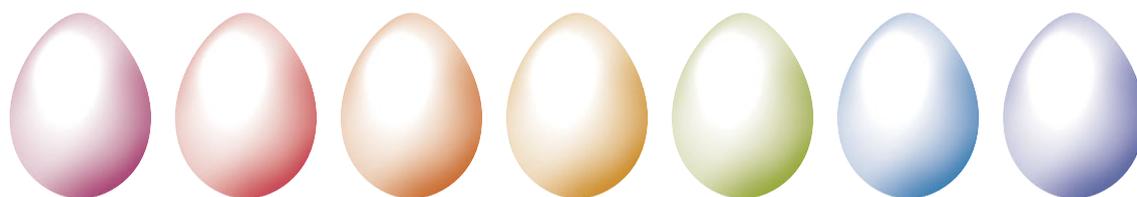


GW 7つの卵

追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）／自動けいぞく投資適用

本書は「交付目論見書」と「請求目論見書」を合冊しております。

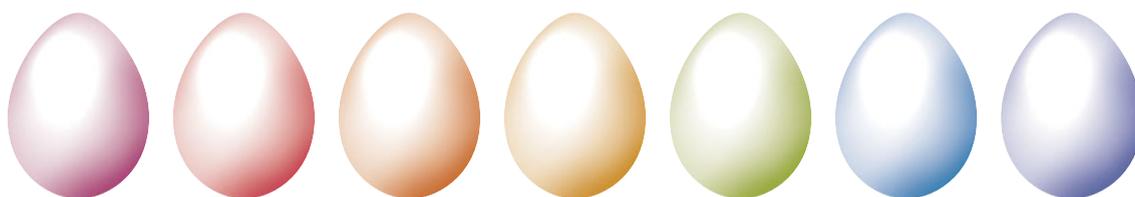


設定・運用は

日興アセットマネジメント

GW 7つの卵

追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）／自動けいぞく投資適用



設定・運用は

日興アセットマネジメント

本書は金融商品取引法第13条の規定に基づき、投資家に交付される目論見書です。

「GW7つの卵」(マザーファンドを含みます。)は、主に株式および債券など値動きのある証券(外貨建証券は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。特に投資する中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。したがって、元金を割り込むことがあります。

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。

投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。

投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

この目論見書により行なう「GW7つの卵」の募集については、委託会社は、証券取引法(現金融商品取引法)昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成19年4月10日に関東財務局長に提出しており、平成19年4月11日にその効力が発生しております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年5月17日、6月27日および10月10日に関東財務局長に提出しております。

当該有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の内容を記載した投資信託説明書(請求目論見書)については、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、投資信託説明書(請求目論見書)をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。

基準価額、販売会社などにつきましては、以下の委託会社の照会先にお問い合わせください。

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。
(半休日となる場合は午前9時～正午)

下記の事項は、この投資信託(以下「当ファンド」といいます。)をお申込みされる投資家の皆様にあらかじめ、ご確認いただきたい重要な事項としてお知らせするものです。

お申込みの際には、下記の事項および投資信託説明書(交付目論見書)の内容を十分にお読みください。

記

当ファンドのリスクについて

- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行者の財務状況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。したがって、投資家の皆様の投資元金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、投資元金が割り込むことがあります。
- ・当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「価格変動リスク」、「流動性リスク」、「信用リスク」および「為替変動リスク」などがあります。

詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の「ファンドのリスク」をご覧ください。

当ファンドの手数料などについて

お申込時、ご換金(解約)時にご負担いただく費用

申込手数料 (1口当たり)	基準価額に対し3.15%(税抜3%)以内 詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
換金(解約)手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用

信託報酬	純資産総額に対し年率1.89%(税抜1.8%)
監査費用	純資産総額に対し 年率0.0084%(税抜0.008%)以内
売買委託手数料など*	<ul style="list-style-type: none">・組入有価証券の売買委託手数料・外貨建資産の保管などに要する費用・借入金の利息・立替金の利息 など

詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)の「費用・税金」をご覧ください。

*売買委託手数料などについては、運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することができません。

当ファンドの手数料などの合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

目次

基本情報

ファンドの概要	1
取得申込み手続きの概要	2
換金手続きの概要	3

特色

ファンドの特色	5
投資方針	9

投資リスク

ファンドのリスク	22
リスク管理体制	23

費用・税金

手数料等及び税金	24
----------	----

ファンド情報

ファンドの性格	29
管理及び運営の概要	31
その他の情報	35

運用

ファンドの運用状況	37
財務ハイライト情報	55

その他

約款	59
用語集	73

ファンドの概要

ファンドの名称	GW7つの卵 (以下「ファンド」といいます。)
商品分類	追加型株式投資信託 / 国際株式型(一般型) / 自動再投資適用
ファンドの目的	中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	証券投資信託「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」受益証券 証券投資信託「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」受益証券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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には、制限を設けません。
主なリスク	<ul style="list-style-type: none"> ・価格変動リスク ・流動性リスク ・信用リスク ・為替変動リスク
信託期間	無期限とします(平成15年2月28日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。
決算日	毎年1月10日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
信託報酬	純資産総額に対し年率1.89%(税抜1.8%)

商品内容を充分にご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

基本情報

取得申込み手続きの概要

申込方法	<ul style="list-style-type: none"> 取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得のお申込みを行なうものとします。 収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。 ＜分配金再投資コース＞をお選びの場合、お申込みの際に、販売会社との間で「自動けいぞく(累積)投資契約」を結んでいただきます。なお、販売会社によっては、別の名称で当該契約と同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあります。また、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。 金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得のお申込みの受付を取り消すことがあります。 金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
取扱時間	<p>原則として、午後3時(わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時)までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。</p>
申込価額 (発行価格)	<p>取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 基準価額につきましては、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。</p>
申込単位	<p>申込単位につきましては、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。</p>
申込手数料	<p>販売会社が定めるものとします。お申込手数料につきましては、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。 ・販売会社におけるお申込手数料率は3.15%(税抜3%)が上限となっております。</p>
申込金額	<p>お申込価額に取得申込口数を乗じて得た額に、お申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。</p>
申込取扱場所	<p>販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。</p>
申込期間	<p>平成19年4月11日から平成20年4月10日とします。 平成20年4月11日以降のお申込期間については、あらた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。</p>

換金手続きの概要

途中換金	原則として、いつでも換金が可能です。
取扱時間	原則として、午後3時(わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時)までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
換金制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
換金単位	< 分配金再投資コース > 1口単位 < 分配金受取りコース > 1口単位 販売会社によっては、換金単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
換金手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

基本情報

< 解約請求による換金 >

解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
手取額	<p>1口当たりのお手取額は、解約価額から所得税および地方税(当該解約価額が受益者毎の個別元本を超過した額に対し10%(内国法人は所得税のみの7%)を差し引いた金額となります。</p> <p>税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご参照ください。</p>
支払開始日	お手取額は、原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
受付中止	<ul style="list-style-type: none"> ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。 ・解約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当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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請求を受け付けたものとして取り扱います。

販売会社によっては、買取請求による換金が可能となる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

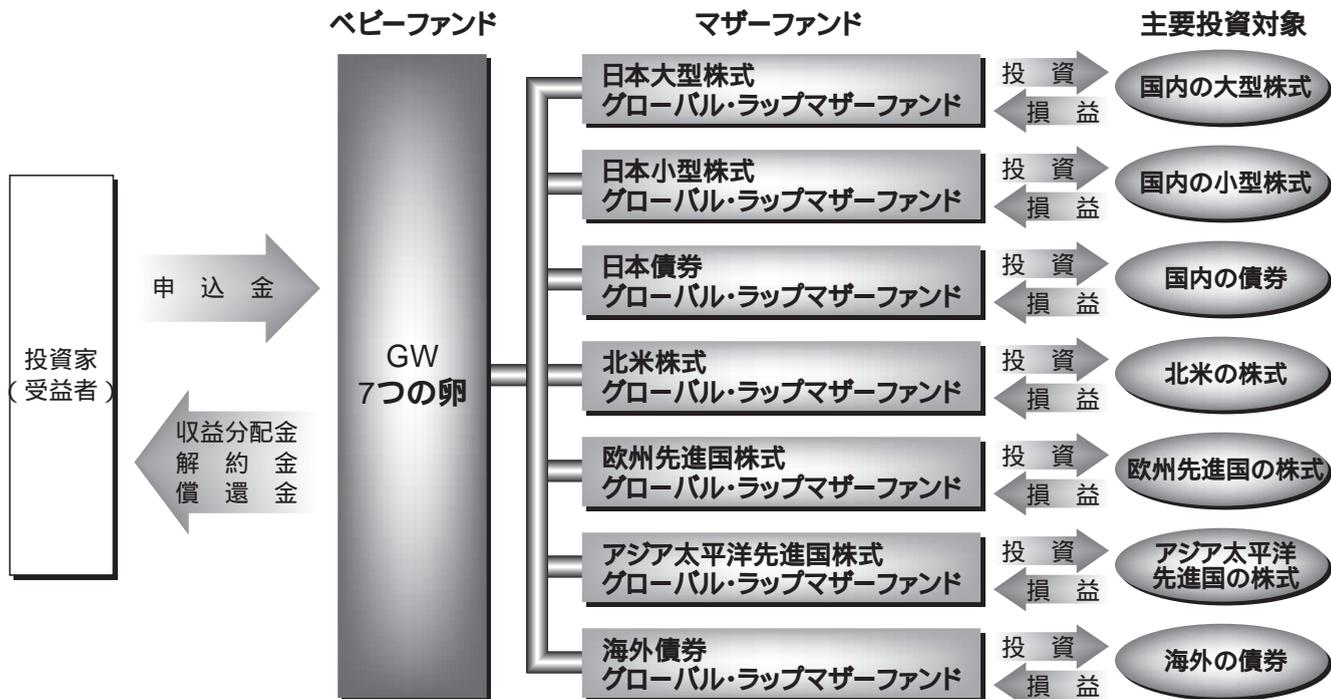
ファンドの特色

1 世界各国から7つの資産を選び、それぞれのスペシャリストが運用します。

- ✓ 世界各国の株式、債券から7つの資産を選び、国際分散投資を行なう¹ことで中長期的な信託財産の成長をめざします。
- ✓ 7つの資産の運用は、それぞれの分野に強みを持つ運用アドバイザー²が各マザーファンドを通じて行ないます(ファミリーファンド方式)。

- 異なる値動きをする傾向のある国内外の株式・債券に分散投資を行なうことで、リターンを安定化を図っています。また、分散投資効果を高めるために、日本株式の資産クラスを大型と小型に分類したり、海外株式を地域分割することにより、7資産に細分化しています。
- 日興グローバルラップ株式会社(日興GW)のファンド・アナリストが評価・選定した投資顧問会社を“運用アドバイザー”と呼びます。

特 色



< 分配金再投資コース > の場合、原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンド受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

日興グローバルラップ株式会社(日興GW)とは

前身の旧「株式会社グローバル・ラップ・コンサルティング・グループ」は1998年2月設立。1990年代に米国で急拡大したサービスである『投資信託ラップ』を日本で初めて導入しました。
 2006年12月、同社が旧「日興コーディアル・アドバイザーズ株式会社」と合併し、「日興グローバルラップ株式会社」として発足。
 有価証券に関する投資顧問・投資一任業務などに加えて、資産配分の策定や、運用会社およびファンドの評価・選定、投資教育・研修などの業務を行ないます。

特 色

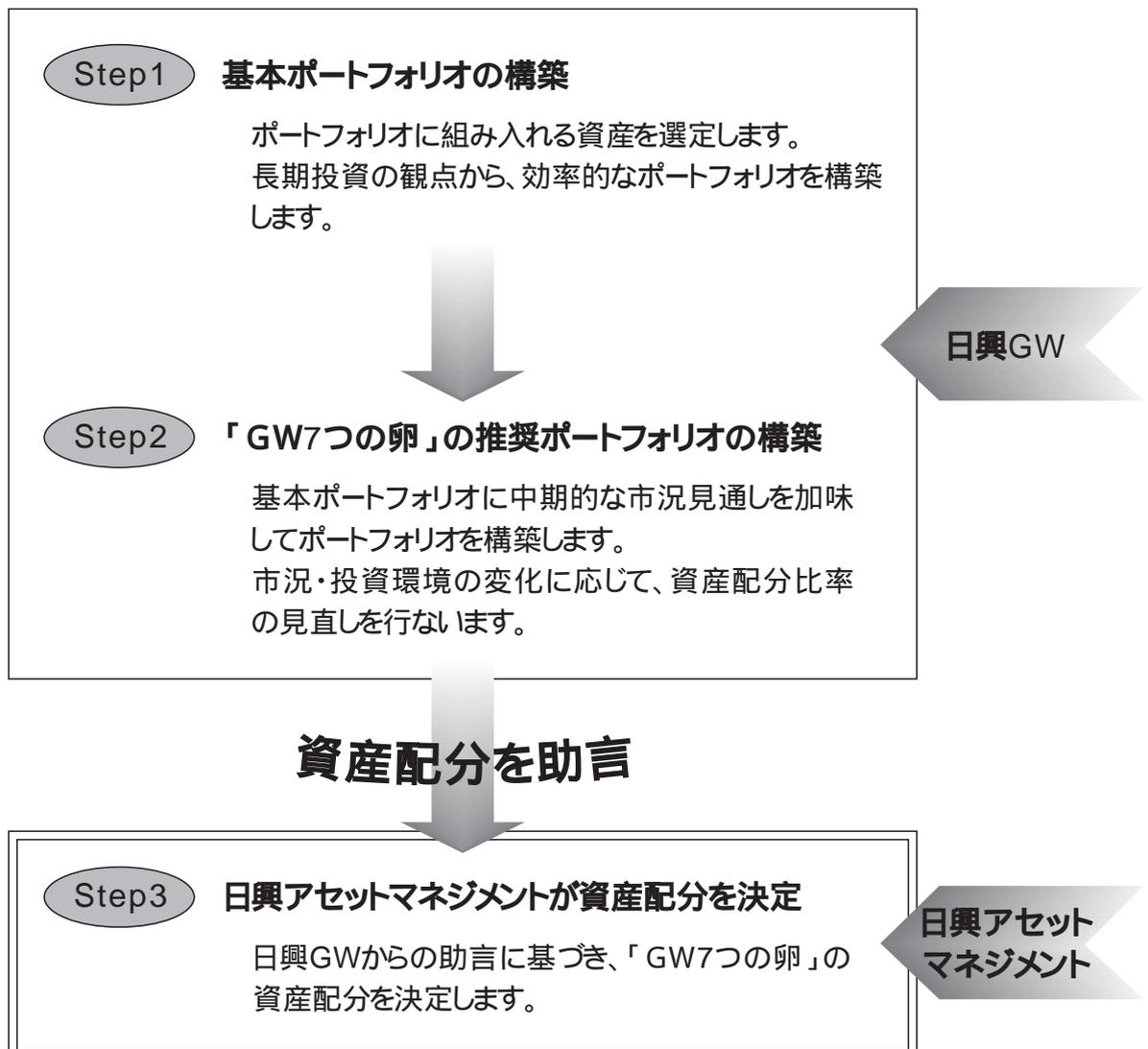
2

資産配分は、日興GWの助言をもとに日興アセットマネジメントが行ないます。

- ✓日興GWは、グローバルなマクロ経済環境・市況などの分析をもとに効率的なポートフォリオを構築し、それに基づき助言を行ないます。
- ✓中期的な市況見通しの変化に応じて、ポートフォリオの資産配分比率を継続的に見直し、調整します。

複数の資産を投資対象としてポートフォリオを構築する場合、各資産への配分比率には無数の組合せが存在します。「効率的なポートフォリオ」とは、期待されるリターンが同じ水準にある無数のポートフォリオのうち、リターンのブレが最も小さくなると判断されるポートフォリオを指します。

< 資産配分の決定プロセス >



特
色

3

運用成果を向上させるために、日興GWが運用状況をモニタリングします。

- ✓日興GWのファンド・アナリストが、各マザーファンドの運用状況を日々モニタリングし、必要な場合には運用アドバイザー交代の助言を行ないます。
- ✓最終的な運用アドバイザーの決定は、日興アセットマネジメントが行ないます。

<日興GWのファンド・アナリストの業務>

特 色

運用会社の調査

質問状やファンド・マネージャーへのインタビューを通じて運用会社を調査します。

調査の中立性を保つため、「GW7つの卵」を設定・運用する日興アセットマネジメントについては、あらかじめ調査対象から除外しています。

運用アドバイザーのモニタリング

運用方針に沿った運用が行なわれているかなど、ファンドの運用状況を監視します。

モニタリングによって運用アドバイザーに懸念材料が見つかった場合には、新たな運用アドバイザーへの交代を検討します。

運用アドバイザーとして選定

<選定に際して重視するポイント>

過去の運用実績だけでなく、将来にわたり安定した運用を行なうための体制が整備されているかなども重視します。下記のポイントについて一定水準を満たすと判断した運用会社の中から運用アドバイザーを選定します。

- 人材(運用に携わる人材が質・量ともに優れ、かつ安定しているか など)
- 投資プロセス(一貫性のある投資プロセスを有し、役割分担の明確なチーム運用が行なわれているか など)
- リサーチ能力(充実したリサーチ体制を持ち、かつ独自の付加価値があるリサーチ手法などを有しているか など)
- プロセスの履行(標榜する投資プロセスを忠実に実践しているか など)
- 事業評価(経営・コンプライアンス・情報開示姿勢などは優れているか など)

運用アドバイザー交代の際などには、暫定的に日興アセットマネジメントが各マザーファンドの運用指図の権限を行使することとなる場合があります。

特 色

4

各マザーファンドの運用アドバイザーおよび基本ポートフォリオは、当面、以下の通りとします。

✓運用アドバイザーおよび基本ポートフォリオは、将来、交代・変更される場合があります。

(平成19年10月10日現在)

マザーファンド名		運用アドバイザー名	基本ポートフォリオ
日本株式	日本大型株式 グローバル・ラップマザーファンド	JPモルガン信託銀行株式会社	23%
	日本小型株式 グローバル・ラップマザーファンド	スパークス・アセット・マネジメント株式会社	10%
日本債券	日本債券 グローバル・ラップマザーファンド	中央三井アセット信託銀行株式会社	17%
海外株式	北米株式 グローバル・ラップマザーファンド	キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニー	15%
	欧州先進国株式 グローバル・ラップマザーファンド	UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社	13%
	アジア太平洋先進国株式 グローバル・ラップマザーファンド	シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール) リミテッド	4%
海外債券	海外債券 グローバル・ラップマザーファンド	PIMCO(パシフィック・インベストメント・マネージメント・ カンパニー・エルエルシー)	18%

運用アドバイザーの評価・選定、交代助言

資産配分を助言

日興GW

5

当ファンドならではの充実した情報提供サービス

毎月の運用状況をご説明する「マンスリーレポート」を作成いたします。

四半期ごとに運用状況の分析などを行なう「四半期レビュー」を作成いたします。

、 については、販売会社を通じてご入手いただけるほか、委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ファンドの決算時には、1年間の運用に関する報告をホームページ上で発信いたします。

投資方針

投資方針

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に分散投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
- ・各マザーファンドの受益証券への投資比率は、下記の資産配分を基本とし、中期的な市況見通しに応じて機動的に変更します。なお、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。

証券投資信託「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」	23%
証券投資信託「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」	10%
証券投資信託「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」	17%
証券投資信託「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」	15%
証券投資信託「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」	13%
証券投資信託「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」	4%
証券投資信託「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」	18%

- ・上記の基本資産配分は、長期的な市況見通しに応じて変更される場合があります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなど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できない場合があります。

投資対象

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」

その他の投資対象に関しましては「約款」をご覧ください。

特 色

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の大型株式の動き(日興バーラ・スタイル・インデックス(日本大型株式) [*])を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> わが国の金融商品取引所上場株式の中から、時価総額の大きな銘柄を中心に厳選投資を行ないます。 ポートフォリオ構築にあたっては、企業のファンダメンタルズ分析、バリュエーション分析などにより、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選し、流動性、銘柄分散も考慮して、リスクの低減につとめます。 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなど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できない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入 有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	JPモルガン信託銀行株式会社(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

^{*}日興バーラ・スタイル・インデックス(日本大型株式)は、わが国の金融商品取引所上場株式の中で、全時価総額の上位85%に属する株式の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各株式の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算します。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の小型株式の動き(日興バーラ・スタイル・インデックス(日本小型株式) [*])を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国の金融商品取引所上場株式の中から、時価総額の小さな銘柄を中心に厳選投資を行ないます。 ・ポートフォリオ構築にあたっては、企業のファンダメンタルズ分析、バリュエーション分析などにより、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選し、流動性、銘柄分散も考慮して、リスクの低減につとめます。 ・株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなど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できない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 ・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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入 有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	スパークス・アセット・マネジメント株式会社(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

^{*}日興バーラ・スタイル・インデックス(日本小型株式)は、わが国の金融商品取引所上場株式の中で、全時価総額の下位15%に属する株式の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各株式の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算します。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

特 色

<日本債券グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の公社債市場全体の動き(日興債券パフォーマンスインデックス(総合))を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国の公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム(利子等収益)の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 ・国債、政府保証債、金融債などで核となるポートフォリオを構築し、社債への投資にあたっては、企業の信用度調査を充分に行ない、流動性、銘柄分散も考慮したうえで、ポートフォリオ全体のリスクの低減につとめます。 ・公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入 有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	中央三井アセット信託銀行株式会社(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

*日興債券パフォーマンスインデックス(総合)は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付機関からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、米国およびカナダの株式市場全体の動き(MSCI北米インデックス(ヘッジなし・円ベース)*)を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	米国およびカナダの金融商品取引所上場株式およびNASDAQ市場で取引されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・米国およびカナダの金融商品取引所上場株式およびNASDAQ市場で取引されている株式を中心に厳選投資を行ないます。 ・投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 ・株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニー(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

*MSCI北米インデックスは、モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル(MSCI社)が発表している、アメリカとカナダの株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、両国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに日興GWが独自に円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

特 色

< 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、欧州先進国の株式市場全体の動き(MSCI欧州インデックス(ヘッジなし・円ベース)*)を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	欧州主要先進国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・欧州主要先進国(MSCI欧州インデックス採用国)の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を中心に厳選投資を行ないます。 ・投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 ・また、投資対象国間の資産配分を図ることによりリスクの低減につとめます。 ・株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社(投資助言)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

*MSCI欧州インデックスは、モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル(MSCI社)が発表している、イギリス、フランス、ドイツなど、欧州主要先進国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに日興GWが独自に円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

特色

< アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、アジアおよび環太平洋の主要先進国の株式市場全体の動き(MSCI 太平洋フリー・インデックス(日本を除く、ヘッジなし・円ベース) [*])を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	アジア・環太平洋主要先進国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 日本を除くアジアおよび環太平洋地域の主要先進国(MSCI太平洋フリー・インデックス(日本を除く)採用国・地域)の株式を中心に厳選投資を行ないます。 投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 また、投資対象国間の資産配分を図ることによりリスクの低減につとめます。 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッド(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

*MSCI太平洋フリー・インデックス(日本を除く)は、モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル(MSCI社)が発表している、オーストラリア、香港、シンガポールなど、日本を除くアジアおよび環太平洋地域の主要先進国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに日興GWが独自に円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

DR(預託証券)...ある国で発行されている株式をその国以外の海外市場で流通させる目的で、原株式を銀行などに預託し海外で発行する代替証券をいいます。海外投資家も国内投資家とほぼ同様の権利を享受でき、取引形態についても株式と変わりません。

カントリーファンド...特定の国、地域の有価証券に投資することを目的としたクローズド・エンド型の会社型投資信託をいいます。会社型投資信託とは、証券投資を目的とする会社を設立し、投資家はその発行株式に投資する形態をいいます。

特 色

< 海外債券グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、世界の主要国の債券市場の動き(シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) [*])を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・世界各国の信用度の高い公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム(利子等収益)の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、信用度の調査、各国の金利動向の見通しに基づき、安定したリターンを提供とリスクコントロールにつとめます。 ・外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(投資一任)
信託期間	無期限(平成13年9月14日設定)
決算日	毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)

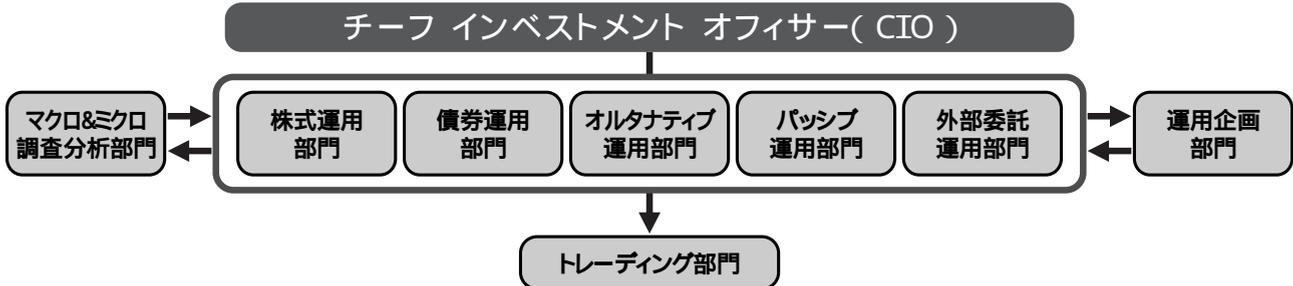
^{*}シティグループ世界国債インデックス(除く日本)は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、残存年数1年以上の固定利付債のトータルリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数を日興GWが独自に円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権およびその他の一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

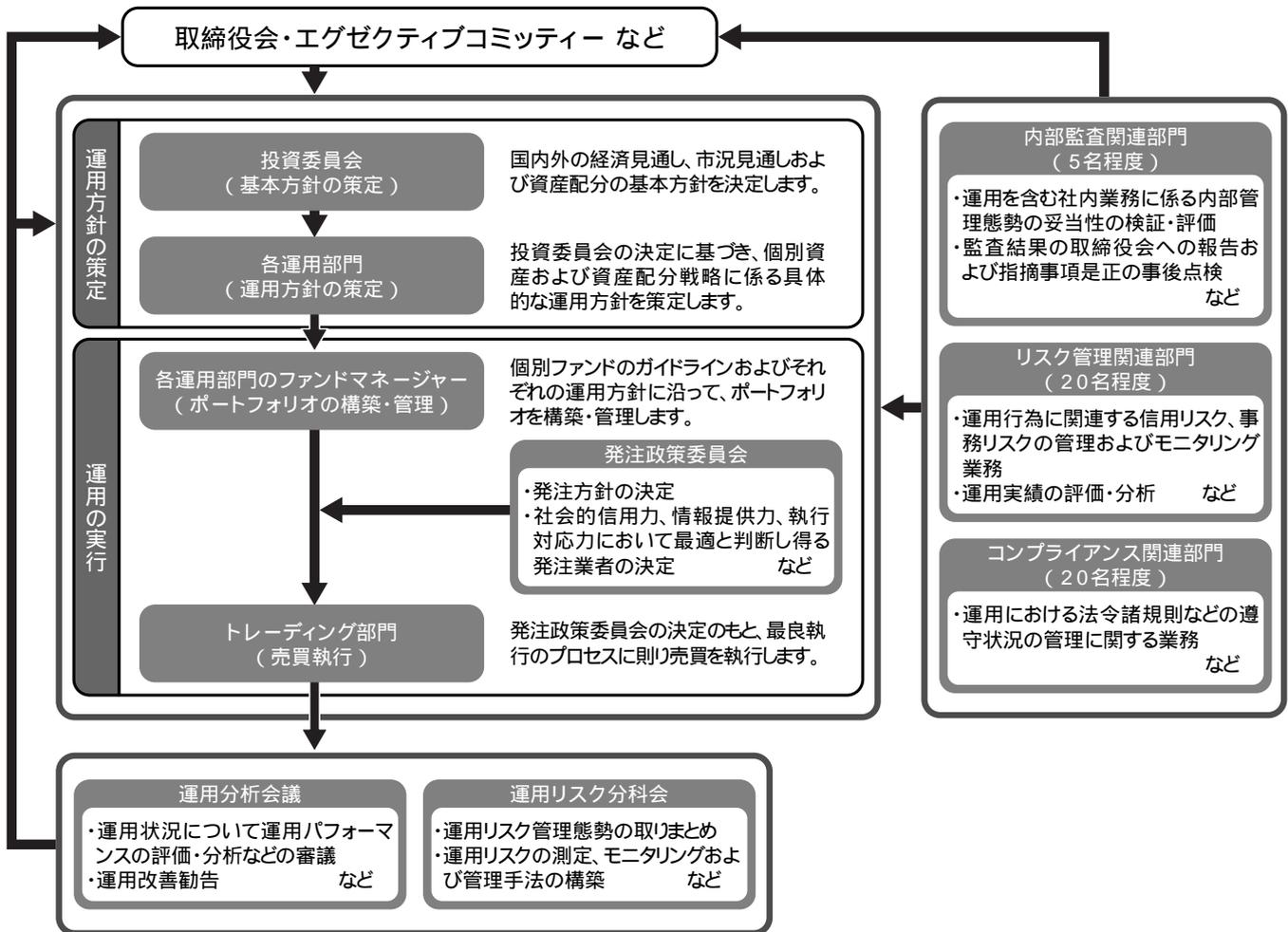
特 色

運用体制

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>
委託会社における運用体制は以下の通りです。



委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では担当窓口として連絡調整を行なうとともに、投資顧問会社の運用プロセスに関する定期的なレビューおよび運用(投資助言を含みます。)するファンドのモニタリングを行ないます。

上記体制は平成19年10月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

特 色

特 色

各マザーファンドの運用アドバイザー(投資顧問会社)は以下の通りです。なお、運用アドバイザーについては、将来、変更する場合があります。

「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、JPモルガン信託銀行株式会社に委託します。

JPモルガン信託銀行は、世界最大級の金融持株会社JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーの資産運用部門「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループの一員です。同グループは約137兆円の運用総資産を有し、日本株式の運用総資産も約5.6兆円にのびります(2007年6月末現在)。

同社のJPモルガン(JPM)日本株運用の運用哲学は、総勢18名のアナリスト(エコノミスト1名を含みます。2007年7月1日現在)が市場では手薄になりがちな長期的な業績予想を行なうことによって当該企業株価の均衡価値を解明し、その均衡価値と市場価格のカイ離を捉えるというものです。また、配当割引モデル(DDM)を活用することにより客観的に銘柄の割安度を判定し、市場タイミングや業種配分の偏りといった銘柄選択以外のリスクは原則として排除するなど、徹底したリスクコントロールのもと、安定的な超過収益の積上げをめざします。

「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、スパークス・アセット・マネジメント株式会社に委託します。

スパークス・アセット・マネジメントは、1989年に発足した日本で数少ない独立系の投資顧問会社です。同社は創業以来「マクロはミクロの集積」という投資哲学の下、「徹底した企業調査をベースにした投資」を一貫して行なっています。特に、経済構造が変革する中で成長する新興企業群や、既存の産業の中で自ら体質改善を図りながら成長を捉えようとする企業群に注目しています。

調査には23名のアナリスト(8名のファンドマネージャーを含みます。2007年6月末現在)が従事しています。徹底した企業訪問・財務分析から得た調査結果を同社独自の社内データベースに蓄積し活用しています。この中から合議の上で有望銘柄がリストアップされ、ポートフォリオの構築が行なわれます。また、運用はチームによる組織立った運用体制が敷かれています。

「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、中央三井アセット信託銀行株式会社に委託します。

中央三井アセット信託銀行は、中央三井トラスト・グループに属し、機関投資家向けの業務に特化した信託銀行です。2007年6月末現在の運用資産総額は約23.1兆円、うち日本債券の運用資産残高は約9.6兆円にのびります。

同社は、長期的な市場動向が中短期的な「市場テーマ(=市場が注目する材料)」の積み重ねにより構成されていると考えており、マーケット動向、マクロ動向、クレジット動向の丹念な調査・分析により、独自に市場テーマを追求し、投資行動に効果的に反映することで超過収益の獲得をめざします。また人間が不得手とする市場データの精緻な分析においては、定量モデル分析を有効に活用し、超過収益獲得の安定性を高める工夫をしています。

特 色

「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニーに委託します。

キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニーは、キャピタル・グループの一員で、米国に拠点を置く機関投資家向けの運用会社です。キャピタル・グループは1931年に創業された世界最大級の運用会社であり、「徹底した個別銘柄調査が長期に渡り優れた実績につながる」を運用哲学としています。

運用における最大の特徴は「マルチ・ファンド・マネージャー・システム」という運用体制にあります。このシステムは、ファンドの資産を複数のファンド・マネージャーに分割し、各ファンド・マネージャーが独自の裁量で運用を行なうものです。複数のファンド・マネージャーのアイデア、スタイルなどをポートフォリオに反映させることで、一人のファンド・マネージャーが運用を行なう場合に起こりやすい独断偏向の回避を図るとともに、運用パフォーマンスの安定に努め、長期的に安定した運用を維持することを目標としています。

特
色

「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用にあたっては、UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社から情報提供および投資助言を受けます。

UBSグローバル・アセット・マネジメントは、スイス最大の銀行であるUBSグループの資産運用会社で、世界23か国のオフィスに約3,400名超の従業員を擁し、2007年6月末現在、約93兆円の資産を運用しています。日本の拠点であるUBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社は、投資プロセスと組織面においてグローバル・スタンダードを実現し、世界トップレベルの投資運用サービスを提供しています。

同社は「長期的にみると世界の資本市場は均衡状態に収斂する」という考えに基づき、「市場価格と本質的な価値との乖離に着目し、割安な証券に投資することを主要な収益機会」とした運用を行ないます。証券の割安・割高を判断するためにUBSグローバル・アセット・マネジメントでは世界の株式・債券に共通したバリュエーション指標を採用し、世界経済・市場リサーチを融合したグローバルな運用体制を整えています。

「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッドに委託します。

シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッドは、シュローダー・グループの中でロンドン、ニューヨークと並んで国際運用拠点の一つと位置付けられています。シュローダー・グループは、1804年に英国に創業した国際金融グループで、ロンドンに本拠地を置きグローバルにオフィスを展開しています。なお、運用資産総額は約34兆円(2007年6月末現在)にのぼります。

同社は、投資対象市場や投資対象企業について実施される徹底した調査、分析によって、本来の投資価値に比べて株価水準が割安な銘柄を見極め、またマクロ分析に基づく国別配分を組み合わせ、リスクのコントロールに配慮しながら、ポートフォリオを構築します。

特 色

「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、PIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)に委託します。

PIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)は、ドイツの保険会社アリアンツ・グループ傘下の債券を専門とする資産運用会社で、米国に本拠を置いています(2007年6月末の運用資産は約86兆円)。

