に含まれた 評価差額(円)	当期の損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	15,587,123	7,098,111
投資証券	107,573,644	7,160,175
合計	123,160,767	14,258,286

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの計算期間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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成23年1月11日現在	平成24年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.7439円	0.7245円
（1万口当たり純資産額）	（7,439円）	（7,245円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

平成24年1月11日現在

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	CAPITAMALL TRUST	206,000.00	361,530.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	132,000.00	257,400.000	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	150,000.00	160,500.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	170,000.00	189,550.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	120,000.00	69,600.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	95,000.00	158,175.000	
シンガポール・ドル 小計	銘柄数 : 6	873,000.00	1,196,755.000	
	組入時価比率 : 2.83%		(71,206,923)	
	合計時価比率 : 2.89%			
	BWP TRUST	20,500.00	35,567.500	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	152,300.00	150,777.000	
	MIRVAC GROUP	191,854.00	238,858.230	
	INVESTA OFFICE FUND	161,080.00	99,869.600	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	8,480.00	27,814.400	
	CFS RETAIL PROPERTY	153,300.00	273,640.500	
	GPT GROUP	121,000.00	375,100.000	
	ABACUS PROPERTY GR	16,920.00	32,401.800	
	CHARTER HALL OFFICE REIT	25,840.00	91,473.600	
	STOCKLAND	130,140.00	438,571.800	
	WESTFIELD GROUP	116,200.00	985,376.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	247,400.00	216,475.000	
	GOODMAN GROUP	445,762.00	274,143.630	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,590.00	48,595.400	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	151,200.00	390,096.000	
オーストラリアドル 小計	銘柄数 : 15	1,965,566.00	3,678,760.460	
	組入時価比率 : 11.57%		(290,989,952)	
	合計時価比率 : 11.80%			
投資信託受益証券計			362,196,875	
			(362,196,875)	
投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,900.00	271,674.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	8,750.00	871,325.000	
	CEDAR REALTY TRUST INC	5,300.00	25,228.000	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,400.00	33,384.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	3,400.00	67,898.000	

	APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7,715.00	176,596.350
	AGREE REALTY CORP	1,100.00	27,082.000
	BRE PROPERTIES -CL A	5,300.00	266,855.000
	SL GREEN	4,225.00	300,989.000
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	2,200.00	97,878.000
	PROLOGIS INC	25,729.00	754,116.990
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,138.00	658,229.180
	LEXINGTON REALTY TRUST	3,521.00	26,618.760
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,800.00	233,472.000
	CBL & ASSOCIATES	5,882.00	93,582.620
	MACK CALI	5,300.00	138,860.000
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	3,500.00	72,310.000
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	3,100.00	83,142.000
	COUSINS PROPERTIES INC	909.00	6,081.210
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,000.00	129,050.000
	EQUITY ONE INC	6,000.00	104,220.000
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.00	47,502.000
	DDR CORP	12,882.00	165,791.340
	DUKE REALTY TRUST	17,200.00	209,840.000
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,700.00	61,446.000
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,060.00	288,297.000
	EQUITY RESIDENTIAL	17,800.00	982,382.000
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,030.00	368,019.600
	FIRST INDUSTRIAL RT	4,600.00	48,898.000
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	34,963.00	520,948.700
	GLIMCHER REALTY TRUST	800.00	7,344.000
	FELCOR LODGING TR INC	4,700.00	15,322.000
	HOME PROPERTIES INC	2,400.00	134,592.000
	HCP INC	22,200.00	912,420.000
	COMMONWEALTH REIT	4,325.00	80,272.000
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,800.00	110,606.000
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,300.00	100,551.000
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.00	45,040.000
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,400.00	202,188.000
	HEALTH CARE REIT INC	11,201.00	619,639.320
	EAST GROUP	2,300.00	102,511.000
	KIMCO REALTY	21,199.00	352,539.370
	KILROY REALTY CORP	2,500.00	97,500.000
	LTC PROPERTIES INC	3,500.00	111,195.000
	SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	11,300.00	253,798.000
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,400.00	238,058.000
	BRANDYWINE REALTY TRUST	5,700.00	54,834.000
	THE MACERICH COMPANY	8,820.00	459,874.800
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,800.00	188,160.000
	ACADIA REALTY TRUST	4,585.00	90,691.300
	HOST HOTELS & RESORTS INC	41,168.00	638,104.000
	MID AMERICA	2,200.00	134,596.000
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,000.00	94,240.000

	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	11,500.00	85,100.000	
	PARKWAY PROPERTIES INC	4,900.00	47,775.000	
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,600.00	63,224.000	
	GETTY REALTY CORP	3,500.00	51,520.000	
	POST PROPERTIES, INC	2,200.00	94,512.000	
	PS BUSINESS PARKS	400.00	23,044.000	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	5,600.00	56,504.000	
	REALTY INCOME CORP	8,100.00	286,011.000	
	REGENCY	3,900.00	147,654.000	
	UDR INC	13,779.00	338,963.400	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,800.00	81,054.000	
	SAUL CENTERS INC	800.00	26,752.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,484.00	2,228,860.320	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	2,700.00	120,177.000	
	PUBLIC STORAGE	8,678.00	1,159,641.140	
	SUN COMMUNITIES INC	1,200.00	43,392.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	3,100.00	195,176.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	4,700.00	136,300.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.00	35,109.000	
	VENTAS INC	17,102.00	930,177.780	
	VORNADO REALTY TRUST	10,429.00	818,780.790	
	WASHINGTON REIT	4,000.00	111,320.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	7,100.00	154,851.000	
	CAPLEASE INC	7,000.00	30,030.000	
	BIOMED REALTY TRUST INC	8,300.00	151,309.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	3,209.00	134,778.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,900.00	145,671.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.00	55,233.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,340.00	94,802.400	
	CUBESMART	8,900.00	93,984.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	5,510.00	368,619.000	
	INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.00	37,877.000	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.00	80,886.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,372.00	83,720.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	3,900.00	39,273.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	4,700.00	92,543.000	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,000.00	84,960.000	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	3,500.00	81,795.000	
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,400.00	129,056.000	
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,200.00	101,764.000	
米ドル小計	銘柄数 : 93	678,705.00	21,217,991.370	
	組入時価比率 : 64.85%		(1,631,451,356)	
	合計時価比率 : 66.14%			
	BRITISH LAND CO PLC	45,200.00	212,801.600	
	DERWENT LONDON PLC	5,800.00	90,480.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.00	26,290.000	
	HAMMERSON PLC	46,200.00	169,600.200	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,200.00	272,808.000	

