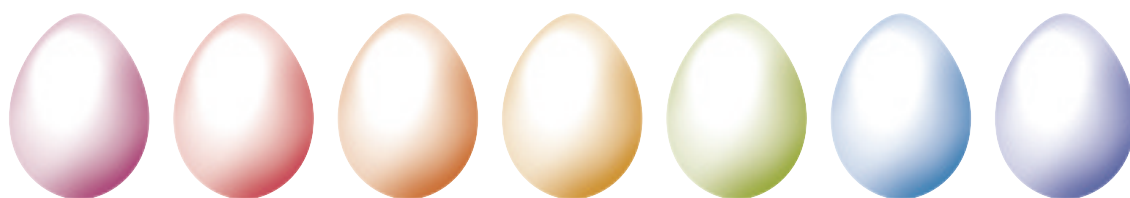


GW 7つの卵

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。

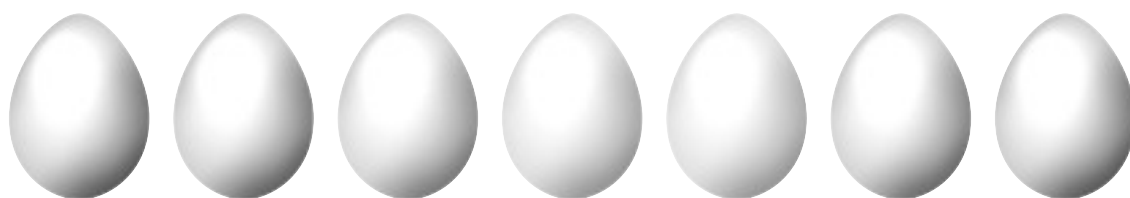


設定・運用は

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、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20年4月10日に関東財務局長に提出しており、平成20年4月11日にその効力が発生しております。

◆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*	・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

基本情報について

ファンドの概要	1
---------------	---

運用の内容について

ファンドの特色	3
投資方針	7
投資方針	
投資対象	
配分方針	
投資制限	
ファンドのリスク	16
ファンドの仕組み・体制	18
ファンドの仕組み	
運用体制・リスク管理体制	

手続きと費用について

取得申込み手続き	25
換金手続き	27
費用・税金	28

運営方法について

管理および運営	33
基準価額	
償還	
信託約款の変更	
異議の申立て	
公告	
その他	

運用の状況について

ファンドの運用状況	39
財務ハイライト情報	60

その他

約款	64
用語集	78

目次

基本情報

運用の内容

手続きと費用

運営方法

運用の状況

その他

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）／自動けいぞく投資適用 ※「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。
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」 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」 ▶ 詳しくは、後述の『投資対象』をご覧ください。
主な投資制限	・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ▶ 詳しくは、後述の『投資制限』をご覧ください。
主なリスク	・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 ▶ 詳しくは、後述の『ファンドのリスク』をご覧ください。
信託報酬	純資産総額に対し年率1.89%（税抜1.8%） ▶ 詳しくは、後述の『費用・税金』をご覧ください。
信託期間	無期限（平成15年2月28日設定） ▶ 詳しくは、後述の『償還』をご覧ください。
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。 ▶ 詳しくは、後述の『分配方針』をご覧ください。
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。

■ 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。

基本情報について

取得・換金（解約）に関して

取得・解約 取扱時間	原則として、販売会社の営業日の午後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
申込価額	取得申込受付日の翌営業日の基準価額
申込手数料	販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、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。 ・販売会社における申込手数料率は3.15%（税抜3%）が上限となっております。
申込単位	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。
申込代金の支払い	販売会社が指定する日までにお支払いください。
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額
解約手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
解約単位	1口単位 ※販売会社によって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。
解約代金の支払い	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。

主な用語の解説

●信託報酬（しんたくほうしゅう）

投資信託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。

●運用報告書（うんようほうこくしょ）

投資家に対して、運用状況（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）に関する情報を報告する書類のことです。

●信託財産留保額（しんたくざいさんりゅうほがく）

投資信託を解約される投資家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です。

➡ 本書で用いている専門的な用語については、後述の『用語集』をご覧ください。

ファンドの特色

1

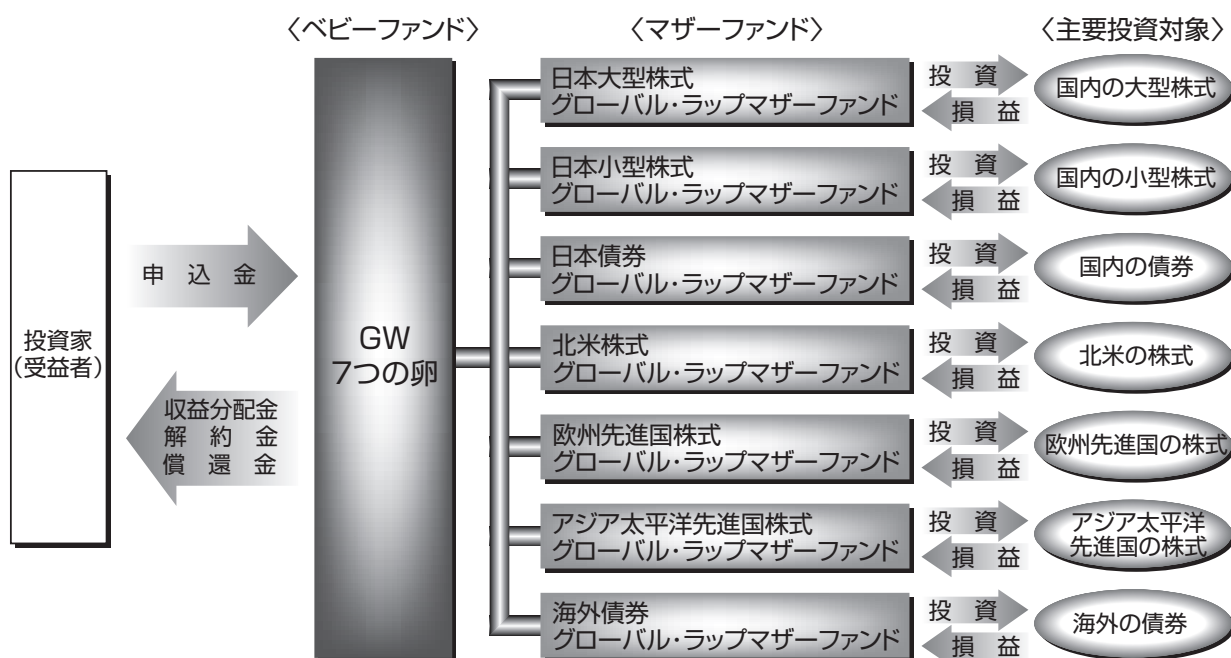
世界各国から7つの資産を選び、それぞれのスペシャリストが運用します。

・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）。

※¹ 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、リターンへの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。

※² “運用アドバイザー”は、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の中から、日興アセットマネジメントが決定します。



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。
- ◆資産配分の策定や、運用会社およびファンドの評価・選定など、国際分散投資に関する様々なサービスを提供しています。

運用の内容について

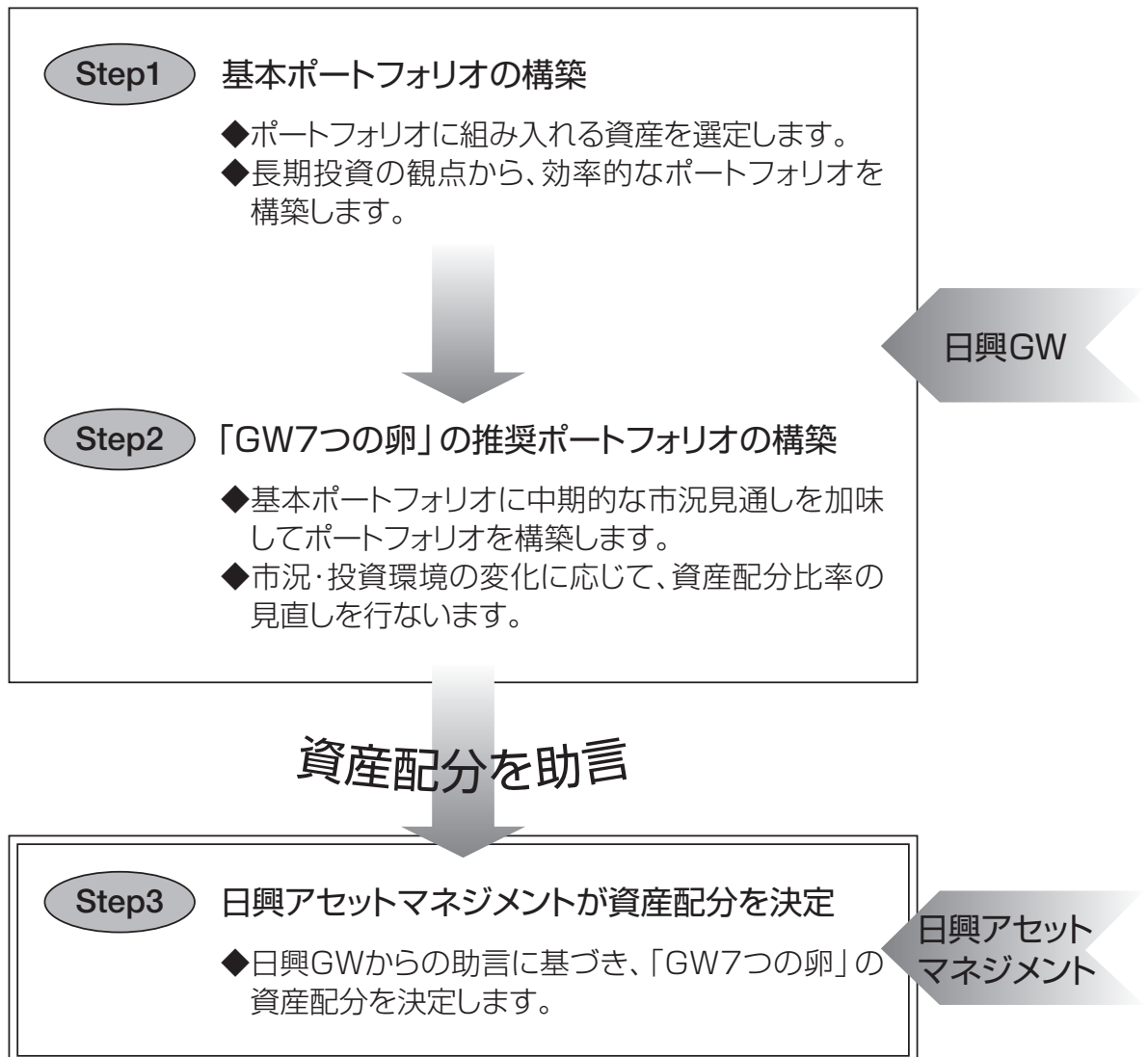
2

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>

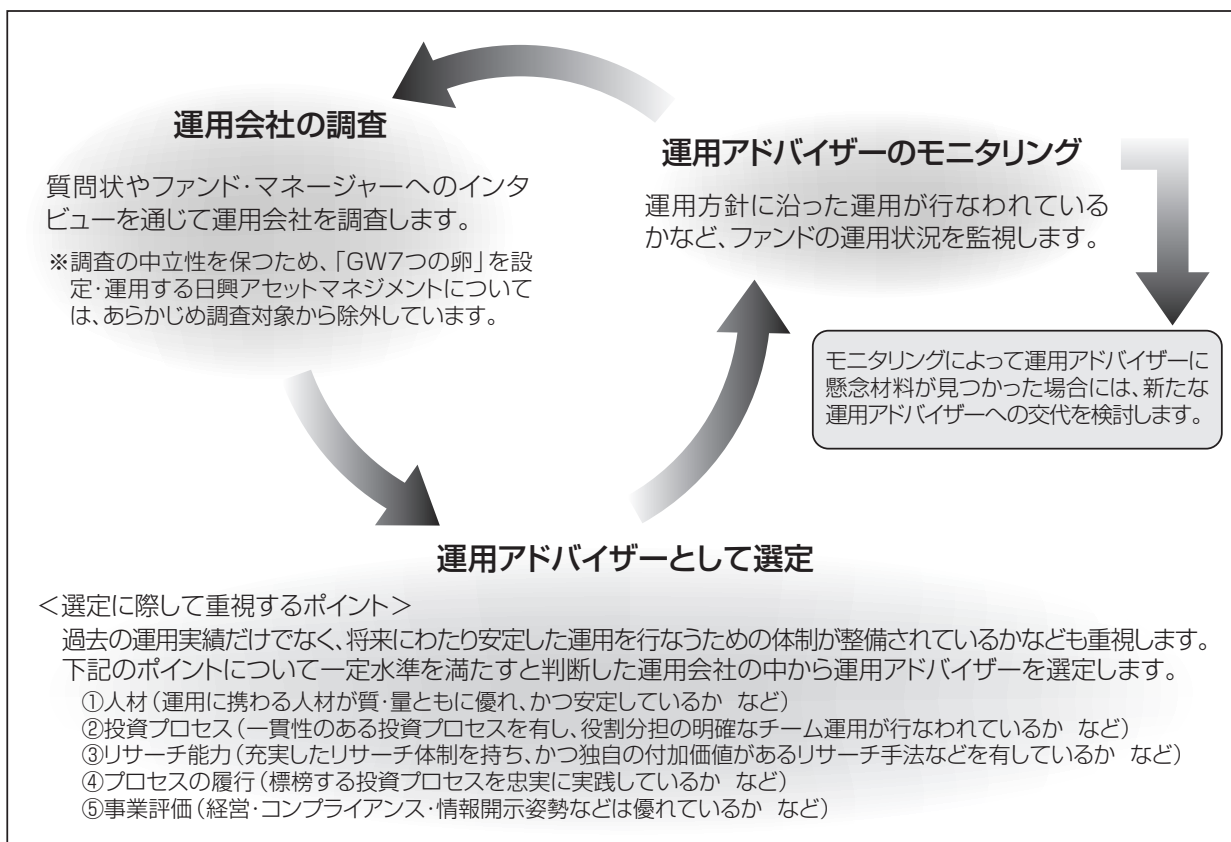


3

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。*
- *平成20年11月18日より、日興アセットマネジメントは、運用アドバイザーを決定するために、日興GWに加えて日興アセットマネジメント アメリカズ・インクから情報提供や助言を受ける予定です。