運用にあたっては、短期のタイミングには依存せず、長期的な見通しに基づいて一貫性のある運用を行います。また、常に複数の投資手法を組み合わせた運用を行なうことで、ひとつの投資戦略に過度に依存することを避け、安定した超過収益の獲得と厳格なリスクの管理をめざしています。

ポートフォリオの構築は、グローバル債券チームが国債、社債、モーゲージ債、信用分析などの各専門チームのサポートを受けて行ないます。

特
色

各マザーファンドの適切な組入比率および運用アドバイザーの評価・選定などについて、日興グローバルラップ株式会社(日興GW)より投資助言を受けます。

日興GWでは、多角的な視点から資産配分を策定します。月例で投資政策に関する委員会を開催し、投資環境と中長期的な市況見通しを確認しています。

分配方針

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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。)などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース >

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

< 分配金受取りコース >

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

投資制限**約款に定める投資制限**

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

その他の投資制限に関しましては「約款」をご覧ください。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)
委託会社は、同一法人の発行する株式を、その運用の指図を行なうすべ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係る議決権の総数が、当該株式に係る議決権の総数に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ないものとします。

投資リスク

ファンドのリスク

- ・当ファンド(マザーファンドを含みます。)は、主に株式および債券など値動きのある証券(外貨建証券は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。特に投資する中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドは、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- ・信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

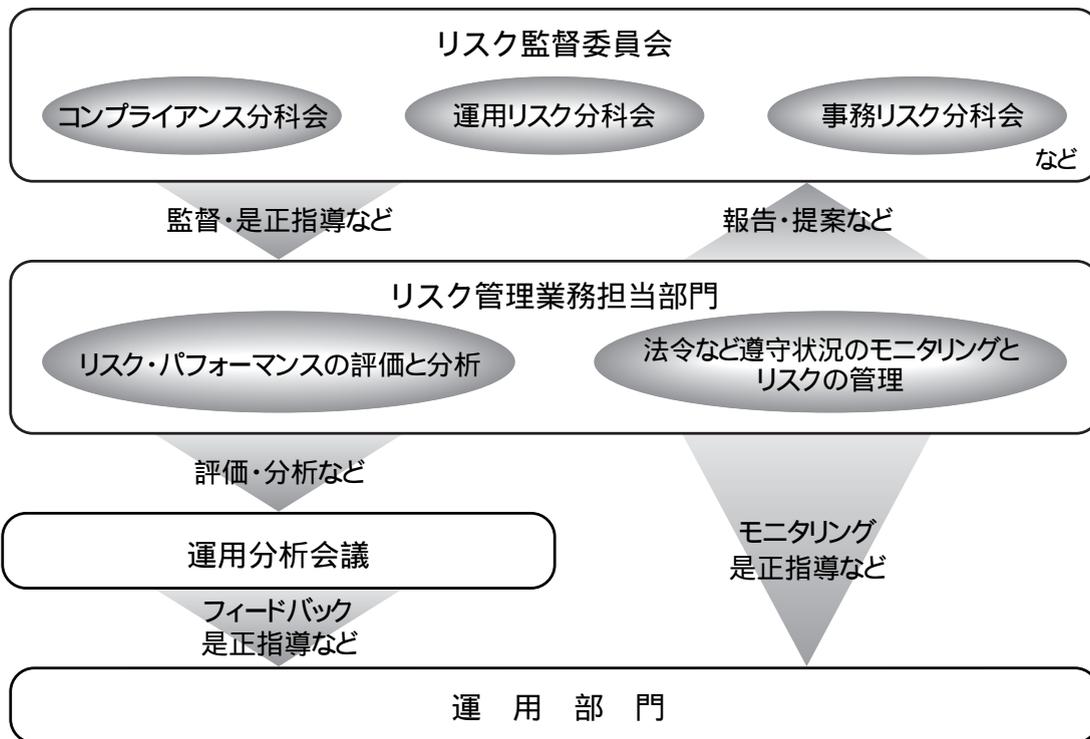
一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

リスク管理体制

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)におけるリスク管理体制>



全体的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会、およびその分科会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。本委員会およびその分科会においては、各種リスク(運用リスク、事務リスク、システムリスクなど)に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

リスク・パフォーマンスの評価と分析

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。また、当社外部委託運用部門では外部委託運用機関との担当窓口として連絡調整を行なうとともに、ファンドのモニタリングも行なっています。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果を運用分析会議に報告し、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果については運用リスク分科会などで報告し運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成19年10月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

費用・税金

手数料等及び税金

受益者が、お申込みから換金(解約)までに直接、間接にご負担していただく主な費用・税金は以下の通りです。

詳しくは、次頁以降の「申込手数料」から「課税上の取扱い」の各項目をご参照ください。下記の税率は、平成16年1月1日から平成21年3月31日までの間に適用されるものです。

時 期	費用・税金	内 容	
直接負担	お申込時	お申込手数料 (1口当たり)	基準価額の3.15%(税抜3%)以内
	収益分配時	所得税・地方税	普通分配金に対し10%*(うち地方税3%)
	換金(解約)時	換金手数料	ありません
		信託財産留保額	ありません
		所得税・地方税	解約差益に対し10%*(うち地方税3%)
	償還時	所得税・地方税	償還差益に対し10%*(うち地方税3%)
間接負担	保有時	信託報酬	純資産総額に対し年率1.89%(税抜1.8%)
		監査費用	純資産総額に対し 年率0.0084%(税抜0.008%)以内
		売買委託手数料など	組入有価証券の売買に係る売買委託手数料 などのファンドを運用するための費用など

売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

*内国法人につきましては7%の源泉徴収となります。

解約または償還により生じた損失については、個人受益者は申告を行なうことにより、株式等譲渡益との損益通算が可能となります。

買取請求に係る課税上の取扱いは、上記と異なります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご参照ください。

お申込手数料は販売会社が定めます。上記は販売会社が定めた手数料率のうち上限の率を記載しております。

売買委託手数料などには、消費税等相当額がかかります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご参照ください。

申込手数料

販売会社が定めるものとします。お申込手数料につきましては、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。

- ・販売会社におけるお申込手数料率は3.15%(税抜3%)が上限となっております。
- ・お申込手数料の額(1口当たり)は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額にお申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、お申込手数料はかかりません。
- ・償還乗換、乗換優遇に関わる手数料の取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

換金(解約)手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

信託報酬

信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に対し年1.89%(税抜1.8%)の率を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて日々、費用計上されます。

- ・信託報酬の配分は、以下の通りとします。

販売会社毎の 純資産総額	信託報酬率(年率)			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
30億円以下の部分	1.8900% (1.80%)	1.2075% (1.15%)	0.6300% (0.60%)	0.0525% (0.05%)
30億円超の部分		1.1025% (1.05%)	0.7350% (0.70%)	

括弧内は税抜です。

投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける報酬の中から支払います。

- ・信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

費用・税金

その他の手数料等

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

監査費用

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、信託期間を通じて日々、信託財産の純資産総額に対し年0.0084%(税抜0.008%)以内の率を乗じて得た金額が費用計上されます。

売買委託手数料など

- ・ 組入有価証券の売買時の売買委託手数料および先物・オプション取引に要する費用など。
- ・ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

課税上の取扱い

< 公募株式投資信託の税制 >

個人受益者および内国法人である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

< 個人受益者の場合 >

	平成16年1月1日から 平成21年3月31日まで	平成21年4月1日以降
収益分配金	普通分配金に対し 10%の源泉徴収(申告不要)	普通分配金に対し 20%の源泉徴収(申告不要)
解約金 償還金	個別元本超過額に対し 10%の源泉徴収(申告不要)	個別元本超過額に対し 20%の源泉徴収(申告不要)
解約損 償還損	解約損または償還損と株式等の譲渡益との損益通算可	
譲渡損益	申告分離課税(株式等の譲渡損益との損益通算可)	

確定申告を行ない、総合課税(配当控除の適用なし)を選択することもできます。

法人の場合、平成16年1月1日から平成21年3月31日までの間は7%(所得税のみ)、平成21年4月1日以降は15%(所得税のみ)の源泉徴収となります。

上場株式等に限定されている特定口座の利用が平成16年10月より可能となりました。なお販売会社によって対応時期などが異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

個人受益者の場合 収益分配金、解約金、 償還金の取扱い

〔平成16年1月1日から平成21年3月31日まで〕

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、軽減税率が適用され、10%(所得税7%および地方税3%)の税率による源泉徴収(申告不要)となります。なお、特別分配金は課税されません。確定申告を行ない、総合課税(配当控除の適用なし)を選択することもできます。

解約時および償還時に損失が生じた時には、確定申告を行なうことで、株式等(上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)のほか、未上場の株式投資信託を含みます。以下同じ。)の譲渡益との損益通算が可能となります。また、上場株式等(公募株式投資信託、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)を含みます。以下同じ。)に係る譲渡損失の3年間の繰越控除の対象となります。

〔平成21年4月1日以降〕

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、20%(所得税15%および地方税5%)の税率による源泉徴収(申告不要)となります。なお、特別分配金は課税されません。確定申告を行ない、総合課税(配当控除の適用なし)を選択することもできます。

解約時および償還時に損失が生じた時には、確定申告を行なうことで、株式等の譲渡益との損益通算が可能となります。また、上場株式等に係る譲渡損失の3年間の繰越控除の対象となります。

買取請求の取扱い

〔平成16年1月1日から平成20年12月31日まで〕

公募株式投資信託を譲渡(買取請求)した場合の譲渡益は、譲渡所得等とみなされ、譲渡益に対し10%(所得税7%および地方税3%)の申告分離課税の対象となり、確定申告を行なうことが必要です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

譲渡損益は、確定申告を行なうことで、株式等の譲渡損益との損益通算が可能となります。また、上場株式等に係る譲渡損失の3年間の繰越控除の対象となります。

〔平成21年1月1日以降〕

公募株式投資信託を譲渡(買取請求)した場合の譲渡益は、譲渡所得等とみなされ、譲渡益に対し20%(所得税15%および地方税5%)の申告分離課税の対象となり、確定申告を行なうことが必要です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

譲渡損益は、確定申告を行なうことで、株式等の譲渡損益との損益通算が可能となります。また、上場株式等に係る譲渡損失の3年間の繰越控除の対象となります。

費用・税金

法人受益者の場合

収益分配金、解約金、償還金の取扱い

[平成16年1月1日から平成21年3月31日まで]

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、軽減税率が適用され、7%(所得税のみ)の税率による源泉徴収となります。なお、特別分配金は課税されません。

[平成21年4月1日以降]

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15%(所得税のみ)の税率による源泉徴収となります。なお、特別分配金は課税されません。

なお、源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

個別元本

- ・各受益者の買付時の基準価額(お申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- ・受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

個別元本超過額

- ・償還金・解約金を受け取る場合、1口当たりの課税前の受取金額(解約金については、信託財産留保額がある場合は、信託財産留保額を差し引いた額)が前記の1口当たりの個別元本を上回る金額をいいます。
- ・この個別元本超過額が所得税および地方税の課税の対象となります。

普通分配金と特別分配金

- ・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「特別分配金」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- ・受益者が収益分配金を受け取る際
 - 1) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは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ます。
 - 2) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
 - 3) 収益分配金発生時に、その個別元本から特別分配金を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合などには、上記の内容が変更になる場合があります。

ファンドの性格

ファンドの性格

ファンドの目的

中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

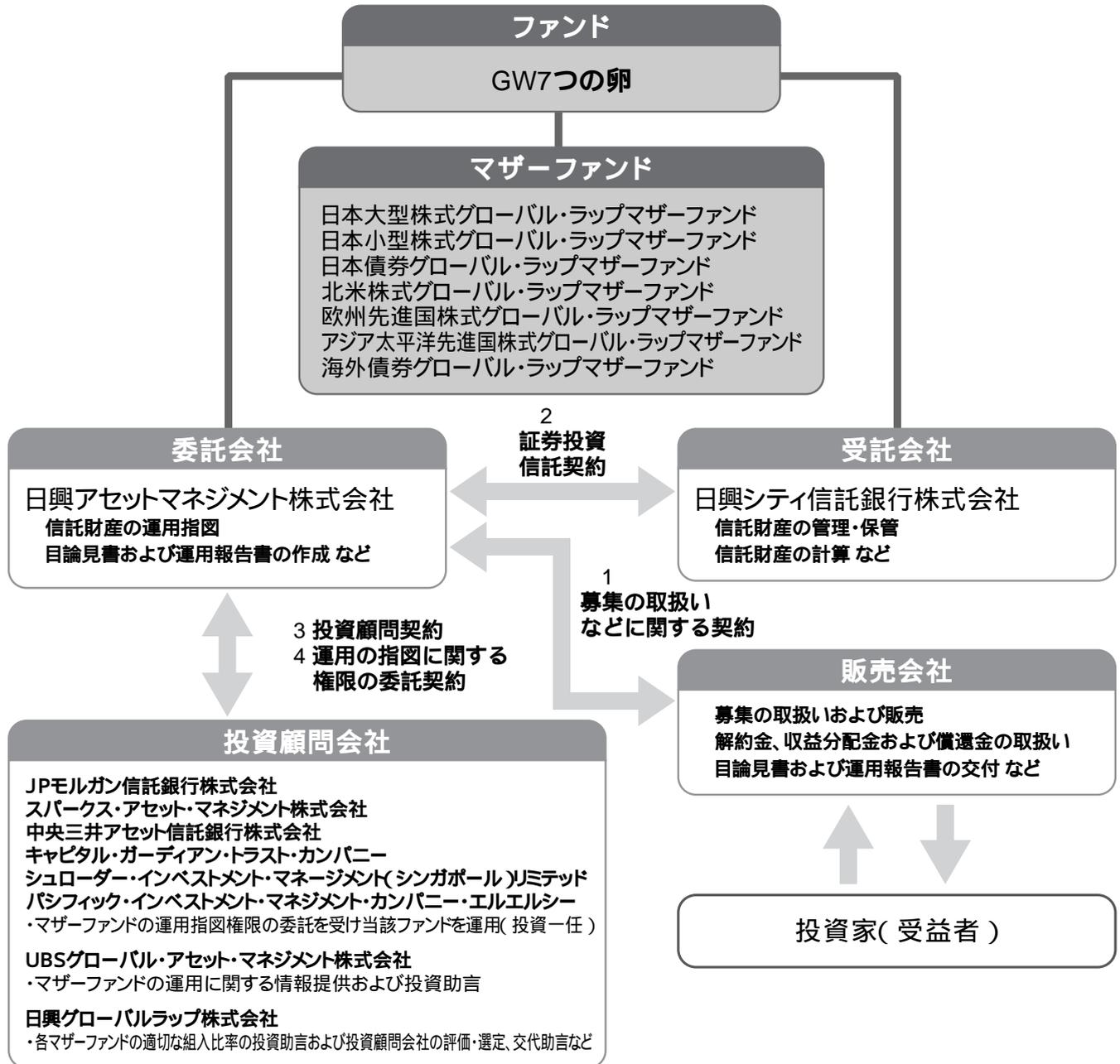
追加型株式投資信託 / 国際株式型(一般型)

「国際株式型(一般型)」とは、社団法人投資信託協会が定める分類方法において、「約款上の株式組入限度70%以上のファンドで、主として外国株式に投資するもの」として分類されるファンドをいいます。

信託金限度額

- ・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの仕組み



ファンド情報

ファンド情報

- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言(有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など)を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。
- 4 投資顧問会社に運用の指図に関する権限を委託するにあたり、そのルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したもの。委託する業務内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況 (平成19年8月末日現在)

- 1) 名称
日興アセットマネジメント株式会社
- 2) 代表者の役職氏名
取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
- 3) 本店の所在の場所
東京都千代田区有楽町一丁目1番3号
平成19年9月18日付で下記に移転
東京都港区赤坂九丁目7番1号
- 4) 資本金
16,287百万円
- 5) 会社の沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
昭和35年：「証券投資信託法」(当時)に基づく免許を受けて営業を開始
昭和60年：投資顧問業開始
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 6) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
株式会社 日興コーディアルグループ	東京都中央区日本橋兜町6番5号	112,842,500株	61.31%
NAMホールディングス 株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目7番3号	69,170,000株	37.58%

管理及び運営の概要

資産管理等の概要

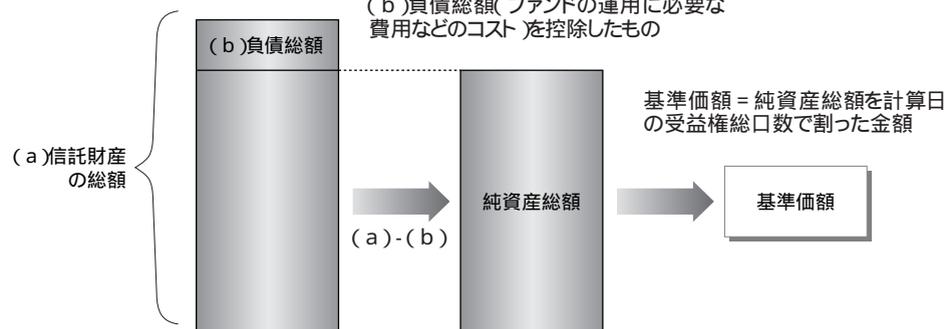
資産の評価 基準価額の算出

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)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。ファンドは便宜上、1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >

(a)信託財産の総額 = ファンドに組み入れられている株式や公社債などを時価などにより評価したもの

純資産総額 = (a)信託財産の総額から (b)負債総額(ファンドの運用に必要な費用などのコスト)を控除したもの



有価証券などの 評価基準

- ・ 信託財産に属する資産については、法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品証券取引所の最終相場(ジャスダック証券取引所については、同所が発表する基準値段)で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)

b) 金融商品取引者(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。)、銀行などの提示する価額(売気配相場を除きます。)

c) 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・ 外貨建資産(外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。)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相場の仲値によって計算します。

ファンド情報

基準価額の 算出頻度と照会先

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額につきましては、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。

保管

該当事項はありません。

計算期間

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とします。

信託の終了他

信託の終了 (繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後記「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
第3計算期間の終了日の翌営業日以降、受益権の口数が10億口を下回る
こととなった場合
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、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
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(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委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

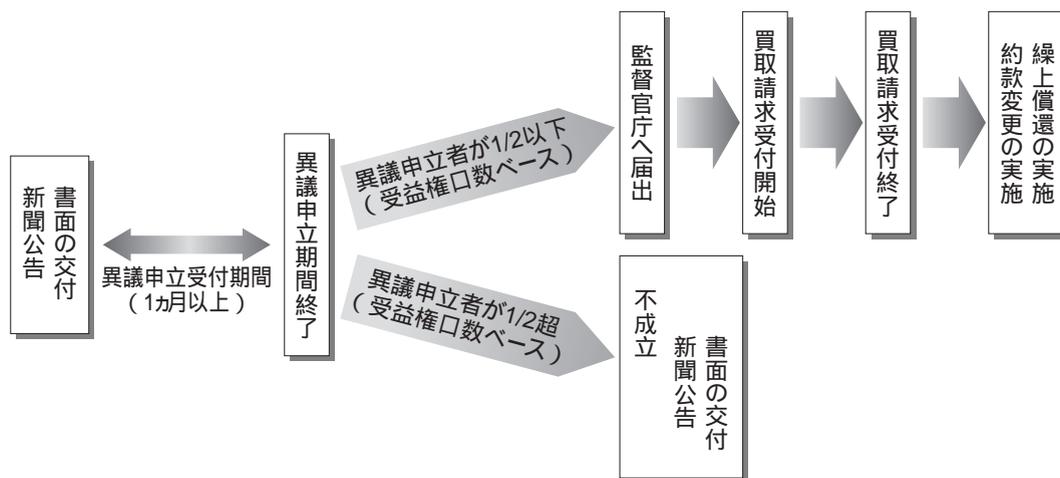
信託約款の変更

- 1) 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、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

異議の申立て

- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べる
ことができます。
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとする
ときは、後記「異議の申立て」の規定を適用します。
- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に
委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の
期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一
を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
 - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨お
よびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告
は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、
原則として公告を行ないません。
 - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数
の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べ
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い
取るべき旨を請求できます。

< 繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ >



償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還
日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日まで)から受益者
に支払います。
- ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

運用報告書の作成

委託会社は、每期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容
および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、あらかじめ届
出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

ファンド情報

関係法人との契約 について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社とのマザーファンドにおける運用の指図に関する権限の委託契約または投資顧問契約は、当該ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

受益者の権利等

受益者の有する主な権利は次の通りです。

- ・収益分配金・償還金受領権
- ・解約請求権
- ・帳簿閲覧権

その他の情報

内国投資信託受益
証券事務の概要

名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情など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を行なわないものとします。

受益者に対する特典
譲渡制限の内容

該当事項はありません。

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・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。
- ・前述の申請のある場合には、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、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なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、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などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得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。

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。

受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託会社と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

質権口記載または記録の
受益権の取扱いについて

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、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

ファンド情報

その他

国内投資信託受益証券の形態等

- ・追加型証券投資信託受益権です。
 - ・格付は取得しておりません。
- ファンドの受益権は、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「振替機関に関する事項」に記載の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(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。)。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、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。

発行価額の総額(設定総額)

5兆円を上限とします。

払込期日および払込取扱場所

- ・取得申込者は、お申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・お申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額(設定総額)は、販売会社によって、追加設定が行な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に払い込まれます。

振替機関に関する事項

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

有価証券届出書(有価証券届出書の訂正届出書を含みます。)の写しを縦覧に供する場所

該当事項はありません。

ファンドの詳細情報の項目

有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」(投資信託説明書(請求目論見書))の記載項目は以下の通りです。

- 第1 【ファンドの沿革】
- 第2 【手続等】
 - 1 【申込(販売)手続等】
 - 2 【換金(解約)手続等】
- 第3 【管理及び運営】
 - 1 【資産管理等の概要】
 - (1)【資産の評価】
 - (2)【保管】
 - (3)【信託期間】
 - (4)【計算期間】
 - (5)【その他】
 - 2 【受益者の権利等】
- 第4 【ファンドの経理状況】
 - 1 【財務諸表】
 - (1)【貸借対照表】
 - (2)【損益及び剰余金計算書】
 - (3)【注記表】
 - (4)【附属明細表】
 - 2 【ファンドの現況】
 - 【純資産額計算書】
- 第5 【設定及び解約の実績】

ファンドの運用状況

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価 (千円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	598,910,210	99.28
日本	598,910,210	99.28
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	4,328,568	0.72
純資産総額	603,238,778	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 親投資信託受益証券 >

発行地	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 (円)		評価額 (円)		投資比率 (%)
			単価	金額	単価	金額	
日本	日本大型株式グローバル・ラップ マザーファンド	84,648,912,672	1.7317	146,586,982,608	1.7550	148,558,841,739	24.63
日本	北米株式グローバル・ラップ マザーファンド	74,186,425,077	1.2954	96,103,797,186	1.3613	100,989,980,457	16.74
日本	海外債券グローバル・ラップ マザーファンド	56,847,702,996	1.6871	95,907,759,947	1.7439	99,136,709,254	16.43
日本	欧州先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド	38,982,707,658	2.2591	88,066,341,597	2.3783	92,712,573,623	15.37
日本	日本債券グローバル・ラップ マザーファンド	64,685,137,232	1.0442	67,547,028,289	1.0539	68,171,666,128	11.30
日本	日本小型株式グローバル・ラップ マザーファンド	26,667,400,008	2.2963	61,236,350,681	2.2213	59,236,295,637	9.82
日本	アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド	7,642,197,256	3.2739	25,019,789,689	3.9392	30,104,143,430	4.99

ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.28
合計	99.28

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。

運 用

(3) 運用実績

純資産の推移

期別	1口当たりの純資産額(円)		純資産総額(百万円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
設定時 (2003年02月28日)	1.0000	1.0000	29	29
第1計算期間末(2004年01月13日)	1.0776	1.2476	1,194	1,383
第2計算期間末(2005年01月11日)	1.0781	1.1581	92,365	99,196
第3計算期間末(2006年01月10日)	1.0805	1.3505	278,488	347,980
第4計算期間末(2007年01月10日)	1.0671	1.1671	583,704	637,978

	1口当たりの純資産額(円)	純資産総額(百万円)
2006年07月末日	1.0721	575,434
2006年08月末日	1.1157	616,466
2006年09月末日	1.1198	632,329
2006年10月末日	1.1296	631,787
2006年11月末日	1.1374	638,653
2006年12月末日	1.1755	644,661
2007年01月末日	1.0949	633,452
2007年02月末日	1.0908	626,366
2007年03月末日	1.0823	619,659
2007年04月末日	1.1133	632,954
2007年05月末日	1.1262	634,515
2007年06月末日	1.1353	633,233
2007年07月末日	1.0925	603,238

分配の推移

	1口当たり税込み分配金(円)
第1期	0.1700
第2期	0.0800
第3期	0.2700
第4期	0.1000

収益率の推移

	収益率(%)
第1期	24.76
第2期	7.47
第3期	25.27
第4期	8.01

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

運 用

(参考) 日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成19年7月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、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います。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	197,453,513	98.30
日本	197,453,513	98.30
有価証券指数等先物取引(買建)	(1,040,965)	(0.52)
日本	(1,040,965)	(0.52)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	3,418,008	1.70
純資産総額	200,871,522	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

発行地	銘柄名	業種	株数	簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	トヨタ自動車	輸送用機器	1,788,300	7,815	13,975,494,300	7,200	12,875,760,000	6.41
日本	三井住友フィナンシャルグループ	銀行	7,237	1,120,954	8,112,340,797	1,080,000	7,815,960,000	3.89
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行	5,552	1,370,491	7,608,965,710	1,270,000	7,051,040,000	3.51
日本	東京電力	電気・ガス	2,151,500	4,240	9,122,360,000	3,170	6,820,255,000	3.40
日本	エルピーダメモリ	電気機器	1,163,700	4,849	5,642,911,829	5,320	6,190,884,000	3.08
日本	日本電信電話	情報・通信	11,896	609,898	7,255,345,418	515,000	6,126,440,000	3.05
日本	ブリヂストン	ゴム製品	2,166,900	2,439	5,284,768,600	2,520	5,460,588,000	2.72
日本	大和証券グループ本社	証券	3,953,000	1,436	5,676,922,876	1,274	5,036,122,000	2.51
日本	NTTドコモ	情報・通信	30,126	217,644	6,556,744,950	165,000	4,970,790,000	2.47
日本	ダイキン工業	機械	1,061,500	4,110	4,362,974,806	4,660	4,946,590,000	2.46
日本	出光興産	石油・石炭	348,700	13,031	4,543,941,812	14,160	4,937,592,000	2.46
日本	JFEホールディングス	鉄鋼	504,900	7,605	3,839,966,096	8,210	4,145,229,000	2.06
日本	松下電器産業	電気機器	1,883,000	2,475	4,660,628,000	2,175	4,095,525,000	2.04
日本	日本板硝子	ガラス・土石	6,031,000	619	3,731,418,000	628	3,787,468,000	1.89
日本	三井住友海上火災保険	保険	2,699,000	1,446	3,902,564,000	1,380	3,724,620,000	1.85
日本	日本特殊陶業	ガラス・土石	1,703,000	2,179	3,710,812,341	2,180	3,712,540,000	1.85
日本	川崎汽船	海運	2,184,000	1,160	2,533,440,000	1,647	3,597,048,000	1.79
日本	第一三共	医薬品	1,077,200	3,619	3,898,211,483	3,290	3,543,988,000	1.76
日本	伊藤忠商事	卸売業	2,249,000	1,151	2,588,765,089	1,503	3,380,247,000	1.68
日本	三菱商事	卸売業	929,900	3,045	2,831,408,120	3,540	3,291,846,000	1.64
日本	クボタ	機械	3,232,000	1,109	3,583,070,000	996	3,219,072,000	1.60
日本	太平洋セメント	ガラス・土石	6,278,000	526	3,299,750,994	509	3,195,502,000	1.59
日本	H O Y A	精密機器	841,100	3,975	3,343,539,002	3,780	3,179,358,000	1.58
日本	東海旅客鉄道	陸運	2,410	1,397,180	3,367,204,042	1,230,000	2,964,300,000	1.48
日本	宇部興産	化学	8,207,000	384	3,149,568,000	360	2,954,520,000	1.47
日本	日本電産	電気機器	357,300	7,235	2,584,997,169	7,900	2,822,670,000	1.41
日本	T D K	電気機器	251,600	10,280	2,586,450,900	10,350	2,604,060,000	1.30
日本	日産自動車	輸送用機器	2,003,800	1,329	2,663,050,200	1,272	2,548,833,600	1.27
日本	東京エレクトロン	電気機器	295,100	8,530	2,517,203,000	8,620	2,543,762,000	1.27
日本	三井不動産	不動産	798,000	3,431	2,737,547,387	3,140	2,505,720,000	1.25

運 用

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
株式	98.30
電気機器	12.53
銀行	10.54
輸送用機器	9.19
情報・通信	8.09
ガラス・土石	5.32
卸売業	5.16
化学	4.60
機械	4.59
電気・ガス	3.40
ゴム製品	3.18
石油・石炭	3.11
不動産	3.06
医薬品	2.94
小売業	2.81
陸運	2.68
食料品	2.62
証券	2.51
精密機器	2.47
海運	2.29
鉄鋼	2.06
保険	1.85
建設	1.71
その他金融	1.24
水産・農林	0.33
合計	98.30

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

< 有価証券指数等先物取引 >

発行地	銘柄名	種類	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	東証株価指数先物 2007-09	買建	61	1,065,606,075	1,040,965,000	0.52

運

用

運 用

(参考) 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成19年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類		時価(千円)	投資比率(%)
株式		79,139,826	98.20
	日本	79,139,826	98.20
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,449,927	1.80
純資産総額		80,589,753	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 株式 >

発行地	銘柄名	業種	株数	簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	理想科学工業	機械	761,600	2,376	1,809,573,135	2,630	2,003,008,000	2.49
日本	東北新社	情報・通信	1,564,800	1,214	1,899,321,593	1,200	1,877,760,000	2.33
日本	サトー	機械	850,300	2,425	2,061,578,229	2,165	1,840,899,500	2.28
日本	阪和興業	卸売業	2,901,000	608	1,763,808,000	601	1,743,501,000	2.16
日本	インテックホールディングス	情報・通信	900,000	1,650	1,484,905,837	1,821	1,638,900,000	2.03
日本	オプテックス	電気機器	580,200	2,625	1,522,854,267	2,715	1,575,243,000	1.95
日本	テレパーク	情報・通信	9,192	165,909	1,525,032,759	167,000	1,535,064,000	1.90
日本	リゾートトラスト	サービス	519,300	2,741	1,423,297,547	2,845	1,477,408,500	1.83
日本	トラスコ中山	卸売業	634,500	2,345	1,487,902,500	2,310	1,465,695,000	1.82
日本	文化シヤッター	金属製品	2,098,000	732	1,535,633,288	697	1,462,306,000	1.81
日本	三井ホーム	建設	1,900,000	758	1,440,087,454	754	1,432,600,000	1.78
日本	日本レストランシステム	小売業	408,300	4,181	1,707,057,368	3,500	1,429,050,000	1.77
日本	パル	小売業	295,650	4,089	1,208,895,186	4,490	1,327,468,500	1.65
日本	カカココム	サービス	4,489	387,400	1,739,037,374	295,000	1,324,255,000	1.64
日本	ソディック	機械	1,437,000	883	1,268,900,633	894	1,284,678,000	1.59
日本	アークス	小売業	723,100	1,600	1,156,986,895	1,770	1,279,887,000	1.59
日本	ユニ・チャーム ペットケア	食料品	257,700	4,230	1,090,071,000	4,840	1,247,268,000	1.55
日本	北日本銀行	銀行	250,800	5,290	1,326,732,000	4,950	1,241,460,000	1.54
日本	ドウシヤ	卸売業	726,400	2,358	1,713,045,634	1,708	1,240,691,200	1.54
日本	ビー・エム・エル	サービス	627,400	2,409	1,511,537,398	1,905	1,195,197,000	1.48
日本	千代田インテグレ	電気機器	391,900	3,110	1,218,851,569	3,020	1,183,538,000	1.47
日本	ビジョン	その他製品	608,100	1,994	1,212,551,400	1,927	1,171,808,700	1.45
日本	アイカ工業	化学	845,800	1,624	1,373,579,200	1,384	1,170,587,200	1.45
日本	エイチ・アイ・エス	サービス	378,200	3,420	1,293,444,000	3,070	1,161,074,000	1.44
日本	ユースン精機	機械	566,500	2,025	1,147,162,500	2,035	1,152,827,500	1.43
日本	西尾レントオール	サービス	478,800	2,037	975,427,355	2,350	1,125,180,000	1.40
日本	メルコホールディングス	電気機器	386,600	3,060	1,183,122,948	2,815	1,088,279,000	1.35
日本	S FOODS	食料品	1,045,000	1,100	1,149,785,119	1,031	1,077,395,000	1.34
日本	MCJ	電気機器	17,623	53,206	937,653,273	60,500	1,066,191,500	1.32
日本	アイホン	電気機器	559,600	2,305	1,289,878,000	1,854	1,037,498,400	1.29

運 用

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
株式	98.20
サービス	15.82
電気機器	12.62
卸売業	10.73
情報・通信	10.39
小売業	9.96
機械	7.99
その他製品	4.71
化学	3.94
食料品	3.87
銀行	2.72
金属製品	2.64
輸送用機器	2.32
建設	2.07
ガラス・土石	2.02
繊維製品	1.68
水産・農林	1.40
不動産	1.00
陸運	0.90
鉄鋼	0.65
鉱業	0.51
精密機器	0.24
合計	98.20

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) 日本債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	51,448,647	55.42
日本	51,448,647	55.42
地方債証券	7,272,932	7.84
日本	7,272,932	7.84
特殊債証券	8,828,515	9.51
日本	8,828,515	9.51
社債券	23,783,025	25.62
日本	23,783,025	25.62
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1,492,682	1.61
純資産総額	92,825,802	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 国債証券・地方債証券・特殊債証券・社債券 >