	WORKSPACE GROUP PLC	7,067.00	16,006.750	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP	37,804.00	117,154.590	
	SHAFTESBURY PLC	16,000.00	75,856.000	
	SEGRO PLC	50,090.00	101,582.520	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	21,400.00	71,583.000	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY PLC	60,000.00	64,260.000	
英ポンド小計	銘柄数 : 11	342,761.00	1,218,422.660	
	組入時価比率 : 5.76%		(144,858,270)	
	合計時価比率 : 5.87%			
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	3,400.00	90,610.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	5,400.00	122,310.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	5,900.00	95,875.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	5,400.00	125,010.000	
	CHARTWELL SENIOR HSG REIT	1,300.00	11,258.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.00	99,279.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	10,000.00	263,400.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	1,200.00	26,820.000	
	PRIMARIS RETAIL REIT	4,900.00	102,018.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	12,000.00	55,920.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,800.00	149,772.000	
カナダドル小計	銘柄数 : 11	55,000.00	1,142,272.000	
	組入時価比率 : 3.43%		(86,287,227)	
	合計時価比率 : 3.50%			
	BEFIMMO	1,104.00	54,338.880	
	COFINIMMO SA	1,090.00	96,574.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	1,934.00	72,254.240	
	GECINA SA	1,790.00	110,729.400	
	ICADE EMGP	1,520.00	85,393.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,230.00	717,556.000	
	KLEPIERRE	3,700.00	78,588.000	
	FONCIERE DES REGIONS	2,000.00	90,500.000	
	MERCIALYS	3,065.00	74,678.720	
	EUROCOMMERCIAL	3,000.00	70,920.000	
	VASTNED RETAIL	700.00	21,819.000	
	CORIO NV	5,800.00	185,948.000	
	WERELDHAVE NV	1,500.00	75,960.000	
	NIEUWE STEEN INVS	2,691.00	23,277.150	
ユーロ小計	銘柄数 : 14	35,124.00	1,758,536.990	
	組入時価比率 : 6.85%		(172,336,625)	
	合計時価比率 : 6.99%			
	LINK REIT/THE	135,000.00	3,807,000.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	133,000.00	458,850.000	
	CHAMPION REIT	250,000.00	732,500.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	218,000.00	848,020.000	
香港ドル小計	銘柄数 : 4	736,000.00	5,846,370.000	
	組入時価比率 : 2.30%		(57,879,063)	
	合計時価比率 : 2.35%			
	GOODMAN PROPERTY TRUST	73,600.00	73,232.000	

	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.00	51,000.000	
	ARGOSY PROPERTY TRUST	88,000.00	69,080.000	
ニュージーランドドル小計	銘柄数： 3	211,600.00	193,312.000	
	組入時価比率： 0.47%		(11,792,032)	
	合計時価比率： 0.48%			
投資証券計			2,104,604,573	
			(2,104,604,573)	
合計			2,466,801,448	
			(2,466,801,448)	

- (注)1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
 3. 通貨の表示については、その通貨の表記単位で表示しております。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 93銘柄	64.85%	66.14%
英ポンド	投資証券 11銘柄	5.76%	5.87%
カナダドル	投資証券 11銘柄	3.43%	3.50%
ユーロ	投資証券 14銘柄	6.85%	6.99%
香港ドル	投資証券 4銘柄	2.30%	2.35%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 6銘柄	2.83%	2.89%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 15銘柄	11.57%	11.80%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	0.47%	0.48%

- (注) 「組入時価比率」は小計金額の純資産に対する比率、「合計金額に対する比率」は小計金額の合計金額に対する比率であります。

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。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	434,745,347円
負債総額	2,405,634円
純資産総額（ - ）	432,339,713円
発行済数量	446,660,719口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9679円

(参考) マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	251,255,980,420円
負債総額	509,374,391円
純資産総額（ - ）	250,746,606,029円
発行済数量	248,775,954,917口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0079円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	264,112,842,942円
負債総額	274,758,124円
純資産総額（ - ）	263,838,084,818円
発行済数量	218,955,340,443口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2050円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	34,783,255,864円
負債総額	274,400,000円
純資産総額（ - ）	34,508,855,864円
発行済数量	52,383,332,568口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6588円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	421,236,769,920円
負債総額	9,832,220,000円
純資産総額（ - ）	411,404,549,920円