<日興GWのファンド・アナリストの業務>



※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。

日興アセットマネジメント アメリカズ・インクとは

- ◆日興アセットマネジメント アメリカズ・インクは、日興アセットマネジメント株式会社が100%出資する海外持株会社（日興米州ホールディング株式会社）の傘下にあるグローバル運用の米国拠点です。

運用の内容について

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20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・アセット・マネジメント株式会社	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	9%
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	18%
海外株式	北米株式 グローバル・ラップマザーファンド	*1 キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニー ＜平成20年11月18日以降＞ ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー	17%
	欧州先進国株式 グローバル・ラップマザーファンド	*2 UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社 ＜平成20年11月18日以降＞ MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド	15%
	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)	14%

*1 平成20年11月18日付で、キャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニーからジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに変更する予定です。

*2 平成20年11月18日付で、UBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社からMFSインターナショナル(U.K.)リミテッドに変更する予定です。

5

当ファンドならではの充実した情報提供サービス

- ①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。
- ②四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。
- ※①、②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。
- ③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」	9%
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」	18%
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」	17%
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」	15%
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」	14%

・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。

運用の内容について

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	・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	・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・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	・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	・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	組入有望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。

運用の内容について

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	・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	・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	・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	・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） <平成20年11月18日以降> ジャナス・キャピタル・マネジメント・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）

*MSCI北米インデックスは、MSCI Inc.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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.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。

運用の内容について

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	・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	・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) <平成20年11月18日以降> MFSインターナショナル(U.K.)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 欧州インデックスは、MSCI Inc.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なわずに日興GWが独自に円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.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。

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	・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	・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、MSCI Inc.が発表している、オーストラリア、香港など、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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.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、投資家がその発行株式に投資する形態をいいます。

運用の内容について

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	・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	・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	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	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、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

運用の内容について

ファンドのリスク

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。

■その他の留意事項

●システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

●解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有証券を大量に売却することがあります。その際に基準価額が大きく変動する可能性があります。

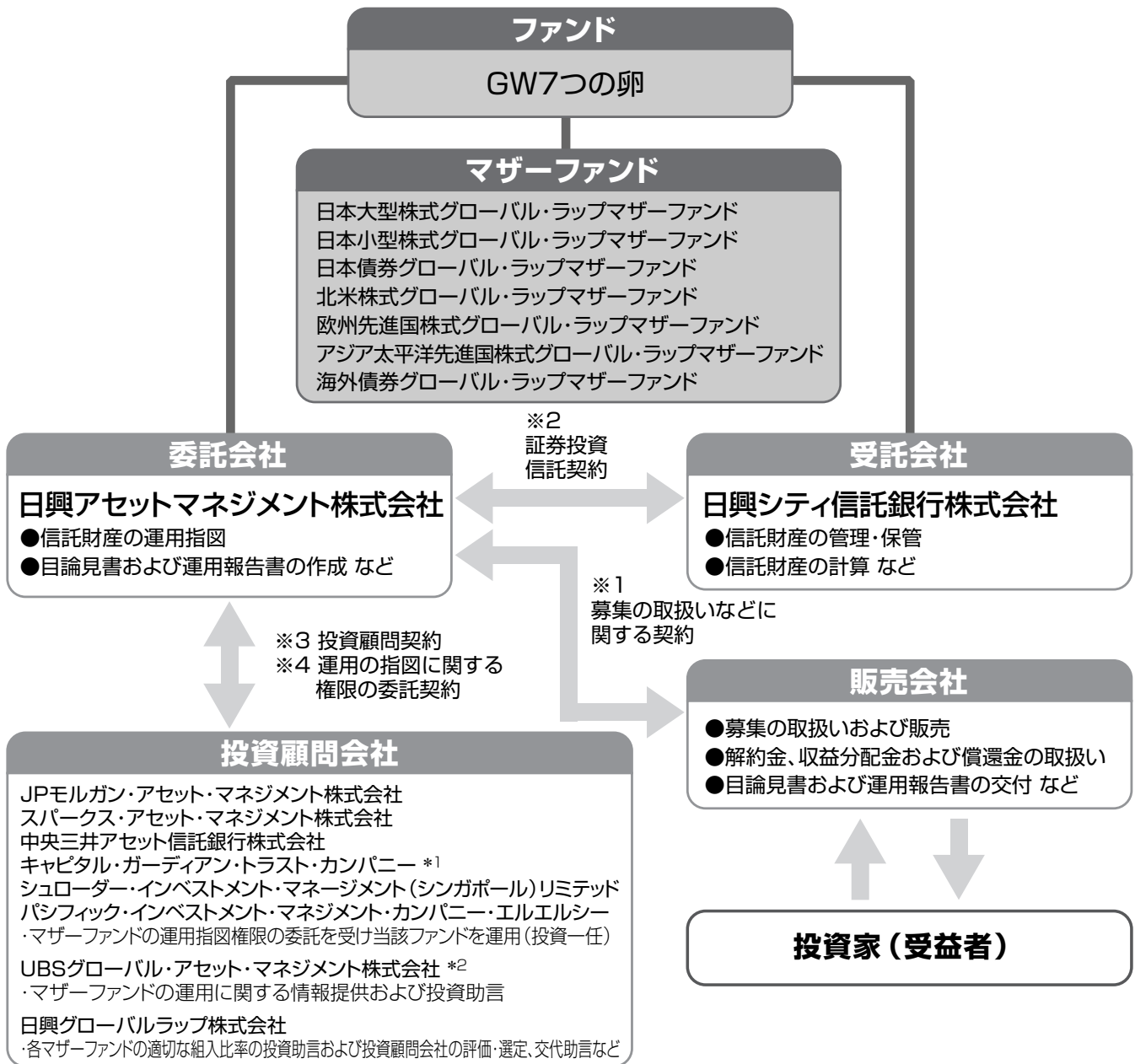
●法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

運用の内容について

ファンドの仕組み・体制

ファンドの仕組み



運用の内容

- *1 平成20年11月18日付で、「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」において、投資顧問会社をキャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニーからジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに変更する予定です。
- *2 平成20年11月18日付で、「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」において、投資顧問会社をUBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社からMFSインターナショナル(U.K.)リミテッドに変更するとともに、投資助言から投資一任の形態へ変更する予定です。

※平成20年11月18日より、日興アセットマネジメントは、運用アドバイザーを決定するために、日興GWに加えて日興アセットマネジメント アメリカズ・インクから情報提供や助言を受ける予定です。

- ※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。

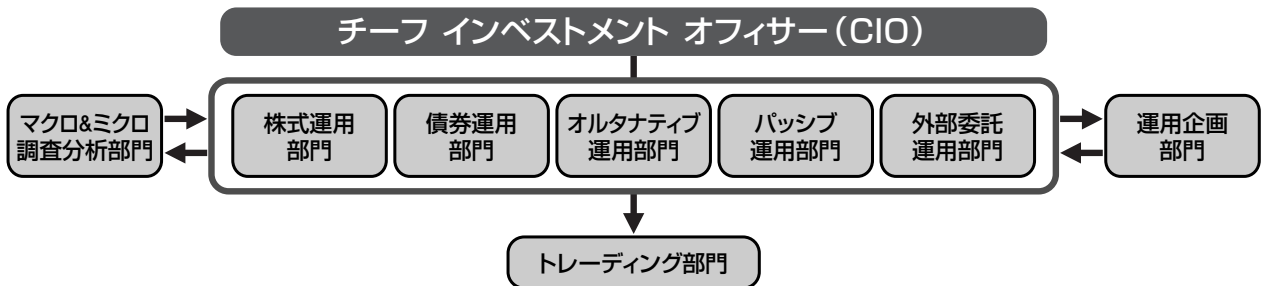
運用の内容について

運用体制・リスク管理体制

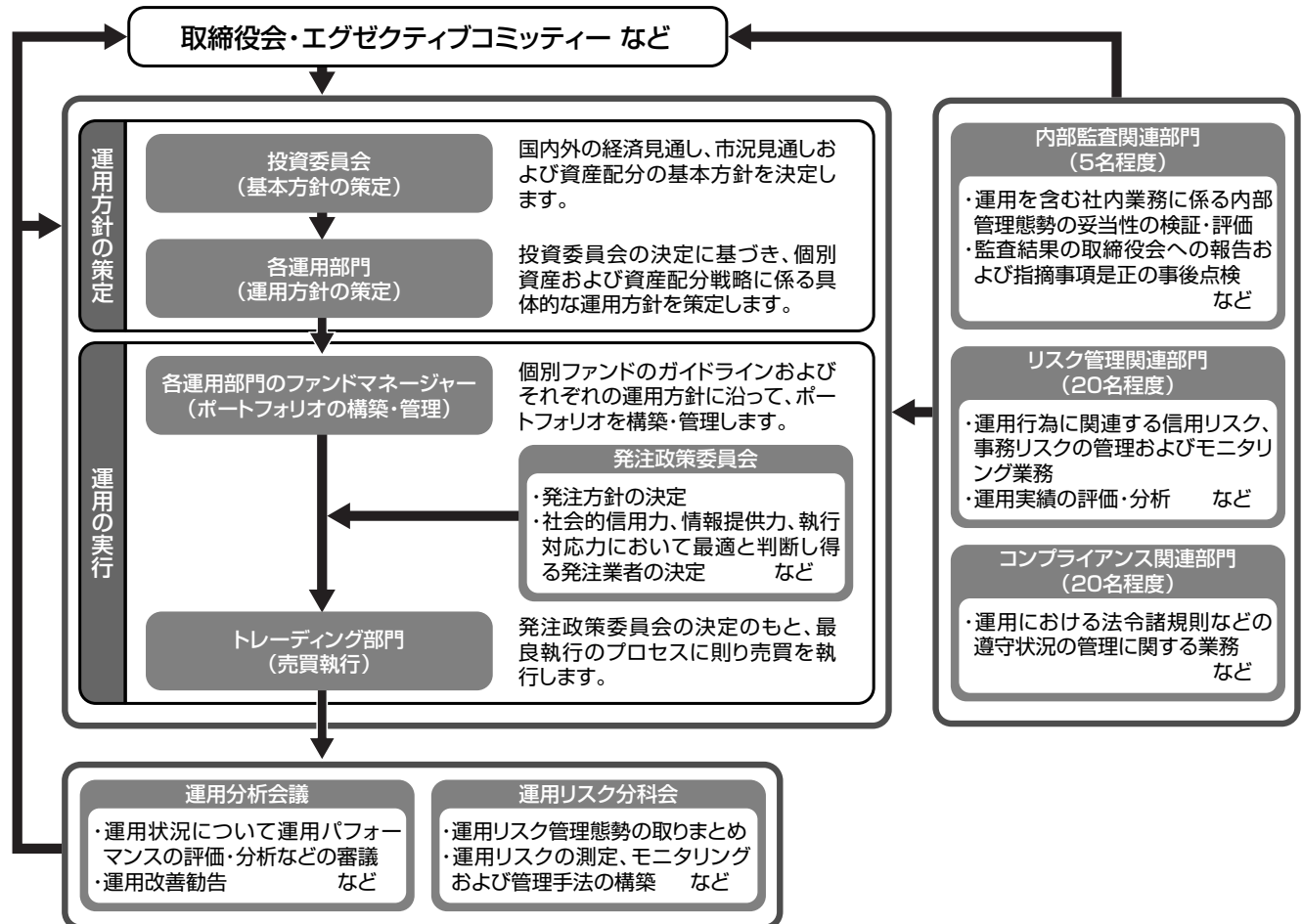
運用体制

＜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。

上記体制は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

◆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。

※以下の内容は、各社提供の情報に基づいて作成しています。

①「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・アセット・マネジメント株式会社に委託します。

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社は、世界有数の金融サービス会社であるJPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の日本拠点のひとつであり、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーの資産運用部門である「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループに属しています。同グループの運用総資産は約125兆円にのぼります（2008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。2008年6月末現在）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。