発行地	銘柄名	種別	利率(%) 償還期限	券面総額 (円)	簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	利付国庫債券(10年) 第264回	国債 証券	1.50000 2014-9-20	13,900,000,000	98.59	13,704,104,000	99.49	13,828,693,000	14.90
日本	利付国庫債券(2年) 第256回	国債 証券	0.90000 2009-5-15	13,800,000,000	99.87	13,782,123,000	99.90	13,786,614,000	14.85
日本	利付国庫債券(20年) 第92回	国債 証券	2.10000 2026-12-20	9,600,000,000	99.50	9,551,550,000	98.37	9,443,808,000	10.17
日本	利付国庫債券(10年) 第233回	国債 証券	1.40000 2011-6-20	8,500,000,000	100.17	8,514,280,000	100.65	8,555,080,000	9.22
日本	利付国庫債券(5年) 第64回	国債 証券	1.50000 2012-6-20	5,800,000,000	100.05	5,802,886,000	100.59	5,834,452,000	6.29
日本	東京都公募公債 620回	地方債 証券	1.35000 2015-3-20	1,500,000,000	98.22	1,473,225,000	97.31	1,459,695,000	1.57
日本	三井住友銀行(劣後特約付) 8回	社債券	1.95000 2014-10-22	1,000,000,000	101.59	1,015,850,000	100.37	1,003,740,000	1.08
日本	プロミス(特定社債間限定同 順位特約付) 34回	社債券	0.79000 2010-4-20	1,000,000,000	98.11	981,050,000	97.09	970,910,000	1.05
日本	ソフトバンク(社債間限定同 順位特約付) 25回	社債券	3.39000 2011-6-17	900,000,000	100.00	900,000,000	100.12	901,044,000	0.97
日本	バンク・オブ・アメリカ・コ ーポレーション円貨社債(劣 後特約付) 1回	社債券	2.39500 2017-6-26	900,000,000	100.00	900,000,000	98.84	889,578,000	0.96
日本	関西国際空港社債(財投機関 債) 第3回	特殊債 証券	2.13000 2014-8-5	800,000,000	102.98	823,816,000	102.19	817,544,000	0.88
日本	みずほコーポレート銀行(劣 後特約付) 2回	社債券	2.18000 2014-8-5	800,000,000	103.32	826,560,000	102.06	816,512,000	0.88
日本	公営企業債券(財投機関債) 第22回	特殊債 証券	1.99000 2016-9-23	800,000,000	101.81	814,472,000	100.81	806,440,000	0.87
日本	東京都民銀行期限前償還条 項付(劣後特約付) 2回	社債券	2.15000 2017-2-23	800,000,000	100.21	801,688,000	99.66	797,240,000	0.86
日本	関西アーバン銀行期限前償還 条項付(劣後特約付) 6回	社債券	1.86000 2017-2-20	800,000,000	100.09	800,720,000	99.54	796,352,000	0.86

運 用

日本	兵庫県公募公債 平成17年度12回	地方債証券	1.10000 2011-3-23	800,000,000	99.30	794,392,000	99.01	792,104,000	0.85
日本	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第9回円貨社債(2005)	社債券	0.91000 2010-9-22	800,000,000	98.62	788,968,000	97.29	778,344,000	0.84
日本	政府保証公営企業債券 政府保証第767回	特殊債証券	1.60000 2008-9-25	705,000,000	101.16	713,149,800	100.78	710,506,050	0.77
日本	第一生命第3回基金流動化特定目的会社 特定社債1回	社債券	1.96000 2011-8-11	700,000,000	101.60	711,172,000	100.97	706,818,000	0.76
日本	広島銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 11回	社債券	1.78000 2016-12-15	700,000,000	100.32	702,261,000	99.66	697,620,000	0.75
日本	オリックス(社債間限定同順位特約付) 83回	社債券	0.92000 2009-3-17	700,000,000	99.53	696,689,000	99.39	695,730,000	0.75
日本	日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付) 5回	社債券	0.46000 2008-9-22	700,000,000	99.27	694,855,000	99.35	695,443,000	0.75
日本	十六銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 1回	社債券	1.75000 2017-3-22	700,000,000	99.90	699,321,000	99.27	694,855,000	0.75
日本	日本鉄道建設債券(財投機関債) 第4回	特殊債証券	0.61000 2013-6-20	700,000,000	94.58	662,074,000	94.29	660,023,000	0.71
日本	は号特別道路債券 は号特別第138回	特殊債証券	1.50000 2011-3-25	610,000,000	100.70	614,263,900	100.36	612,177,700	0.66
日本	道路債券(財投機関債) 第21回	特殊債証券	2.75000 2033-6-20	600,000,000	103.38	620,274,000	101.71	610,266,000	0.66
日本	特別関西国際空港債券 特別第21回	特殊債証券	1.60000 2011-3-16	600,000,000	100.56	603,372,000	100.48	602,880,000	0.65
日本	グローバル・ワン不動産投資法人投資法人債(特定投資法人債間限定同順位特約付) 1回	社債券	1.08000 2010-10-21	600,000,000	98.05	588,324,000	98.37	590,220,000	0.64
日本	日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) 第4回	特殊債証券	2.59000 2035-12-20	600,000,000	99.88	599,250,000	97.85	587,106,000	0.63
日本	兵庫県公募公債 平成16年度4回	地方債証券	1.60000 2014-5-27	590,000,000	99.65	587,952,700	99.24	585,492,400	0.63

(注) 銘柄名に のついている債券は、利払い期ごとに利率の変わる債券です。利率は平成19年7月31日現在を記載しております。

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	55.42
地方債証券	7.84
特殊債証券	9.51
社債券	25.62
合計	98.39

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。

運

用

(参考) 北米株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価 (千円)	投資比率 (%)
投資証券	435,019	0.32
アメリカ	435,019	0.32
株式	133,279,288	98.04
アメリカ	115,393,490	84.88
カナダ	10,662,275	7.84
ドイツ	1,193,508	0.88
オランダ	498,278	0.37
フランス	1,090,233	0.80
イギリス	3,831,440	2.82
シンガポール	516,481	0.38
バミューダ諸島	93,580	0.07
新株予約権付社債 (転換社債)	455,120	0.33
アメリカ	455,120	0.33
為替予約取引 (買建)	(132,431)	(0.10)
為替予約取引 (売建)	(132,193)	(0.10)
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	1,779,889	1.31
純資産総額	135,949,318	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 投資証券 >

発行地	銘柄名	保有数量 (口)	簿価 (円)		評価額 (円)		投資比率 (%)
			単価	金額	単価	金額	
アメリカ	DOUGLAS EMMETT INC	84,300	3,092	260,692,692	2,736	230,612,766	0.17
アメリカ	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	27,600	7,969	219,943,848	5,675	156,619,716	0.12
アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	18,916	3,196	60,453,981	2,526	47,787,218	0.04

< 株式 >

発行地	銘柄名	業種	株数	簿価額 (円)		評価額 (円)		投資比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	MICROSOFT CORP	テクノロジー	1,199,100	3,333	3,996,239,131	3,497	4,193,056,048	3.08
アメリカ	GENERAL ELECTRIC COMPANY	工業	735,100	4,260	3,131,842,681	4,671	3,433,485,820	2.53
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	通信	958,000	3,133	3,001,449,872	3,508	3,360,223,895	2.47
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	通信	47,500	54,930	2,609,177,860	61,386	2,915,840,862	2.14
アメリカ	TARGET CORP	消費関連	386,100	7,316	2,824,707,368	7,472	2,884,866,150	2.12
アメリカ	WASHINGTON MUTUAL INC	金融業	509,400	5,020	2,557,421,000	4,634	2,360,509,883	1.74
アメリカ	WACHOVIA CORP	金融業	403,666	6,741	2,721,153,325	5,744	2,318,501,124	1.71
アメリカ	SANDISK CORPORATION	テクノロジー	331,400	5,303	1,757,500,340	6,727	2,229,409,457	1.64
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR A	エネルギー	238,700	7,861	1,876,359,736	9,270	2,212,792,825	1.63
アメリカ	LOWE'S COS INC	消費関連	647,800	3,850	2,494,086,877	3,355	2,173,561,656	1.60
アメリカ	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	工業	234,600	8,501	1,994,250,566	9,137	2,143,533,350	1.58
アメリカ	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	180,500	8,230	1,485,578,749	11,341	2,047,037,685	1.51
アメリカ	APPLIED MATERIALS INC	テクノロジー	696,700	2,235	1,557,042,707	2,619	1,824,698,266	1.34
アメリカ	KLA-TENCOR CORPORATION	テクノロジー	257,000	6,463	1,661,042,297	6,862	1,763,443,690	1.30
アメリカ	ALLERGAN INC	消費関連	246,400	6,695	1,649,680,673	7,067	1,741,411,007	1.28

運 用

アメリカ	PEPSICO INC	消費関連	217,800	7,623	1,660,259,910	7,838	1,707,148,199	1.26
アメリカ	GENENTECH INC	消費関連	186,300	9,599	1,788,368,462	9,069	1,689,587,303	1.24
アメリカ	FOREST LABORATORIES INC	消費関連	335,100	6,197	2,076,538,967	4,907	1,644,491,320	1.21
イギリス	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	消費関連	264,200	6,506	1,718,889,956	6,127	1,618,647,561	1.19
アメリカ	BAXTER INTERNATIONAL INC	消費関連	253,800	6,250	1,586,325,379	6,337	1,608,361,868	1.18
アメリカ	ALTRIA GROUP INC	消費関連	204,400	7,408	1,514,276,101	7,824	1,599,199,682	1.18
カナダ	BARRICK GOLD CORPORATION	基礎資材	401,200	3,463	1,389,214,444	3,958	1,588,079,268	1.17
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	金融業	297,600	5,771	1,717,440,315	5,323	1,583,995,344	1.17
アメリカ	ILLINOIS TOOL WORKS	工業	229,600	6,288	1,443,806,951	6,576	1,509,893,821	1.11
アメリカ	THE WALT DISNEY CO.	通信	354,500	4,104	1,454,788,442	4,045	1,434,005,462	1.05
アメリカ	INTEL CORP	テクノロジー	502,500	2,292	1,151,716,835	2,837	1,425,451,298	1.05
アメリカ	FLUOR CORP	工業	100,900	10,994	1,109,256,682	13,864	1,398,841,922	1.03
アメリカ	SEAGATE TECHNOLOGY	テクノロジー	481,800	2,846	1,371,175,696	2,874	1,384,495,855	1.02
アメリカ	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	金融業	173,100	8,095	1,401,175,131	7,756	1,342,576,998	0.99
アメリカ	SARA LEE CORP	消費関連	701,300	2,009	1,408,839,186	1,905	1,336,270,204	0.98

< 新株予約権付社債(転換社債) >

発行地	銘柄名	利率(%) 償還期限	通貨	券面総額 (各通貨)	簿価額(各通貨)		評価額(各通貨)		邦貨換算額 (円)	投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額		
アメリカ	Ford Motor Company	4.2500 2036-12-15	アメリカ ドル	3,267,000	111.13	3,630,454	117.13	3,826,474	455,120,788	0.33

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
投資証券	0.32
株式	98.04
消費関連	27.95
金融業	16.19
テクノロジー	15.23
通信	13.72
工業	11.37
エネルギー	7.74
基礎資材	4.65
公益事業	1.19
新株予約権付社債(転換社債)	0.33
合計	98.69

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
カナダドル	買建	131,804,152	132,431,599	0.10
合計		131,804,152	132,431,599	0.10
アメリカドル	売建	131,804,152	132,193,217	0.10
合計		131,804,152	132,193,217	0.10

(参考) 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類		時価(千円)	投資比率(%)
投資証券		941,719	0.75
フランス		941,719	0.75
株式		123,507,131	98.51
ドイツ		11,876,191	9.47
オランダ		14,737,295	11.75
フランス		18,337,994	14.63
イギリス		39,639,877	31.62
スイス		13,480,464	10.75
イタリア		3,342,956	2.67
スウェーデン		4,981,068	3.97
フィンランド		3,731,185	2.98
ベルギー		1,564,664	1.25
デンマーク		1,558,790	1.24
スペイン		4,956,730	3.95
ノルウェー		1,124,733	0.90
オーストリア		534,812	0.43
アイルランド		2,372,965	1.89
ギリシア		1,267,399	1.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		925,156	0.74
純資産総額		125,374,007	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 投資証券 >

発行地	銘柄名	保有数量(口)	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
			単価	金額	単価	金額	
フランス	UNIBAIL-RODAMCO	34,877	37,199	1,297,373,759	27,001	941,719,304	0.75

< 株式 >

発行地	銘柄名	業種	株数	簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
イギリス	BP PLC	エネルギー	4,731,399	1,309	6,191,728,850	1,376	6,511,874,832	5.19
フランス	TOTAL SA	エネルギー	695,964	8,444	5,876,716,932	9,328	6,492,074,682	5.18
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	通信	14,517,454	341	4,957,494,524	358	5,195,989,432	4.14
イギリス	BARCLAYS PLC	金融業	3,029,788	1,832	5,550,143,204	1,646	4,986,342,377	3.98
イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	消費関連	1,465,006	3,362	4,924,807,680	2,936	4,301,683,200	3.43
オランダ	ABN AMRO HOLDING NV	金融業	702,944	5,300	3,725,673,494	5,708	4,012,263,763	3.20
イギリス	PRUDENTIAL PLC	金融業	2,390,158	1,794	4,288,898,918	1,571	3,754,591,645	2.99
スイス	CREDIT SUISSE GROUP	金融業	481,323	8,972	4,318,212,013	7,750	3,730,317,747	2.98
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	消費関連	172,710	21,706	3,748,897,491	20,885	3,607,010,354	2.88
フランス	FRANCE TELECOM SA	通信	1,092,512	3,273	3,575,808,819	3,167	3,460,000,362	2.76
スイス	NOVARTIS AG-REG SHS	消費関連	517,800	6,763	3,501,976,632	6,379	3,303,181,346	2.63
オランダ	KONINKLIJKE KPN NV	通信	1,741,445	1,921	3,345,459,340	1,810	3,152,342,842	2.51
フランス	SUEZ SA	公益事業	504,054	6,523	3,288,045,053	6,215	3,132,684,924	2.50
オランダ	AEGON NV	金融業	1,466,851	2,480	3,638,445,869	2,123	3,114,567,075	2.48

運 用

スペイン	BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	金融業	1,324,996	2,208	2,925,727,908	2,210	2,927,888,711	2.34
イギリス	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	金融業	2,065,201	1,654	3,417,174,693	1,378	2,844,853,616	2.27
フィンランド	NOKIA OYJ	通信	828,550	2,833	2,347,033,254	3,399	2,815,899,425	2.25
ドイツ	ALLIANZ SE-REG	金融業	104,941	25,491	2,675,054,683	24,795	2,601,978,850	2.08
フランス	AXA	金融業	481,951	5,256	2,533,167,421	4,599	2,216,423,248	1.77
オランダ	ING GROEP NV-CVA	金融業	429,069	5,289	2,269,210,527	5,010	2,149,557,428	1.71
スウェーデン	ELECTROLUX AB-SER B	消費関連	717,200	3,115	2,234,167,650	2,964	2,125,960,100	1.70
イギリス	WOLSELEY PLC	消費関連	755,000	2,986	2,254,413,329	2,576	1,945,032,661	1.55
イタリア	INTESA SANPAOLO SPA	金融業	2,167,330	943	2,042,930,460	889	1,926,292,561	1.54
ドイツ	METRO AG	消費関連	188,000	9,086	1,708,197,691	9,315	1,751,244,365	1.40
アイルランド	BANK OF IRELAND	金融業	777,086	2,678	2,080,901,043	2,177	1,691,807,918	1.35
フランス	BNP PARIBAS SA	金融業	130,200	12,957	1,686,963,121	12,927	1,683,141,178	1.34
スイス	NESTLE SA-REGISTERED	消費関連	34,672	47,337	1,641,274,878	45,085	1,563,200,642	1.25
デンマーク	A P MOLLER MAERSK A/S	工業	1,003	1,293,280	1,297,159,840	1,554,128	1,558,790,384	1.24
イギリス	DIAGEO PLC	消費関連	602,721	2,430	1,464,611,467	2,402	1,447,856,266	1.15
イタリア	ENI SPA	エネルギー	341,199	3,922	1,338,207,727	4,152	1,416,663,980	1.13

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
投資証券	0.75
株式	98.51
金融業	33.79
消費関連	25.03
通信	14.71
エネルギー	12.17
工業	5.23
公益事業	3.45
基礎資材	2.23
テクノロジー	1.38
コングロマリット	0.52
合計	99.26

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) アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類		時価(千円)	投資比率(%)
投資証券		563,349	1.33
シンガポール		563,349	1.33
株式		40,990,596	96.76
アメリカ		524,776	1.24
オーストラリア		24,943,739	58.88
イギリス		707,910	1.67
香港		9,031,524	21.32
シンガポール		5,432,533	12.82
バミューダ諸島		350,111	0.83
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		807,071	1.91
純資産総額		42,361,017	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 投資証券 >

発行地	銘柄名	保有数量(口)	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
			単価	金額	単価	金額	
シンガポール	SUNTEC REIT	3,848,000	152	584,550,834	146	563,349,509	1.33

< 株式 >

発行地	銘柄名	業種	株数	簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
オーストラリア	BHP BILLITON LTD	基礎資材	1,098,353	2,982	3,275,760,450	3,757	4,126,102,425	9.74
オーストラリア	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	金融業	353,410	5,133	1,814,078,163	5,575	1,970,333,552	4.65
オーストラリア	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	金融業	447,001	4,158	1,858,559,849	3,895	1,741,290,831	4.11
オーストラリア	WOOLWORTHS LIMITED	消費関連	617,850	2,772	1,712,857,214	2,757	1,703,393,915	4.02
オーストラリア	CSL LIMITED	消費関連	186,760	8,542	1,595,210,820	9,096	1,698,761,265	4.01
オーストラリア	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	金融業	584,656	3,017	1,764,112,074	2,874	1,680,533,160	3.97
オーストラリア	RIO TINTO LIMITED	基礎資材	173,360	8,188	1,419,407,926	9,370	1,624,316,214	3.83
オーストラリア	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	金融業	526,250	3,262	1,716,845,631	3,083	1,622,271,349	3.83
オーストラリア	WESTPAC BANKING CORPORATION	金融業	570,270	2,670	1,522,721,553	2,632	1,501,176,353	3.54
オーストラリア	BRAMBLES LTD	消費関連	1,176,470	1,383	1,627,056,227	1,133	1,333,435,804	3.15
シンガポール	UNITED OVERSEAS BANK LTD	金融業	747,192	1,669	1,246,803,425	1,739	1,299,733,759	3.07
香港	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	コングロマリット	882,500	1,338	1,180,432,000	1,354	1,194,516,700	2.82
香港	KERRY PROPERTIES LTD	金融業	1,334,000	596	794,850,560	840	1,120,293,200	2.64
オーストラリア	SUNCORP-METWAY LIMITED	金融業	414,637	2,146	889,995,146	2,009	832,799,949	1.97

運 用

シンガポール	CITY DEVELOPMENTS LTD	金融業	712,000	1,118	795,789,584	1,149	818,206,192	1.93
香港	JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	コングロマリット	274,800	2,498	686,378,952	2,878	790,970,030	1.87
シンガポール	DBS GROUP HOLDINGS LTD	金融業	443,692	1,747	775,290,541	1,779	789,259,739	1.86
シンガポール	SINGAPORE EXCHANGE LTD	金融業	959,000	500	479,316,352	795	762,377,189	1.80
オーストラリア	WOODSIDE PETROLEUM LTD	エネルギー	166,210	3,774	627,274,147	4,365	725,540,308	1.71
イギリス	STANDARD CHARTERED PLC	金融業	185,550	3,405	631,760,640	3,815	707,910,360	1.67
オーストラリア	ORICA LTD	基礎資材	243,640	2,600	633,395,927	2,859	696,586,251	1.64
香港	DAH SING BANKING GROUP LIMITED	金融業	2,600,800	262	681,534,438	263	684,697,011	1.62
香港	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	テクノロジー	596,000	686	408,569,920	1,037	618,290,400	1.46
香港	HANG SENG BANK LTD	金融業	346,400	1,675	580,233,856	1,716	594,450,112	1.40
オーストラリア	LEND LEASE CORP LIMITED	金融業	311,340	2,018	628,188,725	1,893	589,403,794	1.39
香港	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	金融業	1,151,000	550	632,477,723	511	588,669,742	1.39
香港	LI & FUNG LTD	消費関連	1,358,400	391	530,645,376	418	567,811,200	1.34
香港	COSCO PACIFIC LIMITED	消費関連	1,832,000	293	537,435,520	304	556,928,000	1.31
シンガポール	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	消費関連	415,000	952	395,242,265	1,299	538,966,725	1.27
オーストラリア	FOSTER'S GROUP LTD	消費関連	896,770	680	609,850,770	596	534,764,039	1.26

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
投資証券	1.33
株式	96.76
金融業	44.11
消費関連	20.78
基礎資材	15.22
コングロマリット	7.72
通信	3.22
工業	2.55
エネルギー	1.71
テクノロジー	1.46
合計	98.09

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。

運

用

(参考) 海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	64,757,325	50.82
アメリカ	4,904,643	3.85
カナダ	103,206	0.08
ドイツ	32,954,929	25.86
フランス	1,889,176	1.48
イギリス	23,686,409	18.59
フィンランド	55,443	0.04
スペイン	728,658	0.57
オーストリア	31,662	0.02
メキシコ	71,578	0.06
ブラジル	117,798	0.09
南アフリカ共和国	36,663	0.03
パナマ	37,466	0.03
ロシア	139,689	0.11
地方債証券	220,727	0.17
カナダ	220,727	0.17
特殊債証券	37,293,051	29.26
日本	400,828	0.31
アメリカ	35,732,246	28.04
フランス	248,516	0.20
ノルウェー	911,460	0.72
社債券	39,097,593	30.68
アメリカ	34,656,793	27.20
カナダ	497,061	0.39
ドイツ	250,154	0.20
オランダ	48,532	0.04
フランス	34,194	0.03
イギリス	1,816,042	1.43
スペイン	261,883	0.21
ルクセンブルク	1,254,609	0.98
バミューダ諸島	278,319	0.22
コマーシャル・ペーパー	12,016,469	9.43
アメリカ	6,059,229	4.75
オーストラリア	3,855,431	3.03
スウェーデン	2,101,808	1.65
有価証券先物取引等(買建)	(19,537,745)	(15.33)
ドイツ	(19,537,745)	(15.33)
有価証券先物取引等(売建)	(11,920,631)	(9.35)
アメリカ	(7,562,290)	(5.93)
ドイツ	(4,358,340)	(3.42)
為替予約取引(買建)	(64,236,545)	(50.41)
為替予約取引(売建)	(64,338,940)	(50.49)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	25,947,902	20.36
純資産総額	127,437,265	100.00

運 用

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

< 国債証券・地方債証券・特殊債証券・社債券 >

発行地	銘柄名	種別	利率(%) 償還期限	通貨	券面総額 (各通貨)	簿価額(各通貨)		評価額(各通貨)		邦貨換算額 (円)	投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額		
アメリカ	連邦抵当金庫 (FNMA) TBA	特殊債 証券	5.50000 2037-8-14	アメリカ ドル	129,200,000	95.74	123,690,523	96.41	124,556,810	14,814,787,029	11.63
アメリカ	連邦抵当金庫 (FNMA) TBA	特殊債 証券	5.00000 2037-8-14	アメリカ ドル	128,800,000	93.41	120,317,594	93.56	120,508,500	14,333,280,990	11.25
イギリス	イギリス国債	国債 証券	4.75000 2015-9-7	イギリス ポンド	42,280,000	98.62	41,696,536	96.81	40,930,887	9,891,767,577	7.76
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	6.25000 2030-1-4	ユーロ	34,650,000	130.00	45,045,000	124.50	43,138,418	7,035,013,273	5.52
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	4.25000 2014-7-4	ユーロ	35,700,000	100.77	35,974,890	99.72	35,599,076	5,805,497,330	4.56
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	5.62500 2028-1-4	ユーロ	30,804,215	119.70	36,872,645	114.82	35,369,246	5,768,016,579	4.53
イギリス	イギリス国債	国債 証券	4.25000 2011-3-7	イギリス ポンド	23,300,000	96.56	22,498,480	96.27	22,431,562	5,421,035,685	4.25
イギリス	イギリス国債	国債 証券	9.00000 2011-7-12	イギリス ポンド	16,000,000	113.95	18,232,000	112.68	18,029,264	4,357,132,231	3.42
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	5.00000 2012-7-4	ユーロ	15,300,000	105.04	16,070,355	103.15	15,782,103	2,573,745,357	2.02
アメリカ	アメリカ国債	国債 証券	4.50000 2011-2-28	アメリカ ドル	20,200,000	99.95	20,190,530	99.75	20,149,500	2,396,581,530	1.88
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	5.50000 2031-1-4	ユーロ	11,400,000	118.89	13,553,631	114.40	13,041,817	2,126,859,451	1.67
アメリカ	連邦抵当金庫 (FNMA) TBA	特殊債 証券	5.50000 2027-8-14	アメリカ ドル	17,700,000	96.91	17,152,406	97.27	17,217,399	2,047,837,423	1.61
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	6.50000 2027-7-4	ユーロ	9,900,000	131.39	13,007,610	126.17	12,490,959	2,037,025,545	1.60
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	5.25000 2011-1-4	ユーロ	11,800,000	104.55	12,336,310	102.98	12,151,286	1,981,631,721	1.55
アメリカ	連邦住宅貸付銀行 (FHLB)	特殊債 証券	5.00000 2009-10-2	アメリカ ドル	13,600,000	100.38	13,651,000	100.00	13,600,000	1,617,584,000	1.27
アメリカ	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1	社債券	5.87523 2036-8-20	アメリカ ドル	12,996,572	101.16	13,146,945	100.84	13,105,376	1,558,753,407	1.22
イギリス	イギリス国債	国債 証券	4.00000 2009-3-7	イギリス ポンド	5,800,000	97.49	5,654,420	97.74	5,669,048	1,370,038,733	1.08
イギリス	イギリス国債	国債 証券	5.00000 2014-9-7	イギリス ポンド	5,700,000	99.90	5,694,300	98.40	5,608,686	1,355,451,146	1.06
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	4.25000 2014-1-4	ユーロ	8,000,000	101.79	8,143,200	99.78	7,982,120	1,301,724,130	1.02
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	3.75000 2015-1-4	ユーロ	7,900,000	98.77	7,802,830	96.59	7,630,310	1,244,350,922	0.98
アメリカ	連邦抵当金庫 (FNMA)	特殊債 証券	-- 2007-10-24	アメリカ ドル	10,500,000	98.78	10,371,573	98.78	10,371,573	1,233,594,932	0.97
イギリス	イギリス国債	国債 証券	4.75000 2010-6-7	イギリス ポンド	5,100,000	98.42	5,019,420	98.05	5,000,351	1,208,434,850	0.95
アメリカ	アメリカ国債	国債 証券	4.25000 2007-11-30	アメリカ ドル	10,000,000	99.50	9,950,000	99.78	9,978,125	1,186,798,188	0.93
アメリカ	Pemex Project Funding Master Trust	社債券	5.75000 2015-12-15	アメリカ ドル	10,000,000	101.45	10,145,000	95.96	9,595,500	1,141,288,770	0.90
ルクセンブルク	OAO Gazprom	社債券	6.21200 2016-11-22	アメリカ ドル	10,000,000	100.80	10,080,000	95.48	9,548,000	1,135,639,120	0.89
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	5.00000 2011-7-4	ユーロ	6,400,000	104.15	6,665,600	102.51	6,560,512	1,069,888,297	0.84
ノルウェー	ノルウェー輸出金融公 社 (EXPT)	特殊債 証券	5.00000 2012-2-14	アメリカ ドル	7,700,000	100.60	7,746,223	99.52	7,663,194	911,460,294	0.72
アメリカ	アメリカ国債	国債 証券	3.87500 2010-5-15	アメリカ ドル	7,800,000	98.14	7,654,968	98.24	7,662,890	911,424,141	0.72
ドイツ	ドイツ国債	国債 証券	4.75000 2028-7-4	ユーロ	4,600,000	107.70	4,954,200	103.55	4,763,415	776,817,718	0.61
アメリカ	Citigroup Inc.	社債券	5.39500 2009-1-30	アメリカ ドル	6,200,000	100.00	6,199,932	100.03	6,202,164	737,685,362	0.58

< コマーシャル・ペーパー >

発行地	銘柄名	通貨	券面総額 (各通貨)	評価額 (各通貨)	邦貨換算額 (円)	投資比率 (%)
オーストラリア	HBOS Treasury Services,plc Sydney Branch	アメリカドル	32,500,000	32,414,931	3,855,431,909	3.03
スウェーデン	SWEDBANK	アメリカドル	10,000,000	9,986,824	1,187,832,932	0.93
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	8,000,000	7,954,673	946,128,833	0.74
スウェーデン	SWEDBANK	アメリカドル	7,700,000	7,684,338	913,975,224	0.72
アメリカ	ABN AMRO North America Fin Inc.	アメリカドル	6,300,000	6,222,055	740,051,222	0.58
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	5,400,000	5,333,976	634,423,105	0.50
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	4,900,000	4,897,130	582,464,705	0.46
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	4,200,000	4,135,322	491,855,238	0.39
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	4,000,000	3,967,333	471,874,625	0.37
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	3,900,000	3,879,447	461,421,426	0.36
アメリカ	Societe Generale N.America,Inc	アメリカドル	2,800,000	2,776,680	330,258,399	0.26
アメリカ	CBA (DELAWARE)FINANCE INC	アメリカドル	2,700,000	2,692,899	320,293,407	0.25
アメリカ	Societe Generale N.America,Inc	アメリカドル	2,400,000	2,379,310	282,995,188	0.22
アメリカ	UBS FINANCE(DELAWARE),LLC.	アメリカドル	2,000,000	1,979,019	235,384,620	0.18
アメリカ	Societe Generale N.America,Inc	アメリカドル	1,400,000	1,398,360	166,320,974	0.13
アメリカ	SVENSKA HANDELSBANKEN INC	アメリカドル	1,400,000	1,383,713	164,578,860	0.13
アメリカ	NORDEA NORTH AMERICA INC	アメリカドル	1,300,000	1,295,269	154,059,346	0.12
アメリカ	Societe Generale N.America,Inc	アメリカドル	500,000	493,813	58,734,215	0.05
アメリカ	DEXIA DELAWARE LLC	アメリカドル	9,000,000	77,290	9,192,873	0.01

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率 (%)
国債証券	50.82
地方債証券	0.17
特殊債証券	29.26
社債券	30.68
コマーシャル・ペーパー	9.43
合計	120.36

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

< 有価証券先物取引等 >

発行地	銘柄名	種類	数量または 券面総額	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額 (各通貨)	邦貨換算額 (円)	投資比率 (%)
ドイツ	DEUTSCHLAND 10YR (BUND) FUTURES 2007-09	買建	1,059	ユーロ	117,862,240	119,804,670	19,537,745,584	15.33
合計			--	--	--	--	19,537,745,584	15.33
アメリカ	US T-NOTE 10YR FUTURES 2007-09	売建	593	アメリカドル	62,542,611	63,580,719	7,562,290,688	5.93
ドイツ	DEUTSCHLAND 5YR (BOBL) FUTURES 2007-09	売建	249	ユーロ	26,431,350	26,725,170	4,358,340,724	3.42
合計			--	--	--	--	11,920,631,412	9.35

運 用

< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
ユーロ	買建	34,310,941,123	33,339,637,890	26.16
アメリカドル	買建	15,571,425,832	14,950,684,407	11.73
カナダドル	買建	3,344,401,185	3,215,463,620	2.52
オーストラリアドル	買建	3,172,121,313	3,022,094,758	2.37
スウェーデンクローナ	買建	2,745,273,933	2,738,995,770	2.15
ポーランドズロチ	買建	2,151,276,332	2,134,035,527	1.67
デンマーククローネ	買建	1,351,412,557	1,332,503,200	1.05
スイスフラン	買建	1,248,723,541	1,228,402,490	0.96
シンガポールドル	買建	1,205,946,226	1,180,283,072	0.93
ノルウェークローネ	買建	1,098,552,031	1,094,445,220	0.86
合計		66,200,074,073	64,236,545,954	50.41
アメリカドル	売建	50,628,648,241	49,384,685,583	38.75
イギリスポンド	売建	14,406,400,016	14,056,948,050	11.03
ニュージーランドドル	売建	579,878,371	542,773,800	0.43
ユーロ	売建	363,973,445	354,533,400	0.28
合計		65,978,900,073	64,338,940,833	50.49

財務ハイライト情報

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

GW7つの卵

< 貸借対照表 >

(単位:円)

科 目	期 別	第 3 期	第 4 期
		平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,029,761,421	-
コール・ローン		76,748,305,683	9,200,939,217
親投資信託受益証券		273,751,958,060	573,995,786,727
未収入金		-	63,000,000,000
流動資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944
資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944
負債の部			
流動負債			
未払金		1,700,000,000	-
未払収益分配金		69,492,049,025	54,273,397,421
未払解約金		371,616,961	2,319,961,600
未払受託者報酬		68,761,657	163,720,095
未払委託者報酬		2,406,660,132	5,730,205,563
その他未払費用		2,260,891	4,543,227
流動負債合計		74,041,348,666	62,491,827,906
負債合計		74,041,348,666	62,491,827,906
純資産の部			
元本等			
元本		257,741,764,372	546,981,478,249
剰余金			
期末剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789
剰余金合計		20,746,912,126	36,723,419,789
元本等合計		-	583,704,898,038
純資産合計		278,488,676,498	583,704,898,038
負債・純資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944

運 用

< 損益及び剰余金計算書 >

(単位:円)

科 目	期 別	第 3 期	第 4 期
		自 平成17年1月12日 至 平成18年1月10日	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日
	注記 番号	金 額	金 額
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益			
受取利息		62,382	9,362,975
有価証券売買等損益		56,449,426,161	56,327,828,667
その他収益		-	126,241
営業収益合計		56,449,488,543	56,337,317,883
営業費用			
受託者報酬		104,228,426	289,225,561
委託者報酬		3,647,999,136	10,122,898,912
その他費用		3,716,026	8,159,290
営業費用合計		3,755,943,588	10,420,283,763
営業利益又は営業利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
経常利益又は経常利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
当期純利益又は当期純利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
当期一部解約に伴う当期純利益分配額 又は当期純利益金額分配額		2,982,627,043	3,294,128,667
期首剰余金		6,689,355,708	20,746,912,126
剰余金増加額		37,171,333,272	35,404,143,287
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(-)
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(37,171,333,272)	(35,404,143,287)
剰余金減少額		3,332,645,741	7,777,143,656
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(3,332,645,741)	(7,777,143,656)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(-)
分配金		69,492,049,025	54,273,397,421
期末剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789

< 重要な会計方針に係る事項に関する注記 >

項 目	期 別	第 3 期	第 4 期
		自 平成17年1月12日 至 平成18年1月10日	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとなりますので、当計算期間は平成17年1月12日から平成18年1月10日までとなっております。	-

GW7つの卵

< 中間貸借対照表 >

(単位：円)