発行済数量	360,346,413,515口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1417円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	368,067,609,272円
負債総額	2,937,215,371円
純資産総額（ - ）	365,130,393,901円
発行済数量	322,272,938,488口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1330円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	31,823,579,550円
負債総額	368,852,427円
純資産総額（ - ）	31,454,727,123円
発行済数量	31,534,630,389口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9975円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項 目	金額又は口数
資産総額	3,596,443,379円
負債総額	216,688,000円
純資産総額（ - ）	3,379,755,379円
発行済数量	4,819,417,173口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7013円

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成24年1月31日現在

項目	金額又は口数
資産総額	2,643,332,134円
負債総額	- 円
純資産総額（ - ）	2,643,332,134円
発行済数量	3,490,106,128口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7574円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割で

きるものとしします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

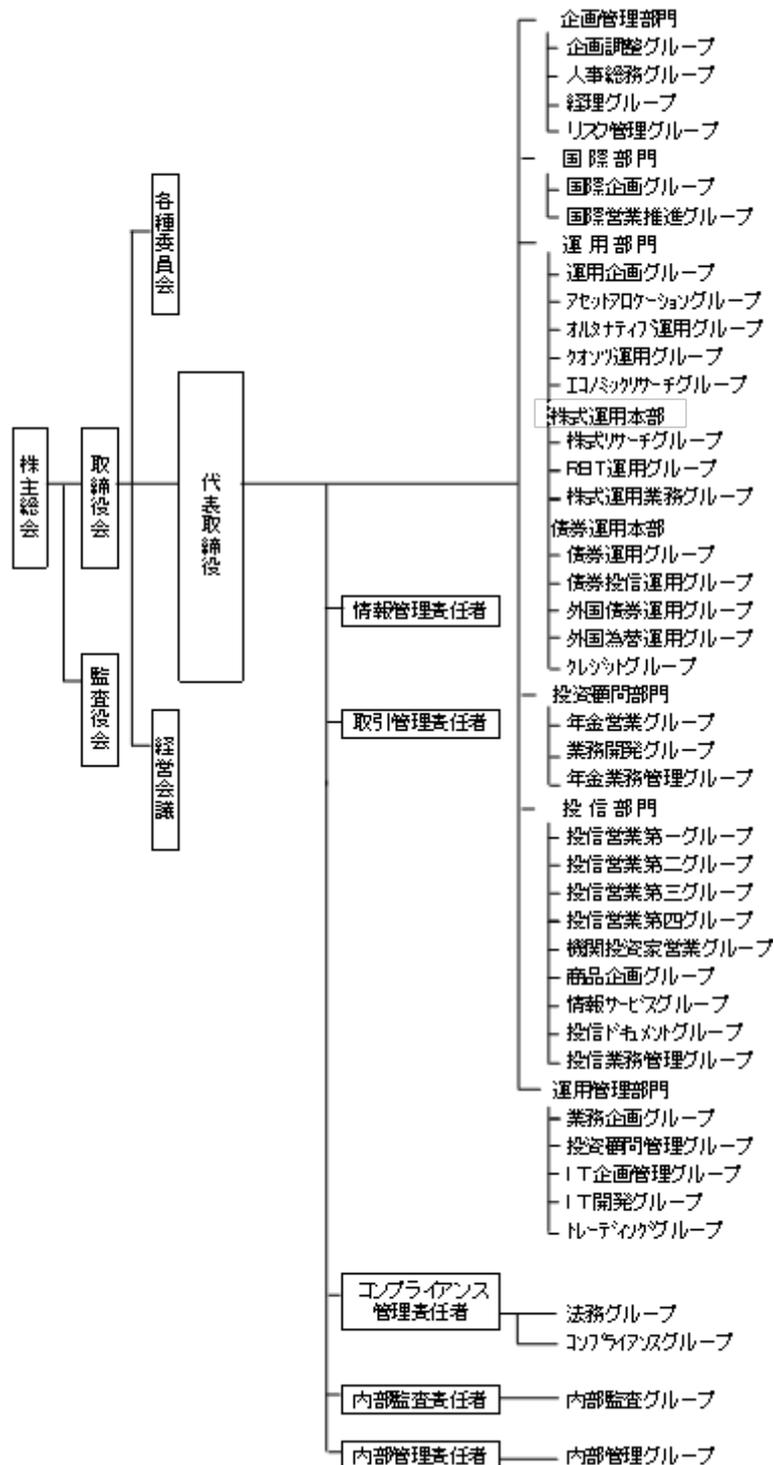
(1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構
会社の組織図