②「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28名のアナリスト（7名のファンドマネージャーを含みます。2008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。

③「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。2008年6月末現在の運用資産総額は約23兆円、うち日本債券の運用資産残高は約13兆円にのぼります。

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。

運用の内容について

④「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。

※平成20年11月18日付で、「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」において、投資顧問会社をキャピタル・ガーディアン・トラスト・カンパニーからジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに変更する予定です。

<ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー>

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー（ジャナス）は、米国デンバーに本拠を置く大手資産運用会社ジャナス・キャピタル・グループ（JCG）の中核企業です。JCGは約20.4兆円の運用資産総額を有し（2008年6月末現在）、個人および機関投資家のニーズに沿うべく、質の高い運用サービスのグローバルな提供に努めています。

ジャナスは、ボトムアップのファンダメンタル・アプローチによる、株式の成長性に着目したポートフォリオを構築します。徹底した個別企業リサーチに基づく運用プロセスによって銘柄選択を行ない、超過収益を追求します。銘柄選択の際は、持続可能な競争優位性を備え、ジャナスが適正と判断する価値よりも割安に評価されている銘柄を探索します。独自の詳細なリサーチと、強みを発揮できる分野に集中する意欲、そして顧客に対し長期の優れた運用成果をお届けするという責任感がジャナスを形成しています。

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27か国のオフィスに約3,800名超の従業員を擁し、2008年6月末現在、約79兆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。

※平成20年11月18日付で、「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」において、投資顧問会社をUBSグローバル・アセット・マネジメント株式会社からMFSインターナショナル（U.K.）リミテッドに変更するとともに、投資助言から投資一任の形態へ変更する予定です。

<MFSインターナショナル（U.K.）リミテッド>

MFSインターナショナル（U.K.）リミテッドは、米国に本拠を置くマサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニー（MFS）グループの英国法人です。MFSは1924年米国初のミューチュアル・ファンドの設定と共に創業した米国最古の資産運用会社で、発祥の地であるボストンの他、ロンドン・シンガポール・東京・シドニー・メキシコシティにリサーチ拠点を置くグローバルな運用会社として、世界中の投資家から約19兆円の運用資産を受託しています（2008年6月末現在）。

同社は、「企業の利益・キャッシュフローの持続的な成長こそが中長期的な株価上昇に繋がる」との信念のもと、独自のリサーチ活動を通じて、産業や個別企業について徹底したファンダメンタルズ分析を行なっています。業界平均以上の、かつ継続的に高い収益成長が期待できるクオリティの高い企業を発掘し、相対的に割安な株価水準でポートフォリオに組み入れるよう努めています。

- 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27.6兆円（2008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。

- ⑦「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・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・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（2008年6月末の運用資産は約88.3兆円）。

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。

- ◆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。

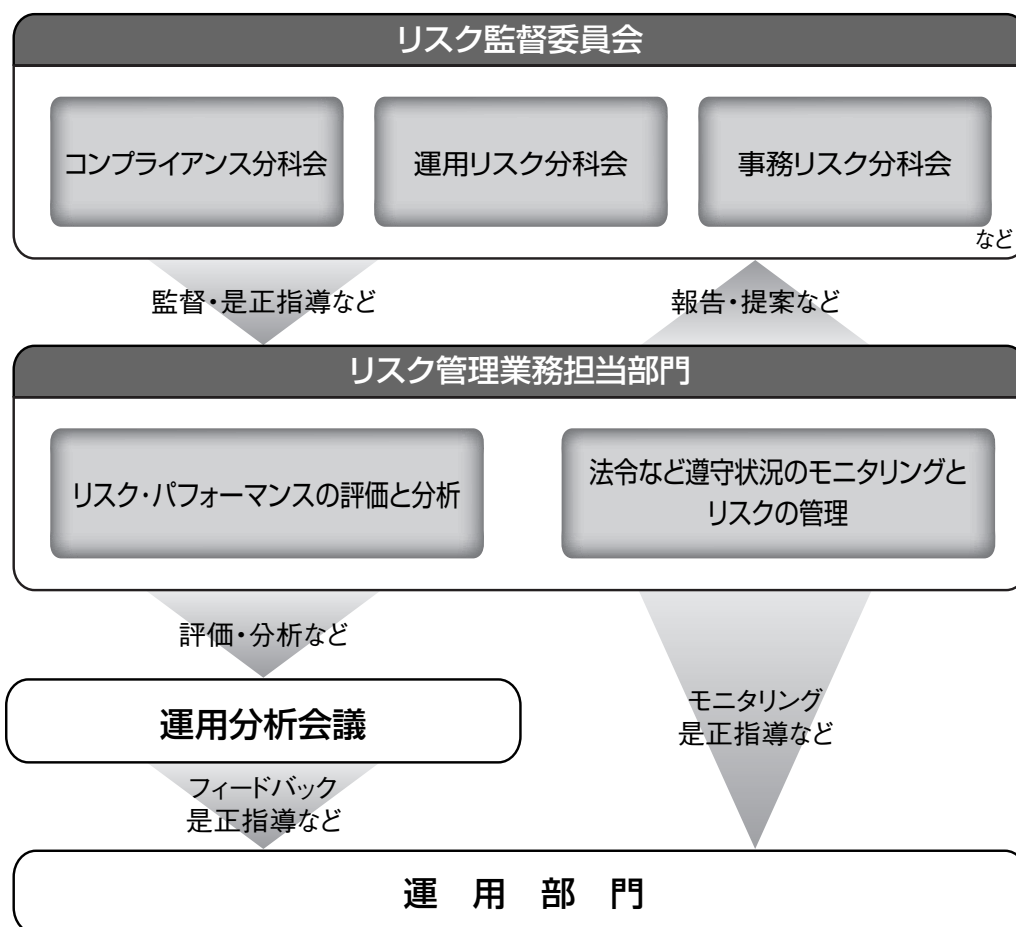
- ◆平成20年11月18日より、日興アセットマネジメントは、運用アドバイザーを決定するために、日興GWに加えて日興アセットマネジメント アメリカズ・インクから情報提供や助言を受ける予定です。

日興アセットマネジメント アメリカズ・インクは、運用会社に関する情報収集と評価分析をグローバルベースで実施可能な調査体制を有しており、運用会社調査に関しての豊かな経験と実績があります。

運用の内容について

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＞



■ 全社リスク管理

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。

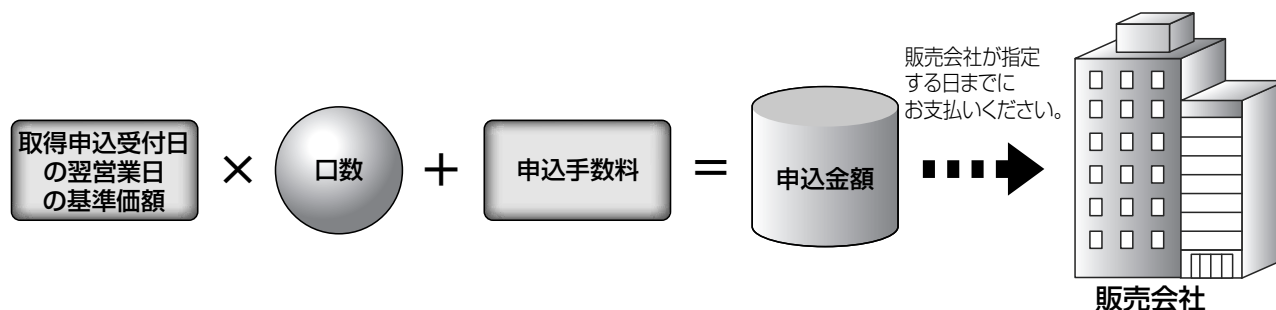
■ 法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

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。

上記体制は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

取得申込み手続き

<申込みについて(イメージ図)>



*申込手数料には消費税等相当額がかかります。

申込みの方法など	
申込方法	販売会社所定の方法でお申し込みください。
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…収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、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。 分配金受取りコース…収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
申込取扱場所	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。
申込みの時間など	
申込みの受付	販売会社の営業日に受け付けます。
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。
申込期間	平成20年4月11日から平成21年4月10日までとします。 ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

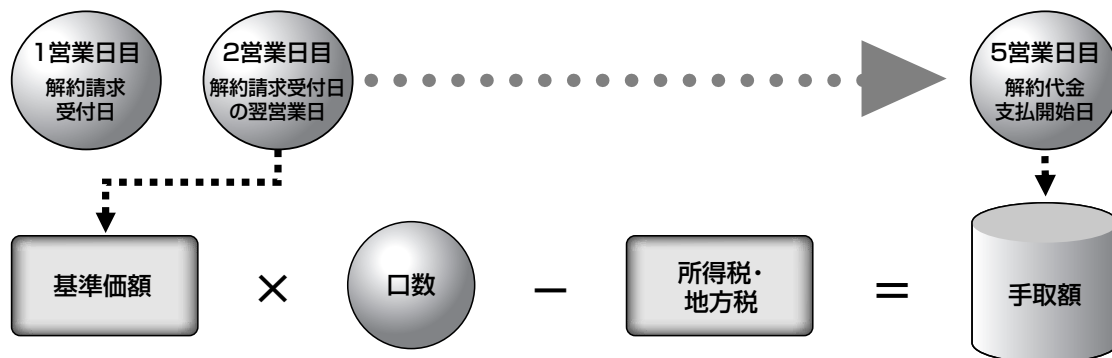
手続きと費用について

申込みの金額など	
申込価額	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。
申込手数料	販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、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。 ・販売会社における申込手数料率は3.15%（税抜3%）が上限となっております。 ・申込手数料の額（1口当たり）は、申込価額に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、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。
申込金額	申込価額に取得申込口数を乗じて得た額に、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。
申込単位	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。
申込代金の支払い	取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
その他	
受付の中止 および取消	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、取得の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申込みの受付を取り消すことができます。 ※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。

換金手続き

《解約請求による換金》

＜換金（解約）について（イメージ図）＞



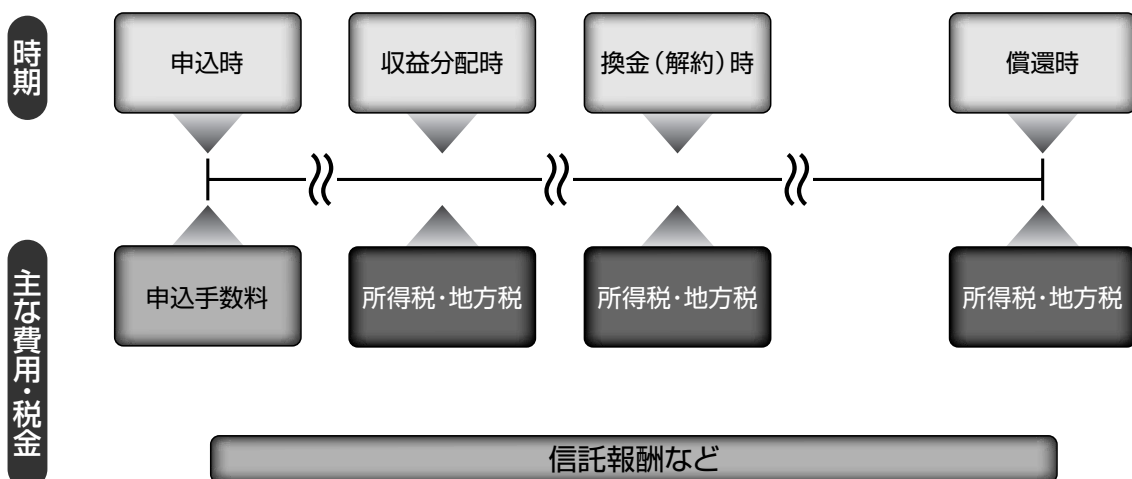
換金（解約）の時間など	
解約の受付	販売会社の営業日に受け付けます。
取扱時間	原則として、午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11時）までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
解約制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
換金（解約）の金額など	
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。 ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
解約手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
手取額	1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税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。詳しくは、後述の「費用・税金」をご覧ください。
解約単位	1口単位 ※販売会社によっては、解約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。
解約代金の支払い	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。
その他	
受付の中止および取消	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。

※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。

手続きと費用について

費用・税金

<ご負担いただく主な費用・税金の概要(イメージ図)>



*申込手数料・信託報酬などには、消費税等相当額がかかります。

《申込時、収益分配時、換金(解約)時などにご負担いただく費用・税金》

時期	項目	費用・税金
申込時	申込手数料 (1口当たり)	基準価額に対し3.15%(税抜3%)以内
収益分配時	所得税・地方税	<平成20年12月31日まで> 普通分配金に対し10%* <平成21年1月1日以降> 普通分配金に対し20%*
換金(解約)時 (解約請求)	換金(解約)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	<平成20年12月31日まで> 個別元本超過額に対し10%* <平成21年1月1日以降> 差益(譲渡益)に対し20%*
償還時	所得税・地方税	<平成20年12月31日まで> 個別元本超過額に対し10%* <平成21年1月1日以降> 差益(譲渡益)に対し20%*

*上記の税率は個人の場合であり、法人の場合については、後述の「課税上の取扱い」をご覧ください。なお、平成21年1月1日以降も2年間に限り、軽減税率が適用される場合があります。詳しくは、後述の「課税上の取扱い」をご覧ください。