科 目	期 別	前中間計算期間末	当中間計算期間末
		平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		828,710,530	-
コール・ローン		10,117,489,428	10,739,414,892
親投資信託受益証券		558,683,710,853	635,245,508,966
未収入金		-	680,000,000
流動資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858
資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858
負債の部			
流動負債			
未払金		500,000,000	-
未払解約金		528,675,264	1,176,867,552
未払受託者報酬		125,505,466	163,772,315
未払委託者報酬		4,392,693,349	5,732,033,207
その他未払費用		3,616,063	4,534,467
流動負債合計		5,550,490,142	7,077,207,541
負債合計		5,550,490,142	7,077,207,541
純資産の部			
元本等			
元本		526,330,278,011	556,282,022,518
剰余金			
中間剰余金		37,749,142,658	83,305,693,799
(うち分配準備積立金)		(-)	(-)
剰余金合計		37,749,142,658	83,305,693,799
元本等合計		564,079,420,669	639,587,716,317
純資産合計		564,079,420,669	639,587,716,317
負債・純資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858

運 用

< 中間損益及び剰余金計算書 >

(単位：円)

科 目	期 別	前中間計算期間	当中間計算期間
		自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
	注記 番号	金 額	金 額
営業収益			
受取利息		163,745	19,281,760
有価証券売買等損益		2,343,247,207	52,805,086,649
その他収益		126,241	-
営業収益合計		2,342,957,221	52,824,368,409
営業費用			
受託者報酬		125,505,466	163,772,315
委託者報酬		4,392,693,349	5,732,033,207
その他費用		3,616,063	4,534,467
営業費用合計		4,521,814,878	5,900,339,989
営業利益金額		-	46,924,028,420
営業損失金額		6,864,772,099	-
経常利益金額		-	46,924,028,420
経常損失金額		6,864,772,099	-
中間純利益金額		-	46,924,028,420
中間純損失金額		6,864,772,099	-
中間一部解約に伴う中間純利益金額分配額		88,040,013	2,881,821,878
期首剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789
剰余金増加額		25,670,594,432	8,010,045,387
(中間一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(-)
(中間追加信託に伴う剰余金増加額)		(25,670,594,432)	(8,010,045,387)
剰余金減少額		1,715,551,788	5,469,977,919
(中間一部解約に伴う剰余金減少額)		(1,715,551,788)	(5,469,977,919)
(中間追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(-)
分配金		-	-
中間剰余金		37,749,142,658	83,305,693,799

< 重要な会計方針に係る事項に関する注記 >

項 目	期 別	前中間計算期間	当中間計算期間
		自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

約款

追加型証券投資信託

GW 7 つの卵

そ の 他

<追加型証券投資信託 GW7つの卵>

運用の基本方針

約款第20条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

運用方法

(1)投資対象

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託	日本大型株式グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	日本小型株式グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	日本債券グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	北米株式グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	欧州先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド
証券投資信託	海外債券グローバル・ラップ マザーファンド

(2)投資態度

主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に分散投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

各マザーファンドの受益証券への投資比率は、下記の資産配分を基本とし、中期的な市況見通しに応じて機動的に変更します。なお、市況動向等によっては内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。

証券投資信託	日本大型株式グローバル・ラップ マザーファンド	23%
証券投資信託	日本小型株式グローバル・ラップ マザーファンド	10%
証券投資信託	日本債券グローバル・ラップ マザーファンド	17%
証券投資信託	北米株式グローバル・ラップ マザーファンド	15%
証券投資信託	欧州先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド	13%
証券投資信託	アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド	4%
証券投資信託	海外債券グローバル・ラップ マザーファンド	18%

上記の基本資産配分は、長期的な市況見通しに応じて変更される場合があります。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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できない場合があります。

運用制限

- (1)株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。
- (2)投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- (3)外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- (4)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第30条の範囲で行ないます。

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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。

分配対象額についての分配方針

分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

追加型証券投資信託 GW7つの卵 約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は証券投資信託であり、日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、日興シティ信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金2,990万円を、受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者は、これを引き受けます。

委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第51条、第52条第1項、第53条第1項および第55条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第5条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第6条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項による受益権については2,990万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議の上、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除く)を法令および社団法人投資信託協会規則に従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(以下「純資産総額」といいます。)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当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

第30条に規定する予約為替の評価は、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。

(追加日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律(政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。)の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)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、以下「振替機関等」といいます。)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(以下、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。)

委託者は、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

そ の 他

ない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、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、委託者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。

委託者は、第6条の規定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なうものとします。振替機関等は、委託者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ないます。

委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第10条 受託者は、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ないます。

（受益権の申込単位および価額）

第11条 委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関が定める単位をもって取得の申込に応ずることができます。ただし、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができるものとします。

前項の取得申込者は、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行な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なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）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なうことができます。

第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料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。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

前項の手料金は、委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。

第3項の規定にかかわらず、証券投資信託の受益証券または受益権を信託終了時まで保有した受益者（信託期間を延長した証券投資信託（追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日（以下「当初の信託終了日」といいます。）以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行なわないものをいいます。以下本項において同じ。）にあっては、当初の信託終了日まで当該信託の受益証券または受益権を保有した受益者をいいます。以下本項において同じ。）が、その償還金（信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取請求にかかる売却代金または一部解約金を含みます。以下本項において同じ。）をもって、当該信託終了日（信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取約定日または一部解約請求日を含みます。）の属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に、当該償還金の支払いを受けた委託者の指定する証券会社または委託者の指定

する登録金融機関でこの信託にかかる受益権の取得申込をする場合の1口当りの受益権の価額は、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額とのいずれか大きい額）で取得する口数について取得申込日の翌営業日の基準価額に、取得申込を行う委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

なお、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関は、当該受益者に対し、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求めることができます。

第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第41条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

追加型証券投資信託の受益証券または受益権を保有する者が、当該信託の信託終了日の1年前の日以降に開始する委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関が別に定める期間内に、当該信託の受益証券または受益権の買取請求にかかる売却代金または一部解約金をもって、当該売却代金または一部解約金の支払いを受けた委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関でこの信託にかかる受益権の取得申込をする場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、取得申込を行う委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受け付けた取得申込の受付を取消することができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第12条 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。

前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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なわれるよう通知するものとします。

委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第13条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（無記名式の受益証券の再交付）

第14条 （削除）

（記名式の受益証券の再交付）

第15条 （削除）

（毀損した場合等の再交付）

第16条 （削除）

（受益証券の再交付の費用）

第17条 （削除）

（投資の対象とする資産の種類）

第18条 この信託において投資の対象とする資産の種類（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条各号で定める特定資産の種類をいいます。）は、次に掲げるものとします。

1. 有価証券
2. 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、第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

そ の 他

この信託においては、前項各号に掲げる資産のほか、次に掲げる資産を投資の対象とします。

1. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第19条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、日興シティ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の証券投資信託(その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに次の有価証券(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. 証券投資信託 日本大型株式グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 日本小型株式グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
3. 証券投資信託 日本債券グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
4. 証券投資信託 北米株式グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
5. 証券投資信託 欧州先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
6. 証券投資信託 アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
7. 証券投資信託 海外債券グローバル・ラップ マザーファンド 受益証券
8. 株券または新株引受権証券
9. 国債証券
10. 地方債証券
11. 特別の法律により法人の発行する債券
12. 社債券(新株引受権証券と社債券と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。)
13. 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。)
14. コマーシャル・ペーパー
15. 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
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第8号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 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、マザーファンドの受益証券を除きます。)
18. 投資証券もしくは投資法人債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。)
19. 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。)
20. 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ません。)
21. 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。)
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 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ません。)
24. 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
25. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第8号の証券または証書ならびに第16号および第21号の証券または証書のうち第8号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、第9号から第13号までの証券ならびに第16号および第21号の証券または証書のうち第9号から第13号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、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の指図ができます。

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前号の権利の性質を有するもの

委託者は、信託財産に属する投資信託証券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。

前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(運用の基本方針)

第20条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行いません。

(投資する株式等の範囲)

第21条 委託者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、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下本条において同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。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。

前項の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

(信用取引の指図範囲)

第22条 委託者は、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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り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なうことの指図をすることができるものとします。

前項の信用取引の指図は、当該売り付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(先物取引等の運用指図)

第23条 委託者は、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。）、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。）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。）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な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るものとします（以下同じ。）。)

委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨にかか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かかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

委託者は、わが国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかか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な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)

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。）を行なうことの指図をすることができます。

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、原則として第3条に定める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。

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もとに算定した価額で評価するものとします。

委託者は、スワップ取引を行な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なうものとします。

そ の 他

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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、第3条に定める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。

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。

委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行な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なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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の50%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の50%を超えないものとします。

前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、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なうものとします。

(公社債の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

前項の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(公社債の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

第1項の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29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および範囲)

第30条 委託者は、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取引の指図をすることができます。

前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

そ の 他

第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(保管業務の委任)

第31条 受託者は、委託者と協議の上、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第33条 金融機関または金融商品取引業者(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

(一括登録)

第34条 (削除)

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第35条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産(金銭を除きます。)については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第36条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第37条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第38条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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、および再投資に係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なわないものとします。

前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当のために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
3. 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、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ます。

そ の 他

再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、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ます。

借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第40条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第41条 この信託の計算期間は、毎年1月11日から翌年1月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成15年2月28日から開始するものとします。

前項にかかわらず、前項の原則により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。ただし、最終計算期間の終了日は、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第42条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務等の諸費用)

第43条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息、信託財産の財務諸表の監査に要する費用ならびに当該費用に係る消費税等相当額(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の額)

第44条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第41条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の180の率を乗じて得た額とします。

前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)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、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

委託者は、主要投資対象とする各マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けたものが受ける報酬を第1項に基づいて委託者が受ける報酬から支弁するものとし、その報酬額は、信託財産に属する各マザーファンドの受益証券の時価総額に、各マザーファンドごとに以下に定める率を乗じて得た金額とします。

日本大型株式グローバル・ラップ マザーファンド	年10,000分の55
日本小型株式グローバル・ラップ マザーファンド		
マザーファンドの純資産総額が300億円以下の部分	年10,000分の75
300億円超400億円以下の部分	年10,000分の65
400億円超の部分	年10,000分の55
日本債券グローバル・ラップ マザーファンド	年10,000分の20
北米株式グローバル・ラップ マザーファンド	年10,000分の50
アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップ マザーファンド		
マザーファンドの純資産総額が150億円以下の部分	年10,000分の60
150億円超200億円以下の部分	年10,000分の50
200億円超の部分	年10,000分の40
海外債券グローバル・ラップ マザーファンド	年10,000分の40

(収益分配)

第45条 信託財産から生ず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. 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（以下「配当等収益」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。ただし、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てんした後、受益者に分配することができます。ただし、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。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第46条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第47条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第47条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第47条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行な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計算期間の末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委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関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、）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第49条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関に支払われます。この場合、委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じたものとし、当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第50条第3項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行な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代金支払前のため委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

一部解約金は、第50条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。

前各項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとし、

収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(受益証券の保護預り等)

第48条 (削除)

そ の 他

(収益分配金および償還金の時効)

第49条 受益者が、収益分配金については第47条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第47条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第50条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。

前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

委託者は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。

前項により一部解約の実行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当日およびその前営業日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日を一部解約の実行の請求日として、第4項の規定に準じて算定した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第50条の2 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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託契約の解約)

第51条 委託者は、信託期間中において、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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

委託者は、第3計算期間の終了日の翌営業日以降において、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合は、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約を行いません。

委託者は、この信託契約の解約を行わないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前3項の規定は、第2項の規定に基づいてこの契約を解約する場合には適用しないものとします。

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、第4項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合も同様の取り扱いとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第52条 委託者は、監督官庁よりこの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。

委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定にしたがうものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第53条 委託者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、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第54条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第56条の規定にしたがい新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第56条 委託者は、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、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託約款の変更を行いません。

委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行わないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第51条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

(公告)

第58条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第59条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

そ の 他

附 則

- 第1条 この約款において、「自動けいぞく投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および委託者の指定する登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第2条 第47条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
- 第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条および第12条から第17条までの規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。
- 第4条 第25条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 第25条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成15年2月28日

東京都港区赤坂九丁目7番1号
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都品川区東品川二丁目3番14号
受託者 日興シティ信託銀行株式会社

用語集

投資信託の基本的な用語を簡潔にまとめたもので、特定のファンドの解説を目的としたものではありません。

あ

委託会社	運用会社のことをいいます。
------	---------------

運用報告書	期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを、受益者に説明する報告書のことをいいます。委託会社が作成し、販売会社からお届けします。
-------	---

か

解約価額	ファンドの解約時の価額で、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額のことをいいます。
------	---

解約請求	ファンドの換金方法の一つです。受益者が販売会社を通じて運用会社に信託財産の一部の解約を請求する方法です。解約価額で行なわれます。
------	--

格付	格付の対象となる債券に対して、約束通りに途中の利息および満期(償還)時の元金が支払われる確実性(信用度)を、利害関係のない第三者(格付機関)が判断(評価)し、投資家に提供する情報のことです。
----	---

基準価額	純資産総額を、受益権総口数で割った金額をいいます。一口当たり、いくらかの価値があるかをあらわしています。
------	--

繰上償還	信託期間が設定されている、あるいは無期限の投資信託でも、受益権の口数が信託約款に定められた一定の口数を下回るなど運用を続けることが困難である場合、ファンドの運用を終了することが受益者のため有利であると委託会社が認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときに、信託期間を繰り上げて運用を終了させることをいいます。
------	---

個別元本	投資信託の課税上の元本に相当する金額。各受益者毎の購入時の取得価額が個別元本となります。同一銘柄を複数回購入した場合は、加重平均された価額となります。
------	---

個別元本方式	税金の計算を各受益者毎の取得元本(個別元本)をもとに行なう方式のことをいいます。
--------	--

さ

自動けいぞく投資	販売会社と受益者との契約により、税引き後の収益分配金を無手数料で自動的に再投資することをいいます。なお、販売会社により取扱いできない場合や一部異なる場合があります。
----------	--

収益分配	ファンドの決算期に、運用の結果あげられた収益などを保有口数に応じて受益者に分配することをいいます。
------	---

受益者	ファンドを購入した「投資家」のことをいいます。
-----	-------------------------

信託財産の総額	信託財産の資産を時価で評価した金額をいいます。
---------	-------------------------

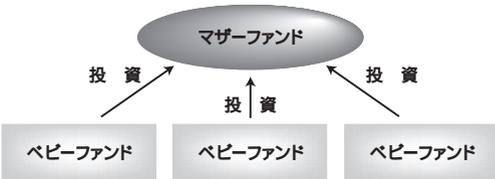
純資産総額	信託財産の資産を時価で評価した金額(信託財産の総額)から負債総額を控除したものをいいます。
-------	---

償還	ファンドの運用終了とともに、受益者に金銭を返還することをいいます。
----	-----------------------------------

信託期間	ファンドの運用が終了するまでの期間のことをいいます。
------	----------------------------

信託財産	多くの投資家(受益者)から集められたお金で、ファンドが運用している資産のことをいいます。
------	--

そ の 他

信託財産留保額	投資信託を中途解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。
信託報酬	ファンドの運用や管理の対価として、委託会社、受託会社、販売会社が信託財産の中から受け取る報酬のことをいいます。原則として日々ファンドから差し引かれます。
デュレーション	金利がある一定の割合で変動した場合、債券価格がどの程度変化するかを示す指標です。即ちこの値が大きいほど金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。
投資信託	多くの投資家から集めた資金を運用会社が運用する金融商品のことをいいます。投資信託は、値動きのある有価証券(外貨建証券には為替変動リスクもあります。)などに投資するので元金が保証されているものではありません。
投資信託説明書	目論見書の別称です。
ファミリー ファンド方式	<p>株式や債券などの運用を親ファンド(マザーファンド)で行ない、子ファンド(ベビーファンド)である投資信託が、その親ファンドの受益証券に投資を行なう仕組みをいいます。マザーファンドの損益は、ベビーファンドに帰属します。</p>  <pre> graph TD MF([マザーファンド]) B1[ベビーファンド] B2[ベビーファンド] B3[ベビーファンド] B1 -- 投資 --> MF B2 -- 投資 --> MF B3 -- 投資 --> MF </pre>
ファンドマネージャー	ファンドの運用担当者(金融資産を運用する専門家)のことをいいます。
分散投資	投資家から集めた資金を複数の投資対象(有価証券の種類、地域など)に分散して投資することにより、リスクを軽減させることをいいます。
ポートフォリオ	株式や債券など、複数の資産や銘柄の組み合わせ、あるいはそうした資産構成をいいます。
目論見書	ファンドの内容、信託約款の内容、運用方法など、ご購入を検討する際に必要な情報が記載されています。取得のお申込みを行なう場合には、目論見書をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取りのうえ、内容をご確認願います。目論見書には、投資家に必ず交付しなければならない交付目論見書と投資家の請求により交付しなければならない請求目論見書があります。
約 款	正式には「信託約款」といいます。法律で定められている記載事項に従い、ファンドの具体的な運営や管理などの詳細について基本的な仕組みを規定したものです。委託会社と受託会社はこの信託約款に基づいて信託契約を締結しています。
リスクとリターン	投資によって得られる収益率をリターンといい、その収益率の不確実性をリスクといいます。一般的にリスクが高いとリターンは高く、リスクが低いとリターンは低くなります。

さ

た

は

ま

や

ら

そ
の
他

日興アセットマネジメントの照会先

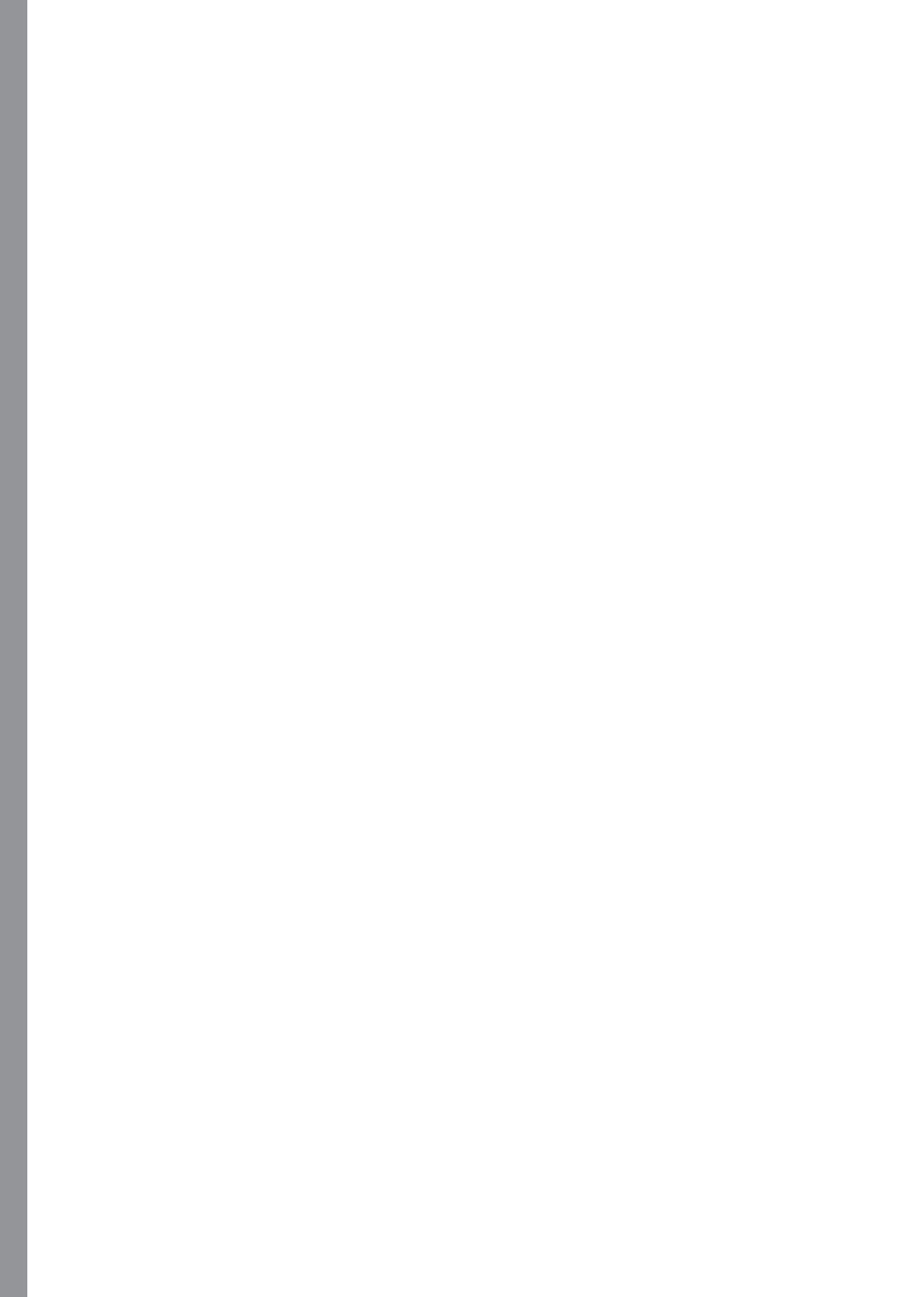
ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

☎ 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)



携帯サイトQRコード



GW7つの卵

追加型株式投資信託／国際株式型（一般型）／自動けいぞく投資適用

設定・運用は

日興アセットマネジメント

本書は金融商品取引法第13条の規定に基づき、投資家の請求により交付される目論見書です。

「GW7つの卵」(マザーファンドを含みます。)は、主に株式および債券など値動きのある証券(外貨建証券は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。特に投資する中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。したがって、元金を割り込むことがあります。

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

この目論見書により行なう「GW7つの卵」の募集については、委託会社は、証券取引法(現金融商品取引法)(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を平成19年4月10日に関東財務局長に提出しており、平成19年4月11日にその効力が発生しております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年5月17日、6月27日および10月10日に関東財務局長に提出しております。

- 目次 -

	頁
第1 【ファンドの沿革】	1
第2 【手続等】	1
1 【申込(販売)手続等】	
2 【換金(解約)手続等】	
第3 【管理及び運営】	3
1 【資産管理等の概要】	
(1)【資産の評価】	
(2)【保管】	
(3)【信託期間】	
(4)【計算期間】	
(5)【その他】	
2 【受益者の権利等】	
第4 【ファンドの経理状況】	6
1 【財務諸表】	
(1)【貸借対照表】	
(2)【損益及び剰余金計算書】	
(3)【注記表】	
(4)【附属明細表】	
2 【ファンドの現況】	
【純資産額計算書】	
第5 【設定及び解約の実績】	62

第1【ファンドの沿革】

平成 15 年 2 月 28 日	ファンドの信託契約締結、運用開始
平成 16 年 12 月 28 日	「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用指図権限の委託先である投資顧問会社をドイチェ・アセット・マネジメント株式会社から J.P. モルガン・インベストメント・マネジメント・インクに変更
平成 17 年 12 月 9 日	「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」、「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」、「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」における投資顧問会社の変更など、ならびに「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」における運用指図権限の範囲の変更

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

(1) 取得の申込み

- ・取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得のお申込みを行なうものとします。
- ・原則として、午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- ・金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得のお申込みの受付を取り消すことがあります。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

(2) 申込単位

申込単位につきましては、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。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社 ホームページ アドレス http://www.nikkoam.com/ コールセンター 電話番号 0120-25-1404 午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。 (半休日となる場合は午前9時～正午)
--

(3) コースの選択

- ・収益分配金の受取方法によって、< 分配金再投資コース > と < 分配金受取りコース > の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
- ・< 分配金再投資コース > をお選びの場合、お申込みの際に、販売会社との間で「自動けいぞく（累積）投資契約」を結んでいただきます。なお、販売会社によっては、別の名称で当該契約と同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあります。また、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

(4) 申込金額

- ・取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、お申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- ・お申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(5) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(6) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の請求

- ・原則として、いつでも換金が可能です。
- ・原則として、午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(2) 換金制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

< 解約請求による換金 >

(1) 換金単位

< 分配金再投資コース > 1口単位

< 分配金受取りコース > 1口単位

販売会社によっては、換金単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(2) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

(3) 手取額

1口当たりのお手取額は、解約価額から所得税および地方税（当該解約価額が受益者毎の個別元本を超過した額に対し10%（内国法人は所得税のみの7%））を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(4) 支払開始日

お手取額は、原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(5) 受付中止

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約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当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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請求を受け付けたものとして取り扱います。販売会社によっては、買取請求による換金が可能となる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）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。ファンドは便宜上、1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場（ジャスダック証券取引所については、同所が発表する基準値段）で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c) 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）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相場の仲値によって計算します。

基準価額の算出頻度と照会先

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額につきましては、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。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(半休日となる場合は午前9時～正午)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします(平成15年2月28日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とします。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後記「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 第3計算期間の終了日の翌営業日以降、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
 - ロ) 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、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ニ) 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(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委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ホ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更

- 1) 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、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。公告は日本経済新聞に掲載します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べ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い取るべき旨を請求できます。

償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
- ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

運用報告書の作成

委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

関係法人との契約について

- ・ 販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・ 投資顧問会社とのマザーファンドの資産における投資一任契約または投資顧問契約は、マザーファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第4【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、第3期計算期間（平成17年1月12日から平成18年1月10日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しており、第4期計算期間（平成18年1月11日から平成19年1月10日まで）については、改正後の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

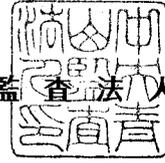
- (2) 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第3期計算期間（平成17年1月12日から平成18年1月10日まで）の財務諸表については、中央青山監査法人による監査を受けており、第4期計算期間（平成18年1月11日から平成19年1月10日まで）の財務諸表については、あらた監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成18年2月21日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

中央青山監査法人



指定社員 公認会計士
業務執行社員

藤間義雄 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

鳥飼裕一 

当監査法人は、証券取引法第193条の2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GW7つの卵の平成17年1月12日から平成18年1月10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及び附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、GW7つの卵の平成18年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

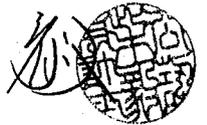
独立監査人の監査報告書

平成19年2月20日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

代表社員 公認会計士
業務執行社員



業務執行社員 公認会計士



当監査法人は、証券取引法第193条の2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GW7つの卵の平成18年1月11日から平成19年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、GW7つの卵の平成19年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1 【財務諸表】

GW7つの卵

(1) 【貸借対照表】

科目	期別 注記 番号	(単位:円)	
		第3期 平成18年1月10日現在	第4期 平成19年1月10日現在
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,029,761,421	-
コール・ローン		76,748,305,683	9,200,939,217
親投資信託受益証券		273,751,958,060	573,995,786,727
未収入金		-	63,000,000,000
流動資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944
資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944
負債の部			
流動負債			
未払金		1,700,000,000	-
未払収益分配金		69,492,049,025	54,273,397,421
未払解約金		371,616,961	2,319,961,600
未払委託者報酬		68,761,657	163,720,095
未払委託者報酬		2,406,660,132	5,730,205,563
その他未払費用		2,260,891	4,543,227
流動負債合計		74,041,348,666	62,491,827,906
負債合計		74,041,348,666	62,491,827,906
純資産の部			
元本等			
元本		257,741,764,372	546,981,478,249
剰余金			
期末剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789
剰余金合計		20,746,912,126	36,723,419,789
元本等合計		-	583,704,898,038
純資産合計		278,488,676,498	583,704,898,038
負債・純資産合計		352,530,025,164	646,196,725,944

(2) 【損益及び剰余金計算書】

科目	期別 注記 番号	(単位:円)	
		第3期 自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	第4期 自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
経常損益の部			
営業損益の部			
営業収益		62,382	9,362,975
受取利息		56,449,426,161	56,327,828,667
有価証券売買等損益		-	126,241
その他収益		56,449,488,543	56,337,317,883
営業収益合計		104,228,426	289,225,561
営業費用			
委託者報酬		3,647,999,136	10,122,898,912
その他費用		3,716,026	8,159,290
営業費用合計		3,755,943,588	10,420,283,763
営業利益又は営業利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
経常利益又は経常利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
当期純利益又は当期純利益金額		52,693,544,955	45,917,034,120
当期一部解約に伴う当期純利益分配額 又は当期純利益金額分配額		2,982,627,043	3,294,128,667
期首剰余金		6,689,355,708	20,746,912,126
剰余金増加額		37,171,333,272	35,404,143,287
(当期一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(-)
(当期追加信託に伴う剰余金増加額)		(37,171,333,272)	(35,404,143,287)
剰余金減少額		3,332,645,741	7,777,143,656
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(3,332,645,741)	(7,777,143,656)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(-)
分配金		69,492,049,025	54,273,397,421
期末剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789

(3)【注記表】

前期については「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期 自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	第4期 自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当フアンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとなりますので、当計算期間は平成17年1月12日から平成18年1月10日までとなっております。	-

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 平成18年1月10日現在	第4期 平成19年1月10日現在
期首元本額	85,676,098,626 円	257,741,764,372 円
期中追加設定元本額	203,506,702,073 円	380,068,619,701 円
期中解約元本額	31,441,036,327 円	90,828,905,824 円
		2.
		546,981,478,249 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第3期 自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	第4期 自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	912,848,455 円	2,286,567,357 円
2. 分配金の計算過程		
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	3,648,493,765 円	9,513,765,757 円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売却等損益	46,062,424,147 円	33,109,139,696 円
C 信託約款に定める収益調整金	40,528,043,239 円	48,373,911,757 円
D 信託約款に定める分配準備積立金	0 円	0 円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	90,238,961,151 円	90,996,817,210 円
F 分配対象収益 (一口当たり)	0.3501 円	0.1663 円
G 分配金額 (一口当たり)	3,501 円	54,273,397,421 円
H 分配金額 (一口当たり)	0.2700 円	0.1000 円
	2,700 円	1,000 円
	98,227,355 円	424,750,403 円

(有価証券に関する注記)

第3期 (自平成17年1月12日 至平成18年1月10日)
売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	273,751,958,060	47,226,870,443
合 計	273,751,958,060	47,226,870,443

第4期 (自平成18年1月11日 至平成19年1月10日)
売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	573,995,786,727	47,873,553,467
合 計	573,995,786,727	47,873,553,467

(1口当たり情報)

	第3期 平成18年1月10日現在	第4期 平成19年1月10日現在
1口当たり純資産額	1.0805 円	1口当たり純資産額 1.0671 円
(1口当たり純資産額)	(10,805 円)	(1口当たり純資産額) (10,671 円)

(4) 【附属細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(親投資信託受益証券)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド	85,157,105,124	147,449,527,522	
	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	26,752,718,828	61,432,268,244	
	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	59,058,174,475	61,662,639,969	
	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	66,832,825,642	86,541,825,923	
	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	37,157,090,082	83,911,856,532	
	アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	9,451,303,674	30,942,623,098	
	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	60,491,402,667	102,055,045,439	
合計		344,900,620,492	573,995,786,727	

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

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成18年1月10日現在		平成19年1月10日現在	
		注記番号	金額	金額	金額
資産の部					
流動資産					
コール・ローン			1,101,354,862		21,791,911,639
株式			99,019,586,000		189,825,749,800
未収入金			605,707,070		1,266,403,543
未収配当金			14,178,420		47,852,280
差入委託証拠金			-		625,930,000
流動資産合計			100,740,826,352		213,557,847,262
資産合計			100,740,826,352		213,557,847,262
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			-		29,519,500
前受金			-		290,415,000
未払金			628,241,125		1,209,084,185
未払解約金			10,010,000		16,502,000,000
流動負債合計			638,251,125		18,031,018,685
負債合計			638,251,125		18,031,018,685
純資産の部					
元本等					
元本			63,463,471,328		112,921,306,554
剰余金					
剰余金			36,639,103,899		82,605,522,023
剰余金合計			36,639,103,899		82,605,522,023
元本等合計			-		195,526,828,577
純資産合計			100,102,575,227		195,526,828,577
負債・純資産合計			100,740,826,352		213,557,847,262

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は、場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的理由をもつて時価と認められた価額で評価しております。	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日 株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は、場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的理由をもつて時価と認められた価額で評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法		デリバティブ取引	デリバティブ取引
3. 収益及び費用の計上基準		個別法に基づき原則として時価で評価しております。 受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在	平成18年1月11日	
1. 期首	期首元本額 35,137,210,377円 期首からの追加設定元本額 39,231,882,185円 期首からの解約元本額 10,905,621,234円 平成18年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 45,614,527,742円 グローバル・ラップ・バランス 388,111円 安定型 759,073,190円 グローバル・ラップ・バランス 706,937,003円 安定成長型 1,278,849,555円 成長型 7,742,519,358円 グローバル・ラップ・バランス 3,345,993,870円 グローバル・ラップ・バランス 3,122,842,105円 超積極型 1,374,287,245円 日本大型株式ファンド 8,775,209円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 31,165,774円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 39,991,965円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 85,802,158円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 59,255,046円 (合計) 63,463,471,328円	期首元本額 63,463,471,328円 期首からの追加設定元本額 65,216,978,373円 期首からの解約元本額 15,759,143,147円 平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 85,157,105,124円 グローバル・ラップ・バランス 415,914円 安定型 706,937,003円 グローバル・ラップ・バランス 1,435,239,565円 成長型 9,760,114,015円 グローバル・ラップ・バランス 3,999,121,669円 グローバル・ラップ・バランス 4,001,277,016円 超積極型 6,222,635,326円 GW7つの卵 (適格機関投資家向け) 日本大型株式ファンド 897,716,195円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 31,221,884円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 86,191,560円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 107,451,159円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 275,498,034円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 240,382,090円 (合計) 112,921,306,554円	期首元本額 63,463,471,328円 期首からの追加設定元本額 65,216,978,373円 期首からの解約元本額 15,759,143,147円 平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 85,157,105,124円 グローバル・ラップ・バランス 415,914円 安定型 706,937,003円 グローバル・ラップ・バランス 1,435,239,565円 成長型 9,760,114,015円 グローバル・ラップ・バランス 3,999,121,669円 グローバル・ラップ・バランス 4,001,277,016円 超積極型 6,222,635,326円 GW7つの卵 (適格機関投資家向け) 日本大型株式ファンド 897,716,195円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 31,221,884円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 86,191,560円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 107,451,159円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 275,498,034円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 240,382,090円 (合計) 112,921,306,554円	1. 期首 期首元本額 63,463,471,328円 期首からの追加設定元本額 65,216,978,373円 期首からの解約元本額 15,759,143,147円 平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 85,157,105,124円 グローバル・ラップ・バランス 415,914円 安定型 706,937,003円 グローバル・ラップ・バランス 1,435,239,565円 成長型 9,760,114,015円 グローバル・ラップ・バランス 3,999,121,669円 グローバル・ラップ・バランス 4,001,277,016円 超積極型 6,222,635,326円 GW7つの卵 (適格機関投資家向け) 日本大型株式ファンド 897,716,195円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 31,221,884円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 86,191,560円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 107,451,159円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 275,498,034円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 240,382,090円 (合計) 112,921,306,554円
2.	(合計) 63,463,471,328円	(合計) 112,921,306,554円	(合計) 112,921,306,554円	