上記組織は、平成24年4月1日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

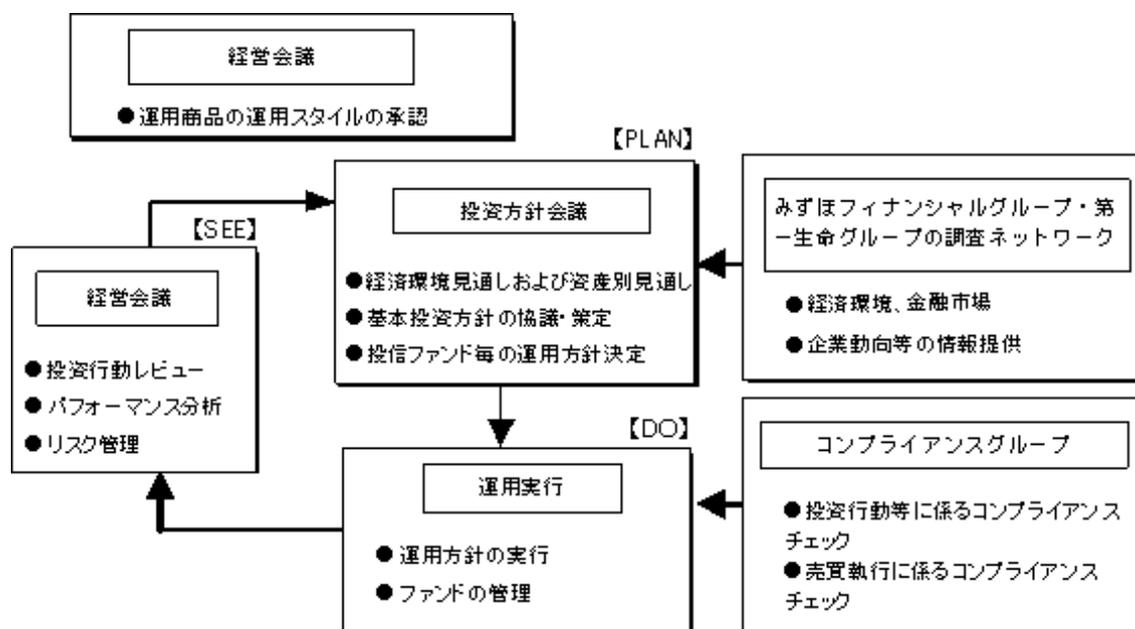
投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成24年1月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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り、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は277本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	14	25,110,217,115
追加型株式投資信託	253	3,948,421,455,464
単位型公社債投資信託	9	71,107,233,679
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	390,669,044
合計	277	4,045,029,575,302

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づき作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第27期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	13,820,588	12,220,759
金銭の信託	399,833	5,967,344
前払費用	33,221	27,593
未収委託者報酬	3,169,323	2,942,180
未収運用受託報酬	1,000,785	1,061,935
未収投資助言報酬	2 271,577	2 267,240
未収収益	247,552	186,483
繰延税金資産	383,608	403,201
その他	21,009	102,404
流動資産計	19,347,501	23,179,143
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 237,642	1 183,704
器具備品	1 351,237	1 206,306
建設仮勘定	10,541	10,956
無形固定資産		
商標権	1 804	1 510
ソフトウェア	1 557,870	1 780,190
ソフトウェア仮勘定	397,829	478,971
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 531	1 451
投資その他の資産		
投資有価証券	1,194,081	604,498
関係会社株式	2,161,144	2,457,319
繰延税金資産	403,908	402,191
長期差入保証金	1,187,070	702,696
その他	328,612	85,690
貸倒引当金	26,925	-
固定資産計	6,811,497	5,920,638
資産合計	26,158,999	29,099,782

（単位：千円）

	第25期 （平成22年3月31日現在）	第26期 （平成23年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	119,466	120,910
未払金	1,526,031	1,479,756
未払収益分配金	7,837	3,223
未払償還金	96,340	98,362
未払手数料	1,206,815	1,134,992
その他未払金	215,038	243,178
未払費用	2 1,522,325	2 1,226,658
未払法人税等	1,283,275	1,706,391
未払消費税等	113,923	143,728
賞与引当金	572,614	575,326
その他	38,231	10,000
流動負債計	5,175,867	5,262,771
固定負債		
退職給付引当金	488,790	579,063
役員退職慰労引当金	96,342	100,260
固定負債計	585,133	679,324
負債合計	5,761,000	5,942,095
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	15,737,995	18,512,674
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,464,702	4,459,380
株主資本計	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	231,525	216,534
評価・換算差額等計	231,525	216,534
純資産合計	20,397,999	23,157,686
負債・純資産合計	26,158,999	29,099,782

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	26,734,588		24,367,005	
運用受託報酬	4,297,349		4,458,894	
投資助言報酬	1,027,153		1,019,727	
その他営業収益	723,055		789,867	
営業収益計		32,782,146		30,635,495
営業費用				
支払手数料	13,000,141		10,405,593	
広告宣伝費	218,782		272,928	
公告費	1,767		2,297	
調査費	5,056,427		4,755,890	
調査費	2,555,070		2,611,173	
委託調査費	2,501,356		2,144,716	
委託計算費	351,370		338,206	
営業雑経費	679,608		671,721	
通信費	32,088		30,286	
印刷費	613,198		585,041	
協会費	21,225		23,561	
諸会費	41		38	
支払販売手数料	13,054		32,794	
営業費用計		19,308,097		16,446,637
一般管理費				
給料	4,678,614		4,576,265	
役員報酬	1 244,725		1 235,289	
給料・手当	3,840,052		3,768,114	
賞与	593,836		572,860	
交際費	45,342		38,997	
寄付金	3,450		13,335	
旅費交通費	269,516		255,190	
租税公課	85,030		89,571	
不動産賃借料	791,980		718,929	
退職給付費用	132,513		139,773	
固定資産減価償却費	397,252		486,987	
福利厚生費	22,233		20,476	
修繕費	5,615		20,842	
賞与引当金繰入	572,614		575,326	
役員退職慰労引当金繰入	45,086		42,036	
役員退職金	18,129		13,140	
機器リース料	2,191		1,951	
事務委託費	285,449		331,935	
消耗品費	78,753		70,952	
器具備品費	2,046		575	
諸経費	88,728		124,218	
一般管理費計		7,524,549		7,520,506
営業利益		5,949,500		6,668,351