※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。

※<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、申込手数料はかかりません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

※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、後述の「課税上の取扱い」をご覧ください。

《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・税金》

時期	項目	費用・税金																	
毎日	信託報酬	純資産総額に対し年率1.89％(税抜1.8％)																	
		・信託報酬の配分は、以下の通りとします。																	
		<table><tr><th rowspan="2">販売会社毎の 純資産総額</th><th colspan="4">信託報酬率(年率)</th></tr><tr><th>合計</th><th>委託会社</th><th>販売会社</th><th>受託会社</th></tr><tr><td>30億円以下の部分</td><td rowspan="2">1.8900％ (1.80％)</td><td>1.2075％ (1.15％)</td><td>0.6300％ (0.60％)</td><td rowspan="2">0.0525％ (0.05％)</td></tr><tr><td>30億円超の部分</td><td>1.1025％ (1.05％)</td><td>0.7350％ (0.70％)</td></tr></table>	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％)
		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信託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。																	
	監査費用	純資産総額に対し年率0.0084％(税抜0.008％)以内																	
随時	売買委託 手数料など	組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息など ・詳しくは、後述の「その他の費用などについて」をご覧ください。																	

※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。

■その他の費用などについて

＜売買委託手数料など＞

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。

- 1) 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
- 2) 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、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

〔投資対象とするマザーファンドに係る費用〕

- ・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

※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。

手続きと費用について

《課税上の取扱い》

個人受益者の場合

＜平成20年12月31日まで＞

1) 収益分配金、解約金、償還金の取扱い

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、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。

2) 買取請求の取扱い

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。

＜平成21年1月1日以降＞

1) 収益分配金に対する課税

- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は配当所得として、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます（原則として、確定申告不要。なお、確定申告により、総合課税または申告分離課税のいずれかを選択することも可能。）。
- ・ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間に限り、1年間に受け取る普通分配金を含む上場株式等の配当等（5%以上保有の大口個人株主等が受け取る配当等は除きます。）の合計額が100万円（年間1銘柄あたり1万円以下のものは除きます。）以下の場合、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます（原則として、確定申告不要）。なお、当該合計額が100万円を超える場合には確定申告が必要となり、申告分離課税を選択した場合、100万円を超える部分については20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。

2) 解約金および償還金に対する課税

- ・解約時および償還時の差益（譲渡益）は譲渡所得として、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要です。なお、「源泉徴収あり」の特定口座については、源泉徴収が行なわれます（原則として、確定申告不要）。
 - ・ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの2年間に限り、1年間の解約時および償還時の譲渡所得を含む上場株式等の譲渡所得等の合計額が500万円以下の場合、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。なお、当該合計額が500万円を超える場合には、「源泉徴収あり」の特定口座についても確定申告が必要となり、500万円を超える部分については20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。
- ※解約時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告により、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限り、）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）については、上場株式等の譲渡損と損益通算が可能です。
- ※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

・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。

・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。

※上記の7% (所得税のみ) の税率は、平成21年4月1日以降は15% (所得税のみ) の税率となります。

2) 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

1) 各受益者の買付時の基準価額 (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。

2) 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。

普通分配金と特別分配金

1) 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。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

イ) 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。

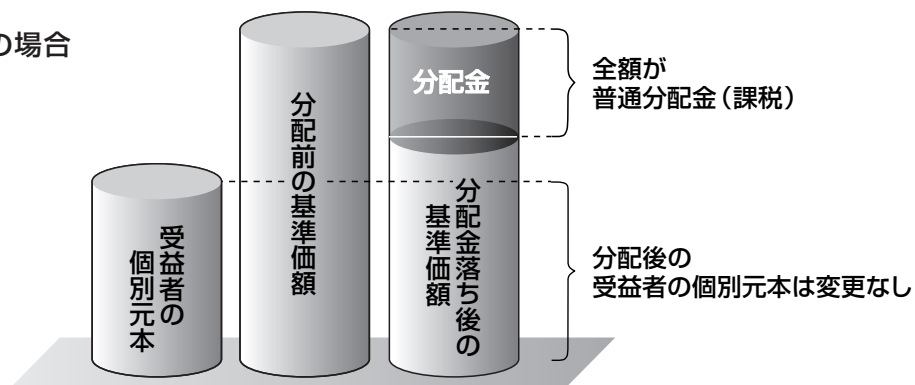
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。

ハ) 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。

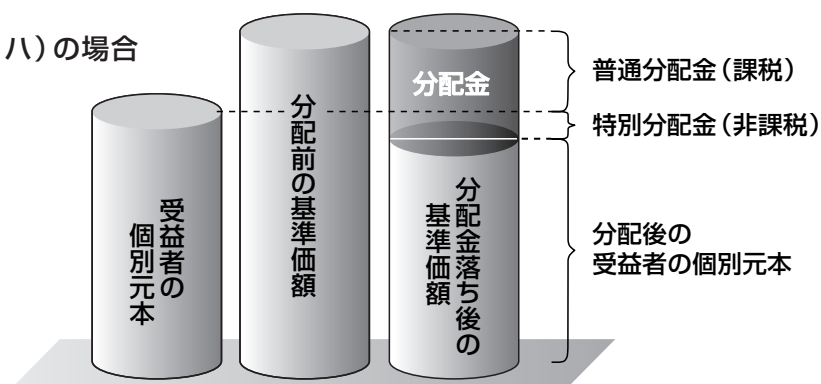
手続きと費用について

＜分配金に関するイメージ図＞

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



※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。

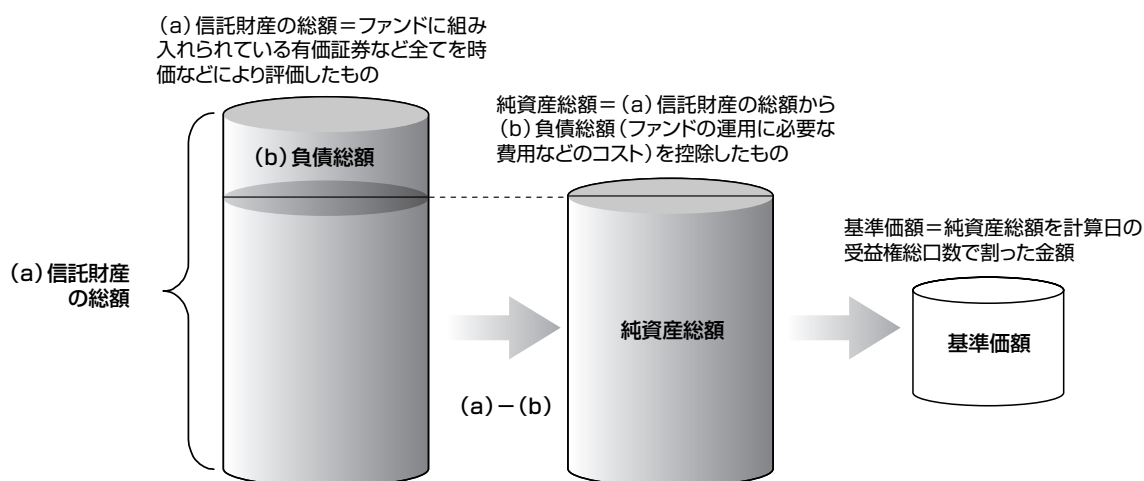
管理および運営

基準価額

基準価額の算出

- ・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。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産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。なお、ファンドは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>



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。

運営方法について

償還

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。

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。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。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、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などには、後述の「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。
- 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。

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。

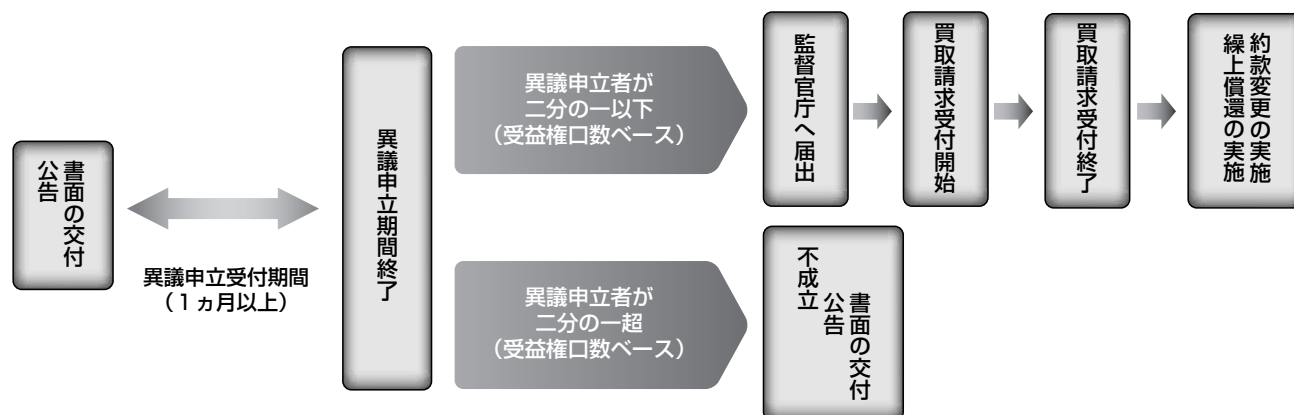
信託約款の変更

- 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。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。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 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、後述の「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。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 >



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

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。

運営方法について

発行(売出)価額の総額

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、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。
- ・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。

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。

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、その翌日より次の計算期間が開始されます。

委託会社の概況(平成20年8月末現在)

- 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
東京都港区赤坂九丁目7番1号
- 4) 資本金
16,403百万円
- 5) 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
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
日興シティホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目3番1号	107,570,100株	58.14%
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	37.38%

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

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

該当事項はありません。

譲渡制限の内容

①譲渡制限はありません。

②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。
- ・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た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。

③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。

運営方法について

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

上記の情報については、EDINET（エディネット）※でもご覧いただくことができます。

※Electronic Disclosure for Investors' NETworkの略で、「金融商品取引法に基づく有価証券報告書等の開示書類に関する電子開示システム」の愛称です。投資家はEDINETを利用することにより、インターネットを通じてファンドの有価証券届出書や有価証券報告書などを閲覧することができます。

ファンドの運用状況

以下の運用状況は平成 20 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	405,163,754	99.31
日本	405,163,754	99.31
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	2,824,202	0.69
純資産総額	407,987,957	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

＜親投資信託受益証券＞

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド	69,230,081,139	1.4658 1.3847	101,477,461,344 95,862,893,353	23.50
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	67,409,534,199	1.1506 1.0315	77,562,974,423 69,532,934,526	17.04
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	60,480,573,263	1.0790 1.0752	65,257,582,530 65,028,712,372	15.94
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	34,333,398,474	1.7477 1.7825	60,002,857,599 61,199,282,779	15.00
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	27,958,597,946	2.1856 1.8843	61,107,534,187 52,682,386,109	12.91
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	23,740,055,039	1.7936 1.7207	42,581,029,387 40,849,512,705	10.01
日本円 日本	親投資信託受益証券 －	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	5,761,852,532	3.9639 3.4725	22,839,283,194 20,008,032,917	4.90

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	99.31
合計	99.31

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

運用の状況について

(3) 運用実績

① 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2月28日)	1.0000	1.0000	29	29
第1計算期間末 (2004年1月13日)	1.0776	1.2476	1,194	1,383
第2計算期間末 (2005年1月11日)	1.0781	1.1581	92,365	99,196
第3計算期間末 (2006年1月10日)	1.0805	1.3505	278,488	347,980
第4計算期間末 (2007年1月10日)	1.0671	1.1671	583,704	637,978
第5計算期間末 (2008年1月10日)	0.9781	0.9811	504,338	505,885
第6中間計算期間末 (2008年7月10日)	0.8993	0.8993	410,935	410,935

	1口当たりの純資産額 (円)	純資産総額 (百万円)
2007年7月末日	1.0925	603,238
2007年8月末日	1.0564	581,943
2007年9月末日	1.0837	591,324
2007年10月末日	1.0954	587,048
2007年11月末日	1.0340	545,274
2007年12月末日	1.0328	534,072
2008年1月末日	0.9375	474,152
2008年2月末日	0.9333	463,501
2008年3月末日	0.8818	430,688
2008年4月末日	0.9376	448,216
2008年5月末日	0.9601	450,706
2008年6月末日	0.9118	419,727
2008年7月末日	0.9099	407,987

② 分配の推移

	1口当たり税込み分配金 (円)
第1計算期間 (2003年2月28日～2004年1月13日)	0.1700
第2計算期間 (2004年1月14日～2005年1月11日)	0.0800
第3計算期間 (2005年1月12日～2006年1月10日)	0.2700
第4計算期間 (2006年1月11日～2007年1月10日)	0.1000
第5計算期間 (2007年1月11日～2008年1月10日)	0.0030
第6中間計算期間 (2008年1月11日～2008年7月10日)	—