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)

売買目的有価証券

(単位:円)	
種 類	貸借対照表計上額
株式	99,019,586,000
合 計	99,019,586,000

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)

売買目的有価証券

(単位:円)	
種 類	貸借対照表計上額
株式	189,825,749,800
合 計	189,825,749,800

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

取引の内容	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利先渡し取引、スワップ取引、金利代替予約取引であります。		同左
取引の利用目的および取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。

II 取引の時価等に関する事項
(株式関連)

平成18年1月10日現在

該当事項はありません。

(単位:円)

区 分	種 類	平成19年1月10日現在		時 価	評価損益
		契 約 額 等	うち1年超		
市 場 取 引	株価指数先物取引 買建	4,359,410,000	-	4,330,300,000	△29,110,000
	合 計	4,359,410,000	-	4,330,300,000	△29,110,000

(注) 時価の算定方法

1. 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が評価されています。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(1) 口当たり情報

平成18年1月10日現在		平成19年1月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,577.3円 (15,773円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,731.5円 (17,315円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
1334 マルハグループ本社	3,185,000	240	764,400,000	
1721 コムシスホールディングス	437,000	1,337	584,269,000	
1801 大成建設	4,627,000	376	1,739,752,000	
1860 戸田建設	1,347,000	545	734,115,000	
2267 ヤクルト本社	810,600	3,370	2,731,722,000	
2503 キリンビール	833,000	1,832	1,525,056,000	
2579 コカ・コーラウエストホールディングス	171,800	2,755	473,309,000	
4118 カネカ	1,553,000	1,106	1,717,618,000	
4183 三井化学	460,000	921	423,660,000	
4205 日本ゼオン	1,591,000	1,243	1,977,613,000	
4208 宇部興産	7,905,000	345	2,727,225,000	
4452 花王	241,000	3,200	771,200,000	
4519 中外製薬	1,618,400	2,430	3,932,712,000	
4568 第一三共	1,060,400	3,570	3,785,628,000	
5016 新日鉄ホールディングス	1,387,000	808	1,120,696,000	
5019 出光興産	266,000	10,880	2,894,080,000	
5108 プリズメーション	1,675,600	2,510	4,205,756,000	
5202 日本板硝子	1,802,000	532	958,664,000	
5233 太平洋セメント	1,115,000	468	521,820,000	
5334 日本特殊陶業	1,195,000	2,310	2,760,450,000	
5407 日新製鋼	4,533,000	428	1,940,124,000	
5411 JFEホールディングス	460,200	5,780	2,659,956,000	
5423 東京製鐵	378,800	1,727	654,187,600	
5711 三菱マテリアル	3,081,000	428	1,318,668,000	
6326 クボタ	5,013,000	1,084	5,434,092,000	
6367 ダイキン工業	554,800	3,940	2,185,912,000	
6481 THK	703,100	2,900	2,038,980,000	
6502 東芝	2,686,000	805	2,162,230,000	
6665 エルピーダメモリ	903,800	5,930	5,359,534,000	
6701 N.E.C.	943,000	580	546,940,000	
6752 松下電器産業	1,814,000	2,290	4,154,060,000	
6762 TDK	296,700	9,400	2,788,980,000	
6841 横河電機	444,000	1,830	812,520,000	
6902 テンソー	538,500	4,550	2,450,175,000	
6981 村田製作所	262,400	7,880	2,067,712,000	
7201 日産自動車	2,441,600	1,429	3,489,046,400	
7203 トヨタ自動車	1,914,000	7,690	14,718,660,000	
7453 良品計画	45,900	8,630	396,117,000	
7911 凸版印刷	1,116,000	1,303	1,454,148,000	
7974 任天堂	34,100	29,150	994,015,000	

(単位:株、円)

8001 伊藤忠商事	1,558,000	939	1,462,962,000
8016 オノワード梱山	624,000	1,525	951,600,000
8031 三井物産	1,691,000	1,672	2,827,352,000
8035 東京エレクトロン	570,200	8,850	5,046,270,000
8053 住友商事	388,300	1,621	629,434,300
8113 エニ・チャーム	186,300	6,900	1,285,470,000
8252 丸井	1,131,700	1,442	1,631,911,400
8253 クレディセゾン	379,300	4,560	1,729,608,000
8273 イズミ	377,400	4,500	1,698,300,000
8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,346	1,490,000	7,965,540,000
8316 三井住友フィナンシャルグループ	6,803	1,210,000	8,231,630,000
8327 日本シティ銀行	684	1,140,000	779,760,000
8328 札幌北洋ホールディングス	5,875,000	500	2,937,500,000
8341 十七銀行	1,590,000	759	1,206,810,000
8359 八十二銀行	1,850,000	794	1,468,900,000
8591 オリックス	51,790	34,000	1,760,860,000
8601 大和証券グループ本社	3,573,000	1,332	4,759,236,000
8752 三井住友海上火災保険	3,222,000	1,330	4,285,260,000
8801 三井不動産	911,000	2,855	2,600,905,000
8815 東急不動産	2,615,000	1,119	2,926,185,000
9021 西日本旅客鉄道	3,255	508,000	1,653,540,000
9022 東海旅客鉄道	2,447	1,220,000	2,985,340,000
9104 商船三井	2,013,000	1,137	2,288,781,000
9107 川崎汽船	2,287,000	929	2,124,623,000
9432 日本電信電話	11,875	612,000	7,267,500,000
9437 NTTドコモ	33,951	190,000	6,450,690,000
9501 東京電力	2,378,300	3,850	9,156,455,000
9737 C S Kホールディングス	312,000	5,090	1,588,080,000
9741 日立情報システムズ	599,400	2,615	1,567,431,000
9792 ニチイ字箱	130,400	1,727	225,200,800
9831 ヤマダ電機	36,140	10,120	365,736,800
9832 オートバックスセブン	77,700	4,380	340,326,000
9843 ニトリ	99,050	5,310	525,955,500
9987 スズケン	627,500	4,420	2,773,550,000
9989 サンドラッグ	129,000	2,715	350,235,000
合計	96,792,541		189,825,749,800

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2. 「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日 注記 番号	(単位:円)	
		平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン			
株式		2,205,719,195	6,881,293,126
未収入金		47,703,125,300	81,661,866,510
未収配当金		24,789,944	433,158,841
流動資産合計		49,973,740,104	89,057,978,627
資産合計		49,973,740,104	89,057,978,627
負債の部			
流動負債			
未払金		260,851,552	116,671,244
未払解約金		10,040,000	6,601,000,000
流動負債合計		270,891,552	6,717,671,244
負債合計		270,891,552	6,717,671,244
純資産の部			
元本		18,219,019,241	35,857,273,851
剰余金			
剰余金		31,483,829,311	46,483,033,532
剰余金合計		31,483,829,311	46,483,033,532
元本等合計		-	82,340,307,383
純資産合計		49,702,848,552	82,340,307,383
負債・純資産合計		49,973,740,104	89,057,978,627

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日 株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 時価が入手できなかった有価証券	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準	受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合は予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1. 期首	平成17年1月12日	平成18年1月11日
期首元本額	11,334,653,202 円	18,219,019,241 円
期首からの追加設定元本額	10,063,678,051 円	21,403,589,543 円
期首からの解約元本額	3,179,312,012 円	3,765,334,933 円
平成18年1月10日現在の元本の内訳	※	※
GW 7 つの卵	12,732,061,054 円	26,752,718,828 円
グローバル・ラップ・バランス	203,702 円	287,263 円
安定型		
グローバル・ラップ・バランス	328,702,425 円	346,869,252 円
安定成長型		
グローバル・ラップ・バランス	491,180,237 円	598,710,898 円
成長型		
グローバル・ラップ・バランス	2,155,670,697 円	3,089,299,519 円
積極成長型		
グローバル・ラップ・バランス	859,309,505 円	1,163,274,069 円
積極型		
グローバル・ラップ・バランス	820,713,016 円	1,162,363,287 円
超積極型		
日本小型株式ファンド	759,267,364 円	1,999,324,296 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	4,782,806 円	476,769,456 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	13,881,783 円	21,320,257 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	14,732,411 円	42,210,153 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	23,622,632 円	45,303,222 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型)	14,891,609 円	88,517,649 円
(合計)	18,219,019,241 円	35,857,273,851 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数		35,857,273,851 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	47,703,125,300	11,717,298,073	
合 計	47,703,125,300	11,717,298,073	

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	81,661,866,510	△7,433,769,209	
合 計	81,661,866,510	△7,433,769,209	

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

(1 口当たり情報)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1 口当たり純資産額	2,7281 円	1 口当たり純資産額
(1 万口当たり純資産額)	(27,281 円)	(1 万口当たり純資産額)
		2,2963 円
		(22,963 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株 数	評 価 額		備 考
		単価	金額	
1301 極洋	2,476,000	250	619,000,000	
1868 三井ホーム	1,700,000	808	1,373,600,000	
2059 エニ・チャーム ベットケア	257,700	4,210	1,084,917,000	
2135 V S N	181,200	3,500	634,200,000	
2292 S FOODS	816,000	1,077	878,832,000	
2305 スタジオアリス	507,800	1,396	708,888,800	
2329 東北新社	1,351,500	1,050	1,419,075,000	
2344 平安レイサービス	582,600	655	381,603,000	
2371 カカココム	1,840	386,000	710,240,000	
2412 ペネフィット・リン	6,000	128,000	768,000,000	
2453 ジャパンペストレスキューシステム	1,078	380,000	409,640,000	
2476 テンブラスタッフ	6,541	166,000	1,085,806,000	
2674 ハードオフコーポレーション	512,500	726	372,075,000	
2703 日本ライオン	280,700	741	207,998,700	
2726 パル	183,250	4,370	800,802,500	
2761 トシム・グループ	240,800	4,090	984,872,000	
2766 日本風力開発	1,257	238,000	299,166,000	
2775 日本レステランシステム	300,000	3,930	1,179,000,000	

(単位:株、円)

2778	パレセ	323,700	1,452	470,012,400
2780	コマ兵	407,000	868	353,276,000
2781	あきんピシシロー	86,200	3,110	268,082,000
3003	昭栄	269,200	3,250	874,900,000
3028	アルベン	244,200	3,260	796,092,000
3341	日本調剤	95,420	4,000	381,680,000
3344	ワンダーコーポレーション	1,625	370,000	601,250,000
3434	アルファC○	92,100	2,175	200,317,500
3593	ホギメディカ	200,000	4,850	970,000,000
3738	テラベーク	5,566	248,000	1,380,368,000
3819	インテックホールディングス	500,000	1,592	796,000,000
4206	アイカ工業	1,000,000	1,605	1,605,000,000
4221	大倉工業	996,000	492	490,032,000
4301	アミューズ	231,800	1,698	393,596,400
4329	ワークスブリケージョング	11,905	80,800	961,924,000
4613	関西ペイント	1,294,000	926	1,198,244,000
4681	リゾートトラスト	422,300	3,120	1,317,576,000
4696	ワタベウェディング	437,400	1,868	817,063,200
4745	東京個別指導学院	1,407,600	299	420,872,400
4799	アグレックス	476,700	1,462	696,935,400
5384	フジインコンポーネツツド	300,000	3,330	999,000,000
5445	東京鐵鋼	1,460,000	970	1,416,200,000
5930	文化シヤッター	1,782,000	681	1,213,542,000
5999	イハラサイエンス	260,000	1,570	408,200,000
6143	ソフティック	1,186,100	1,018	1,207,449,800
6210	東洋機械金属	1,100,000	952	1,047,200,000
6222	島精機製作所	80,900	2,630	212,767,000
6287	サト一	670,000	2,085	1,396,950,000
6315	TOWA	565,900	715	404,618,500
6323	ローツエ	206,900	1,300	268,970,000
6387	サムコ	76,500	1,270	97,155,000
6413	理想科学工業	772,700	2,460	1,900,842,000
6455	モリタ	812,000	667	541,604,000
6482	ユ一シン精機	566,500	2,140	1,212,310,000
6621	高岳製作所	4,188,000	224	938,112,000
6622	ダイヘン	1,300,000	583	757,900,000
6651	日東工業	187,700	1,909	358,319,300
6669	シーシーエス	597	509,000	303,873,000
6670	MCJ	16,994	61,200	1,040,082,800
6676	マルコホールディングス	568,600	3,320	1,887,752,000
6718	アイホン	800,000	2,080	1,664,000,000
6729	オンキヨー	399,000	277	110,523,000
6730	アケセル	1,000	357,000	357,000,000
6788	日本トリム	189,000	5,300	1,001,700,000
6809	TOA	1,000,000	876	876,000,000
6914	オブテックス	325,000	2,430	789,750,000
6916	アイ・オー・データ機器	279,200	784	218,892,800
6939	ユ一・エム・シー・ジャパン	25,779	29,290	755,066,910
6996	ニチコン	875,800	1,550	1,357,490,000
7414	小野健	38,300	1,310	50,173,000
7427	エコーテレーディング	296,900	1,306	387,751,400
7458	第一興商	600,000	1,450	870,000,000
7483	ドウシヤ	630,700	2,215	1,397,000,500
7498	ジャパン	676,100	1,089	736,272,900
7514	ヒマラヤ	265,100	1,380	365,838,000
7517	黒田電気	624,800	1,126	703,524,800
7524	マルシエ	350,000	1,053	368,550,000
7601	ポプラ	289,200	1,016	293,827,200
7631	マクニカ	378,600	3,640	1,378,104,000

7740	タムロン	660,200	2,330	1,538,266,000
7864	フジシールインターナショナル	249,000	2,965	738,285,000
7905	大建工業	2,381,000	446	1,061,926,000
7931	未来工業	140,400	1,415	198,666,000
7943	ニチハ	800,000	1,569	1,255,200,000
7956	ビジョン	608,100	2,110	1,283,091,000
7971	東一	1,688,000	311	524,968,000
7994	眞村製作所	634,000	1,216	770,944,000
8011	三陽商会	426,000	861	366,786,000
8078	阪和興業	3,246,000	481	1,561,326,000
8127	ヤマトインターナショナル	334,700	996	333,361,200
8186	大塚家具	293,900	3,760	1,105,064,000
8397	神鋼銀行	320,000	4,600	1,472,000,000
8551	北日本銀行	250,800	5,430	1,361,844,000
9470	学習研究社	400,000	266	106,400,000
9603	エイチ・アイ・エス	378,200	2,990	1,130,818,000
9616	共立メンテナンス	39,600	2,750	108,900,000
9699	西尾レントオール	450,800	2,100	946,680,000
9719	住商情報システム	409,600	2,635	1,079,296,000
9741	日立情報システムズ	391,200	2,615	1,022,988,000
9743	丹青社	1,248,000	552	688,896,000
9824	泉州電業	106,900	2,530	270,457,000
9830	トラスコ中山	634,500	2,450	1,554,525,000
9948	アークス	671,700	1,453	975,980,100
	合計	58,817,952		81,661,866,510

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等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。

3. 「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日 注記 番号	(単位:円)	
		平成18年4月10日現在 金額	平成19年4月10日現在 金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,047,319,372	1,978,666,384
国債証券		19,884,227,743	46,816,042,028
地方債証券		3,479,742,225	5,789,576,210
特殊債券		10,611,389,068	9,915,004,018
社債券		8,317,567,056	19,818,767,558
未収入金		420,110,000	22,275,582,000
未収利息		54,725,159	224,810,539
前払費用		31,035,302	6,154,321
流動資産合計		43,846,115,925	106,824,603,058
資産合計		43,846,115,925	106,824,603,058
負債の部			
流動負債			
未払金		403,300,000	16,130,240,000
未払解約金		4,000,000	7,100,000,000
流動負債合計		407,300,000	23,230,240,000
負債合計		407,300,000	23,230,240,000
純資産の部			
元本等			
元本		41,523,629,377	80,061,123,747
剰余金			
剰余金		1,915,186,548	3,533,239,311
剰余金合計		1,915,186,548	3,533,239,311
元本等合計		-	83,594,363,058
純資産合計		43,438,815,925	83,594,363,058
負債・純資産合計		43,846,115,925	106,824,603,058

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
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は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1. 期首	平成17年1月12日	平成18年1月11日
期首元本額	18,880,159,484 円	41,523,629,377 円
期首からの追加設定元本額	29,010,013,245 円	45,941,299,565 円
期首からの解約元本額	6,366,543,352 円	7,403,805,195 円
平成18年1月10日現在の元本の内訳	※	※
GW 7つの卵	28,454,564,919 円	59,058,174,475 円
グローバル・ラップ・バランス		
安定型	3,192,141 円	3,915,084 円
グローバル・ラップ・バランス	3,436,182,227 円	3,778,448,667 円
安定成長型		
グローバル・ラップ・バランス	3,571,967,024 円	4,235,584,760 円
成長型		
グローバル・ラップ・バランス	5,042,105,750 円	6,863,223,594 円
積極成長型		
日本債券ファンド	630,481,704 円	4,460,735,597 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	71,802,351 円	395,795,082 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	149,929,421 円	287,356,595 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	108,811,537 円	461,886,690 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	54,592,303 円	320,299,169 円
(合計)	41,523,629,377 円	80,061,123,747 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数		80,061,123,747 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 17 年 1 月 12 日 至 平成 18 年 1 月 10 日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	19,884,227,743	87,735,400
地方債証券	3,479,742,225	△31,232,898
特殊債券	10,611,389,068	△66,853,650
社債券	8,317,567,056	△1,745,000
合計	42,292,926,092	△12,096,148

対象期間 (自 平成 18 年 1 月 11 日 至 平成 19 年 1 月 10 日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	46,816,042,028	△10,638,200
地方債証券	5,789,576,210	6,483,594
特殊債券	9,915,004,018	△71,729,650
社債券	19,818,767,558	70,933,000
合計	82,339,389,814	△4,951,256

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの

期末日までの期間に対応する金額であります。

(1 口当たり情報)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1 口当たり純資産額	1.0461 円	1 口当たり純資産額
(1 万口当たり純資産額)	(10,461 円)	(1 万口当たり純資産額)
		1.0441 円
		(10,441 円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(邦貨建債券)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	0045 0024	利付国庫債券 (5 年) 第 2 4 回	13,700,000,000	13,660,884,271
	0045 0036	利付国庫債券 (5 年) 第 3 6 回	22,000,000,000	21,924,760,000
	0064 0063	日本国債清算事業団債券継国庫債券 第 6 3 号	200,000,000	201,938,757
	0067 0272	利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 7 2 回	900,000,000	881,244,000
	0067 0279	利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 7 9 回	7,800,000,000	8,004,750,000
	0069 0063	利付国庫債券 (2 0 年) 第 6 3 回	1,300,000,000	1,256,190,000
	0069 0079	利付国庫債券 (2 0 年) 第 7 9 回	900,000,000	886,275,000
			46,800,000,000	46,816,042,028
			310,000,000	309,879,100
			104,000,000	104,816,400
国債証券	0103 0107	神奈川県公債 1 0 7 回	100,000,000	100,041,000
	0103 0114	神奈川県公債 1 1 4 回	250,000,000	246,987,500
	0103 0129	神奈川県公債 1 2 9 回	400,000,000	403,743,546
	0104 0235	大阪府公債 2 3 5 回	500,000,000	489,910,000
	0104 0261	大阪府公債 2 6 1 回	500,000,000	490,335,000
	0106 1403	兵庫県公債 平成 1 4 年度 3 回	500,000,000	580,654,400
	0106 1604	兵庫県公債 平成 1 6 年度 4 回	800,000,000	787,200,000
	0106 1712	兵庫県公債 平成 1 7 年度 1 2 回	103,100,000	103,716,538
	0111 1001	福岡県公債 平成 1 0 年度 1 回	119,000,000	121,632,280
	0111 1201	福岡県公債 平成 1 2 年度 1 回		

0111 1501	福岡県公債 平成15年度1回	100,500,000	100,646,730
0153 1102	神戸市公債 平成11年度2回	101,600,000	102,480,872
0155 9001	札幌市 第1回20年公債	100,000,000	97,444,000
0200 0681	東京都公債 第681回	100,000,000	101,063,164
0200 0761	東京都公債 第761回	200,000,000	199,238,000
0211 1405	埼玉県 平成14年度公債ホ号	144,000,000	136,352,160
0211 1407	埼玉県 平成14年度公債ト号	162,000,000	151,009,920
0211 1502	埼玉県 平成15年度公債ロ号	350,000,000	342,307,000
0214 1501	神奈川県公債平成第15回ロ号	200,000,000	194,818,000
0240 1505	福岡県平成15年度第5回公債	500,000,000	494,780,000
0254 1408	横浜市平成14年度第8回事業公債	140,000,000	130,520,600
		5,874,200,000	5,789,576,210
地方債証券 計			
特殊債券			
0905 7004	第4回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	584,928,000
0905 7007	第7回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,105,000
0905 9020	道路債券(財投機関債) 第20回	100,000,000	99,747,000
0905 9021	道路債券(財投機関債) 第21回	600,000,000	606,150,000
0906 0767	政府保証公営企業債券 政府保証第767回	705,000,000	713,720,850
0906 9022	第22回 公営企業債券	800,000,000	801,736,000
0909 9001	水資源開発債券(財投機関債) 第1回	100,000,000	100,188,000
0912 9004	日本鉄道建設債券(財投機関債) 第4回	700,000,000	653,905,000
0914 1016	特別地域振興整備債券 特別第16回	325,000,000	330,889,000
0914 1019	特別地域振興整備債券 特別第19回	185,000,000	185,022,200
0917 9009	都市基盤整備債券(財投機関債) 第9回	100,000,000	99,471,000
0917 9010	都市基盤整備債券(財投機関債) 第10回	200,000,000	199,282,000
0920 3130	は号特別道路債券 は号特別第130回	100,000,000	102,105,000
0920 3138	は号特別道路債券 は号特別第138回	610,000,000	610,872,300
0936 1020	特別関西国際空港債券 特別第20回	400,000,000	407,164,000
0936 1021	特別関西国際空港債券 特別第21回	600,000,000	600,096,000
0936 9003	関西国際空港社債(財投機関債) 第3回	800,000,000	812,104,000
0944 5197	は号特別鉄道建設債券 は号特別第197回	100,000,000	99,768,000
0952 1631	利附工債券(5年) 利附\第631号	200,000,000	199,415,310
0952 1632	利附工債券(5年) 利附\第632号	200,000,000	199,196,000
0952 1634	利附工債券(5年) 利附\第634号	100,000,000	99,440,000
0959 1640	みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附\第640号	130,000,000	129,924,540
0959 1643	みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附\第643号	100,000,000	99,813,000
0959 1656	みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附\第656号	200,000,000	198,816,000
0959 1659	みずほコーポレート銀行債券(5年) 利附\第659号	100,000,000	99,874,000
0972 3059	利附工債券(3年) 利附第59号	100,000,000	99,564,374
0975 2129	利附あおぞら債券(2年) 利附第29回	100,000,000	99,599,444
1293 0105	福岡北九州高速道路債券 第105回	200,000,000	194,002,000

1293 0107	福岡北九州高速道路債権 第107回	500,000,000	488,790,000
1293 0109	福岡北九州高速道路債券 第109回	500,000,000	500,080,000
1295 0002	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) 第2回	100,000,000	100,643,000
1295 0003	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) 第3回	100,000,000	99,181,000
1299 0003	緑資源機構緑資源債券(財投機関債) 第3回	200,000,000	198,412,000
	特殊債券 計	9,955,000,000	9,915,004,018
社債券			
1210 1002	ペナル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション 第2回円貨社債(1999)	400,000,000	407,788,000
1218 1009	エイチエスビジネス・ファイナンス・コーポレーション 第9回円貨社債(2005)	800,000,000	785,288,000
1222 1003	ザ・ワールドマン・サックス・グループ・インク 第3回円貨社債(2004)	500,000,000	497,810,000
1222 1008	ザ・ワールドマン・サックス・グループ・インク 第8回円貨社債(2006)	500,000,000	497,215,000
2768 0601	双日(社債間限定同順位特約付) 6回	400,000,000	398,512,000
2768 0701	双日(社債間限定同順位特約付) 7回	200,000,000	201,368,000
2768 0901	双日株式会社 第9回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,074,000
6758 1901	ソニー 19回	400,000,000	396,148,000
7201 2801	日産自動車(特定社債間限定同順位特約付) 28回	100,000,000	101,270,728
7201 4501	日産自動車(社債間限定同順位特約付) 45回	500,000,000	492,225,000
8308 0601	株式会社リそなホールディングス 第6回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	400,000,000	400,448,000
8310 0204	みずほコーポレート銀行(劣後特約付) 2回	800,000,000	812,504,000
8315 0305	三菱東京UFJ銀行(劣後特約付) 3回2号(旧UFJ銀行3回)	500,000,000	484,300,000
8315 1106	三菱東京UFJ銀行(劣後特約付) 11回	500,000,000	505,480,000
8331 0202	株式会社千葉銀行 第2回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	400,000,000	398,236,000
8339 0102	東京都民銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 1回	400,000,000	396,452,000
8345 0202	株式会社岩手銀行 第2回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	199,602,000
8379 0304	広島銀行(劣後特約付) 3回	200,000,000	210,060,000
8379 1102	株式会社広島銀行 第11回期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	700,000,000	697,837,000
8403 0105	住友信託銀行(劣後特約付) 1回	400,000,000	389,248,000
8403 0604	住友信託銀行(劣後特約付) 6回	400,000,000	407,384,000
8410 0201	株式会社セブーン銀行 第2回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	300,000,000	299,388,000
8412 0604	三井住友銀行(劣後特約付) 6回	500,000,000	495,785,000
8412 0804	三井住友銀行(劣後特約付) 8回	1,000,000,000	997,310,000
8413 0104	みずほ銀行(劣後特約付) 1回	100,000,000	97,760,000
8413 0704	みずほ銀行(劣後特約付) 7回	500,000,000	514,585,000
8427 0151	第一生命第2回基金流動化特定目的会社 特定社債1回A号	100,000,000	100,100,000

8427 0153	第一生命第2回基金流動化特定目的会社 特定社債1回C号	500,000,000	507,220,000
8434 0501	日産フィナンシャルサービス(社債間限定同順位特約付) 5回	700,000,000	692,804,000
8449 0152	ニッセイ基金特定目的会社 特定社債1回B号	100,000,000	100,177,670
8545 0402	関西アーバン銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 4回	500,000,000	496,850,000
8564 0201	武富士(社債間限定同順位特約付) 2回	1,300,000,000	1,304,021,246
8565 1101	三洋電機クレジット(社債間限定同順位特約付) 11回	100,000,000	98,178,000
8572 2701	アコム(特定社債間限定同順位特約付) 27回	100,000,000	100,539,000
8572 4301	アコム(特定社債間限定同順位特約付) 43回	300,000,000	290,217,000
8574 3401	プロミス(特定社債間限定同順位特約付) 34回	1,000,000,000	973,500,000
8574 3501	プロミス(特定社債間限定同順位特約付) 35回	600,000,000	584,400,000
8583 0101	UFJニコス(社債間限定同順位特約付) 1回	400,000,000	397,936,000
8591 0079	オリックス(社債間限定同順位特約付) 79回	200,000,000	199,654,914
8591 0083	オリックス(社債間限定同順位特約付) 83回	700,000,000	695,261,000
8775 0152	フコク生命基金流動化特定目的会社 第1回B号特定社債(一般担保付)	400,000,000	397,680,000
8776 0001	第一生命第3回基金流動化特定目的会社 特定社債 第1回	700,000,000	706,377,000
8792 0151	住友生命劣後償還流動化特定目的会社 特定社債1回A号	400,000,000	404,060,000
8958 0101	クローバル・フロンティア不動産投資法人債(特定投資法人債間限定同順位特約付) 1回	600,000,000	585,714,000
社債券計		19,900,000,000	19,818,767,558
合計		82,529,200,000	82,339,389,814

第2 有価証券先物取引等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。

4. 「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成18年1月10日現在		平成19年1月10日現在	
		注記 番号	金額	金額	金額
資産の部					
流動資産					
預金			334,433,111		205,012,910
コール・ローン			63,001,373		9,844,297,643
株式			54,507,568,646		112,569,328,553
社債券			-		306,194,729
投資証券			191,498,900		231,207,030
派生商品評価勘定			-		121,710
未収入金			1,005,747,420		525,545,324
未収配当金			53,336,684		113,129,720
未収利息			-		763,719
前払費用			-		47,627
流動資産合計			56,155,586,134		123,795,648,965
資産合計			56,155,586,134		123,795,648,965
負債の部					
流動負債					
未払金			3,234,348		104,063,202
未払解約金			-		9,601,000,000
流動負債合計			3,234,348		9,705,063,202
負債合計			3,234,348		9,705,063,202
純資産の部					
元本等					
元本			48,477,604,275		88,105,696,555
剰余金					
剰余金			7,674,747,511		25,984,889,208
剰余金合計			7,674,747,511		25,984,889,208
元本等合計			-		114,090,585,763
純資産合計			56,152,351,786		114,090,585,763
負債・純資産合計			56,155,586,134		123,795,648,965

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場の使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日 株式、社債券及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場の使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引	為替予約取引
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準	受取配当金の計上基準	受取配当金の計上基準
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

(貸借対照表に関する注記)

期首	平成17年1月12日現在	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在	平成18年1月11日
1. 期首	期首元本額 23,786,867,341 円	期首元本額 23,786,867,341 円	期首元本額 48,477,604,275 円	期首元本額 48,477,604,275 円
	期首からの追加設定元本額 33,256,792,261 円	期首からの追加設定元本額 33,256,792,261 円	期首からの追加設定元本額 50,453,246,319 円	期首からの追加設定元本額 50,453,246,319 円
	期首からの解約元本額 8,566,055,327 円	期首からの解約元本額 8,566,055,327 円	期首からの解約元本額 10,825,154,039 円	期首からの解約元本額 10,825,154,039 円
	平成18年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 34,671,123,899 円	平成18年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 34,671,123,899 円	平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 66,832,825,642 円	平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 66,832,825,642 円
	グローバル・ラップ・バランス 363,610 円	グローバル・ラップ・バランス 363,610 円	グローバル・ラップ・バランス 402,088 円	グローバル・ラップ・バランス 402,088 円
	安定型 639,380,332 円	安定型 639,380,332 円	安定型 614,344,943 円	安定型 614,344,943 円
	グローバル・ラップ・バランス 1,056,169,682 円	グローバル・ラップ・バランス 1,056,169,682 円	グローバル・ラップ・バランス 1,172,603,643 円	グローバル・ラップ・バランス 1,172,603,643 円
	成長型 6,157,043,077 円	成長型 6,157,043,077 円	成長型 7,564,436,753 円	成長型 7,564,436,753 円
	グローバル・ラップ・バランス 2,643,970,509 円	グローバル・ラップ・バランス 2,643,970,509 円	グローバル・ラップ・バランス 3,151,004,759 円	グローバル・ラップ・バランス 3,151,004,759 円
	積極成長型 2,479,586,126 円	積極成長型 2,479,586,126 円	積極成長型 2,824,076,150 円	積極成長型 2,824,076,150 円
	超積極型 648,067,010 円	超積極型 648,067,010 円	超積極型 4,921,469,939 円	超積極型 4,921,469,939 円
	北米株式ファンド	北米株式ファンド	北米株式ファンド	北米株式ファンド
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 8,214,676 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 8,214,676 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 426,998,076 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 426,998,076 円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 26,990,089 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 26,990,089 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 29,604,403 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 29,604,403 円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 32,816,964 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 32,816,964 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 75,817,592 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 75,817,592 円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 67,123,495 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 67,123,495 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 88,674,555 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 88,674,555 円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 46,754,806 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 46,754,806 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 214,703,087 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 214,703,087 円
	(合計) 48,477,604,275 円	(合計) 48,477,604,275 円	(合計) 88,105,696,555 円	(合計) 88,105,696,555 円
2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数			

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	54,507,568,646	2,761,063,417
投資証券	191,498,900	13,819,416
合 計	54,699,067,546	2,774,882,833

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	112,569,328,553	5,639,639,994
社債券	306,194,729	25,953,235
投資証券	231,207,030	21,682,297
合 計	113,106,730,312	5,687,275,526

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

取引の内容	自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日
取引の目的および取引に対する取組方針	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利スワップ取引、金先物取引、為替先物取引、および為替予約取引であります。	同左
取引に係るリスクの内容	取引の目的および取引に対する取組方針は、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門等が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門等が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。

II 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

平成18年1月10日現在
 該当事項はありません。

区分	種 類	平成19年1月10日現在		評価損益
		契 約 額 等	時 価	
市場取引以外の取引	為替予約取引	132,000,000	132,121,710	121,710
	アメリカドル	132,000,000	132,121,710	121,710
合 計		132,000,000	132,121,710	121,710