（単位：千円）

	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）		第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	5,287		4	341,775
受取利息	18,745			9,168
時効成立分配金	157			2,574
投資信託解約益	559,971			157,213
先物利益	-			9,816
金銭の信託運用益	-			69,014
雑収入	3,431			8,602
営業外収益計		587,592		598,165
営業外費用				
為替差損	17,771			755
時効成立後支払分配金	444			-
先物損失	719,577			-
金銭の信託運用損	1,116			-
雑損失	-			6,089
営業外費用計		738,911		6,844
経常利益		5,798,181		7,259,672
特別利益				
貸倒引当金戻入益	-			4,288
過年度損益修正益	-		3,4	105,241
特別利益計		-		109,530
特別損失				
固定資産除却損	2	21,626	2	31,419
固定資産売却損		2,464		1,440
関係会社株式評価損		-		3,825
特別損失計		24,090		36,684
税引前当期純利益		5,774,091		7,332,518
法人税、住民税及び事業税		2,508,095		2,885,426
法人税等調整額		135,267		7,586
法人税等合計		2,372,828		2,877,839
当期純利益		3,401,263		4,454,678

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	10,040,000	11,650,000
当期変動額	1,610,000	1,780,000
当期末残高	11,650,000	13,430,000
研究開発積立金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
前期末残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	3,299,438	3,464,702
当期変動額		
剰余金の配当	1,626,000	1,680,000
別途積立金の積立	1,610,000	1,780,000
当期純利益	3,401,263	4,454,678
当期末残高	3,464,702	4,459,380
利益剰余金合計		
前期末残高	13,962,732	15,737,995
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	15,737,995	18,512,674
株主資本合計		
前期末残高	18,391,210	20,166,473
当期変動額	1,775,263	2,774,678
当期末残高	20,166,473	22,941,152
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	1,547	231,525
当期変動額（純額）	233,073	14,991
当期末残高	231,525	216,534
純資産合計		
前期末残高	18,389,662	20,397,999
当期変動額	2,008,336	2,759,687
当期末残高	20,397,999	23,157,686

[次へ](#)

重要な会計方針

<p style="text-align: center;">第25期 （自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第26期 （自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日）</p>
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式：移動平均法による原価法</p> <p>（2）その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 定率法によっております。</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>（3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法</p> <p>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p> <p>6. 引当金の計上基準</p> <p>（1）貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>（2）賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p>	<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>（1）子会社株式及び関連会社株式 同左</p> <p>（2）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</p> <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 同左</p> <p>3. デリバティブの評価基準及び評価方法 同左</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（2）無形固定資産（リース資産を除く） 同左</p> <p>（3）リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産） 同左</p> <p>5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 同左</p> <p>6. 引当金の計上基準</p> <p>（1）同左</p> <p>（2）同左</p>

<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(会計方針の変更) 当事業年度から「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準委員会平成20年7月31日 企業会計基準第19号)を適用しております。 なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>7. リース取引の処理方法 所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。</p> <p>8. 消費税等の処理方法 税抜方式によっております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <hr/> <p>(4) 同左</p> <p>7. リース取引の処理方法 同左</p> <p>8. 消費税等の処理方法 同左</p>
--	--

追加情報

第25期（平成22年3月31日現在）	第26期（平成23年3月31日現在）
<p>当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>	<hr/>

注記事項

(貸借対照表関係)

第25期（平成22年3月31日現在）			第26期（平成23年3月31日現在）		
1. 固定資産の減価償却累計額			1. 固定資産の減価償却累計額		
建物	471,484千円		建物	484,832千円	
器具備品	356,326千円		器具備品	499,620千円	
商標権	6,882千円		商標権	2,428千円	
ソフトウェア	684,370千円		ソフトウェア	809,403千円	
電話施設利用権	1,065千円		電話施設利用権	1,145千円	
2. 関係会社項目			2. 関係会社項目		
関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。			関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。		
流動資産	未収投資助言報酬	270,492千円	流動資産	未収投資助言報酬	266,194千円
流動負債	未払費用	400,075千円	流動負債	未払費用	291,628千円

(損益計算書関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1. 役員報酬の限度額	1. 役員報酬の限度額
取締役 年額250,000千円	同左
監査役 年額 50,000千円	
2. 固定資産除却損の内訳	2. 固定資産除却損の内訳
建物 1,199千円	建物 15,317千円
器具備品 15,159千円	器具備品 3,597千円
ソフトウェア 5,267千円	ソフトウェア 12,503千円
	3. 過年度損益修正益の内訳
	特別利益の過年度損益修正益は、過年度の調査費の過大計上分の戻し入れであります。
	4. 関係会社項目
	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。
	受取配当金 331,240千円
	過年度損益修正益 105,241千円

（株主資本等変動計算書関係）

第25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

発行済株式の種類	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	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,626,000	67,750	平成21年3月31日	平成21年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	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	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月30日 定時株主総会	普通 株式	1,680,000	70,000	平成22年3月31日	平成22年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成23年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

(リース取引関係)

第25期 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)				第26期 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)			
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額				1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額			
	器具備品	その他	合計		器具備品	その他	合計
取得価額相当額	90,601千円	-	90,601千円	取得価額相当額	46,681千円	-	46,681千円
減価償却累計額 相当額	75,063千円	-	75,063千円	減価償却累計額 相当額	46,138千円	-	46,138千円
期末残高相当額	15,538千円	-	15,538千円	期末残高相当額	543千円	-	543千円
未経過リース料期末残高相当額				未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
未経過リース料 期末残高相当額	15,764千円	586千円	16,350千円	未経過リース料 期末残高相当額	586千円	-	586千円
当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額				当期の支払リース料、減価償却費相当額及び支払 利息相当額			
支払リース料		24,096千円		支払リース料		15,998千円	
減価償却費相当額		22,727千円		減価償却費相当額		14,995千円	
支払利息相当額		845千円		支払利息相当額		234千円	
減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする 定額法によっております。				減価償却費相当額の算定方法 同左			
利息相当額の算定方法 リース料総額とリース資産の取得価額相当額との 差額を利息相当額とし、各期への配分方法につい ては、利息法によっております。				利息相当額の算定方法 同左			
2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額				2. オペレーティング・リース取引 オペレーティング・リース取引のうち解約不能の ものに係る未経過リース料期末残高相当額			
	1年以内	1年超	合計		1年以内	1年超	合計
	1,609千円	1,475千円	3,084千円		1,475千円	-	1,475千円