③ 収益率の推移

	収益率 (%)
第1計算期間 (2003年2月28日～2004年1月13日)	24.76
第2計算期間 (2004年1月14日～2005年1月11日)	7.47
第3計算期間 (2005年1月12日～2006年1月10日)	25.27
第4計算期間 (2006年1月11日～2007年1月10日)	8.01
第5計算期間 (2007年1月11日～2008年1月10日)	△8.06
第6中間計算期間 (2008年1月11日～2008年7月10日)	△8.06

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

(参考) 日本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 20 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	135,288,102	99.31
日本	135,288,102	99.31
有価証券指数等先物取引(買建)	(676,780)	(0.50)
日本	(676,780)	(0.50)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	944,794	0.69
純資産総額	136,232,897	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	株式 輸送用機器	トヨタ自動車	1,694,700	5,337 4,660	9,044,238,000 7,897,302,000	5.80
日本円 日本	株式 銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,062,300	936 971	5,677,271,165 5,886,493,300	4.32
日本円 日本	株式 電気・ガス業	東京電力	1,902,600	2,681 2,975	5,100,295,200 5,660,235,000	4.15
日本円 日本	株式 鉄鋼	JFE ホールディングス	889,400	4,560 5,290	4,055,918,200 4,704,926,000	3.45
日本円 日本	株式 情報・通信業	日本電信電話	7,498	432,000 553,000	3,239,136,000 4,146,394,000	3.04
日本円 日本	株式 電気機器	ソニー	966,200	4,326 4,120	4,179,556,650 3,980,744,000	2.92
日本円 日本	株式 医薬品	中外製薬	2,146,900	1,169 1,725	2,509,518,767 3,703,402,500	2.72
日本円 日本	株式 電気機器	エルピーダメモリ	1,179,800	3,358 3,090	3,961,216,000 3,645,582,000	2.68
日本円 日本	株式 証券、商品先物取引業	大和証券グループ本社	3,847,000	933 946	3,587,342,000 3,639,262,000	2.67
日本円 日本	株式 卸売業	住友商事	2,236,100	1,336 1,468	2,988,162,200 3,282,594,800	2.41
日本円 日本	株式 機械	ダイキン工業	701,000	4,386 4,640	3,074,881,200 3,252,640,000	2.39
日本円 日本	株式 輸送用機器	ホンダ	895,800	3,086 3,490	2,764,214,800 3,126,342,000	2.29
日本円 日本	株式 海運業	川崎汽船	3,474,000	955 864	3,318,360,322 3,001,536,000	2.20
日本円 日本	株式 食料品	JT	5,623	518,747 505,000	2,916,915,250 2,839,615,000	2.08
日本円 日本	株式 情報・通信業	KDDI	4,391	619,543 621,000	2,720,411,651 2,726,811,000	2.00
日本円 日本	株式 医薬品	第一三共	824,200	2,854 3,230	2,352,516,897 2,662,166,000	1.95
日本円 日本	株式 ゴム製品	ブリヂストン	1,494,100	1,767 1,765	2,640,615,900 2,637,086,500	1.94
日本円 日本	株式 銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	3,019	779,329 848,000	2,352,793,529 2,560,112,000	1.88
日本円 日本	株式 情報・通信業	野村総合研究所	1,047,000	2,670 2,420	2,795,332,273 2,533,740,000	1.86
日本円 日本	株式 卸売業	伊藤忠商事	2,279,000	936 1,080	2,133,385,000 2,461,320,000	1.81

運用の状況について

日本円 日本	株式 ガラス・土石製品	日本板硝子	5,141,000	446 442	2,292,364,502 2,272,322,000	1.67
日本円 日本	株式 電気機器	T D K	348,000	6,471 6,500	2,251,935,100 2,262,000,000	1.66
日本円 日本	株式 陸運業	西日本旅客鉄道	4,077	451,000 512,000	1,838,727,000 2,087,424,000	1.53
日本円 日本	株式 化学	住友化学	2,624,000	688 716	1,806,454,194 1,878,784,000	1.38
日本円 日本	株式 電気機器	キャノン	375,100	4,825 4,960	1,809,704,078 1,860,496,000	1.37
日本円 日本	株式 その他金融業	オリックス	110,730	14,179 16,580	1,570,094,760 1,835,903,400	1.35
日本円 日本	株式 不動産業	住友不動産	805,000	1,721 2,250	1,385,202,000 1,811,250,000	1.33
日本円 日本	株式 機械	クボタ	2,581,000	662 690	1,707,720,000 1,780,890,000	1.31
日本円 日本	株式 石油・石炭製品	新日鉱ホールディングス	2,627,500	568 654	1,491,317,381 1,718,385,000	1.26
日本円 日本	株式 建設業	大成建設	6,406,000	253 263	1,620,661,000 1,684,778,000	1.24

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 (%)
株式	99.31
電気機器	13.22
情報・通信業	11.29
銀行業	11.07
輸送用機器	9.58
卸売業	5.30
化学	5.03
機械	4.70
医薬品	4.67
電気・ガス業	4.15
証券、商品先物取引業	3.71
鉄鋼	3.45
小売業	3.02
食料品	2.95
陸運業	2.76
ガラス・土石製品	2.68
不動産業	2.61
海運業	2.20
ゴム製品	1.94
建設業	1.63
その他金融業	1.35
石油・石炭製品	1.26
水産・農林業	0.73
合計	99.31

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

<有価証券指数等先物取引>

国・地域	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 2008-09	買建	52	649,561,900	676,780,000	0.50
合計			—	649,561,900	676,780,000	0.50

(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 20 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		55,171,374	95.44
	日本	55,171,374	95.44
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,636,336	4.56
純資産総額		57,807,711	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	株式 情報・通信業	テレパーク	13,045	95,583 120,600	1,246,885,433 1,573,227,000	2.72
日本円 日本	株式 卸売業	阪和興業	2,454,000	453 631	1,111,662,000 1,548,474,000	2.68
日本円 日本	株式 情報・通信業	東北新社	1,501,900	1,075 1,019	1,614,542,500 1,530,436,100	2.65
日本円 日本	株式 その他製品	ビジョン	551,400	1,727 2,500	952,267,800 1,378,500,000	2.38
日本円 日本	株式 食料品	ユニ・チャーム ペットケア	418,600	3,086 3,260	1,291,838,043 1,364,636,000	2.36
日本円 日本	株式 機械	ユーシン精機	565,100	1,937 2,365	1,094,850,201 1,336,461,500	2.31
日本円 日本	株式 サービス業	カカココム	3,990	313,963 291,300	1,252,712,178 1,162,287,000	2.01
日本円 日本	株式 繊維製品	ホギメディカル	218,600	5,135 5,270	1,122,595,654 1,152,022,000	1.99
日本円 日本	株式 サービス業	スタジオアリス	728,100	1,298 1,580	945,140,801 1,150,398,000	1.99
日本円 日本	株式 建設業	三井ホーム	1,890,000	474 607	896,351,107 1,147,230,000	1.98
日本円 日本	株式 不動産業	リサ・パートナーズ	7,014	192,699 149,400	1,351,591,296 1,047,891,600	1.81
日本円 日本	株式 機械	理想科学工業	723,300	1,353 1,350	978,592,167 976,455,000	1.69
日本円 日本	株式 サービス業	西尾レントオール	719,800	999 1,340	719,308,836 964,532,000	1.67
日本円 日本	株式 サービス業	ベネフィット・ワン	9,824	99,909 97,600	981,503,983 958,822,400	1.66
日本円 日本	株式 卸売業	トラスコ中山	560,600	1,528 1,618	856,596,800 907,050,800	1.57
日本円 日本	株式 その他製品	フルヤ金属	51,400	18,189 17,490	934,915,178 898,986,000	1.56
日本円 日本	株式 水産・農林業	ホクト	308,500	1,921 2,885	592,628,500 890,022,500	1.54
日本円 日本	株式 金属製品	文化シヤッター	2,071,000	324 421	671,004,000 871,891,000	1.51
日本円 日本	株式 機械	サトー	648,900	1,251 1,321	811,473,055 857,196,900	1.48
日本円 日本	株式 電気機器	オブテックス	706,600	1,350 1,206	953,910,000 852,159,600	1.47
日本円 日本	株式 サービス業	メッセージ	5,566	132,076 149,000	735,134,368 829,334,000	1.43

運用の状況について

日本円 日本	株式 サービス業	ぐるなび	3,514	315,000 235,500	1,106,910,000 827,547,000	1.43
日本円 日本	株式 食料品	S FOODS	1,000,000	676 795	676,000,000 795,000,000	1.38
日本円 日本	株式 電気機器	ダイヘン	1,900,000	355 415	675,066,469 788,500,000	1.36
日本円 日本	株式 卸売業	トシン・グループ	450,200	1,649 1,745	742,325,159 785,599,000	1.36
日本円 日本	株式 卸売業	日本風力開発	2,510	430,000 309,000	1,079,300,000 775,590,000	1.34
日本円 日本	株式 その他製品	フジシールインター ナショナル	399,000	1,368 1,922	545,832,000 766,878,000	1.33
日本円 日本	株式 食料品	雪印乳業	2,045,000	291 374	595,095,000 764,830,000	1.32
日本円 日本	株式 卸売業	ドウシシャ	449,000	1,608 1,695	721,992,000 761,055,000	1.32
日本円 日本	株式 サービス業	リゾートトラスト	519,300	1,364 1,411	708,325,200 732,732,300	1.27

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 (%)
株式	95.44
サービス業	18.92
卸売業	10.47
電気機器	9.46
情報・通信業	9.36
その他製品	6.80
機械	5.67
食料品	5.06
小売業	4.72
ガラス・土石製品	2.83
金属製品	2.78
建設業	2.67
繊維製品	2.67
銀行業	2.38
陸運業	1.85
不動産業	1.81
化学	1.66
水産・農林業	1.54
輸送用機器	1.29
鉱業	1.25
証券、商品先物取引業	1.15
鉄鋼	0.57
精密機器	0.54
合計	95.44

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 20 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	52,387,208	57.05
日本	52,387,208	57.05
地方債証券	6,895,440	7.51
日本	6,895,440	7.51
特殊債券	7,307,168	7.96
日本	7,307,168	7.96
社債券	24,519,206	26.70
日本	21,286,329	23.18
アメリカ	3,232,877	3.52
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	715,809	0.78
純資産総額	91,824,833	100.00

(2) 投資資産

① 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・特殊債券・社債券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第270回	1.30000 2015-06-20	11,900,000,000	102.81 100.48	12,234,390,000 11,956,525,000	13.02
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第286回	1.80000 2017-06-20	10,000,000,000	103.83 102.87	10,383,000,000 10,287,300,000	11.20
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (5年) 第64回	1.50000 2012-06-20	9,200,000,000	101.12 101.79	9,302,671,000 9,364,496,000	10.20
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (20年) 第92回	2.10000 2026-12-20	9,200,000,000	101.95 99.08	9,379,524,000 9,115,360,000	9.93
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第284回	1.70000 2016-12-20	6,200,000,000	105.11 102.52	6,517,120,000 6,356,054,000	6.92
日本円 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (2年) 第263回	0.80000 2009-12-15	5,300,000,000	100.02 100.14	5,301,150,000 5,307,473,000	5.78
日本円 日本	地方債証券 —	東京都公債 620回	1.35000 2015-03-20	1,500,000,000	101.46 99.85	1,521,945,000 1,497,795,000	1.63
日本円 日本	社債券 —	三井住友銀行 (劣後特約付) 8回	1.95000 2014-10-22	1,000,000,000	99.60 99.38	995,960,000 993,830,000	1.08
日本円 日本	社債券 —	プロミス (特定社債間限定同 順位特約付) 34回	0.79000 2010-04-20	1,000,000,000	95.93 95.53	959,260,000 955,280,000	1.04
日本円 日本	社債券 —	北海道電力 293回	1.86000 2017-09-25	900,000,000	103.26 101.36	929,331,000 912,267,000	0.99
日本円 日本	社債券 —	ソフトバンク (社債間限定同 順位特約付) 25回	3.39000 2011-06-17	900,000,000	97.30 97.60	875,655,000 878,418,000	0.96
日本円 日本	特殊債券 —	関西国際空港社債 (財投機関 債) 第3回	2.13000 2014-08-05	800,000,000	106.00 103.50	848,016,000 828,000,000	0.90
日本円 日本	特殊債券 —	公営企業債券 (財投機関債) 第22回	1.99000 2016-09-23	800,000,000	105.68 103.08	845,400,000 824,600,000	0.90
日本円 日本	社債券 —	みずほコーポレート銀行 (劣後特約付) 2回	2.18000 2014-08-05	800,000,000	100.78 100.49	806,256,000 803,952,000	0.88
日本円 日本	地方債証券 —	兵庫県公債 平成17年 度12回	1.10000 2011-03-23	800,000,000	100.35 100.13	802,808,000 801,040,000	0.87
日本円 日本	社債券 —	東京都民銀行期限前償還条項 付 (劣後特約付) 2回	2.15000 2017-02-23	800,000,000	98.48 96.75	787,808,000 774,024,000	0.84