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう に評価しています。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
 - ② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,1583 円	1口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(11,583 円)	(1万口当たり純資産額)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式(アメリカドル)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
00105510 AFLAC INC	64,500	46.00000	2,967,000.00	
00130010 AES CORPORATION	152,400	20.16000	3,072,384.00	
00819010 AFFILIATED COMPUTER SERVICES INC-A	86,100	48.55000	4,180,155.00	
00915810 AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,900	69.11000	1,167,959.00	
01381710 ALCOA INC	159,900	28.52000	4,560,348.00	
01849010 ALLERGAN INC	102,000	116.09000	11,841,180.00	
02144110 ALTEGRA CORPORATION	429,200	19.86000	8,523,912.00	
02364710 TIME WARNER INC	130,500	22.25000	2,903,625.00	
02687410 AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	119,300	71.29000	8,504,897.00	
02971710 AMERICAN STANDARD COMPANIES INC	127,700	45.81000	5,849,937.00	
02991220 AMERICAN TOWER CORP	58,500	39.15000	2,290,275.00	
03060910 AMERICREDIT CORP	71,200	25.53000	1,817,736.00	
03116210 AMGEN INC	26,500	71.27000	1,888,655.00	
03251110 ANADARKO PETROLEUM CORP	41,600	41.36000	1,720,576.00	
03522910 ANHEUSER-BUSCH COMPANIES INC	41,300	48.76000	2,013,788.00	
03674B10 WELLPPOINT INC	93,900	76.21000	7,156,119.00	
03822210 APPLIED MATERIALS INC	652,900	19.25000	12,568,325.00	
03938010 ARCH COAL INC	112,700	27.90000	3,144,330.00	
05301510 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	27,400	48.60000	1,331,640.00	
05430310 AVON PRODUCTS INC	176,100	33.85000	5,960,985.00	
05548210 BJ SERVICES CO	157,100	26.05000	4,092,455.00	
05722410 BAKER HUGHES INC	120,200	68.32000	8,212,064.00	
06790110 BARRICK GOLD CORPORATION	292,600	29.39000	8,599,514.00	
07181310 BAXTER INTERNATIONAL INC	198,700	46.33000	9,205,771.00	
07785310 VERIZON COMMUNICATIONS INC	75,700	36.96000	2,797,872.00	
08467010 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL A	40	109,350.00000	4,374,000.00	
08651610 BEST BUY CO INC	83,800	49.04000	4,109,552.00	
12485720 CBS CORP	107,850	30.89000	3,331,486.50	
12589610 CMS ENERGY CORP	130,800	16.30000	2,132,040.00	
12686C10 CABLEVISION SYSTEM CORPORATION	50,600	29.31000	1,483,086.00	
13321L10 CAMECO CORPORATION	159,000	37.18000	5,911,620.00	
13442910 CAMPBELL SOUP CO	73,800	38.34000	2,829,492.00	
14040H10 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,800	76.63000	3,433,024.00	
14365810 CARNIVAL CORP	36,100	50.43000	1,820,523.00	
15678210 CERNER CORP	41,500	45.34000	1,881,610.00	
16161A10 JPMORGAN CHASE & CO	297,600	47.75000	14,210,400.00	
16307210 CHEESECAKE FACTORY	56,400	26.99000	1,522,236.00	
16675110 CHEVRON CORPORATION	56,600	70.63000	3,997,658.00	
17123210 CHUBB CORP	31,000	52.13000	1,616,030.00	
17275R10 CISCO SYSTEMS INC	804,300	28.47000	22,898,421.00	
18450210 CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS	121,500	35.44000	4,305,960.00	
19121610 COCA-COLA COMPANY	97,600	48.61000	4,744,336.00	
20030010 COMCAST CORP-CL A	67,500	42.74000	2,884,950.00	
20051910 COMMERCE BANCORP INC	48,500	34.77000	1,686,345.00	
20449H10 COMPASS BAKESHARES INC	26,000	59.50000	1,547,000.00	
20563810 COMPWARE CORP	152,000	8.68000	1,319,360.00	
21666910 COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	35,600	90.51000	3,222,156.00	
21935010 CORNING INC	189,500	18.46000	3,498,170.00	
23585110 DANAHER CORP	99,400	72.63000	7,219,422.00	

(単位:株、アメリカドル)

23918K10 DAVITA INC	75,200	53.09000	3,992,368.00	
23975310 TARGET CORP	310,100	58.26000	18,066,426.00	
24702510 DELL INC	261,900	26.84000	7,029,396.00	
25468710 THE WALT DISNEY CO.	292,000	34.45000	10,059,400.00	
25674710 DOLLAR TREE STORES INC	75,600	31.96000	2,416,176.00	
26054310 DOW CHEMICAL COMPANY	130,500	39.39000	5,140,395.00	
27864210 EBAY INC	283,100	29.75000	8,422,225.00	
29101110 EMERSON ELECTRIC CO	70,000	43.92000	3,074,400.00	
29264F20 ENDO PHARMACEUTICALS HOLDINGS INC	69,300	29.48000	2,042,964.00	
29356210 EOG RESOURCES INC	31,000	61.45000	1,904,950.00	
30231G10 EXXON MOBIL CORPORATION	80,200	72.09000	5,781,618.00	
30372610 FAIRCHILD SEMICONDUCTOR INTERNATIONAL INC	227,100	17.58000	3,992,418.00	
31304N10 FEDEX CORP	16,000	108.17000	1,730,720.00	
31340030 FREDDIE MAC	73,500	65.45000	4,810,575.00	
31358610 FANNIE MAE	111,000	58.50000	6,493,500.00	
31677310 FIFTH THIRD BANCORP	124,100	40.00000	4,964,000.00	
33735810 WACHOVIA CORP	333,166	56.51000	18,827,210.66	
34386110 FLUOR CORP	142,900	75.92000	10,848,968.00	
34537010 FORD MOTOR CO	98,800	7.79000	730,702.00	
34583810 FOREST LABORATORIES INC	460,400	51.20000	23,572,480.00	
34963110 FORTUNE BRANDS INC	24,200	84.82000	2,052,644.00	
35671D85 FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	5,750	51.90000	298,425.00	
36960410 GENERAL ELECTRIC COMPANY	670,700	37.55000	25,184,785.00	
37044210 GENERAL MOTORS CORP	86,700	30.77000	2,667,759.00	
37427610 GETTY IMAGES INC	120,000	43.76000	5,251,200.00	
38259F50 GOOGLE INC-CL A	42,800	485.50000	20,779,400.00	
40621610 HALLIBURTON CO	102,600	28.71000	2,945,646.00	
41034510 HANESBRANDS INC	222,350	24.69000	5,489,821.50	
42823610 HOME DEPOT INC	34,700	42.20000	1,464,340.00	
44368310 HUDSON CITY BANCORP INC	418,800	39.32000	4,911,068.00	
44701110 HUNTSMAN CORP	264,500	20.16000	5,332,320.00	
45230810 ILLINOIS TOOL WORKS	169,300	46.52000	7,875,836.00	
45245W10 IMCONE SYSTEMS INC	161,800	29.22000	4,727,796.00	
45660710 INDRAMAC BANCORP INC	116,100	43.77000	5,081,697.00	
45814010 INTEL CORP	502,500	21.03000	10,567,575.00	
46014610 INTERNATIONAL PAPER CO	89,100	33.75000	3,007,125.00	
46025410 INTERNATIONAL RECTIFIER CORPORATION	128,700	38.94000	5,011,578.00	
46631310 JABIL CIRCUIT INC	195,900	24.64000	4,826,976.00	
47110910 JARDEN CORP	20,900	35.06000	732,754.00	
47836610 JOHNSON CONTROLS INC	23,500	85.17000	2,001,495.00	
48248010 KLA-TENCOR CORPORATION	212,500	51.10000	10,858,750.00	
49455P10 KINDER MORGAN INC	31,500	105.81000	3,333,015.00	
50075N10 KRAFT FOODS INC-A	143,700	35.13000	5,048,181.00	
51783410 LAS VEGAS SANDS CORP	67,600	92.38000	6,244,888.00	
52490810 LEGGETT & PLATT INC	97,300	23.44000	2,280,712.00	
52490810 LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC	24,400	78.24000	1,909,056.00	
52605710 LENNAR CORP-CL A	21,800	48.78000	1,063,404.00	
53279110 LINCAR HOLDINGS INC	47,700	40.15000	1,915,155.00	
53567810 LINEAR TECHNOLOGY CORP	106,100	31.18000	3,308,198.00	
54866110 LOWE'S COS INC	567,000	31.87000	18,070,290.00	
55269010 MDU RESOURCES GROUP INC	46,650	24.90000	1,161,585.00	
57174810 MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	257,000	31.13000	8,000,410.00	
58013510 MCDONALD'S CORPORATION	44,400	43.79000	1,944,276.00	
58155Q10 MCKESSON CORPORATION	28,400	51.13000	1,452,092.00	
58405U10 MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	32,100	54.22000	1,740,462.00	
58505510 MEDTRONIC INC	87,900	53.85000	4,733,415.00	
59018810 MERRILL LYNCH & CO INC	17,600	93.53000	1,646,128.00	

外国株式(カナダドル)		銘柄		株数		評価額		備考	
						金額			
						単価			
AL	ALCAN INC	129,500		52,60000	6,811,700.00				
BNS	BANK OF NOVA SCOTIA	12,200		51.53000	628,666.00				
CM	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	53,300		98.71000	5,261,243.00				
CNQ	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	9,600		54.65000	524,640.00				
ECA	ENCANA CORP	16,400		53.25000	873,300.00				
FTT	FINNINF INTERNATIONAL INC	79,000		46.96000	3,709,840.00				
GWO	GREAT WEST LIFECO INC	24,800		33.65000	834,520.00				
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	143,000		39.08000	5,588,440.00				
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	34,200		157.34000	5,381,028.00				
RCL/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	174,600		35.08000	6,124,968.00				
RY	ROYAL BANK OF CANADA	45,100		53.93000	2,432,243.00				
SC	SHOPPERS DRUG MART CORP	39,200		50.57000	1,982,344.00				
SJRB	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,200		38.31000	697,242.00				
SU	SUNCOR ENERGY INC	11,400		84.25000	960,450.00				
T/A	TELUS CORPORATION -NON VOTE	31,100		54.50000	1,694,950.00				
TD	TORONTO-DOMINION BANK	77,800		68.93000	5,362,754.00				
TEK/B	TECK COMINCO LIMIED-CL B	12,200		77.35000	943,670.00				
TLM	TALISMAN ENERGY INC	39,000		18.14000	707,460.00				
カナダドル 計				950,600	50,519,458.00				
(邦貨換算額)					(5,126,209,403)				

銘柄		株数		評価額		備考	
				金額			
				単価			
総合計					(112,569,328,553)		
					112,569,328,553		

(注) 総合計の()内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

(2) 株式以外の有価証券

(外貨建債券)

アメリカドル		銘柄		株数		評価額		備考	
						金額			
						単価			
種類	銘柄	株数		単価	金額				
社債券	536L02 Ford Motor Company 4.25% 20361215	2,332,000.00		2.563,800.80	2,563,800.80				
社債券	計	2,332,000.00		2.563,800.80	2,563,800.80				
アメリカドル	計	2,332,000.00		2.563,800.80	2,563,800.80				
(邦貨換算額)				(278,510,760)	(306,194,729)				

銘柄		株数		評価額		備考	
				金額			
				単価			
総合計					(278,510,760)		
					278,510,760		

(注) 総合計の()内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

59151K10	METHANEX CORP	55,100	1,478,884.00	26.84000	1,478,884.00		
59491810	MICROSOFT CORP	1,006,800	30,163,728.00	29.96000	30,163,728.00		
59990210	MILLENNIUM PHARMACEUTICALS INC	242,800	2,668,372.00	10.99000	2,668,372.00		
62007610	MOTOROLA INC	11,900	217,294.00	18.26000	217,294.00		
63936L10	NAVTEQ CORP	47,600	1,646,008.00	34.58000	1,646,008.00		
65163910	NEWMONT MINING CORP	40,000	1,718,800.00	42.97000	1,718,800.00		
65473P10	NISOURCE INC	95,400	2,251,440.00	23.60000	2,251,440.00		
66977W10	NOVA CHEMICALS CORP	62,300	1,755,614.00	28.18000	1,755,614.00		
68191910	OMNICO GROUP INC	27,500	2,835,800.00	103.12000	2,835,800.00		
70432610	PAYCHEX INC	77,600	3,118,744.00	40.19000	3,118,744.00		
71344810	PEPSICO INC	164,200	10,402,070.00	63.35000	10,402,070.00		
71815410	ALTRIA GROUP INC	82,900	2,169,493.00	26.17000	2,169,493.00		
74752510	QUALCOMM INC	176,400	15,544,368.00	88.12000	15,544,368.00		
74912110	QUEST COMMUNICATIONS INTERNATIONAL INC	48,700	1,842,808.00	37.84000	1,842,808.00		
77537110	ROHM AND HAAS CO	172,000	1,443,080.00	8.39000	1,443,080.00		
78025920	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR A	18,600	947,856.00	50.96000	947,856.00		
78387G10	AT&T INC	202,400	13,465,672.00	66.53000	13,465,672.00		
80004C10	SANDISK CORPORATION	129,400	4,391,836.00	33.94000	4,391,836.00		
80305420	SAP AG-SPONSORED ADR	248,000	10,939,280.00	44.11000	10,939,280.00		
80311110	SARA LEE CORP	101,200	5,526,532.00	54.61000	5,526,532.00		
80685710	SCHLUMBERGER LTD	552,500	9,403,550.00	17.02000	9,403,550.00		
81731510	SEPRACOR INC	241,600	14,058,704.00	58.19000	14,058,704.00		
82619750	SIEMENS AG	109,000	6,743,830.00	61.87000	6,743,830.00		
82691910	SILICON LABORATORIES INC	25,700	2,571,285.00	100.05000	2,571,285.00		
85206110	SPRINT NEXTEL CORPORATION	55,200	1,824,360.00	33.05000	1,824,360.00		
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	304,843	5,319,510.35	17.45000	5,319,510.35		
86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	30,900	1,908,693.00	61.77000	1,908,693.00		
87182910	SYSCO CORP	1,196,700	6,857,091.00	5.73000	6,857,091.00		
88077010	TERADYNE INC	140,100	5,014,179.00	35.79000	5,014,179.00		
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	84,500	1,325,805.00	15.69000	1,325,805.00		
90390U10	SLM CORP	55,400	1,721,832.00	31.08000	1,721,832.00		
90478450	UNILEVER N V -NY SHARES	489,400	24,279,134.00	49.61000	24,279,134.00		
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	137,400	3,658,962.00	26.63000	3,658,962.00		
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	107,700	5,673,636.00	52.68000	5,673,636.00		
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	194,900	14,438,192.00	74.08000	14,438,192.00		
91704710	URBAN OUTFITTERS INC	164,000	10,245,080.00	62.47000	10,245,080.00		
92552430	VIACOM INC-CLASS B	69,300	1,713,096.00	24.72000	1,713,096.00		
93932210	WASHINGTON MUTUAL INC	61,650	2,595,465.00	42.10000	2,595,465.00		
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	464,200	20,847,222.00	44.91000	20,847,222.00		
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	159,500	6,061,000.00	38.00000	6,061,000.00		
98391910	XILINX INC	286,500	10,196,535.00	35.59000	10,196,535.00		
98934D10	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	375,500	9,008,245.00	23.99000	9,008,245.00		
99990000	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	169,500	4,674,810.00	27.58000	4,674,810.00		
7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	286,800	15,573,240.00	54.30000	15,573,240.00		
G9007810	TRANSOCEAN INC	585,300	6,777,774.00	11.58000	6,777,774.00		
G9825510	XI CAPITAL LTD -CLASS A	253,600	6,766,048.00	26.68000	6,766,048.00		
N0705911	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	27,700	2,065,035.00	74.55000	2,065,035.00		
アメリカドル 計		77,900	1,928,804.00	24.76000	1,928,804.00		
(邦貨換算額)					899,632,581.01		
					(107,443,119,150)		

(外国投資証券)

アメリカドル		(単位:アメリカドル)		備考
銘柄	銘柄	券面総額	評価額	
37002110	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	27,600	1,478,532.00	
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	18,916	457,388.88	
アメリカドル	計	46,516	1,935,920.88	
(邦貨換算額)			(231,207,030)	

アメリカドル		(単位:円)	
銘柄	銘柄	券面総額	評価額
総合計			(231,207,030)
			231,207,030

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

外貨建価値証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入債券時価比率 (%)	組入投資証券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	株式 156銘柄	99.7	-	-	95.2
アメリカドル	社債券 1銘柄	-	0.2	-	0.2
アメリカドル	投資証券 2銘柄	-	-	0.1	0.1
カナダドル	株式 18銘柄	100.0	-	-	4.5

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

5. 「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	注記番号	平成18年1月10日現在		平成19年1月10日現在	
			金額	金額	金額	金額
資産の部						
流動資産						
預金			-	-	95,339,946	
コール・ローン			792,915,266		8,828,049,171	
株式			44,330,378,721		108,809,827,126	
投資証券			884,274,434		1,145,519,971	
未収入金			7,286,030		-	
未収配当金			48,675,387		118,323,479	
流動資産合計			46,063,529,838		118,997,059,693	
資産合計			46,063,529,838		118,997,059,693	
負債の部						
流動負債						
未払解約金			-		8,502,000,000	
流動負債合計			-		8,502,000,000	
負債合計			-		8,502,000,000	
純資産の部						
元本等						
元本			26,439,944,000		48,928,939,986	
剰余金						
剰余金			19,623,585,838		61,566,119,707	
剰余金合計			19,623,585,838		61,566,119,707	
元本等合計			-		110,495,059,693	
純資産合計			46,063,529,838		110,495,059,693	
負債・純資産合計			46,063,529,838		118,997,059,693	

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買配相場は使用しない)又は価格提供会社の提示する価額のいずれから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額をもつて時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買配相場は使用しない)又は価格提供会社の提示する価額のいずれから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額をもつて時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引
3. 収益及び費用の計上基準	<p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについて、は当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについて、は当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1. 期首	<p>期首元本額 13,538,803,077 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 17,254,995,760 円</p> <p>期首からの解約元本額 4,353,854,837 円</p> <p>平成18年1月10日現在の元本の内訳 ※</p> <p>GW 7つの卵 18,749,219,388 円</p> <p>グローバル・ラップ・バランス 175,743 円</p> <p>安定型 294,609,742 円</p> <p>安定成長型 512,180,321 円</p> <p>成長型 3,318,547,796 円</p> <p>グローバル・ラップ・バランス 1,487,042,753 円</p> <p>積極成長型 1,493,586,155 円</p> <p>超積極型 490,032,708 円</p> <p>欧州先進国株式ファンド</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 4,023,762 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 12,189,874 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 16,033,569 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 36,119,365 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 26,182,824 円</p> <p>(合計) 26,439,944,000 円</p>	<p>期首元本額 26,438,944,000 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 30,437,435,251 円</p> <p>期首からの解約元本額 7,948,439,265 円</p> <p>平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※</p> <p>GW 7つの卵 37,157,090,082 円</p> <p>グローバル・ラップ・バランス 181,279 円</p> <p>安定型 275,361,301 円</p> <p>安定成長型 629,685,577 円</p> <p>成長型 4,129,511,224 円</p> <p>グローバル・ラップ・バランス 1,703,619,277 円</p> <p>積極成長型 1,805,532,150 円</p> <p>超積極型 2,585,585,482 円</p> <p>GW 7つの卵 (価格機関投資家向け)</p> <p>欧州先進国株式ファンド 331,724,681 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 12,157,345 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 34,161,045 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 46,577,132 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 115,463,910 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 102,289,501 円</p> <p>(合計) 48,928,939,986 円</p>
2.	<p>本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数</p>	<p>本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数</p>

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	44,330,378,721	5,373,280,824	
投資証券	884,274,434	139,065,085	
合 計	45,214,653,155	5,512,345,909	

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	108,809,827,126	7,186,959,630	
投資証券	1,145,519,971	234,645,611	
合 計	109,955,347,097	7,401,605,241	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

取引の内容	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指差先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡し取引、為替先渡し取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的および取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。

II 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,7422 円 (17,422 円)	1口当たり純資産額 2,2583 円 (1万口当たり純資産額) (22,583 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式(イギリスポンド)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
ARRIVA PLC	354,063	7,88000	2,790,016.44			
BCS BARCLAYS PLC	2,750,788	7.65000	21,043,528.20			
BP PLC	4,026,899	5.35500	21,564,044.14			
CADBURY SCHWEPES PLC	909,093	5.40500	4,913,647.66			
DIAGEO PLC	549,721	9.91000	5,447,735.11			
DAILY MAIL&GENERAL TRUST-A NV	106,054	7.24000	767,830.96			
DSG INTERNATIONAL PLC	1,618,365	1.91500	3,099,168.97			
FIRSTGROUP PLC	457,954	5.82000	2,665,292.28			
GALLAHER GROUP PLC	392,924	11.39500	4,477,368.98			
GLXO GLAXOSMITHKLINE PLC	1,322,006	13.60000	17,979,281.60			
ITV PLC	759,051	1.08750	825,467.96			
KESA ELECTRICALS PLC	952,296	3.49500	3,328,274.52			
KGFF KINGFISHER PLC	1,684,500	2.36000	3,975,420.00			
MORSE PLC	747,113	1.09750	819,956.51			
MSY MYSYS PLC	1,101,668	2.22000	2,445,702.96			
PRUDENTIAL PLC	2,179,158	7.19500	15,679,041.81			
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	636,067	20.87000	13,274,718.29			
RTOL RENTOKIL INITIAL PLC	1,316,694	1.63750	2,156,086.42			
SCOTTISH POWER PLC	829,079	7.45500	6,180,783.94			
TAYLOR NELSON SORFES PLC	584,091	2.02000	1,179,863.82			
VODAFONE GROUP PLC	13,491,454	1.49500	20,169,723.73			
WOLSELEY PLC	215,000	12.93000	2,779,950.00			
イギリスポンド 計	36,984,038		157,562,904.30			
(邦貨換算額)			(36,433,270,360)			

外国株式(スイスフラン)

外国株式(スイスフラン)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
CREDIT SUISSE GROUP	561,623	84.00000	47,176,332.00			
HOLCIM LTD-REG	116,900	116.70000	13,642,230.00			
NESTLE SA-REGISTERED	66,828	428.00000	28,602,384.00			
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	159,710	227.00000	36,254,170.00			
スイスフラン 計	905,061		125,675,116.00			
(邦貨換算額)			(12,066,067,887)			

外国株式(スウェーデンクローナ)

外国株式(スウェーデンクローナ)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
ELECTROLUX AB-SER B	717,200	110.50000	79,250,600.00			
ELECTROLUX AB	717,200	19.90000	14,272,280.00			
HUSQVARNA AB	650,200	106.00000	68,921,200.00			
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS	2,525,000	28.25000	71,331,250.00			
HOLMEN AB-B SHARES	80,300	296.00000	23,768,800.00			
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	182,400	364.00000	66,393,600.00			
スウェーデンクローナ 計	4,872,300		323,937,730.00			
(邦貨換算額)			(5,500,462,655)			

外国株式(デンマーククローナ)

外国株式(デンマーククローナ)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
A P MOLLER MAERSK A/S	820	53,500.00000	43,870,000.00			
デンマーククローナ 計	820		43,870,000.00			
(邦貨換算額)			(911,618,600)			

外国株式(ノルウェークローナ)

外国株式(ノルウェークローナ)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
TELENOR ASA	580,000	123.00000	71,340,000.00			
ノルウェークローナ 計	580,000		71,340,000.00			
(邦貨換算額)			(1,337,625,000)			

外国株式(ユーロ)

外国株式(ユーロ)		株数		評価額		備考
銘柄	株数	単価	金額	単価	金額	
AEGO NV	1,324,851	15.20000	20,137,735.20			
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	450,474	15.73000	7,085,956.02			
ALPHA BANK A.E.	164,000	24.46000	4,011,440.00			
ALLIANZ SE-REG	95,241	155.60000	14,819,499.60			
ABN AMRO HOLDING NV	637,944	24.34000	15,527,556.96			
ASML HOLDING NV	174,680	19.00000	3,318,920.00			
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	1,494,296	14.43000	21,562,691.28			
BI INTESA SANPAOLO SPA	2,142,330	5.69000	12,189,857.70			
BANK OF IRELAND	594,086	17.25000	10,247,983.50			
BNP PARIBAS SA	119,000	83.90000	9,984,100.00			
BOUYGUES SA	75,887	49.70000	3,771,583.90			
CRH PLC	56,371	30.51000	1,719,879.21			
DEP DEPPA BANK PLC	246,000	13.72000	3,375,120.00			
DEXIA	189,343	21.55000	4,080,341.65			
DPB DEUTSCHE POSTBANK AG	58,970	66.54000	3,923,863.80			
ENI SPA	498,199	24.56000	12,235,767.44			
ETE NATIONAL BANK OF GREECE SA	83,000	37.00000	3,071,000.00			
FRANCE TELECOM SA	1,001,512	22.25000	22,283,642.00			
CELESTIO AG	108,254	41.11000	4,450,321.94			
ING GROEP NV-CVA	446,269	33.77000	15,070,504.13			
KBC GROUP	54,133	96.45000	5,221,127.85			
KONINKLIJKE KPN NV	1,601,445	11.52000	18,448,646.40			
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	180,276	22.35000	4,029,168.60			
SUEZ SA	471,654	38.70000	18,253,009.80			
MEG METRO AG	112,000	49.34000	5,526,080.00			
MIDI AXA	436,251	31.67000	13,816,069.17			
NOKIA OYJ	1,222,550	14.96000	18,289,348.00			
ORDINA NV	277,668	17.79000	4,939,713.72			
REPSOL YPF SA	174,237	25.47000	4,437,816.39			
SOFF SANOFI-AVENTIS SA	251,816	68.65000	17,287,168.40			
TELEKOM AUSTRIA AG	172,191	21.35000	3,676,277.85			
TOL TOTAL SA	517,464	51.85000	26,830,508.40			
TNT NV	176,347	32.56000	5,741,858.32			
ユーロ 計	15,608,739		339,364,557.23			
(邦貨換算額)			(52,560,782,624)			

総合計

(単位:円)	(108,809,827,126)
	108,809,827,126

(注) 総合計の()内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

6. 「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日 注記 番号	平成18年1月10日現在 金額	平成19年1月10日現在 金額
資産の部			
流動資産			
預金		41,011,207	-
コール・ローン		164,499,013	3,101,422,331
株式		22,729,274,788	40,768,616,377
投資証券		533,221,859	789,791,317
派生商品評価勘定		92,275	-
未収入金		219,176,542	223,666,435
未収配当金		5,651,685	33,065,192
流動資産合計		23,692,927,369	44,916,561,652
資産合計		23,692,927,369	44,916,561,652
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	743,623
未払金		-	21,578,853
未払解約金		10,000,000	3,001,000,000
流動負債合計		10,000,000	3,023,322,476
負債合計		10,000,000	3,023,322,476
純資産の部			
元本等			
元本		9,927,467,676	12,796,318,061
剰余金			
剰余金		13,755,459,693	29,096,921,115
剰余金合計		13,755,459,693	29,096,921,115
元本等合計		-	41,893,239,176
純資産合計		23,692,927,369	41,893,239,176
負債・純資産合計		23,692,927,369	44,916,561,652

(単位:ユーロ)

銘柄	銘柄数	券面総額	評価額	備考
UL	UNIBAIL HOLDING	40,527	7,396,177.50	
ユーロ計		40,527	7,396,177.50	
〔邦貨換算額〕			(1,145,519,971)	

(単位:円)

総合計	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
	100.0	-	33.1
	100.0	-	11.0
	100.0	-	5.0
	100.0	-	0.8
	100.0	-	1.2
	97.9	-	47.8
	-	2.1	1.1

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
イギリスポンド	株式 22銘柄	100.0	-	33.1
スイスフラン	株式 4銘柄	100.0	-	11.0
スウェーデンクローナ	株式 6銘柄	100.0	-	5.0
デンマーククローネ	株式 1銘柄	100.0	-	0.8
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	100.0	-	1.2
ユーロ	株式 33銘柄	97.9	-	47.8
ユーロ	投資証券 1銘柄	-	2.1	1.1

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場の使用しない)又は価格提供会社の提示する価額のいずれから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日 株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買相場の使用しない)又は価格提供会社の提示する価額のいずれから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引	為替予約取引
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準	受取配当金の計上基準	受取配当金の計上基準
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在	平成18年1月11日
1. 期首	期首元本額 5,452,825,116 円 期首からの追加設定元本額 6,209,078,012 円 期首からの解約元本額 1,734,435,452 円 平成18年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 6,800,881,424 円 グローバル・ラップ・バランス 52,866 円 安定型 108,640,786 円 安定成長型 184,942,158 円 成長型 1,259,821,810 円 グローバル・ラップ・バランス 564,033,791 円 積極成長型 731,832,563 円 超積極型 242,385,296 円 アジア・太平洋先進国株式ファンド 1,175,562 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 4,348,096 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 5,852,297 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 13,309,202 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 10,191,825 円 (合計) 9,927,467,676 円	期首元本額 9,927,467,676 円 期首からの追加設定元本額 5,557,250,130 円 期首からの解約元本額 2,688,399,745 円 平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 9,451,303,674 円 グローバル・ラップ・バランス 52,578 円 安定型 82,341,292 円 安定成長型 176,590,017 円 成長型 1,069,888,662 円 グローバル・ラップ・バランス 489,182,408 円 積極成長型 613,661,611 円 超積極型 657,691,907 円 アジア・太平洋先進国株式ファンド 171,082,296 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 3,371,088 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 10,205,038 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 13,024,858 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 28,854,653 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 29,067,979 円 (合計) 12,796,318,061 円	期首元本額 9,927,467,676 円 期首からの追加設定元本額 5,557,250,130 円 期首からの解約元本額 2,688,399,745 円 平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 9,451,303,674 円 グローバル・ラップ・バランス 52,578 円 安定型 82,341,292 円 安定成長型 176,590,017 円 成長型 1,069,888,662 円 グローバル・ラップ・バランス 489,182,408 円 積極成長型 613,661,611 円 超積極型 657,691,907 円 アジア・太平洋先進国株式ファンド 171,082,296 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型) 3,371,088 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型) 10,205,038 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型) 13,024,858 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型) 28,854,653 円 年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型) 29,067,979 円 (合計) 12,796,318,061 円
2.	(合計) 9,927,467,676 円	(合計) 12,796,318,061 円	(合計) 12,796,318,061 円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	22,729,274,788	3,173,860,914	
投資証券	533,221,859	△1,126,899	
合 計	23,262,496,647	3,172,734,015	

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
株式	40,768,616,377	5,374,068,072	
投資証券	789,791,317	215,514,630	
合 計	41,558,407,694	5,589,582,702	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

取引の内容	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプショナル取引、金利先物取引、金利先物取引、為替先物取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的および取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。

II 取引の時価等に関する事項

(通貨関連) (単位:円)

区分	種 類	平成18年1月10日現在		評価損益
		契約額等 うち1年超	時 価	
市場	為替予約取引	17,923,726	17,831,451	92,275
場外	売建 シンガポール 引以	17,923,726	17,831,451	92,275
以外の取引				
合 計		17,923,726	17,831,451	92,275

(単位:円)

区分	種 類	平成19年1月10日現在		評価損益
		契約額等 うち1年超	時 価	
市場	為替予約取引	166,796,125	167,539,748	△743,623
場外	売建 アメリカドル 引以	166,796,125	167,539,748	△743,623
以外の取引				
合 計		166,796,125	167,539,748	△743,623

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
 - ①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
 - ②計算期間末日に当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

平成18年1月10日現在		平成19年1月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3856 円 (23,856 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,2739 円 (32,739 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
DCPT DATAFAST ASIA LTD	1,794,000	1.16000	2,081,040.00	
HKLD HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,194,000	4.16000	4,967,040.00	
JMH JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	314,400	22.30000	7,011,120.00	
アメリカドル計	3,302,400		14,059,200.00	
(邦貨換算額)			(1,679,090,256)	

(単位:株、アメリカドル)

外国株式(オーストラリアドル)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
ANZ AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	594,386	27.69000	16,458,548.34	
BHP BHP BILLITON LTD	1,441,403	24.70000	35,602,654.10	
BXBAU BRAMBLES LTD	1,157,380	12.82000	14,837,611.60	
CBA COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	412,730	49.51000	20,434,262.30	
CCL COCA-COLA AMATIL LIMITED	137,490	7.72000	1,061,422.80	
CSL CSL LIMITED	210,220	63.63000	13,376,298.60	
DXL DYNO NOBEL LTD	1,038,780	2.40000	2,493,072.00	
FBG FOSTER'S GROUP LTD	1,412,270	6.88000	9,716,417.60	
JHX JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	407,451	9.83000	4,005,243.33	
LIC LEND LEASE CORP LIMITED	311,340	17.52000	5,454,676.80	
LNN LION NATHAN LIMITED	511,520	8.07000	4,127,966.40	
MAY SYMBION HEALTH LTD	1,101,070	3.67000	4,040,926.90	
MCG MACQUARIE COMMUNICATIONS INFRASTRUCTURE GROUP	562,640	6.19000	3,482,741.60	
NAB NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	505,581	40.40000	20,425,472.40	
NCP NEWS CORP INC-CDI CLASS B	72,630	28.98000	2,104,817.40	
NCPD NEWS CORP INC-CDI CLASS A	103,105	27.79000	2,865,287.95	
NRM INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	51,580	6.54000	337,333.20	
ORI ORICA LTD	198,310	23.38000	4,636,487.80	
PAN PROMINA GROUP LTD	1,194,810	6.93000	8,280,033.30	
QBE QBE INSURANCE GROUP LIMITED	711,690	28.50000	20,283,165.00	
RIN RINKER GROUP LTD	416,240	17.92000	7,459,020.80	
RIO RIO TINTO LIMITED	167,450	71.64000	11,996,118.00	
SRG SYDNEY ROADS GROUP	1,895,530	1.32500	2,511,577.25	
TAB TABCORP HOLDINGS LIMITED	263,310	17.31000	4,557,896.10	
WBC WESTPAC BANKING CORPORATION	669,470	24.01000	16,073,974.70	
WOW WOOLWORTHS LIMITED	674,990	22.92000	15,470,770.80	
WPL WOODSIDE PETROLEUM LTD	166,210	36.13000	6,005,167.30	
オーストラリアドル計	16,389,586		258,098,964.37	
(邦貨換算額)			(24,039,337,541)	

(単位:株、オーストラリアドル)

外国株式(香港ドル)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
ASMP ASM PACIFIC TECHNOLOGY	808,000	44.50000	35,956,000.00	
DASB DAH SING BANKING GROUP LIMITED	2,806,000	19.06000	53,482,360.00	
FLGL COSCO PACIFIC LIMITED	2,456,000	18.80000	46,172,800.00	
FRPA FIRST PACIFIC CO	3,732,000	4.09000	15,263,880.00	
HKEX HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	716,000	85.90000	61,504,400.00	
HL HANG LING GROUP LIMITED	1,821,000	22.95000	41,791,950.00	
HSGH HANG SENG BANK LTD	233,300	107.60000	25,103,080.00	
KERP KERRY PROPERTIES LTD	1,599,500	37.40000	59,821,300.00	
LIFU LI & FUNG LTD	1,862,400	23.95000	44,604,480.00	
SCP STANDARD CHARTERED PLC	209,850	222.20000	46,628,670.00	
SHGH SHANGRI-LA ASIA LTD.	2,010,000	20.40000	41,004,000.00	
SWPA SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,047,000	90.55000	94,805,850.00	
SWPB SWIRE PACIFIC LTD B	1,445,000	16.70000	24,131,500.00	
WHB WING HANG BANK LIMITED	374,500	85.75000	32,113,375.00	
香港ドル計	21,120,550		622,383,645.00	
(邦貨換算額)			(9,534,917,441)	

(単位:株、シンガポールドル)

外国株式(シンガポールドル)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
CYCM JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	702,000	14.70000	10,319,400.00	
CYDM CITY DEVELOPMENTS LTD	858,000	13.00000	11,154,000.00	
DBS DBS GROUP HOLDINGS LTD	545,692	22.60000	12,332,639.20	
MOB MOBILEONE LTD	1,006,320	2.18000	2,193,777.60	
SCIL SEMBCORP INDUSTRIES LTD	676,000	3.66000	2,474,160.00	
SGX SINGAPORE EXCHANGE LTD	959,000	5.75000	5,514,250.00	
TELE SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	2,319,020	3.20000	7,420,864.00	
UOBH UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,012,192	19.40000	19,636,524.80	
シンガポールドル計	8,078,224		71,045,615.60	
(邦貨換算額)			(5,515,271,139)	