（金融商品関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

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。

デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券及び金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託であり、為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金・保証金であります。

デリバティブ取引は、投資有価証券及び金銭の信託に係る為替及び市場価格の変動リスクの低減を目的とした為替予約取引及び株価指数先物取引等であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	13,820,588	13,820,588	-
(2) 金銭の信託	399,833	399,833	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	1,111,335	1,111,335	-
(4) 長期差入保証金	61,485	61,485	-
資産計	15,393,243	15,393,243	-
(1) 未払法人税等	1,283,275	1,283,275	-
負債計	1,283,275	1,283,275	-
デリバティブ取引(*)	(38,094)	(38,094)	-

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

(4) 長期差入保証金

長期差入保証金として表示しているもののうち、短期間で回収されることが見込まれるものについては、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。

負債

(1) 未払法人税等

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等（貸借対照表計上額1,125,584千円）につきましては、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ため、「(4)長期差入保証金」には含めておりません。

(注3) 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

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,819,459	-	-	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
(3) 長期差入保証金(*)	61,485	-	-	-
合計	13,880,945	-	-	-

(*) 長期差入保証金のうち、継続的に契約予定である本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金・保証金等1,125,584千円は含めておりません。

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)金融商品に対する取組方針

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。
デリバティブは、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。
取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。
金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。
長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金であります。
金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引および債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替および市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(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

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,220,759	12,220,759	-
(2) 金銭の信託	5,967,344	5,967,344	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	524,252	524,252	-
資産計	18,712,356	18,712,356	-
(1) 未払法人税等	1,706,391	1,706,391	-
負債計	1,706,391	1,706,391	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金（貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、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ため、記載しておりません。

(注3) 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

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,220,413	-	-	-
合計	12,220,413	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

(有価証券関係)

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,161,144千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	368,968	146,101	222,866
債券	-	-	-
その他（投資信託）	716,414	544,802	171,611
小計	1,085,382	690,904	394,477
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	25,953	30,000	4,047
小計	25,953	30,000	4,047
合計	1,111,335	720,904	390,430

（注）非上場株式（貸借対照表計上額82,746千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
2,070,000	563,988	4,017

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	513,129	146,101	367,027
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,400	3,000	400
小計	516,529	149,101	367,427
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,723	10,000	2,277
小計	7,723	10,000	2,277
合計	524,252	159,101	365,150

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
719,016	162,043	4,830

（金銭の信託関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	399,833	838

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 運用目的の金銭の信託

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	5,967,344	119,701

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引 以外の 取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	22,960	-	743	743
	香港ドル	27,416	-	264	264
	豪ドル	101,481	-	1,076	1,076
	シンガポールドル	14,547	-	154	154
	合計	166,405	-	2,238	2,238

（注1）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(2) 株式関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場 取引	株価指数先物取引 売建	561,971	-	29,413	29,413
	合計	561,971	-	29,413	29,413

（注2）時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 不動産投資信託関連

区分	種類	第25期(平成22年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額のうち 1年超(千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	REIT指数先物取引 売建	104,418	-	6,442	6,442
合計		104,418	-	6,442	6,442

(注3) 時価の算定方法

取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

第26期（平成23年3月31日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日現在)	(千円)
(1) 退職給付債務	530,305	
(2) 未認識数理計算上の差異	41,515	
退職給付引当金	488,790	

3. 退職給付費用に関する事項

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	(千円)
(1) 勤務費用	82,653	
(2) 利息費用	6,471	
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	5,402	
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,987	
退職給付費用	132,513	

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第25期 (平成22年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

第26期（平成23年3月31日現在）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日現在) (千円)	
(1) 退職給付債務	636,624	
(2) 未認識数理計算上の差異	57,560	
	<hr/>	
退職給付引当金	579,063	

3. 退職給付費用に関する事項

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) (千円)	
(1) 勤務費用	85,216	
(2) 利息費用	7,954	
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	9,383	
(4) 確定拠出年金 拠出額	37,218	
	<hr/>	
退職給付費用	139,773	

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

	第26期 (平成23年3月31日)
(1) 割引率(%)	1.5
(2) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(3) 数理計算上の差異の処理年数(年)	5

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第25期	第26期
	(平成22年3月31日現在)	(平成23年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	108,541	128,299
未払事業所税	6,290	6,141
賞与引当金	233,054	234,157
未払法定福利費	26,912	28,823
未払確定拠出年金掛金	2,712	2,739
減価償却超過額	17,598	36,256
減価償却超過額（一括償却資産）	6,098	3,039
繰延資産償却超過額（税法上）	89,657	139,027
退職給付引当金	198,937	235,678
役員退職慰労引当金	39,211	40,806
ゴルフ会員権評価損	5,577	5,577
投資有価証券評価損	66,421	763
関係会社株式評価損	-	1,556
貸倒引当金繰入額	14,840	-
繰延税金資産合計	815,851	862,867
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	28,334	57,474
繰延税金負債合計	28,334	57,474
差引繰延税金資産の純額	787,517	805,393