運用の状況について

日本円 アメリカ	社債券 —	エイチエスビーシー・ファイ ナンス・コーポレーション 第9回円貨社債（2005）	0.91000 2010-09-22	800,000,000	94.24 94.39	753,880,000 755,088,000	0.82
日本円 日本	社債券 —	関西電力 451回	1.85000 2016-09-20	700,000,000	104.22 102.31	729,526,000 716,198,000	0.78
日本円 日本	社債券 —	第一生命第3回基金流動化特 定目的会社 特定社債1回	1.96000 2011-08-11	700,000,000	101.71 100.91	711,963,000 706,391,000	0.77
日本円 日本	社債券 —	中部電力 484回	1.41000 2014-09-25	700,000,000	101.62 99.97	711,361,000 699,818,000	0.76
日本円 日本	社債券 —	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	0.46000 2008-09-22	700,000,000	99.92 99.92	699,471,080 699,471,080	0.76
日本円 日本	社債券 —	オリックス（社債間限定同順 位特約付） 83回	0.92000 2009-03-17	700,000,000	99.34 99.34	695,379,800 695,379,800	0.76
日本円 日本	社債券 —	十六銀行期限前償還条項付 （劣後特約付） 1回	1.75000 2017-03-22	700,000,000	98.85 97.76	691,971,000 684,348,000	0.75
日本円 日本	地方債証券 —	東京都公募公債 646回	1.99000 2017-06-20	600,000,000	105.16 103.19	630,936,000 619,122,000	0.67
日本円 日本	特殊債券 —	は号特別道路債券 は号特別第138回	1.50000 2011-03-25	610,000,000	101.62 100.91	619,882,000 615,544,900	0.67
日本円 日本	特殊債券 —	道路債券（財投機関債） 第21回	2.75000 2033-06-20	600,000,000	104.19 101.67	625,146,000 610,020,000	0.66
日本円 日本	特殊債券 —	特別関西国際空港債券 特別第21回	1.60000 2011-03-16	600,000,000	101.66 100.92	609,936,000 605,508,000	0.66
日本円 日本	地方債証券 —	兵庫県公募公債 平成16年 度4回	1.60000 2014-05-27	590,000,000	102.43 100.96	604,342,900 595,658,100	0.65
日本円 日本	特殊債券 —	日本高速道路保有・債務返済 機構債券（財投機関債） 第4回	2.59000 2035-12-20	600,000,000	100.14 98.05	600,810,000 588,294,000	0.64
日本円 日本	社債券 —	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	1.08000 2010-10-21	600,000,000	99.11 97.65	594,654,000 585,900,000	0.64

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（％）
国債証券	57.05
地方債証券	7.51
特殊債券	7.96
社債券	26.70
合計	99.22

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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) 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 20 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 (%)
株式	94,846,168	96.28
アメリカ	84,898,338	86.18
カナダ	7,182,315	7.29
イギリス	1,528,671	1.55
日本	389,142	0.40
フランス	344,945	0.35
オランダ	325,858	0.33
シンガポール	176,898	0.18
転換社債型新株予約権付社債	253,441	0.26
アメリカ	253,441	0.26
投資証券	253,588	0.26
アメリカ	253,588	0.26
為替予約取引(買建)	(75,018)	(0.08)
為替予約取引(売建)	(74,999)	(0.08)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	3,157,083	3.20
純資産総額	98,510,282	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	株式 その他金融	JPMORGAN CHASE & CO	683,800	4,929 4,495	3,370,484,389 3,073,372,196	3.12
アメリカドル アメリカ	株式 バイオテクノロジー	GENENTECH INC	279,800	8,524 10,271	2,385,065,788 2,873,937,720	2.92
アメリカドル アメリカ	株式 インターネット	GOOGLE INC-CL A	53,700	53,197 52,190	2,856,700,849 2,802,577,439	2.84
アメリカドル アメリカ	株式 その他金融	GOLDMAN SACHS GROUP INC	121,300	19,191 20,129	2,327,808,796 2,441,611,359	2.48
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	WELLS FARGO & COMPANY	650,000	3,192 3,373	2,074,820,108 2,192,673,600	2.23
アメリカドル アメリカ	株式 小売り	TARGET CORP	364,800	5,795 4,962	2,114,055,245 1,810,001,457	1.84
アメリカドル アメリカ	株式 運輸関連	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	262,400	7,810 6,805	2,049,287,783 1,785,651,103	1.81
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	BAXTER INTERNATIONAL INC	233,100	6,294 7,414	1,467,130,437 1,728,154,076	1.75
アメリカドル カナダ	株式 鉱業	BARRICK GOLD CORPORATION	356,700	4,538 4,585	1,618,663,287 1,635,601,194	1.66
アメリカドル アメリカ	株式 その他製造	GENERAL ELECTRIC COMPANY	465,200	3,957 3,132	1,840,821,203 1,457,116,373	1.48
アメリカドル アメリカ	株式 通信	QUALCOMM INC	242,100	4,559 6,016	1,103,803,111 1,456,424,405	1.48

運用の状況について

アメリカドル アメリカ	株式 飲料	PEPSICO INC	192,500	7,552 7,234	1,453,762,401 1,392,604,521	1.41
アメリカドル アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	578,900	2,821 2,397	1,633,055,816 1,387,635,110	1.41
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	MARATHON OIL CORPORATION	258,500	5,528 4,879	1,429,058,070 1,261,339,273	1.28
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス サービス	SCHLUMBERGER LTD	113,900	9,337 11,073	1,063,532,794 1,261,165,632	1.28
アメリカドル アメリカ	株式 半導体	APPLIED MATERIALS INC	659,700	2,269 1,861	1,497,148,776 1,227,533,608	1.25
アメリカドル アメリカ	株式 小売り	BEST BUY CO INC	278,000	4,678 4,367	1,300,581,967 1,214,016,770	1.23
アメリカドル アメリカ	株式 食品	KRAFT FOODS INC-A	333,482	3,332 3,461	1,111,248,196 1,154,154,924	1.17
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス サービス	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	259,400	3,827 4,207	992,816,244 1,091,282,622	1.11
アメリカドル アメリカ	株式 医薬品	ABBOTT LABORATORIES	174,700	5,929 6,147	1,035,773,523 1,073,814,863	1.09
アメリカドル アメリカ	株式 通信	AT&T INC	319,900	4,112 3,342	1,315,365,972 1,069,102,345	1.09
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	MEDTRONIC INC	183,400	5,332 5,714	977,856,311 1,047,973,643	1.06
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア・サービス	UNITEDHEALTH GROUP INC	344,400	3,859 2,950	1,329,104,778 1,015,812,484	1.03
カナダドル カナダ	株式 化学	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	43,800	16,265 23,023	712,406,829 1,008,406,524	1.02
アメリカドル アメリカ	株式 エンジニアリング建設	FLUOR CORP	106,400	7,769 9,449	826,618,146 1,005,331,764	1.02
アメリカドル アメリカ	株式 ソフトウェア	MICROSOFT CORP	352,144	3,134 2,836	1,103,692,576 998,676,017	1.01
アメリカドル イギリス	株式 医薬品	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	192,600	4,136 5,058	796,514,634 974,142,603	0.99
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	CONOCOPHILLIPS	106,200	8,709 9,156	924,911,512 972,324,890	0.99
アメリカドル アメリカ	株式 貯蓄貸付 (S & L)	HUDSON CITY BANCORP INC	485,200	1,960 1,953	951,086,707 947,424,421	0.96
アメリカドル アメリカ	株式 保険	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	309,800	4,518 2,893	1,399,817,559 896,341,614	0.91

< 転換社債型新株予約権付社債 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	転換社債型新株 予約権付社債 —	Ford Motor Company	4.25000 2036-12-15	3,267,000	9,541.59 7,757.61	311,723,745 253,441,119	0.26

< 投資証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	投資証券 —	SCHERING-PLOUGH CORP	9,400	21,192 20,381	199,200,288 191,577,828	0.19
アメリカドル アメリカ	投資証券 —	DOUGLAS EMMETT INC	24,200	2,368 2,562	57,317,296 62,011,145	0.06

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 (%)
株式	96.28
その他金融	8.04
医薬品	6.91
小売り	6.23
通信	6.21
石油・ガス	5.01
銀行	4.02
半導体	3.83
インターネット	3.75
コンピューター	3.72
鉱業	3.50
石油・ガス サービス	3.47
バイオテクノロジー	3.36
保険	3.28
メディア	2.85
ヘルスケア製品	2.82
ソフトウェア	2.78
食品	2.69
その他製造	2.58
運輸関連	2.27
化学	1.87
飲料	1.86
ヘルスケア・サービス	1.78
貯蓄貸付 (S & L)	1.43
鉄鋼	1.38
農業	1.25
電子機器	1.16
エンジニアリング建設	1.02
商業サービス	0.97
電力	0.84
電気部品・電気機械	0.80
自動車 製造	0.72
航空宇宙・防衛	0.51
航空	0.45
化粧品 パーソナルケア	0.39
自動車 部品・機器	0.38
レジャー	0.36
宿泊施設	0.35
繊維製品	0.33
生活用品	0.25
機械 建設・鉱業用	0.24
広告	0.24
水道	0.18
石炭	0.09
投資会社	0.08
その他資源	0.04
転換社債型新株予約権付社債	0.26
投資証券	0.26
合計	96.80

運用の状況について

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

<為替予約取引>

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカドル	買建	74,991,957	75,018,331	0.08
合計		74,991,957	75,018,331	0.08
カナダドル	売建	74,991,957	74,999,285	0.08
合計		74,991,957	74,999,285	0.08

(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 20 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	73,199,121	97.13
イギリス	26,854,908	35.63
フランス	11,724,497	15.56
ドイツ	11,470,687	15.22
スイス	9,760,436	12.95
アイルランド	3,250,930	4.31
オランダ	3,085,238	4.09
スペイン	1,889,692	2.51
ルクセンブルグ	1,750,938	2.32
スウェーデン	1,247,244	1.66
ノルウェー	786,973	1.04
オーストリア	648,165	0.86
ギリシャ	370,078	0.49
フィンランド	359,328	0.48
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	2,162,951	2.87
純資産総額	75,362,072	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

<株式>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	BP PLC	3,479,669	1,071 1,093	3,725,452,810 3,803,023,505	5.05
スイスフラン スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	193,955	19,239 19,518	3,731,566,190 3,785,588,864	5.02
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	439,358	7,721 8,287	3,392,274,375 3,640,977,013	4.83
イギリスポンド イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	12,080,914	311 289	3,756,032,927 3,486,927,013	4.63
スイスフラン スイス	株式 医薬品	NOVARTIS AG-REG SHS	476,954	5,098 6,453	2,431,591,239 3,077,621,044	4.08
イギリスポンド イギリス	株式 銀行	BARCLAYS PLC	3,686,305	893 716	3,293,044,844 2,641,230,160	3.50
ユーロ ドイツ	株式 その他製造	SIEMENS AG-REG	191,753	11,289 13,048	2,164,733,116 2,501,993,432	3.32
スイスフラン スイス	株式 その他金融	CREDIT SUISSE GROUP AG	444,602	5,062 5,467	2,250,562,808 2,430,852,543	3.23
ユーロ フランス	株式 銀行	BNP PARIBAS SA	224,439	10,475 10,732	2,350,932,466 2,408,575,882	3.20
ユーロ フランス	株式 通信	FRANCE TELECOM SA	574,920	3,412 3,332	1,961,349,641 1,915,826,958	2.54
イギリスポンド イギリス	株式 ガス	CENTRICA PLC	2,810,066	635 680	1,785,020,241 1,911,233,793	2.54
イギリスポンド イギリス	株式 食品	TESCO PLC	2,374,278	821 798	1,948,856,479 1,895,656,889	2.52

運用の状況について

ユーロ スペイン	株式 銀行	BANCO SANTANDER SA	905,310	2,025 2,087	1,833,261,260 1,889,692,763	2.51
ユーロ ドイツ	株式 自動車 製造	DAIMLER AG-REG	283,594	8,822 6,414	2,501,976,977 1,818,873,481	2.41
ユーロ ルクセンブルグ	株式 鉄鋼	ARCELORMITTAL	180,062	8,461 9,724	1,523,519,035 1,750,938,805	2.32
ユーロ アイルランド	株式 銀行	BANK OF IRELAND	1,875,514	1,435 908	2,691,064,188 1,703,066,677	2.26
イギリスポンド イギリス	株式 メディア	BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC	1,774,184	1,123 955	1,993,154,618 1,694,299,946	2.25
ユーロ オランダ	株式 運輸関連	TNT NV	431,369	3,789 3,792	1,634,409,820 1,635,863,275	2.17
ユーロ ドイツ	株式 保険	ALLIANZ SE-REG	84,000	18,631 18,286	1,565,002,592 1,536,001,639	2.04
ユーロ ドイツ	株式 生活用品	HENKEL AG & CO KGAA	339,365	4,845 4,399	1,644,290,348 1,492,782,371	1.98
イギリスポンド イギリス	株式 保険	PRUDENTIAL PLC	1,299,597	1,358 1,149	1,765,032,070 1,492,633,420	1.98
ユーロ フランス	株式 電力	SUEZ SA	221,754	6,088 6,511	1,350,111,540 1,443,921,345	1.92
ユーロ フランス	株式 保険	AXA	448,185	3,551 3,177	1,591,660,724 1,424,038,010	1.89
ユーロ ドイツ	株式 食品	METRO AG	189,534	8,516 6,301	1,614,101,585 1,194,211,657	1.58
ユーロ ドイツ	株式 保険	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	60,500	19,420 17,849	1,174,899,591 1,079,888,488	1.43
イギリスポンド イギリス	株式 航空	BRITISH AIRWAYS PLC	1,910,000	472 563	900,946,914 1,074,383,404	1.43
イギリスポンド イギリス	株式 食品	CADBURY SCHWEPPE'S PLC	758,240	1,365 1,326	1,035,170,604 1,005,468,701	1.33
イギリスポンド イギリス	株式 流通・卸売業	WOLSELEY PLC	1,292,069	1,083 733	1,399,297,285 946,490,932	1.26
イギリスポンド イギリス	株式 鉱業	RIO TINTO PLC	82,343	10,266 11,451	845,353,000 942,920,826	1.25
イギリスポンド イギリス	株式 小売り	KINGFISHER PLC	3,407,661	267 261	911,038,168 887,715,590	1.18