(単位:円)

銘柄	株数	評価額	備考
総合計		(40,768,616,377)	
		40,768,616,377	

(注) 総合計の()内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

(2) 株式以外の有価証券

銘柄	債面総額	評価額		備考
		単価	金額	
CCT CAPITACOMMERCIAL TRUST	682,000	1,684,540.00		
SUN SUNTEC REIT	4,851,000	8,489,250.00		
シンガポールドル計	5,533,000	10,173,790.00		
(邦貨換算額)		(789,791,317)		

(単位:シンガポールドル)

銘柄	債面総額	評価額	備考
総合計		(789,791,317)	
		789,791,317	

(単位:円)

(注1) 投資証券における債面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

外貨建資産証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価 比率 (%)	合計額に対する比 率 (%)
アメリカドル	株式 3銘柄	100.0	-	4.0
オーストラリアドル	株式 27銘柄	100.0	-	57.9
香港ドル	株式 14銘柄	100.0	-	22.9
シンガポールドル	株式 8銘柄	87.5	-	13.3
シンガポールドル	投資証券 2銘柄	-	12.5	1.9

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

7. 「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日 注記 番号	平成18年1月10日現在 金額	平成19年1月10日現在 金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		454,934,245	12,692,685,072
国債証券		37,722,479,424	65,004,816,656
地方債証券		-	214,519,756
特殊債券		16,520,487,749	26,846,479,590
社債券		5,611,589,263	47,711,491,822
コモディティ・ペーパー		13,943,224,660	-
派生商品評価勘定		1,378,187,328	648,709,762
未収入金		15,845,571,859	32,586,592,268
未収利息		345,558,440	1,029,850,612
前払費用		138,850,300	118,924,566
差入委託証拠金		358,646,354	1,691,585,706
流動資産合計		92,319,529,622	188,545,655,810
資産合計		92,319,529,622	188,545,655,810
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		917,726,113	2,583,763,848
未払金		28,218,064,999	44,692,002,298
未払解約金		7,000,000	11,715,100,000
流動負債合計		29,142,791,112	58,990,866,146
負債合計		29,142,791,112	58,990,866,146
純資産の部			
元本等			
元本		41,180,184,178	76,792,032,001
剰余金			
剰余金		21,996,554,332	52,762,757,663
剰余金合計		21,996,554,332	52,762,757,663
元本等合計		-	129,554,789,664
純資産合計		63,176,738,510	129,554,789,664
負債・純資産合計		92,319,529,622	188,545,655,810

(2) 注記表

平成17年1月12日から平成18年1月10日までについては「重要な会計方針」及び「注記事項」を記載しております。

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券、社債券及びコモディティ・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、売買取引相場は使用しない)又は価格提示会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 公正な評価額を入手できなかった場合は入手した評価額が時価と認められない事由が認められれば、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認めた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認めた価値で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券及びコモディティ・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、売買取引相場は使用しない)又は価格提示会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 公正な評価額を入手できなかった場合は入手した評価額が時価と認められない事由が認められれば、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもつて時価と認めた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもつて時価と認めた価値で評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (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相場の仲値で評価しております。 外貨建取引等の処理基準	(1) デリバティブ取引 同左 同左	(1) デリバティブ取引 同左 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	「投資信託財産の貸借対照表、損益及び剰余金計算書、附属明細表並びに運用報告書に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。	「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。	

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在	平成18年1月11日
1. 期首			
期首元本額	17,468,691,575 円	41,180,184,178 円	41,180,184,178 円
期首からの追加設定元本額	30,772,322,655 円	44,086,015,461 円	44,086,015,461 円
期首からの解約元本額	7,060,830,052 円	8,474,167,638 円	8,474,167,638 円
平成18年1月10日現在の元本の内訳	※	※	※
GW 7つの卵	31,452,790,886 円	60,491,402,667 円	60,491,402,667 円
グローバル・ラップ・バランス	469,859 円	515,312 円	515,312 円
安定型	663,806,578 円	672,814,301 円	672,814,301 円
安定成長型	1,094,472,709 円	1,208,310,526 円	1,208,310,526 円
成長型	5,475,095,375 円	6,935,974,116 円	6,935,974,116 円
グローバル・ラップ・バランス	1,606,393,159 円	1,988,028,842 円	1,988,028,842 円
積極成長型	724,875,539 円	4,459,573,344 円	4,459,573,344 円
グローバル・ラップ・バランス	10,571,305 円	503,697,815 円	503,697,815 円
海外債券ファンド	29,192,998 円	38,797,054 円	38,797,054 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	33,329,951 円	82,109,379 円	82,109,379 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	60,122,682 円	92,704,907 円	92,704,907 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	29,063,137 円	197,566,834 円	197,566,834 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	(合計) 41,180,184,178 円	120,536,904 円	120,536,904 円
海外債券ファンド			
GW 7つの卵 (適格機関投資家向け)			
海外債券ファンド			
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)			
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)			
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)			
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)			
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型)			
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数			

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自平成17年1月12日 至 平成18年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
国債証券	37,722,479,424	624,496,541	
特殊債券	16,520,487,749	25,906,123	
社債証券	5,611,589,263	△24,328,568	
ノーマンシャル・ペーパー	13,943,224,660	69,507,089	
合 計	73,797,781,096	695,581,185	

対象期間 (自平成18年1月11日 至 平成19年1月10日)
 売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額	(単位:円)
国債証券	65,004,816,656	△1,093,530,108	
地方債証券	214,519,756	1,561,115	
特殊債券	26,846,479,590	6,693,389	
社債証券	47,711,491,822	46,130,794	
合 計	139,777,307,824	△1,039,144,810	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

取引の内容	自平成17年1月12日 至平成18年1月10日	自平成18年1月11日 至平成19年1月10日
取引の利用目的および取引に対する取組方針	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプцион取引、金利先物取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引に係るリスクの内容	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理部門が日常的にこれを監視しております。	同左

II 取引の時価等に関する事項

(債券関連)

区分	種 類	平成18年1月10日現在		評価損益
		契約額等 うち1年超	時 価	
市場取引	債券先物取引 買建	3,160,049,626	3,190,447,206	30,397,580
合 計		3,160,049,626	3,190,447,206	30,397,580

区分	種 類	平成19年1月10日現在		評価損益
		契約額等 うち1年超	時 価	
市場取引	債券先物取引 買建	17,250,211,097	16,889,700,019	△360,511,078
合 計		17,250,211,097	16,889,700,019	△360,511,078

(注) 時価の算定方法

1. 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場で評価しています。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(通貨関連) (単位:円)

区分	種類	平成18年1月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
	為替予約取引	-	-	
	売建	39,941,370,561	38,593,580,813	1,347,789,748
	アメリカドル	21,295,572,435	20,383,587,423	911,985,012
	カナダドル	555,129,688	543,374,730	11,754,958
	イギリスポンド	11,623,719,423	11,293,938,880	329,780,543
	ユーロ	6,466,949,015	6,372,679,780	94,269,235
市場	買建	39,069,538,387	38,151,812,274	△917,726,113
	アメリカドル	10,334,783,906	10,178,088,334	△156,695,572
	カナダドル	2,330,417,031	2,214,790,890	△115,626,141
	オーストラリアドル	302,593,896	289,636,560	△12,957,336
	イギリスポンド	1,747,620,709	1,728,794,970	△18,825,739
	スイスフラン	741,534,263	720,078,120	△21,456,143
	スウェーデンクローナ	731,868,510	715,292,880	△16,575,630
	シンガポールドル	274,840,302	269,047,740	△5,792,562
	デンマーククローネ	727,607,622	707,723,240	△19,884,382
	ノルウェークローネ	216,066,006	210,074,280	△5,991,726
	ポーランドズロチ	590,865,486	587,846,770	△3,018,716
	ユーロ	21,071,340,656	20,530,438,490	△540,902,166
	合計	79,010,908,948	76,745,393,087	430,063,635

(単位:円)

区分	種類	平成19年1月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
	為替予約取引	-	-	
	売建	109,185,937,282	111,276,692,850	△2,090,755,568
	アメリカドル	80,704,369,479	82,565,474,841	△1,861,105,362
	カナダドル	3,531,791,749	3,548,670,750	△16,879,001
	オーストラリアドル	598,451,050	601,462,080	△3,011,030
	イギリスポンド	16,126,934,696	16,332,897,960	△205,963,264
	ユーロ	116,940,924	115,884,230	1,056,694
市場	買建	107,124,355	106,553,850	570,505
	アメリカドル	8,000,325,029	8,005,749,139	△5,424,110
	カナダドル	106,171,928,282	106,688,140,842	516,212,560
	オーストラリアドル	38,704,567,803	39,014,271,522	309,703,719
	イギリスポンド	6,539,466,635	6,513,828,750	△25,637,885
	スイスフラン	1,187,202,794	1,198,919,580	11,716,786
	スウェーデンクローナ	7,824,922,769	7,856,298,580	31,375,811
	シンガポールドル	1,218,663,414	1,191,091,490	△27,571,924
	デンマーククローネ	1,493,952,120	1,477,071,590	△16,880,530
	ノルウェークローネ	504,522,737	517,851,840	13,329,103
	ポーランドズロチ	1,375,210,658	1,368,250,650	△6,960,008
	ユーロ	340,949,473	335,065,900	△5,883,573
	合計	45,835,124,838	46,094,566,700	259,441,862

(注) 時価の算定方法

- ① 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
 - ② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
- ② 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

	平成18年1月10日現在	平成19年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,5342 円	1口当たり純資産額 1,6871 円
(1万口当たり純資産額)	(15,342 円)	(1万口当たり純資産額) (16,871 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(外貨建債券)

アメリカドル

(単位:アメリカドル)

種別	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	107F00 アメリカ国債 3.625% 20070630	30,000,000.00	29,803,125.00	
	107K01 アメリカ国債 4.25% 20071130	10,000,000.00	9,932,813.00	
	110E00 アメリカ国債 3.875% 20100515	7,800,000.00	7,612,312.50	
	111B01 アメリカ国債 4.5% 20110228	45,200,000.00	44,938,689.76	
	207061 ロシア国債 10% 20070626	700,000.00	714,630.00	
	210C00 ロシア国債 8.25% 20100331	466,674.02	488,141.01	
	210P01 アメリカ国債 8.75% 20100415	3,500,000.00	3,539,578.35	
	214A03 メキシコ国債 5.875% 20140115	600,000.00	613,200.00	
	214F00 南アフリカ国債 6.5% 20140602	300,000.00	316,500.00	
	214G01 ブラジル国債 10.5% 20140714	800,000.00	1,015,200.00	
	215A02 アメリカ国債 1.625% 20150115	3,900,000.00	3,888,635.01	
	215C01 パナマ国債 7.25% 20150315	300,000.00	324,000.00	
	218A00 ブラジル国債 8% 20180115	105,000.00	116,235.00	
	219020 アメリカ国債 8.875% 20190215	300,000.00	412,125.00	
	219022 アメリカ国債 8.125% 20190815	200,000.00	262,656.26	
	219100 ブラジル国債 8.875% 20191014	500,000.00	611,750.00	
	221020 アメリカ国債 7.875% 20210215	400,000.00	523,562.52	
	221K00 アメリカ国債 0% 20211115	7,300,000.00	3,553,640.00	
	223080 アメリカ国債 6.25% 20230815	43,600,000.00	50,494,250.00	
	224K00 アメリカ国債 0% 20241115	4,200,000.00	1,770,720.00	
	227110 アメリカ国債 6.125% 20271115	2,000,000.00	2,340,312.60	
	230C01 ロシア国債 5% 20300331	700,000.00	788,340.00	
	国債証券 計		162,871,674.02	164,060,416.01
特殊債券	809100 連邦住宅貸付銀行 (FHLB) 5% 20091002	13,600,000.00	13,640,120.00	
	815F00 日本政策投資銀行 4.25% 20150609	3,600,000.00	3,413,016.00	
	840181 政府担当金庫 (GNMA) 008770 6.125% 20251220	12,772.73	12,954.48	
	850171 連邦担当金庫 (FNMA) 2004-W2 5AF 5.7% 20440325	155,505.40	155,740.01	
	850182 連邦担当金庫 (FNMA) 2004-W8 2A 6.5% 20440625	270,561.61	277,012.93	
	850183 連邦担当金庫 (FNMA) 2004-W8 1AF 5.6% 20440625	131,040.19	131,175.60	
	850192 連邦担当金庫 (FNMA) 1999-37 F 5.75% 20290625	75,036.77	75,278.37	
	850233 FANNIE MAE WHOLE LOAN 2004-W12 1A1 6% 20440725	730,742.58	735,669.53	
	850256 FANNIE MAE GRANTOR TRUST 2005-14 A1B 5.44% 20350925	3,142,123.38	3,144,695.50	
	850264 FANNIE MAE GRANTOR TRUST 2004-T3 1A1 6% 20440225	87,546.64	88,151.08	
	850271 連邦担当金庫 (FNMA) 5.5% 20280325	4,757,082.30	4,768,142.04	
	850302 連邦担当金庫 (FNMA) 7.006% 20301001	22,147.39	22,366.64	
	850303 連邦担当金庫 (FNMA) 4.546% 20351001	2,802,971.13	2,763,140.91	
	850304 連邦担当金庫 (FNMA) TBA 5% 20370212	117,800,000.00	114,358,037.14	
	850305 連邦担当 (FNMA) TBA 5.5% 20370212	54,200,000.00	53,768,096.46	
	850307 連邦担当金庫 (FNMA) TBA 5.5% 20270215	17,700,000.00	17,628,785.82	
	860107 FLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-21 A 5.71% 20291025	104,680.66	104,680.66	
	860108 FLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-62 1A1 5.958% 20441025	1,413,620.80	1,422,745.29	
	860109 FREDDIE MAC 2770 YW 4% 20220615	2,289,941.37	2,258,454.44	
	860110 連邦住宅貸付担当公社 (FHLMC) 4.715% 20350901	3,429,693.95	3,388,263.24	
	870124 連邦担当金庫 (FNMA) 2000-13 F 6% 20230925	78,326.44	79,413.28	
	870276 FLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-61 1A1 6.158% 20440725	536,383.77	539,923.58	
	507F07 Vodafone Group Plc 5.42375% 20070629	226,940,177.11	222,775,883.00	
507I02 DAIMLER CHRYSLER NA HLDG 5.83313% 20070910	2,300,000.00	2,300,000.00		
507I04 VTB Capital SA for Vneshtorgbank 6.115% 20070921	800,000.00	801,760.00		
507I01 ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 5.365% 20071221	1,000,000.00	1,001,839.00		
507I02 Unicredit to Italiano/New York NY 5.3575% 20071213	1,600,000.00	1,601,643.20		
508A00 Morgan Stanley 5.49838% 20080118	5,200,000.00	5,200,546.00		
508D12 Morgan Stanley 5.40688% 20080425	800,000.00	801,040.00		
508E09 HSBC Finance Corporation 5.375% 20080521	2,700,000.00	2,700,810.00		
508F03 Westpac Banking Corp/NY 5.28% 20080606	5,900,000.00	5,902,731.70		
508F04 AIG SunAmerica Global Financing IX 5.365% 20080623	3,000,000.00	3,000,864.00		
508G08 Royal Bank of Scotland Plc 5.42375% 20080721	3,100,000.00	3,100,775.00		
508H08 Mandalay Resort Group 9.5% 20080801	2,800,000.00	2,802,240.00		
508J04 General Electric Capital Corporation 5.38% 20081024	3,000,000.00	3,163,200.00		
508L07 The Goldman Sachs Group, Inc. 5.455% 20081222	2,800,000.00	2,802,377.20		
508L08 The Goldman Sachs Group, Inc. 5.40563% 20081223	2,000,000.00	2,002,200.00		
509A09 Citigroup Inc. 5.41625% 20090130	3,800,000.00	3,801,755.60		
509A10 CMS Energy Corporation 7.5% 20090115	6,200,000.00	6,205,728.80		
509B15 Banco Santander Central Hispano SA 5.42813% 20090206	2,700,000.00	2,788,830.00		
509D06 Charter One Bank NA 5.43% 20090424	2,300,000.00	2,303,755.90		
509F07 General Electric Capital Corporation 5.48% 20090615	5,950,000.00	5,957,919.45		
509J10 General Electric Capital Corporation 5.41% 20091026	3,800,000.00	3,803,420.00		
509J11 HSBC Finance Corporation 5.42% 20091021	2,800,000.00	2,801,150.80		
509K11 Bank of America Corporation 5.37813% 20091106	3,000,000.00	3,002,886.00		
510F08 Goldman Sachs Group LP 5.66375% 20100628	2,900,000.00	2,900,002.90		
520L01 H.J. HEINZ COMPANY 6.428% 20201201	900,000.00	904,950.00		
536E00 HSBC Holdings plc 6.5% 20360502	2,600,000.00	2,646,898.80		
536L00 Wells Fargo & Company 5.95% 20361215	3,600,000.00	3,925,800.00		
	1,200,000.00	1,201,083.60		

特殊債券 計

社債券

870204	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-ARI 1A2 5.7% 20340319	163,784.32	164,073.26	
870212	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-AR3 1A2 5.64% 20340719	60,318.23	60,382.87	
870216	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 5 A 5.7% 20261019	141,019.53	141,068.20	
870237	WASHINGTON MUTUAL 2003-R1 A1 5.62% 20271225	3,880,026.46	3,879,442.12	
870248	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES, INC. 2004-SD1 A1 5.52% 20421225	18,741.60	18,741.60	
870254	WASHINGTON MUTUAL 2005-ARI A1A 5.67% 20450125	312,333.81	313,626.77	
870255	WASHINGTON MUTUAL 2005-AR2 2A1A 5.66% 20450125	309,640.39	310,334.20	
870256	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2005-2 2A1 5.67% 20350325	334,411.16	335,783.91	
870258	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-3 2A1 5.64% 20350425	280,506.27	281,365.12	
870278	MASTR SEASONED SECURITIES TRUST 2005-1 2A1 6.19847% 20170925	664,037.08	675,711.05	
870279	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2005-3 2A2A 4.68066% 20350825	2,340,660.09	2,305,844.63	
870283	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2003-11 1A11 4.75% 20181025	1,769,750.47	1,717,157.37	
870286	BANC OF AMERICA MORTGAGE SECURITIES 2004-4 1A9 5% 20340525	3,399,487.27	3,344,790.87	
870287	GMAC MORTGAGE CORPORATION LOAN TRUST 2004-J4 A1 5.5% 20340925	2,626,397.25	2,607,044.11	
870291	PNC MORTGAGE ACCEPTANCE CORP 2000-C2 A1 7.05% 20331012	27,699.96	27,741.55	
870292	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2005- OPT3 A2 5.46% 20351125	576,747.83	577,156.68	
870293	6SR MORTGAGE LOAN TRUST 2005-AR6 2A1 4.53973% 20350925	2,562,970.26	2,520,381.12	
870294	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 2005-4 2A1 4.08181% 20350420	317,829.05	311,779.77	
870298	SACO I INC 2005-8 A2 5.46% 20351125	58,286.88	58,324.35	
870299	FIRST HORIZON ALTERNATIVE MORTGAGE SECURITIES 2004-AA1 A1 4.75242% 20340625	37,263.01	37,050.30	
870301	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 3A2A 5.25% 20360220	1,275,898.88	1,286,007.21	
870302	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 5A1 5.25% 20360220	1,213,785.57	1,208,986.38	
870303	CS FIRST BOSTON MORTGAGE SECURITIES CORP 2005-CN2A A1S 5.57% 20191115	298,363.64	298,550.83	
870305	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENT INC 2005-AR8 A1 5.63% 20350225	1,582,400.21	1,585,117.50	
870306	SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC TRUST 2005-FR4 A2A 5.47% 20360125	142,200.25	142,200.25	
870307	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2005-AHL2 A1 5.45% 20351025	119,962.29	119,962.29	
870310	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-FRE1 A2 5.42% 20350525	541,736.57	542,126.44	
870311	GSAMP TRUST 2006-SD1 A1 5.47% 20351225	93,671.69	93,671.69	
870312	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORPORATION 2005-S7 A1 5.48% 20351225	153,575.76	153,575.76	

870313	COMMERCIAL MORTGAGE PASS THROUGH CERTIFICATES 2006-CN2A A2FL 5.54% 20190205	3,700,000.00	3,708,973.98	
870314	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-OA1 2A1 5.56% 20460401	3,135,061.05	3,139,256.70	
870315	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR2 2A1 4.95% 20360325	1,821,028.30	1,801,403.07	
870316	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS3 A11 5.42% 20360425	2,489,850.45	2,491,986.49	
870317	MORGAN STANLEY CAPITAL I 2006-NC2 A2A 5.42% 20360225	3,663,833.23	3,666,469.71	
870318	RESIDENTIAL ACCREDIT LOANS INC 2006- 003 A1 5.56% 20460425	4,019,797.87	4,012,093.12	
870319	MORGAN STANLEY HOME EQUITY LOANS 2006- 2 A1 5.42% 20360225	59,932.97	59,932.97	
870320	LEHMAN XS TRUST 2006-4N A1A 5.43% 20460425	2,876,619.72	2,878,446.37	
870321	OPTION ONE MORTGAGE LOAN TRUST 2005-4 A2 5.45% 20351125	1,517,145.43	1,517,145.43	
870322	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-RM1 A2A 5.42% 20370225	419,262.51	419,262.51	
870323	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-RS1 A11 5.43% 20360125	1,968,189.41	1,968,189.41	
870324	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006- OPT2 A1 5.42% 20360525	40,070.92	40,101.35	
870325	FREMONT HOME LOAN TRUST 2006-1 2A1 5.41% 20360425	1,093,422.13	1,094,164.89	
870326	ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY 2006-HE3 A3 5.41% 20360325	2,326,817.04	2,328,514.68	
870328	MASTR ADJUSTABLE RATE MORTGAGES TRUST 2004-4 4A1 5.1923% 20340525	2,769,680.65	2,764,935.35	
870329	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2006-AR3 12A1 5.57% 20350925	3,877,952.88	3,883,560.39	
870330	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR8 1A1 5.22693% 20360420	1,965,410.29	1,976,281.94	
870331	MORGAN STANLEY CAPITAL I 2006-HE2 A2A 5.42% 20360325	63,007.51	63,050.80	
870333	CARRINGTON MORTGAGE LOAN TRUST 2006- RF1 A1 5.39% 20360525	1,810,800.65	1,812,043.76	
870335	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-RM2 A2A 5.35% 20370525	4,797,713.73	4,801,051.01	
870336	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2006-FF7 2A1 5.38% 20360525	3,793,244.20	3,795,854.33	
870337	SLM STUDENT LOAN TRUST 2004-4 A3 5.46688% 20131025	630,777.85	630,777.85	
870338	BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES 2006-BB7 A1 5.46% 20190315	5,100,000.00	5,103,159.45	
870339	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-EFC1 A1 5.43% 20360225	2,596,617.17	2,595,805.72	
870340	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-8 2A1 5.38% 20460125	5,504,373.10	5,508,207.99	
870341	CARRINGTON MORTGAGE LOAN TRUST 2006- FRE1 A1 5.415% 20360725	3,076,154.65	3,078,185.52	
870342	SLC STUDENT LOAN TRUST 2006-1 A1 5.33% 20101215	888,269.94	888,425.65	
870343	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2006-NC1 A2A 5.42% 20360825	3,768,180.84	3,770,759.02	
870344	NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-2 A2A 5.42% 20360825	3,572,450.37	3,574,911.78	

870345	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS5 A1 5.42% 20360625	3,727,981.50	3,730,554.92	
870346	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-HY12 A1 6.19621% 20360625	4,589,905.47	4,632,350.62	
870347	LEHMAN XS TRUST 2006-10N 1A1A 5.43% 20360625	4,122,457.00	4,124,826.36	
870348	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1 5.9191% 20360820	15,479,868.00	15,626,496.40	
870349	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-13 3AV1 5.4% 20370125	4,362,184.86	4,367,145.96	
870351	LEHMAN BROTHERS FLOATING RATE COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2006-L1FA A1 5.43% 20210915	4,928,262.53	4,931,292.42	
870353	THORNBERG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-5 A1 5.44% 20360625	5,316,145.18	5,309,018.35	
870354	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A2 5.37% 20360825	4,789,812.47	4,792,851.60	
870355	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006- EQ1 A1 5.37% 20360901	5,785,522.79	5,789,617.77	
870356	BEAR STEARNS ALT-A TRUST 2006-6 32A1 5.83952% 20361025	5,359,018.78	5,361,590.57	
870357	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-15 A1 5.46% 20361025	5,314,383.17	5,338,387.70	
870358	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-4 A11 5.47% 20351225	3,758,859.74	3,758,859.74	
870359	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A1A 5.58% 20351025	6,897,040.06	6,903,506.03	
870360	ACE SECURITIES CORP 2006-NC1 A2A 5.42% 20351225	645,360.39	645,360.39	
870361	AMERIQUE MORTGAGE SECURITIES INC 2006-RI A2A 5.43% 20360325	398,307.03	398,307.03	
870362	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES INC 2006-EC2 A1 5.42% 20360225	206,599.48	206,594.91	
870363	CENTEX HOME EQUITY 2006-A AV1 5.4% 20360625	737,474.84	737,244.37	
870364	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2006-FF1 2A1 5.44% 20360125	2,143,704.60	2,143,704.60	
870365	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2006-FFH1 A1 5.42% 20360125	987,078.82	987,078.82	
870366	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2005-OPT1 A3 5.56% 20350625	4,786,336.01	4,792,318.93	
870367	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I 2006-WMC2 A2A 5.39% 20360725	1,098,831.78	1,098,488.39	
870368	RESIDENTIAL ACCREDIT LOANS INC 2005- RQ1 A1 5.65% 20350825	4,939,419.07	4,947,291.51	
870369	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORP 2005- WF4 A2 5.43% 20351125	4,578,640.07	4,578,640.07	
870370	ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2006-OPT1 A3A 5.36% 20360925	1,623,198.78	1,622,691.52	
870371	ACCREDITED MORTGAGE LOAN TRUST 2006-2 A1 5.39% 20360925	1,117,889.01	1,117,539.66	
870372	ACE SECURITIES CORP 2006-HE1 A2A 5.43% 20360225	723,196.74	723,196.74	
870373	ARGENT SECURITIES INC 2005-W4 A1A1 5.47% 20360225	374,457.62	374,457.62	
870374	ARGENT SECURITIES INC 2006-W3 A2A 5.42% 20360425	710,478.07	710,478.07	

870375	ARGENT SECURITIES INC 2006-W2 A2A 5.37% 20360925	885,524.42	885,247.69	
870376	ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2004-OPT5 A1 5.7% 20340625	1,170,691.14	1,172,520.34	
870377	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-3 2A1 5.42% 20360625	858,542.27	858,542.27	
870378	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-4 2A1 5.42% 20360725	503,066.56	503,066.56	
870379	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-5 2A1 5.42% 20360825	870,380.97	870,108.97	
870380	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-6 2A1 5.42% 20360925	1,225,870.42	1,225,870.42	
870381	GSAMP TRUST 2006-S2 A1A 5.42% 20360125	690,681.95	690,681.95	
870382	INDYMAC RESIDENTIAL ASSET BACKED TRUST 2006-C 3A1 5.39% 20360825	953,588.01	953,290.01	
870383	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-FRE2 A2 5.42% 20360225	296,149.96	296,057.41	
870384	LEHMAN XS TRUST 2006-11 A1 5.4% 20460625	2,080,462.22	2,079,812.07	
870385	MASTR ASSET BACKED SECURITIES TRUST 2006-HE1 A1 5.43% 20360125	658,754.43	658,754.43	
870386	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS9 A11 5.42% 20361125	5,466,163.34	5,470,071.10	
870387	ACE SECURITIES CORP 2006-NC1 A2B 5.5% 20351225	250,000.00	250,078.12	
870388	ARGENT SECURITIES INC 2006-W1 A2A 5.43% 20360325	176,900.56	176,900.56	
870389	ARGENT SECURITIES INC 2006-W4 A2A 5.41% 20360525	596,066.18	596,066.18	
870390	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2005-16 4AV1 5.45% 20360525	404,772.65	404,772.65	
870391	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-1 AFI 5.48% 20360725	212,889.01	212,889.01	
870392	HOME EQUITY MORTGAGE TRUST 2006-1 A1A1 5.44% 20360525	582,714.40	582,714.40	
870393	FREMONT HOME LOAN TRUST 2005-E 2A2 5.52% 20360125	300,000.00	300,093.75	
870394	GSAMP TRUST 2006-S1 A2A 5.44% 20351125	125,588.99	125,588.99	
870395	GSR MORTGAGE LOAN TRUST 2005-HE1 A2A 5.43% 20301125	190,702.42	190,702.42	
870396	HSI ASSET SECURITIZATION CORP TRUST 2006-OPT1 2A1 5.43% 20351225	494,189.97	494,189.97	
870397	HOME EQUITY ASSET TRUST 2005-8 2A1 5.46% 20360225	177,429.44	177,429.44	
870398	INDYMAC RESIDENTIAL ASSET BACKED TRUST 2006-D 2A1 5.37% 20361125	1,316,805.11	1,316,393.60	
870399	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-HE1 A2A 5.43% 20361225	231,834.54	231,834.54	
870400	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-RS6 A1 5.39% 20361125	5,191,543.34	5,194,838.41	
870401	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-BM1 A1 5.43% 20360125	127,125.08	127,125.08	
870402	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-NC1 A1 5.43% 20360125	147,033.30	147,033.30	
870403	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006- WF1 A1A 5.42% 20361025	5,231,548.90	5,235,252.31	
870404	STRUCTURED ASSET INVESTMENT LOAN TRUST 2005-11 A4 5.44% 20360125	289,053.74	289,053.74	

870405	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2005-FF3 A1 5.43% 20350425	109,401.89	109,401.89	
870406	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC1 A2 5.42% 20360325	554,700.66	554,527.30	
870407	GSAMP TRUST 2006-HE7 A2A 5.36% 20461125	5,451,959.14	5,454,961.53	
870408	ACE SECURITIES CORP 2006-ASP4 A2A 5.37% 20360825	1,157,563.04	1,157,201.30	
870409	INDYMAC INDEX MORTGAGE LOAN TRUST 2006-AR14 1A1A 5.44% 20461125	5,323,893.63	5,326,397.45	
870410	STRUCTURED ASSET SEC CORP 2006-11 A1 5.33439% 20351025	2,852,040.00	2,840,545.41	
870411	ACE SECURITIES CORP 2006-HE4 A2A 5.38% 20361025	284,645.83	284,556.87	
870412	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-R24 A1A 5.4% 20361025	283,702.92	283,614.26	
870413	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS7 A1 5.37% 20360925	269,847.44	269,763.11	
870414	SPECIALTY UNDERWRITING & RESIDENTIAL FINANCE 2006-BC1 A2A 5.43% 20361225	776,778.91	776,778.91	
870415	ARKLE MASTER ISSUER PLC 2006-1A 1A 5.33% 20071119	5,700,000.00	5,702,680.71	
870417	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-CH1 A2 5.37% 20281125	5,228,987.10	5,231,886.57	
870418	THORNBERG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-6 A1 5.43% 20111125	5,850,203.35	5,846,400.71	
870419	HSI ASSET SECURITIZATION CORP TRUST 2006-HE2 2A1 5.4% 20361225	5,916,207.59	5,906,966.47	
870420	DALLMER CHRISLER AUTO TRUST 2006-D A1 5.32938% 20071208	5,147,569.46	5,151,845.53	
870422	INDYMAC INDEX MORTGAGE LOAN TRUST 2006-AR8 A1A 5.43% 20460725	577,288.25	577,550.05	
870423	CITIBANK CREDIT CARD ISSUANCE TRUST 2003-A4 A4 5.435% 20090320	800,000.00	800,000.00	
870424	HONDA AUTO RECEIVABLES OWNER TRUST 2006-1 A2 5.1% 20080918	353,563.86	353,121.90	
870425	HONDA AUTO RECEIVABLES OWNER TRUST 2006-2 A2 5.42% 20081222	400,000.00	400,000.00	
870426	MENA CREDIT CARD MASTER NOTE TRUST 2002-B4 B4 5.85% 20100315	900,000.00	902,812.50	
870427	SLM STUDENT LOAN TRUST 2006-9 A1 5.34476% 20121025	900,000.00	899,718.75	
870428	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-WF2 A2A 5.41% 20361225	6,800,000.00	6,809,590.72	
870429	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2005-14 2A1 5.53% 20350525	338,882.96	339,364.37	
870430	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2004-16 1A4A 5.73% 20340925	29,300.23	29,389.12	
870431	HYUNDAI AUTO RECEIVABLES TRUST 2006-B A1 5.3476% 20071115	1,049,012.72	1,048,029.26	
870432	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-3 A12 5.59% 20351125	900,000.00	901,406.25	
870433	SUSQUHANNA AUTO LEASE TRUST 2006-1 A1 4.99092% 20070416	33,215.35	33,597.66	
870434	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-NL1 A1 5.38% 20361125	800,000.00	799,750.00	
870435	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-2 A1 5.42% 20360325	247,147.96	247,147.96	

870436	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2005-A A 5.52% 20350425	42,396.17	42,396.17	
870437	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2005-AR10 2A12 4.10896% 20350625	400,000.00	396,929.40	
870438	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2004-HE 2A1 3.9889% 20341225	150,205.20	147,248.90	
870439	SAXON ASSET SECURITIES TRUST 2006-3 A1 5.38% 20361125	727,675.22	727,447.82	
870440	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORP 2006-BC3 A2 5.37% 20361025	742,227.50	741,995.55	
870441	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2004-12 12A1 4.73755% 20340825	383,608.15	379,481.17	
870442	HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST 2004-11 A1A 5.7% 20350119	379,301.54	381,089.90	
870443	MASTR ASSET BACKED SECURITIES TRUST 2005-NC2 A1 5.46% 20351125	615,420.82	615,420.82	
870444	GS MORTGAGE SECURITIES CORP II 1998-C1 A2 6.62% 20301018	326,700.61	330,882.86	
870445	AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT TRUST 2004-3 5A 4.29% 20341025	138,851.40	136,424.13	
870446	FREMONT HOME LOAN TRUST 2006-C 2A1 5.37% 20361025	959,636.00	959,336.11	
870447	SPECIALTY UNDERWRITING & RESIDENTIAL FINANCE 2006-BC2 A2A 5.41% 20370225	3,164,599.67	3,163,610.73	
870448	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A12 5.59% 20351025	3,000,000.00	3,003,750.00	
870449	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-NC2 A1 5.43% 20360225	91,321.02	91,321.02	
870450	MORGAN STANLEY HOME EQUITY LOANS 2006-2 A2 5.46% 20360225	100,000.00	99,968.75	
870451	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-25 2A1 5.39% 20460125	6,000,000.00	6,006,490.20	
870452	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2006-WF3 A2 5.45% 20361025	100,000.00	99,968.75	
870453	GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR8 1A1A 5.43% 20470125	5,900,000.00	5,902,314.57	
870454	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A3 5.43% 20360825	100,000.00	99,968.75	
870455	ARRAN RESIDENTIAL MORTGAGES FUNDING PLC 2006-1A A1B 5.37% 20360412	4,230,094.58	4,228,773.52	
870456	ACE SECURITIES CORP 2006-FM2 A2A 5.37% 20360825	183,757.02	183,699.59	
870457	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I 2006-HE4 A1 5.39% 20360625	274,504.83	274,419.04	
社債券 計		395,653,870.44	396,415,912.46	
アメリカドル 計		785,465,721.57	783,252,191.47	
(邦貨換算額)		(93,808,171,127)	(93,543,809,224)	