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

第25期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

第26期については、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	24,367,005	5,478,622	789,867	30,635,495

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(追加情報)

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

(関連当事者との取引)

第25期（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その 他の 関係 会社	第一生命 保険相互 会社	東京都 千代田 区	4,200億円 (基金償却 積立金)	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産の運 用及び助 言、当社 設定投信 の販売	資産運用の 助言の顧問 料の受入	711,279	未収投 資助言 報酬	190,025
								販売手数料 の支払	13,054		
								保険料の支 払	6,572		

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 支払販売手数料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注3) 保険料は、一般的取引条件と同様に決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注5) 平成22年4月1日付にて、第一生命保険相互会社は、相互会社から株式会社へ組織変更しております。新会社の商号は、第一生命保険株式会社であります。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	785,924	未払 費用	296,169
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	244,629	未払 費用	98,673

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,434,905	未払手 数料	122,995
								預金の預入 (純額)	90,148	現金・ 預金	412,513
								受取利息	199	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	613,204	未払手 数料	104,436
								預金の預入 (純額)	1,133,958	現金・ 預金	12,572,634
								受取利息	16,966	未収 収益	1,071
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	247,604	未払 費用	113,245
								業務委託料 の支払	48,770	未払 費用	36,277
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	401,000	金銭の 信託	399,833
信託報酬の 支払								130			

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

第26期（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	2,102億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務 1名, 出向 3名, 転籍 2名	資産運 用の助 言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	710,392	未収投資 助言報酬	190,149

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	646,432	未払 費用	172,736
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り 資産の運 用の顧問 料の支払	224,694	未払 費用	88,837
	DIAM SINGAPORE PTE. LTD.	Central Singapore	700,000 千円	資産の 運用	(所有) 直接100%	-	なし	増資の引 受	300,000	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
その他の 関係会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	1,538,792	未払手 数料	108,444
								預金の預入 (純額)	112,401	現金・ 預金	524,914
								受取利息	156	未収 収益	-
	株式会社 みずほコ ーポレー ト銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売、 預金取引	投資信託の 販売代行手 数料	536,163	未払手 数料	89,649
								預金の引出 (純額)	1,524,876	現金・ 預金	11,047,758
								受取利息	7,802	未収 収益	-
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り 資産の運 用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	198,967	未払 費用	94,085
								業務委託料 の支払	17,740	未払 費用	21,598
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 追加 (純額)	5,500,000	金銭の 信託	5,967,344
信託報酬の 支払								3,163			

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税が含まれております。

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 849,916円62銭 1株当たり当期純利益金額 141,719円30銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 964,903円60銭 1株当たり当期純利益金額 185,611円60銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行していないため記載しておりません。

（注）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,401,263千円	4,454,678千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
_____	_____

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,268,020
金銭の信託		5,629,150
前払費用		59,568
未収委託者報酬		2,810,956
未収運用受託報酬		1,659,443
未収投資助言報酬		313,603
未収収益		243,409
繰延税金資産		375,975
その他		20,513
	流動資産計	22,380,642
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	168,959
器具備品	1	173,255
建設仮勘定		39,682
無形固定資産		
商標権	1	430
ソフトウェア	1	1,082,772
ソフトウェア仮勘定		189,016
電話加入権		7,148
電話施設利用権	1	411
投資その他の資産		4,173,376
投資有価証券		388,843
関係会社株式		2,457,319
繰延税金資産		542,108
長期差入保証金		702,696
その他		82,408
	固定資産計	5,835,053
資産合計		28,215,695

	第27期中間会計期間末 (平成23年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	45,556
未払金	1,335,271
未払収益分配金	3,223
未払償還金	95,222
未払手数料	1,089,997
その他未払金	146,827
未払費用	1,253,226
未払法人税等	1,383,356
未払消費税等	121,733
前受収益	4,659
賞与引当金	566,648
流動負債計	4,710,452
固定負債	
退職給付引当金	616,545
役員退職慰労引当金	118,905
固定負債計	735,451
負債合計	5,445,903
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	18,252,663
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	15,630,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	1,999,370
株主資本計	22,681,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	88,650
評価・換算差額等計	88,650
純資産合計	22,769,792
負債・純資産合計	28,215,695

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,186,600	
運用受託報酬	2,427,618	
投資助言報酬	487,590	
その他営業収益	367,965	
営業収益計		15,469,773
営業費用		
支払手数料	5,317,217	
広告宣伝費	77,160	
調査費	2,399,769	
調査費	1,478,893	
委託調査費	920,876	
委託計算費	170,060	
営業雑経費	274,550	
通信費	13,894	
印刷費	212,477	
協会費	12,507	
諸会費	19	
支払販売手数料	35,652	
営業費用計		8,238,758
一般管理費		
給料	2,023,999	
役員報酬	123,681	
給料・手当	1,900,318	
交際費	15,479	
寄付金	3,156	
旅費交通費	98,767	
租税公課	46,092	
不動産賃借料	322,850	
退職給付費用	73,794	
固定資産減価償却費	1 228,152	
福利厚生費	15,312	
修繕費	3,575	
賞与引当金繰入	566,648	
役員退職慰労引当金繰入	26,763	
役員退職金	528	
機器リース料	828	
事務委託費	174,574	
消耗品費	28,721	
器具備品費	671	
諸経費	52,322	
一般管理費計		3,682,240
営業利益		3,548,774