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 (%)
株式	97.13
銀行	12.66
石油・ガス	9.88
医薬品	9.43
通信	8.89
保険	7.89
食品	6.39
その他製造	3.32
その他金融	3.23
運輸関連	3.21
電力	3.00
ガス	2.54
自動車 製造	2.41
鉄鋼	2.32
メディア	2.25
鉱業	2.12
生活用品	1.98
木材・紙	1.50
航空	1.43
水道	1.26
流通・卸売業	1.26
小売り	1.18
ソフトウェア	1.15
建築資材	1.12
半導体	1.07
金属 加工・鉱業用	1.04
レジャー	0.97
化学	0.96
コンピューター	0.62
商業サービス	0.62
航空宇宙・防衛	0.59
電子機器	0.48
多角産業	0.38
合計	97.13

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

運用の状況について

(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 20 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	28,068,641	95.84
オーストラリア	17,512,688	59.80
香港	6,246,549	21.33
シンガポール	3,506,685	11.97
バミューダ諸島	580,370	1.98
アメリカ	222,346	0.76
投資証券	705,202	2.41
オーストラリア	384,415	1.31
シンガポール	320,786	1.10
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	513,146	1.75
純資産総額	29,286,990	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 評価額上位銘柄明細

＜株式＞

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	RIO TINTO LIMITED	205,260	13,075 12,403	2,683,752,238 2,545,782,307	8.69
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	BHP BILLITON LTD	580,533	3,689 4,008	2,141,479,832 2,326,579,347	7.94
オーストラリアドル オーストラリア	株式 食品	WOOLWORTHS LIMITED	472,930	2,841 2,556	1,343,744,382 1,208,848,428	4.13
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	280,780	4,056 4,123	1,138,976,231 1,157,659,085	3.95
オーストラリアドル オーストラリア	株式 保険	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	456,990	2,373 2,328	1,084,662,670 1,064,075,989	3.63
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	WESTPAC BANKING CORPORATION	485,120	2,419 2,138	1,173,737,519 1,036,970,779	3.54
オーストラリアドル オーストラリア	株式 バイオテクノロジー	CSL LIMITED	281,960	3,915 3,495	1,103,735,614 985,512,006	3.37
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	367,181	2,984 2,599	1,095,653,318 954,287,557	3.26
オーストラリアドル オーストラリア	株式 商業サービス	BRAMBLES LTD	1,147,310	962 831	1,103,640,715 953,335,675	3.26
シンガポールドル シンガポール	株式 銀行	UNITED OVERSEAS BANK LTD	598,192	1,492 1,528	892,515,889 914,203,913	3.12
香港ドル 香港	株式 多角産業	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	763,000	1,198 1,167	913,725,429 890,430,156	3.04
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	524,096	2,293 1,643	1,201,996,974 861,345,487	2.94
オーストラリアドル オーストラリア	株式 通信	TELSTRA CORP LTD	1,532,095	443 451	678,309,732 691,271,459	2.36
香港ドル 香港	株式 銀行	HANG SENG BANK LTD	283,600	2,002 2,150	567,750,317 609,650,950	2.08

シンガポールドル シンガポール	株式 通信	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	2,089,020	304 282	634,607,820 588,718,843	2.01
アメリカドル バミューダ諸島	株式 多角産業	JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	318,000	1,806 1,825	574,172,434 580,370,861	1.98
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	ORICA LTD	242,410	2,865 2,341	694,388,236 567,407,730	1.94
アメリカドル 香港	株式 多角産業	JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	171,200	3,290 3,287	563,189,800 562,708,378	1.92
シンガポールドル シンガポール	株式 不動産	CITY DEVELOPMENTS LTD	599,000	828 900	495,900,714 539,049,684	1.84
オーストラリアドル オーストラリア	株式 石油・ガス	WOODSIDE PETROLEUM LTD	93,960	5,233 5,285	491,657,050 496,548,683	1.70
シンガポールドル シンガポール	株式 銀行	DBS GROUP HOLDINGS LTD	305,692	1,456 1,525	445,099,575 466,217,228	1.59
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	SUNCORP-METWAY LIMITED	328,587	1,350 1,354	443,557,751 444,769,054	1.52
シンガポールドル シンガポール	株式 流通・卸売業	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	318,000	1,348 1,356	428,725,132 431,268,166	1.47
シンガポールドル シンガポール	株式 エンジニアリング建設	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	1,137,000	334 354	380,281,113 402,101,414	1.37
アメリカドル 香港	株式 不動産	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	903,000	442 441	398,828,587 398,340,029	1.36
香港ドル 香港	株式 宿泊施設	SHANGRI-LA ASIA LTD.	1,630,000	259 236	422,019,718 384,964,272	1.31
香港ドル 香港	株式 不動産	KERRY PROPERTIES LTD	638,000	540 555	344,422,386 354,149,334	1.21
オーストラリアドル オーストラリア	株式 飲料	LION NATHAN LIMITED	389,990	888 884	346,348,559 344,756,152	1.18
オーストラリアドル オーストラリア	株式 飲料	COCA-COLA AMATIL LIMITED	433,134	851 795	368,497,855 344,429,543	1.18
香港ドル 香港	株式 多角産業	HUTCHISON WHAMPOA LTD	313,000	1,074 1,031	336,308,064 322,760,592	1.10

＜投資証券＞

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 —	WESTFIELD GROUP	227,680	1,804 1,688	410,806,337 384,415,641	1.31
シンガポールドル シンガポール	投資証券 —	SUNTEC REIT	2,656,000	114 121	301,917,082 320,786,899	1.10

運用の状況について

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 (%)
株式	95.84
銀行	23.88
鉱業	18.81
多角産業	9.37
不動産	6.87
通信	4.56
食品	4.13
商業サービス	4.09
保険	3.70
バイオテクノロジー	3.37
飲料	2.70
流通・卸売業	2.48
宿泊施設	2.07
石油・ガス	2.04
エンジニアリング建設	1.37
繊維製品	1.05
半導体	0.83
建築資材	0.80
ヘルスケア製品	0.76
メディア	0.74
木材・紙	0.60
投資会社	0.52
エンターテインメント	0.49
運輸関連	0.37
化学	0.24
投資証券	2.41
合計	98.25

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は平成 20 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	26,812,030	31.91
ドイツ	12,040,923	14.33
アメリカ	4,967,219	5.91
ブラジル	4,049,293	4.82
フランス	3,004,506	3.58
イギリス	1,574,707	1.87
スペイン	579,952	0.69
オランダ	364,284	0.43
カナダ	100,140	0.12
パナマ	34,933	0.04
南アフリカ	33,490	0.04
オーストリア	32,628	0.04
ロシア	29,949	0.04
地方債証券	5,237,792	6.23
オーストラリア	4,757,519	5.66
アメリカ	480,272	0.57
特殊債券	28,777,696	34.25
アメリカ	16,472,308	19.61
ドイツ	5,719,160	6.81
国際機関	2,213,444	2.63
カナダ	1,464,850	1.74
スペイン	1,414,679	1.68
ノルウェー	858,326	1.02
日本	381,699	0.45
フランス	253,226	0.30
社債券	33,509,497	39.88
アメリカ	23,668,620	28.17
ルクセンブルグ	2,060,451	2.45
スペイン	1,873,073	2.23
イギリス	1,451,920	1.73
アイルランド	1,197,216	1.42
オランダ	1,017,909	1.21
スイス	903,927	1.08
ドイツ	597,992	0.71
フランス	398,387	0.47
オーストラリア	306,747	0.37
カナダ	33,249	0.04
有価証券先物取引等(買建)	(66,552,273)	(79.21)
ドイツ	(65,796,780)	(78.31)
イギリス	(755,492)	(0.90)
有価証券先物取引等(売建)	(57,337,029)	(68.24)
ドイツ	(57,337,029)	(68.24)
為替予約取引(買建)	(57,033,528)	(67.88)
為替予約取引(売建)	(58,280,105)	(69.36)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	△10,317,158	△12.28
純資産総額	84,019,859	100.00

運用の状況について

(2) 投資資産

① 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・特殊債券・社債券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	特殊債券 —	連邦抵当金庫 (FNMA) TBA	5.00000 2038-08-13	149,300,000	10,268.58 10,219.03	15,330,997,035 15,257,011,664	18.16
ユーロ ドイツ	国債証券 —	ドイツ国債	5.50000 2031-01-04	42,300,000	19,139.30 18,415.56	8,095,924,371 7,789,780,519	9.27
オーストラリアドル オーストラリア	地方債証券 —	New South Wales Treasury Corporation	6.00000 2012-05-01	48,000,000	9,903.19 9,911.50	4,753,530,778 4,757,519,247	5.66
イギリスポンド ドイツ	特殊債券 —	ドイツ復興金融公庫 (KfW)	4.75000 2012-12-07	17,100,000	21,391.40 20,830.84	3,657,928,898 3,562,074,085	4.24
ブラジルリアル ブラジル	国債証券 —	ブラジル国債	12.50000 2022-01-05	35,500,000	7,582.88 7,288.56	2,691,920,625 2,587,439,688	3.08
イギリスポンド 国際機関	特殊債券 —	欧州投資銀行 (EIB)	6.25000 2014-04-15	10,000,000	23,223.09 22,134.44	2,322,309,040 2,213,444,120	2.63
イギリスポンド ドイツ	特殊債券 —	ドイツ復興金融公庫 (KfW)	5.50000 2015-12-07	10,000,000	22,393.24 21,570.87	2,239,323,600 2,157,086,740	2.57
ユーロ ドイツ	国債証券 —	ドイツ国債	6.50000 2027-07-04	9,900,000	21,472.50 20,419.42	2,125,777,052 2,021,522,897	2.41
アメリカドル アメリカ	国債証券 —	アメリカ国債	— 2008-08-21	18,000,000	10,801.15 10,801.15	1,944,207,137 1,944,207,137	2.31
アメリカドル アメリカ	国債証券 —	アメリカ国債	— 2008-09-04	18,000,000	10,795.74 10,795.74	1,943,232,921 1,943,232,921	2.31
ユーロ フランス	国債証券 —	フランス国債	5.75000 2032-10-25	9,900,000	19,256.46 18,961.40	1,906,389,336 1,877,178,559	2.23
カナダドル カナダ	特殊債券 —	Canada Housing Trust	3.95000 2013-06-15	13,800,000	10,543.01 10,614.86	1,454,936,017 1,464,850,832	1.74
ブラジルリアル ブラジル	国債証券 —	ブラジル国債	10.25000 2028-01-10	23,300,000	6,544.13 6,274.05	1,524,781,125 1,461,853,650	1.74
イギリスポンド スペイン	特殊債券 —	スペイン開発金融公庫 (ICO)	4.62500 2012-06-06	6,800,000	21,327.42 20,804.11	1,450,264,671 1,414,679,317	1.68
ユーロ スペイン	社債券 —	Banco Santander Central Hispano SA	4.50000 2012-11-14	8,000,000	16,971.68 16,338.22	1,357,734,772 1,307,057,648	1.56
イギリスポンド イギリス	国債証券 —	イギリス国債	5.00000 2014-09-07	5,700,000	22,647.20 21,617.86	1,290,890,235 1,232,217,840	1.47
アメリカドル アメリカ	国債証券 —	アメリカ国債	— 2008-08-28	10,000,000	10,797.79 10,797.79	1,079,779,243 1,079,779,243	1.29
イギリスポンド アイルランド	社債券 —	General Electric Capital Corporation	6.00000 2013-04-11	5,100,000	21,356.73 20,966.66	1,089,193,311 1,069,299,476	1.27
アメリカドル ルクセンブルグ	社債券 —	GAO Gazprom	6.21200 2016-11-22	10,000,000	10,060.57 9,968.12	1,006,056,600 996,812,340	1.19
アメリカドル オランダ	社債券 —	Rabobank Nederland	3.12000 2010-05-19	9,200,000	10,812.00 10,800.36	994,704,000 993,632,704	1.18
ユーロ ルクセンブルグ	社債券 —	GAO Gazprom	6.60500 2018-02-13	6,100,000	15,649.45 15,133.66	954,616,319 923,153,266	1.10
アメリカドル アメリカ	社債券 —	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1	5.82083 2036-08-20	11,438,147	8,111.45 7,757.19	927,799,835 887,278,243	1.06
アメリカドル ノルウェー	特殊債券 —	ノルウェー輸出金融公 社 (EXPT)	5.00000 2012-02-14	7,700,000	11,475.96 11,147.10	883,649,299 858,326,416	1.02
アメリカドル イギリス	社債券 —	Barclays Bank Plc	5.45000 2012-09-12	7,900,000	11,020.16 10,813.45	870,592,911 854,262,456	1.02
アメリカドル アメリカ	社債券 —	Allstate Life Global Funding II	3.36875 2010-05-21	8,000,000	10,812.00 10,667.71	864,960,000 853,417,109	1.02