カナダドル (単位:カナダドル)			
種 類	銘柄	券面総額	評価額
国債証券	325F00 カナダ国債 9% 20250601	600,000.00	972,240.00
国債証券 計		600,000.00	972,240.00
地方債証券	431F00 Province of Ontario 6.2% 20310602	1,700,000.00	2,114,120.00
地方債証券 計		1,700,000.00	2,114,120.00
社債券	511L00 Rogers Cable Inc 7.25% 20111215	300,000.00	324,390.00
社債券 計		300,000.00	324,390.00
カナダドル 計		2,600,000.00	3,410,750.00
(邦貨換算額)		(263,822,000)	(346,088,803)

外貨建有的価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	国債証券 22銘柄	20.9	14.0
アメリカドル	特殊債券 22銘柄	28.4	19.0
アメリカドル	社債券 194銘柄	50.7	33.9
カナダドル	国債証券 1銘柄	28.5	0.1
カナダドル	地方債証券 1銘柄	62.0	0.2
カナダドル	社債券 1銘柄	9.5	0.0
イギリスポンド	国債証券 6銘柄	100.0	11.7
ユーロ	国債証券 26銘柄	98.1	20.7
ユーロ	特殊債券 1銘柄	0.8	0.2
ユーロ	社債券 4銘柄	1.1	0.2

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

(単位:イギリスポンド)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	307L01 イギリス国債 7.25% 20071207	340,000.00	345,746.00	
	309C00 イギリス国債 4% 20090307	5,800,000.00	5,656,740.00	
	310F00 イギリス国債 4.75% 20100607	5,100,000.00	5,035,230.00	
	311C00 イギリス国債 4.25% 20110307	12,500,000.00	12,108,750.00	
	314I00 イギリス国債 5% 20140907	5,700,000.00	5,734,770.00	
	315I00 イギリス国債 4.75% 20150907	42,280,000.00	41,984,040.00	
	国債証券 計		71,720,000.00	70,865,276.00
イギリスポンド 計		71,720,000.00	70,865,276.00	
(邦貨換算額)		(16,583,815,600)	(16,386,177,769)	

(単位:ユーロ)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	304D00 フランス国債 5.5% 20200425	2,800,000.00	3,336,200.00		
	308A01 スペイン国債 6% 20080131		0.52	0.53	
	308B01 フィンランド国債 6% 20080425	336,375.00	344,639.73		
	309G01 ドイツ国債 4.5% 20090704	2,100,000.00	2,127,510.00		
	309G02 ドイツ国債 4% 20090704	2,300,000.00	2,304,370.00		
	310G00 ドイツ国債 5.25% 20100704	1,800,000.00	1,875,060.00		
	311G00 ドイツ国債 5% 20110704	6,400,000.00	6,668,800.00		
	311I00 スペイン国債 5.35% 20111031	3,400,000.00	3,600,260.00		
	312A00 ドイツ国債 5% 20120104	800,000.00	837,040.00		
	312G02 ドイツ国債 5% 20120704	9,800,000.00	10,289,020.00		
	312I00 フランス国債 4.75% 20121025	3,000,000.00	3,118,500.00		
	313G02 ドイツ国債 3.75% 20130704	300,000.00	296,310.00		
	313I00 オーストリア国債 3.8% 20131020	200,000.00	198,000.00		
	314A00 ドイツ国債 4.25% 20140104	8,000,000.00	8,129,600.00		
	314G01 ドイツ国債 4.25% 20140704	16,900,000.00	17,182,230.00		
	315A01 ドイツ国債 3.75% 20150104	7,900,000.00	7,774,390.00		
	327070 ドイツ国債 6.5% 20270704	9,900,000.00	13,072,950.00		
	328010 ドイツ国債 5.625% 20280104	30,804,215.00	37,100,596.54		
	328070 ドイツ国債 4.75% 20280704	4,600,000.00	4,993,760.00		
	330A00 ドイツ国債 6.25% 20300104	34,650,000.00	45,221,715.00		
	331A00 ドイツ国債 5.5% 20310104	9,500,000.00	11,412,350.00		
	332G00 スペイン国債 5.75% 20320730	800,000.00	993,200.00		
	332I00 フランス国債 5.75% 20321025	3,600,000.00	4,485,240.00		
	334G00 ドイツ国債 4.75% 20340704	200,000.00	219,680.00		
	335D00 フランス国債 4.75% 20350425	100,000.00	109,550.00		
	355D00 フランス国債 4% 20550425	1,100,000.00	1,074,590.00		
	国債証券 計		161,290,590.52	186,765,561.80	
	特殊債券	フランス鉄道線路公社 (RFF) 5.25% 20100414	1,500,000.00	1,551,900.00	
	特殊債券 計		1,500,000.00	1,551,900.00	
	社債券	509I00 France Telecom SA 7% 20091223	200,000.00	215,170.00	
		510A00 DEPPA Deutsche Pfandbriefbank AG 5.5% 20100115	1,500,000.00	1,558,500.00	
		870004 DUTCH MBS BV IX A 3.884% 20770702	116,048.51	116,255.77	
		870006 Delphinus BV 2002-I A1 3.776% 20920425	270,022.00	270,608.48	
		社債券 計		2,086,070.51	2,160,534.25
	ユーロ 計		164,876,661.03	190,477,996.05	
(邦貨換算額)		(25,536,097,260)	(29,501,232,028)		
総合計		(136,191,905,987)	(139,777,307,824)		
総合計		136,191,905,987	139,777,307,824		

(注) 総合計の()内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、前中間計算期間(平成18年1月11日から平成18年7月10日まで)の中間財務諸表については、中央青山監査法人による中間監査を受けており、当中間計算期間(平成19年1月11日から平成19年7月10日まで)の中間財務諸表については、あらた監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

平成18年8月29日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

中央青山監



指定社員 公認会計士
業務執行社員

藤間義雄

指定社員 公認会計士
業務執行社員

鳥飼裕一

当監査法人は、証券取引法第193条の2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GW7つの卵の平成18年1月11日から平成18年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、GW7つの卵の平成18年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成18年1月11日から平成18年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

独立監査人の中間監査報告書

平成19年8月21日

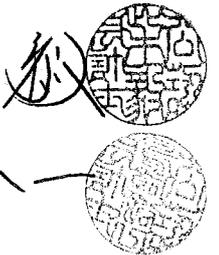
日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

代表社員 公認会計士
業務執行社員

業務執行社員 公認会計士

蔡
鳥飼裕一



当監査法人は、証券取引法第193条の2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GW7つの卵の平成19年1月11日から平成19年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間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、我が国におけ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。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する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、GW7つの卵の平成19年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成19年1月11日から平成19年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(1)【中間貸借対照表】

科目	期別	(単位：円)	
		前中間計算期間末 平成18年7月10日現在	当中間計算期間末 平成19年7月10日現在
資産の部		金額	金額
流動資産			
金銭信託		828,710,530	-
コール・ローン		10,117,489,428	10,739,414,892
新投資信託受益証券		588,683,710,853	635,245,508,966
未収入金		-	680,000,000
流動資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858
資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858
負債の部			
流動負債			
未払金		500,000,000	-
未払解約金		528,675,264	1,176,867,552
未払委託者報酬		125,505,466	163,772,315
未払委託者報酬		4,392,693,349	5,732,033,207
その他未払費用		3,616,063	4,534,467
流動負債合計		5,550,490,142	7,077,207,541
負債合計		5,550,490,142	7,077,207,541
純資産の部			
元本等		526,330,278,011	556,282,022,518
剰余金		37,749,142,658	83,305,693,799
(うち配準備積立金)		(-)	(-)
剰余金合計		37,749,142,658	83,305,693,799
元本等合計		564,079,420,669	639,587,716,317
純資産合計		564,079,420,669	639,587,716,317
負債・純資産合計		569,629,910,811	646,664,923,858

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

科目	期別	(単位：円)	
		前中間計算期間 自平成18年7月10日 至平成18年7月10日	当中間計算期間 自平成19年1月11日 至平成19年7月10日
営業収益		金額	金額
受取利息		163,745	19,281,760
有価証券売買等損益		2,343,247,207	52,805,086,649
その他収益		126,241	-
営業収益合計		2,342,957,221	52,824,368,409
営業費用			
委託者報酬		125,505,466	163,772,315
委託者報酬		4,392,693,349	5,732,033,207
その他費用		3,616,063	4,534,467
営業費用合計		4,521,814,878	5,900,339,989
営業利益金額		6,864,772,099	46,924,028,420
経常利益金額		-	-
経常損失金額		6,864,772,099	-
中間純利益金額		-	46,924,028,420
中間純損失金額		6,864,772,099	-
中間一部解約に伴う中間純利益金額分配額		88,040,013	2,881,821,878
期首剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789
剰余金増加額		25,670,594,432	8,010,045,387
(中間一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(-)
(中間追加信託に伴う剰余金増加額)		(25,670,594,432)	(8,010,045,387)
剰余金減少額		1,715,551,788	5,469,977,919
(中間一部解約に伴う剰余金減少額)		(1,715,551,788)	(5,469,977,919)
(中間追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(-)
分配金		-	-
中間剰余金		37,749,142,658	83,305,693,799

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	期 別	前中間計算期間 自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	当中間計算期間 自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。		親投資信託受益証券
			同左

(中間貸借対照表に関する注記)

	前中間計算期間末 平成18年7月10日現在	当中間計算期間末 平成19年7月10日現在
1. 期首元本額	257,741,764,372 円	546,981,478,249 円
期中追加設定元本額	289,092,086,311 円	88,825,671,754 円
期中解約元本額	20,503,571,672 円	79,525,127,485 円
中間計算期間末日における 2. 受益権の総口数	526,330,278,011 口	556,282,022,518 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

	前中間計算期間 自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	当中間計算期間 自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	998,840,196 円	1,254,874,735 円

(1 口当たり情報)

	前中間計算期間末 平成18年7月10日現在	当中間計算期間末 平成19年7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,0717 円 (10,717 円)	1口当たり純資産額 1,1498 円 (11,498 円)

(参考)

当ファンドは「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科 目	対象年月日	平成18年7月10日現在		平成19年7月10日現在	
		注記 番号	金 額	金 額	金 額
資産の部					
流動資産					
コール・ローン			2,245,928,703		2,617,348,293
株式			175,830,759,600		208,691,492,300
派生商品評価勘定			-		4,614,800
未収入金			1,971,273,572		-
未収配当金			24,602,400		53,956,980
差入委託証拠金			-		17,110,000
流動資産合計			180,072,564,275		211,384,522,373
資産合計			180,072,564,275		211,384,522,373
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			-		280,475
前受金			-		5,250,000
未払金			1,752,632,774		-
未払解約金			11,000,000		103,388,929
流動負債合計			1,763,632,774		108,919,404
負債合計			1,763,632,774		108,919,404
純資産の部					
元本等			111,142,799,914		113,993,046,701
剰余金					
剰余金			67,166,131,587		97,282,556,268
剰余金合計			67,166,131,587		97,282,556,268
元本等合計			178,308,931,501		211,275,602,969
純資産合計			178,308,931,501		211,275,602,969
負債・純資産合計			180,072,564,275		211,384,522,373

(単位：円)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価値額（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は、時価が認められなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた場合もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価値で評価しております。	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価値額（ただし、売買相場は使用しない）又は価格提供会社の提示する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合は、時価が認められなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた場合もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法		デリバティブ取引 受取配当金の計上基準 個別法に基づき原則として時価で評価しております。	デリバティブ取引 受取配当金の計上基準 個別法に基づき原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日に、その金額が確定しているものについては、当該金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
3. 収益及び費用の計上基準		受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日に、その金額が確定しているものについては、当該金額を計上し、残額については入金時に計上しております。	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日に、その金額が確定しているものについては、当該金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1.	<p>期首 63,463,471,328 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 48,119,488,773 円</p> <p>期首からの解約元本額 440,160,187 円</p> <p>平成18年7月10日現在の元本の内訳</p> <p>GW7つの卵 91,677,390,364 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 415,914 円</p> <p>ス安定型 744,117,327 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 1,321,667,831 円</p> <p>ス安定成長型 8,432,065,535 円</p> <p>ス成長型 3,582,874,129 円</p> <p>ス積成長型 3,616,057,480 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 1,137,090,758 円</p> <p>ス積成長型 29,276,084 円</p> <p>ス超積成長型 84,363,337 円</p> <p>日本大型株式ファンド 102,043,193 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定成長型) 211,371,761 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型) 204,076,201 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積成長型) (合計) 111,142,799,914 円</p> <p>2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該積投資信託の受益権の総数</p>	<p>期首 112,921,306,554 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 4,739,569,224 円</p> <p>期首からの解約元本額 3,667,829,077 円</p> <p>平成19年7月10日現在</p> <p>1. 期首 84,648,912,672 円</p> <p>期首からの追加設定元本額 437,084 円</p> <p>期首からの解約元本額 693,813,205 円</p> <p>平成19年7月10日現在の元本の内訳</p> <p>GW7つの卵 84,648,912,672 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 437,084 円</p> <p>ス安定型 693,813,205 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 1,509,373,332 円</p> <p>ス安定成長型 10,058,396,413 円</p> <p>ス成長型 4,317,355,281 円</p> <p>ス積成長型 3,913,090,461 円</p> <p>グローバル・ラップ・バラン 7,258,494,423 円</p> <p>ス超積成長型 734,994,226 円</p> <p>ス積成長型 31,663,169 円</p> <p>日本大型株式ファンド 83,897,819 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定型) 122,227,442 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型) 332,629,075 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積成長型) 287,772,099 円</p> <p>年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積成長型) (合計) 113,993,046,701 円</p> <p>2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該積投資信託の受益権の総数</p>

当該積投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(平成18年7月10日現在)

該当事項はありません。

区分	種類	平成19年7月10日現在		
		契約額等	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	514,720,000	519,100,000	4,380,000
	合計	514,720,000	519,100,000	4,380,000

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

1. 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います。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(1口当たり情報)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,6043 円	1口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(16,043 円)	(1万口当たり純資産額)
		1,8534 円
		(18,534 円)

2. 「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成18年7月10日現在		平成19年7月10日現在	
		注記番号	金額	金額	金額
資産の部					
流動資産					
コール・ローン			1,539,548,321		2,353,945,540
株式			73,882,168,950		80,884,397,420
未収入金			195,902,989		99,585,999
未収配当金			29,192,220		31,786,020
流動資産合計			75,646,812,460		83,369,714,979
資産合計			75,646,812,460		83,369,714,979
負債の部					
流動負債					
未払金			336,678,480		581,733,375
未払隣約金			-		1,314,163
流動負債合計			336,678,480		583,047,538
負債合計			336,678,480		583,047,538
純資産の部					
元本等					
元本			31,358,160,860		36,063,744,961
剰余金					
剰余金			43,951,973,120		46,722,922,480
剰余金合計			43,951,973,120		46,722,922,480
元本等合計			75,310,133,980		82,786,667,441
純資産合計			75,310,133,980		82,786,667,441
負債・純資産合計			75,646,812,460		83,369,714,979

(単位：円)

3. 「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	(単位：円)	
		平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
資産の部	注記番号	金額	金額
流動資産			
コール・ローン		1,470,718,584	1,150,994,323
国債証券		46,014,992,325	49,702,180,000
地方債証券		5,691,252,519	7,218,788,209
特殊債券		7,561,801,550	8,762,549,178
社債券		16,289,159,622	24,910,867,756
未収入金		102,500,000	4,987,800,000
未収利息		149,495,650	219,897,341
前払費用		61,829,410	55,843,256
流動資産合計		77,341,749,660	97,008,920,063
資産合計		77,341,749,660	97,008,920,063
負債の部			
流動負債			
未払金		691,040,000	4,910,750,000
流動負債合計		691,040,000	4,910,750,000
負債合計		691,040,000	4,910,750,000
純資産の部			
元本等			
元本		74,733,715,022	88,013,624,223
剰余金			
剰余金		1,916,994,638	4,084,645,840
剰余金合計		1,916,994,638	4,084,645,840
元本等合計		76,650,709,660	92,098,170,063
純資産合計		76,650,709,660	92,098,170,063
負債・純資産合計		77,341,749,660	97,008,920,063

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自 平成18年7月10日 至 平成18年7月10日	自 平成18年1月11日 至 平成19年7月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	対象期間	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売買配相場の使用しない）又は価格提供会社の提示する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が認められない場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額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は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融機関の提示する価額（ただし、売買配相場の使用しない）又は価格提供会社の提示する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が認められない場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成18年7月10日 至 平成19年1月11日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所に掲げる計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、赤気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価値もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価値で評価しております。	株式及び投資証券は移動平均法、社債券は移動平均法(ただし購入後最初の利払日以前は個別法)に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、赤気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、赤気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価値のいずれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券
2. デリバティブ等の評価基準及び為替予約取引の評価方法	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	為替予約取引 受取配当金の計上基準
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基外貨建取引等の重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

1. 期首	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1. 期首	48,477,604,275 円	88,105,696,555 円
期首からの追加設定元本額	39,550,999,630 円	18,663,324,586 円
期首からの解約元本額	170,113,825 円	5,911,258,235 円
平成18年7月10日現在の元本の内訳		平成19年7月10日現在の元本の内訳
GW7つの卵	72,375,198,785 円	75,235,821,178 円
グローバル・ラップ・バラン	402,088 円	482,540 円
ス安定型		
グローバル・ラップ・バラン	645,546,682 円	645,139,417 円
ス安定成長型		
グローバル・ラップ・バラン	1,146,920,136 円	1,399,491,864 円
ス成長型		
グローバル・ラップ・バラン	6,875,341,228 円	8,988,831,315 円
ス積極成長型		
グローバル・ラップ・バラン	2,969,401,864 円	3,869,347,883 円
ス積極型		
グローバル・ラップ・バラン	2,789,849,873 円	3,094,435,390 円
ス超積極型		
北米株式ファンド	546,645,376 円	6,474,739,633 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	27,914,127 円	372,376,916 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	75,640,106 円	32,476,549 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	78,579,506 円	76,440,780 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	165,961,317 円	112,518,162 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	161,088,992 円	288,625,763 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン		257,035,516 円
(合計)	87,858,490,080 円	100,847,762,906 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該投資信託の受益権の総数	87,858,490,080 口	100,847,762,906 口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

区分	種類	平成18年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建	168,801,662	168,555,430	246,232
	カナダドル	168,801,662	168,555,430	246,232
	買建	271,801,662	271,701,555	100,107
	アメリカドル	271,801,662	271,701,555	100,107
合計	440,603,324	440,256,985	146,125	

(単位：円)

区分	種類	平成19年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建	500,000,000	499,635,213	364,787
	アメリカドル	500,000,000	499,635,213	364,787
	合計	500,000,000	499,635,213	364,787

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の對顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
 計算期間末日において当該日の對顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 ・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 ・計算期間末日に当該日を超える對顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている對顧客先物相場の仲値を用います。
2. 計算期間末日に對顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の對顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,135円	1口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(11,351円)	(1万口当たり純資産額)
		1,4629円
		(14,629円)

5. 「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成18年7月10日現在		平成19年7月10日現在	
		注記番号	金額	金額	金額
資産の部					
流動資産					
預金			141,318,483		199,250,804
コール・ローン			3,354,128,373		507,667,704
株式			89,269,766,040		136,515,678,931
投資証券			2,084,388,745		1,087,761,049
未収入金			-		5,678,221,730
未収配当金			188,682,984		289,884,608
流動資産合計			95,018,284,625		144,278,464,826
資産合計			95,018,284,625		144,278,464,826
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			-		1,580,652
未払金			-		4,195,143,206
未払解約金			107,700,000		359,882,207
流動負債合計			107,700,000		4,556,606,065
負債合計			107,700,000		4,556,606,065
純資産の部					
元本等					
元本			51,912,224,407		53,176,614,078
剰余金					
剰余金			42,998,360,218		86,545,244,663
剰余金合計			42,998,360,218		86,545,244,663
元本等合計			94,910,584,625		139,721,858,761
純資産合計			94,910,584,625		139,721,858,761
負債・純資産合計			95,018,284,625		144,278,464,826

(単位：円)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成18年7月10日 至 平成19年1月11日	自 平成18年7月10日現在 至 平成19年1月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所に掲げる計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買配相場は使用しない)又は、売買取引相場の提供している価額のいずれかから入ります。</p> <p>(3) 時価が入りできなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託業者が恣意義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券</p> <p>証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所に掲げる計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売買配相場は使用しない)又は、売買取引相場の提供している価額のいずれかから入ります。</p> <p>(3) 時価が入りできなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託業者が恣意義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>受取配当金は計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>	<p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>受取配当金は計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準
	<p>「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

1. 期首	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
期首元本額	26,439,944,000 円	48,928,939,986 円
期首からの追加設定元本額	25,995,805,346 円	8,102,174,632 円
期首からの解約元本額	523,524,939 円	3,854,500,540 円
	平成18年7月10日現在の元本の内訳	平成19年7月10日現在の元本の内訳
	GW7つの卵	GW7つの卵
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス安定型	ス安定型
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス安定成長型	ス安定成長型
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス成長型	ス成長型
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス積極成長型	ス積極成長型
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス積極型	ス積極型
	グローバル・ラップ・パラン	グローバル・ラップ・パラン
	ス超積極型	ス超積極型
	欧州先進国株式ファンド	欧州先進国株式ファンド
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(積極成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(積極成長型)
	欧州先進国株式ファンド	欧州先進国株式ファンド
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(安定成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(積極成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス(積極成長型)
	(合計)	(合計)
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該投資信託の受益権の総数	51,912,224,407 円	53,176,614,078 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該投資信託の受益権の総数	51,912,224,407 口	53,176,614,078 口

当該投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(平成18年7月10日現在)

該当事項はありません。

(通貨関連)

区分	種類	平成19年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場	為替予約取引			
取引	取	1,159,167,708	1,160,748,360	1,580,652
以外	スライフラン	-	1,160,748,360	1,580,652
取引	合計	1,159,167,708	1,160,748,360	1,580,652

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

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

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

・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。

・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。

2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在	
1口当たり純資産額	1,8283 円	1口当たり純資産額	2,6275 円
(1万口当たり純資産額)	(18,283 円)	(1万口当たり純資産額)	(26,275 円)

6. 「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科目	対象年月日 注記 番号	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		180,457,315	33,127,844
コール・ローン		452,891,796	224,468,359
株式		34,772,213,681	45,909,779,502
投資証券		336,492,577	682,514,400
派生商品評価勘定		93,245	396,945
未収入金		-	227,997,755
未収配当金		36,363,886	54,635,610
流動資産合計		35,778,512,490	47,132,920,415
資産合計		35,778,512,490	47,132,920,415
負債の部			
流動負債			
未払金		-	66,026,867
未払解約金		-	313,313,526
流動負債合計		-	379,340,393
負債合計		-	379,340,393
純資産の部			
元本			
元本等		13,659,439,650	10,985,662,937
剰余金			
剰余金		22,119,072,840	35,767,917,085
剰余金合計		22,119,072,840	35,767,917,085
元本等合計		35,778,512,490	46,753,580,022
純資産合計		35,778,512,490	46,753,580,022
負債・純資産合計		35,778,512,490	47,132,920,415

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所に掲げる計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、売買相場の使用しない)又は、売買取引相場の提供する価値のいづれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が恣意義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所に掲げる計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準値で評価しております。 (2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価値(ただし、売買相場の使用しない)又は、売買取引相場の提供する価値のいづれかから入手した価値で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が恣意義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引
3. 収益及び費用の計上基準	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取相場の仲値で評価しております。 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。	「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1. 期首	9,927,467,676 円	12,796,318,061 円
期首元本額	4,252,097,452 円	59,864,412 円
期首からの追加設定元本額	520,125,478 円	1,870,519,536 円
期首からの解約元本額		
平成18年7月10日現在の元本の内訳		平成19年7月10日現在の元本の内訳
GW7つの卵	10,746,288,513 円	7,862,833,255 円
グローバル・ラップ・バラ	52,578 円	46,483 円
グロス 安定型		
グローバル・ラップ・バラ	98,085,110 円	68,095,580 円
グロス 安定成長型		
グローバル・ラップ・バラ	186,356,662 円	153,782,079 円
グロス 成長型		
グローバル・ラップ・バラ	1,142,199,983 円	993,372,282 円
グロス 積極成長型		
グローバル・ラップ・バラ	520,251,223 円	454,516,636 円
グロス 積極型		
グローバル・ラップ・バラ	683,257,068 円	523,424,958 円
グロス 超積極型		
アジア太平洋先進国株式ファンド	198,824,959 円	698,590,813 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定型)	3,623,616 円	146,937,941 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定成長型)	11,426,572 円	2,851,307 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス(成長型)	15,202,164 円	8,134,215 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極成長型)	25,275,444 円	12,356,108 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極型)	28,595,758 円	30,258,599 円
(合計)	13,659,439,650 円	10,985,662,937 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の繰越	13,659,439,650 円	10,985,662,937 円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成18年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引以外の取引	為替予約取引			93,245
	売建 オーストラリアドル	22,887,539 22,887,539	22,794,294 22,794,294	93,245 93,245
	合計	22,887,539	22,794,294	93,245

区分	種類	平成19年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引以外の取引	為替予約取引			396,945
	売建 アメリカドル オーストラリアドル	208,994,882 10,961,725 198,033,157	208,597,937 10,928,920 197,669,017	396,945 32,805 364,140
	合計	208,994,882	208,597,937	396,945

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1口当たり純資産額	2,6193 円	1口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(26,193 円)	(1万口当たり純資産額)
		4,2559 円
		(42,559 円)

7. 「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成18年7月10日現在		平成19年7月10日現在	
		注記番号	金額	金額	金額
資産の部					
流動資産					
預金			4,337,312,192		5,095,815,428
コール・ローン			1,395,189,088		1,025,708,422
国債証券			57,510,685,832		65,736,594,823
地方債証券			-		229,737,691
社債証券			19,247,087,709		35,924,751,526
社債券			22,132,271,197		42,619,862,664
コモディティ・ペーパー			20,760,123,169		9,637,339,665
派生商品評価勘定			872,626,500		978,709,104
未収入金			865,662,740		27,923,136,747
未収利息			757,671,215		1,303,950,810
前払費用			125,149,043		158,006,949
差入委託証拠金			995,532,633		1,073,209,238
流動資産合計			128,999,321,328		191,706,823,067
資産合計			128,999,321,328		191,706,823,067
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			345,465,131		427,406,875
未払金			10,874,657,256		60,428,680,537
未払解約金			-		30,247,882
流動負債合計			11,220,122,387		60,886,335,294
負債合計			11,220,122,387		60,886,335,294
純資産の部					
元本等					
元本			76,059,316,922		73,939,637,820
剰余金					
剰余金			41,719,882,019		56,880,849,953
剰余金合計			41,719,882,019		56,880,849,953
元本等合計			117,779,198,941		130,820,487,773
純資産合計			117,779,198,941		130,820,487,773
負債・純資産合計			128,999,321,328		191,706,823,067

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成18年1月11日 至 平成18年7月10日	自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券、社債券及びビコム・シャル・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されている有価証券は、原則として証券取引所における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は証券取引所が発表する基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託業者が恣実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券及びビコム・シャル・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 証券取引所に上場されている有価証券 証券取引所に上場されていない有価証券</p> <p>(2) 証券取引所に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(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間で評価しております。</p>	<p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1. 期首	平成18年7月11日	平成19年7月11日
期首元本額	41,180,184,178 円	76,792,032,001 円
期首からの追加設定元本額	35,018,137,510 円	1,620,787,766 円
期首からの解約元本額	139,004,766 円	4,473,181,947 円
	平成18年7月10日現在の元本の内訳	平成19年7月10日現在の元本の内訳
	GW7つの卵	GW7つの卵
	グローバル・ラップ・パランス 安定型	グローバル・ラップ・パランス 安定型
	グローバル・ラップ・パランス 安定成長型	グローバル・ラップ・パランス 安定成長型
	グローバル・ラップ・パランス 成長型	グローバル・ラップ・パランス 成長型
	グローバル・ラップ・パランス 積極成長型	グローバル・ラップ・パランス 積極成長型
	グローバル・ラップ・パランス 積極型	グローバル・ラップ・パランス 積極型
	海外債券ファンド	海外債券ファンド
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極成長型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極成長型)
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極型)	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極型)
	(合計)	(合計)
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該積投資信託の受益権の総数	76,059,316,922 円	73,939,637,820 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該積投資信託の受益権の総数	76,059,316,922 口	73,939,637,820 口

当該積投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

区分	種類	平成18年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	債券先物取引 買建	30,774,527,869	30,652,863,040	121,664,829
		-	-	-
合計		30,774,527,869	30,652,863,040	121,664,829

(単位：円)

区分	種類	平成19年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	債券先物取引 売建 買建	14,918,540,578	14,826,169,308	92,371,270
		16,361,998,078	16,146,206,430	215,791,648
合計		31,280,538,656	30,972,375,738	123,420,378

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

1. 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います。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(通貨関連)

区分	種類	平成18年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	為替予約取引 売建	63,385,332,915	62,727,034,109	668,298,806
		53,347,851,341	52,707,354,389	640,496,952
市場取引	アメリカドル イギリスポンド 買建	10,047,481,574	10,019,679,720	27,801,854
		60,825,023,915	60,805,551,307	19,472,608
市場取引	アメリカドル カナダドル 買建	10,047,481,574	9,996,492,517	50,989,057
		3,134,432,091	3,068,154,770	66,277,321
市場取引	オーストラリアドル スイスフラン 買建	501,468,583	506,573,760	5,105,177
		1,172,899,162	1,156,392,260	16,506,902
市場取引	スウェーデンクローナ シンガポールドル 買建	1,205,899,672	1,220,277,300	14,377,628
		281,087,401	278,258,800	2,828,601
市場取引	デンマーククローネ ノルウェークローネ 買建	1,109,651,219	1,108,519,440	1,131,779
		334,926,572	327,160,860	7,765,712
市場取引	ポーランドズロチ ユーロ	1,059,208,280	1,030,545,460	28,662,820
		41,977,969,361	42,113,176,140	135,206,779
合計		124,220,356,830	123,532,585,416	648,826,198

(単位：円)

区分	種類	平成19年7月10日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	為替予約取引 売建	65,242,724,809	65,084,215,765	158,509,044
		50,131,002,744	49,969,500,255	161,502,489
市場取引	アメリカドル イギリスポンド 買建	14,406,400,016	14,413,977,640	7,577,624
		705,322,049	700,737,870	4,584,179
市場取引	アメリカドル カナダドル 買建	65,463,899,522	65,980,113,065	516,213,563
		15,913,741,778	15,787,616,206	126,125,572
市場取引	オーストラリアドル スイスフラン 買建	3,344,401,185	3,374,405,080	30,003,895
		2,285,611,570	2,293,923,560	8,311,990
市場取引	スウェーデンクローナ シンガポールドル 買建	1,248,723,541	1,256,385,740	7,662,199
		2,745,273,933	2,814,863,940	69,590,007
市場取引	ニュージーランドドル デンマーククローネ 買建	1,197,839,807	1,222,798,439	24,958,632
		130,677,135	130,616,850	60,285
市場取引	デンマーククローネ ノルウェークローネ 買建	1,351,412,557	1,369,737,600	18,325,043
		1,098,552,031	1,133,744,040	35,192,009
市場取引	ポーランドズロチ ユーロ	2,151,276,332	2,221,118,590	69,842,258
		33,996,389,653	34,374,903,040	378,513,387
合計		130,706,624,331	131,064,328,850	674,722,607

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	平成18年7月10日現在	平成19年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,5485 円	1口当たり純資産額
(1万口当たり純資産額)	(15,485 円)	(1万口当たり純資産額)
		1,7693 円
		(17,693 円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成 19 年 7 月 31 日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	604,656,847,721 円
負債総額	1,418,069,362 円
純資産総額 (-)	603,238,778,359 円
発行済数量	552,161,765,797 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0925 円

(参考) 日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	207,986,558,716 円
負債総額	7,115,036,660 円
純資産総額 (-)	200,871,522,056 円
発行済数量	114,457,908,218 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.7550 円

(参考) 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	81,125,090,190 円
負債総額	535,336,358 円
純資産総額 (-)	80,589,753,832 円
発行済数量	36,280,952,016 口
1 単位当たり純資産額 (/)	2.2213 円

(参考) 日本債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	97,364,863,293 円
負債総額	4,539,060,503 円
純資産総額 (-)	92,825,802,790 円
発行済数量	88,082,532,062 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0539 円

(参考) 北米株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	135,949,318,675 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	135,949,318,675 円
発行済数量	99,869,530,368 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.3613 円

(参考) 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	125,374,007,001 円
負債総額	0 円
純資産総額 (-)	125,374,007,001 円
発行済数量	52,714,802,480 口
1 単位当たり純資産額 (/)	2.3783 円

(参考) アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	42,361,093,837 円
負債総額	76,404 円
純資産総額 (-)	42,361,017,433 円
発行済数量	10,753,715,765 口
1 単位当たり純資産額 (/)	3.9392 円

(参考) 海外債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	127,760,973,462 円
負債総額	323,707,942 円
純資産総額 (-)	127,437,265,520 円
発行済数量	73,076,888,020 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.7439 円

第 5 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第 1 計算期間	2,082,909,813	974,067,175
第 2 計算期間	87,363,652,509	2,796,396,521
第 3 計算期間	203,506,702,073	31,441,036,327
第 4 計算期間	380,068,619,701	90,828,905,824

(注) 第 1 計算期間の設定数量には、当初設定数量を含みます。

日興アセットマネジメントの照会先

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

☎ 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)



携帯サイトQRコード

日興アセットマネジメントの照会先

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/>

☎ 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)



携帯サイトQRコード