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日至平成23年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	57,123	
受取利息	2,091	
雑収入	3,855	
営業外収益計		63,070
営業外費用		
為替差損	1,209	
時効成立後支払分配金	36	
金銭の信託運用損	337,781	
雑損失	997	
営業外費用計		340,025
経常利益		3,271,819
特別利益		
ゴルフ会員権売却益	1,959	
特別利益計		1,959
特別損失		
固定資産除却損	5,729	
固定資産売却損	381	
特別損失計		6,111
税引前中間純利益		3,267,666
法人税、住民税及び事業税		1,344,597
法人税等調整額		24,919
法人税等合計		1,319,677
中間純利益		1,947,989

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
株主資本			
	資本金		
	当期首残高		2,000,000
	当中間期変動額		-
	当中間期末残高		2,000,000
	資本剰余金		
	資本準備金		
	当期首残高		2,428,478
	当中間期変動額		-
	当中間期末残高		2,428,478
	利益剰余金		
	利益準備金		
	当期首残高		123,293
	当中間期変動額		-
	当中間期末残高		123,293
	その他利益剰余金		
	別途積立金		
	当期首残高		13,430,000
	当中間期変動額		2,200,000
	当中間期末残高		15,630,000
	研究開発積立金		
	当期首残高		300,000
	当中間期変動額		-
	当中間期末残高		300,000
	運用責任準備積立金		
	当期首残高		200,000
	当中間期変動額		-
	当中間期末残高		200,000
	繰越利益剰余金		
	当期首残高		4,459,380
	当中間期変動額		
	剰余金の配当		2,208,000
	別途積立金の積立		2,200,000
	中間純利益		1,947,989
	当中間期末残高		1,999,370
	利益剰余金合計		
	当期首残高		18,512,674
	当中間期変動額		260,010
	当中間期末残高		18,252,663
	株主資本合計		
	当期首残高		22,941,152
	当中間期変動額		260,010
	当中間期末残高		22,681,141
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高		216,534
	当中間期変動額(純額)		127,883
	当中間期末残高		88,650
純資産合計			

当期首残高	23,157,686
当中間期変動額	387,894
当中間期末残高	22,769,792

[前](#) [次](#)

重要な会計方針

項目	第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産（リース資産を除く）：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建 物 ... 6～18年 器具備品 ... 2～20年 (2)無形固定資産（リース資産を除く）：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3)リース資産（所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産）：リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込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の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日次会計期間から費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建ての資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

7. リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に準じた会計処理によっております。
8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)
当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第27期中間会計期間末 （平成23年9月30日現在）
1．固定資産の減価償却累計額	建物 … 499,974千円 器具備品 … 531,842千円 商標権 … 2,508千円 ソフトウェア … 798,730千円 電話施設利用権 … 1,185千円

（中間損益計算書関係）

項目	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
1．減価償却実施額	有形固定資産 … 64,964千円 無形固定資産 … 163,188千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

(リース取引関係)

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース資産の内容

該当事項はありません。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「4. 固定資産の減価償却の方法」に記載のとおりであります。

(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料中間期末残高相当額

該当事項はありません。

当中間会計期間に係る支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料 588千円

減価償却費相当額 543千円

支払利息相当額 1千円

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

利息相当額の算定方法

リース料総額とリース資産の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料中間期末残高相当額

1年以内	1年超	合計
670千円	-	670千円

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、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含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,268,020	11,268,020	-
(2) 金銭の信託	5,629,150	5,629,150	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	308,597	308,597	-
資産計	17,205,769	17,205,769	-
(1) 未払法人税等	1,383,356	1,383,356	-
負債計	1,383,356	1,383,356	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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。

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（3）投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

長期差入保証金のうち、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等（中間貸借対照表計上額702,696千円）につきましては、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ため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式（中間貸借対照表計上額2,457,319千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	298,359	146,101	152,257
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,118	3,000	118
小計	301,478	149,101	152,376
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	7,119	10,000	2,881
小計	7,119	10,000	2,881
合計	308,597	159,101	149,495

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（金銭の信託関係）

第27期中間会計期間末（平成23年9月30日現在）

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）

1．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	12,186,600	2,915,208	367,965	15,469,773

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

（持分法損益等）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）	
該当事項はありません。	

（1株当たり情報）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）	
1株当たり純資産額	948,741円 34銭
1株当たり中間純利益金額	81,166円 22銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期中間会計期間 （自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
中間純利益	1,947,989千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	1,947,989千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第27期中間会計期間（自平成23年4月1日 至平成23年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更等

平成21年6月29日付で、定款について次の変更をいたしました。

・株券不発行に伴う対応および役付取締役（取締役会長職）追加に伴う変更

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】****(1) 受託会社**

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成23年3月末日現在 247,303百万円

c. 事業の内容

日本において信託銀行業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

(平成23年3月31日現在)

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	7,425	「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おります。

(3) 投資顧問会社

a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

平成23年5月末日現在 5,425万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

(4) 投資顧問会社

a. 名称

DIAM International Ltd

b. 資本金の額

平成23年12月末日現在 400万ポンド

c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の送付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

委託会社は、DIAM International Ltdの株式について100%保有しています。
その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。
（委託会社の略称： D I A M 、当ファンドの略称：マ資産エゴ）

独立監査人の監査報告書

平成24年2月22日

D I A M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 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド エボリューションの平成23年1月12日から平成24年1月11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、マネックス資産設計ファンド エボリューションの平成24年1月11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。

D I A M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

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月10日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野 功	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23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、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）上記は、独立監査人の中間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。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年2月9日

D I A M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 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド エボリューションの平成22年5月28日から平成23年1月11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、マネックス資産設計ファンド エボリューションの平成23年1月11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。

D I A M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

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	浅野 功	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A M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25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、D I A M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、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。