アメリカドル アメリカ	社債券 —	Merrill Lynch & Co., Inc.	4.96563 2010-05-12	7,600,000	10,760.21 10,503.51	817,776,000 798,266,913	0.95
ユーロ ドイツ	国債証券 —	ドイツ国債	4.75000 2028-07-04	4,600,000	17,712.21 16,806.11	814,761,723 773,081,167	0.92
アメリカドル アメリカ	社債券 —	Morgan Stanley	3.23500 2016-10-18	8,000,000	9,154.95 9,002.07	732,396,230 720,165,696	0.86
ユーロ ドイツ	国債証券 —	ドイツ国債	6.25000 2030-01-04	3,550,000	20,958.10 20,042.51	744,012,477 711,508,937	0.85
イギリスポンド アメリカ	社債券 —	Merrill Lynch & Co., Inc.	7.75000 2018-04-30	3,100,000	21,304.37 20,159.26	660,435,561 624,937,041	0.74

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 (%)
国債証券	31.91
地方債証券	6.23
特殊債券	34.25
社債券	39.88
合計	112.27

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

<有価証券先物取引等>

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
ドイツ	DEUTSCHLAND 5YR (BOBL) FUTURES 2008-09	買建	3,648	65,157,197,756	65,796,780,634	78.31
イギリス	UK GILT 10YR FUTURES 2008-09	買建	33	748,858,044	755,492,602	0.90
合計			—	65,906,055,800	66,552,273,236	79.21
ドイツ	DEUTSCHLAND 2YR (SCHATZ) FUTURES 2008-09	売建	2,492	42,991,957,013	43,179,231,634	51.39
ドイツ	DEUTSCHLAND 10YR (BUND) FUTURES 2008-09	売建	750	13,949,182,909	14,157,797,625	16.85
合計			—	56,941,139,922	57,337,029,259	68.24

<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	28,318,069,519	28,181,332,680	33.54
アメリカドル	買建	17,585,975,402	17,685,334,787	21.05
カナダドル	買建	2,633,477,843	2,653,722,480	3.16
シンガポールドル	買建	2,326,821,912	2,382,980,842	2.84
ポーランドズロチ	買建	1,973,651,219	2,162,438,023	2.57
スウェーデンクローナ	買建	1,107,124,569	1,135,752,000	1.35
デンマーククローネ	買建	827,119,888	857,455,200	1.02
ノルウェークローネ	買建	781,215,736	807,740,920	0.96
スイスフラン	買建	741,708,572	755,550,050	0.90
イギリスポンド	買建	386,744,601	390,833,100	0.47
オーストラリアドル	買建	20,512,574	20,388,000	0.02
合計		56,702,421,835	57,033,528,082	67.88
アメリカドル	売建	40,843,054,433	41,442,806,202	49.33
イギリスポンド	売建	8,069,225,827	8,154,102,600	9.70
オーストラリアドル	売建	4,729,579,351	4,733,583,900	5.63
カナダドル	売建	1,640,868,679	1,654,448,080	1.97
ユーロ	売建	1,506,960,262	1,504,092,920	1.79
ニュージーランドドル	売建	439,400,315	430,818,380	0.51
シンガポールドル	売建	355,156,968	360,253,100	0.43
合計		57,584,245,835	58,280,105,182	69.36

運用の状況について

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) 「財務諸表」および「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。

GW 7つの卵

<貸借対照表>

(単位：円)

科 目	期 別	第4期	第5期
		平成19年1月10日現在	平成20年1月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,200,939,217	18,777,156,196
親投資信託受益証券		573,995,786,727	492,827,614,367
未収入金		63,000,000,000	600,000,000
流動資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563
資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		54,273,397,421	1,546,911,029
未払解約金		2,319,961,600	857,125,528
未払受託者報酬		163,720,095	151,590,687
未払委託者報酬		5,730,205,563	5,305,676,193
その他未払費用		4,543,227	4,749,596
流動負債合計		62,491,827,906	7,866,053,033
負債合計		62,491,827,906	7,866,053,033
純資産の部			
元本等			
元本		546,981,478,249	515,639,121,751
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金(△)		36,723,419,789	△11,300,404,221
(うち分配準備積立金)			(81,357,500)
剰余金合計		36,723,419,789	△11,300,404,221
元本等合計		583,704,898,038	504,338,717,530
純資産合計		583,704,898,038	504,338,717,530
負債・純資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563

＜損益及び剰余金計算書＞

(単位：円)

科 目	期 別	第4期 自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	第5期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日
		注記 番号	金 額
営業収益			
受取利息			9,362,975
有価証券売買等損益			△32,391,807,950
その他収益			2,710,902
営業収益合計			△32,352,192,275
営業費用			
受託者報酬			289,225,561
委託者報酬			11,037,709,400
その他費用			9,284,063
営業費用合計			11,362,356,465
営業利益金額			45,917,034,120
営業損失金額			-
経常利益金額			45,917,034,120
経常損失金額			-
当期純利益金額			45,917,034,120
当期純損失金額			-
当期一部解約に伴う当期純利益金額分配額			3,294,128,667
期首剰余金			20,746,912,126
剰余金増加額			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)			(35,404,143,287)
剰余金減少額			7,777,143,656
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)			(7,777,143,656)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)			(-)
分配金			54,273,397,421
期末剰余金又は期末欠損金(△)			△11,300,404,221

＜重要な会計方針に係る事項に関する注記＞

項 目	期 別	第4期 自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	第5期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日
		有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券の評価基準及び評価方法
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

運用の状況について

GW 7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 平成19年7月10日現在	当中間計算期間末 平成20年7月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,739,414,892	7,023,132,759
親投資信託受益証券		635,245,508,966	408,063,382,420
未収入金		680,000,000	840,000,000
流動資産合計		646,664,923,858	415,926,515,179
資産合計		646,664,923,858	415,926,515,179
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,176,867,552	762,446,884
未払受託者報酬		163,772,315	117,307,081
未払委託者報酬		5,732,033,207	4,105,749,985
その他未払費用		4,534,467	5,923,076
流動負債合計		7,077,207,541	4,991,427,026
負債合計		7,077,207,541	4,991,427,026
純資産の部			
元本等			
元本		556,282,022,518	456,962,731,674
剰余金			
中間剰余金又は中間欠損金(△)		83,305,693,799	△46,027,643,521
(うち分配準備積立金)		(-)	(71,460,126)
剰余金合計		83,305,693,799	△46,027,643,521
元本等合計		639,587,716,317	410,935,088,153
純資産合計		639,587,716,317	410,935,088,153
負債・純資産合計		646,664,923,858	415,926,515,179

＜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 自 平成19年1月11日 至 平成19年7月10日	当中間計算期間 自 平成20年1月11日 至 平成20年7月10日
	注記 番号	金 額	金 額
営業収益			
受取利息		19,281,760	13,277,359
有価証券売買等損益		52,805,086,649	△34,941,725,168
営業収益合計		52,824,368,409	△34,928,447,809
営業費用			
受託者報酬		163,772,315	117,307,081
委託者報酬		5,732,033,207	4,105,749,985
その他費用		4,534,467	5,923,076
営業費用合計		5,900,339,989	4,228,980,142
営業利益金額		46,924,028,420	-
営業損失金額		-	39,157,427,951
経常利益金額		46,924,028,420	-
経常損失金額		-	39,157,427,951
中間純利益金額		46,924,028,420	-
中間純損失金額		-	39,157,427,951
中間一部解約に伴う中間純利益金額分配額		2,881,821,878	-
中間一部解約に伴う中間純損失金額分配額		-	3,315,015,143
期首剰余金又は期首欠損金(△)		36,723,419,789	△11,300,404,221
剰余金増加額		8,010,045,387	1,394,550,268
(中間一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(1,394,550,268)
(中間追加信託に伴う剰余金増加額)		(8,010,045,387)	(-)
剰余金減少額		5,469,977,919	279,376,760
(中間一部解約に伴う剰余金減少額)		(5,469,977,919)	(-)
(中間追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(279,376,760)
分配金		-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)		83,305,693,799	△46,027,643,521

＜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19年1月11日 至 平成19年7月10日	当中間計算期間 自 平成20年1月11日 至 平成20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>

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	9%
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	18%
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	17%
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	15%
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	14%

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。

①分配対象額の範囲

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

②分配対象額についての分配方針

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、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 GW 7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。

② 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。

② 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。

③ 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。

② 委託者は、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。

② 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。

③ 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。）。

② 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

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なわないものとします。

- ③ 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。
- ④ 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 前項の手数料は、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。
- ⑤ 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つては、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。）にあつては、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つては、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つては、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。

- ⑥ 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。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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号ロ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。

- ② 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。
- ③ 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

- ② 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。以下次号において同じ。）で次号に定めるものの以外のもの
19. 投資法人債券（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。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
20. 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。）
21. 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。）
22. 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。）
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 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。）
25. 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
26. 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22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19号の証券ならびに第16号および第22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。

- ② 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

③ 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。

④ 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。

② 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ますものとします。

② 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。

③ 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。）。)

② 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。

③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における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。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第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。

③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。

④ 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たときは、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。

(金利先渡し取引および為替先渡し取引の運用指図)

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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡し取引および為替先渡し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。
- ③ 金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡し取引および為替先渡し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たときは、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。
- ② 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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、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。

- ② 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。
- ③ 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

- ② 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。
- ③ 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。

- ④ 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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わないものとします。

- ② 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
- ③ 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

そ の 他

ます。

- ④ 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。
- ⑤ 借入金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。

- ② 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。
- ③ 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。

- ② 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。

- ② 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

② 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。

② 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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、

⑥ 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)

そ の 他

第48条 (削 除)

(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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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項の信託契約の解約を行いません。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

- ② 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。

- ② 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。

- ② 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。

- ② 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行な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。
- ② 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

約款変更実施予定日 平成20年11月18日

追加型証券投資信託 GW 7つの卵 約款

第44条

約 款 の 新 旧 対 照 表

新	旧
(信託報酬等の額)	(信託報酬等の額)
第44条	第44条
①～③ (略)	①～③ (同 左)
④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。	④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	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	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	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	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	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
欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド 年10,000分の50	欧州先進国株式グローバル・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	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	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	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	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

そ の 他

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。

委託会社（委託者）

いたくがいしゃ（いたくしゃ）

投資信託の運用を行なう会社です。

解約価額

かいやくかがく

投資信託を解約請求によって換金する時の価額で、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額のことです。

解約請求（解約）

かいやくせいぎゅう（かいやく）

投資信託の換金方法の一つで、受益者が販売会社を通じて委託会社に解約を請求する方法のことです。（なお、受益者が販売会社に受益権の買取りを請求する換金方法を買取請求（買取）といいます。）

繰上償還

くりあげしょうかん

信託期間を繰り上げて信託（運用）を終了させることです。

自動けいぞく投資

じどうけいぞくとうし

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行います。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

しゅうえきぶんぱい

投資信託の決算期末に、運用によって得た収益などを保有口数に応じて受益者に分配することです。また、その分配される金額を収益分配金または分配金といいます。

受益者

じゅえきしゃ

投資信託を購入した投資家のことです。

純資産総額

じゅんしさんそうがく

信託財産の総額（信託財産に属する資産を時価などで評価して得た金額）から負債総額（運用に必要な費用などのコスト）を控除した金額のことです。

償還

しょうかん

投資信託の信託契約を解約し、信託（運用）を終了することです。

信託期間

しんたくきかん

信託財産を運用する期間のことで、運用開始日（設定日）から運用終了日（償還日）までのことです。

信託財産

しんたくざいさん

投資信託が保有するすべての資産（組入有価証券、現金など）のことです。

ファンドマネージャー

投資信託の運用を行なう人（金融資産を運用する専門家）のことです。

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のことです。

目論見書

（投資信託説明書）

もくろみしょ
（とうししんたくせつめいしょ）

投資家に交付することが義務づけられている投資信託の説明資料です。投資家が投資信託を購入するにあたって知っておくべき重要な情報（特色、運用方針、信託報酬、手数料など）が記載されています。

目論見書には、お申込みの際にあらかじめまたは同時に投資家に交付される「交付目論見書」と、投資家から請求があった場合に交付される「請求目論見書」があります。

約款（信託約款）

やっかん（しんたくやっかん）

投資信託の仕組みや運営、管理などの詳細について規定したものをいいます。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をリターンといい、その収益を獲得するにあたって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、その逆にリスクが低いとリターンは低くなります。

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)



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、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20年4月10日に関東財務局長に提出しており、平成20年4月11日にその効力が発生しております。

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	4
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	7
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	63

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・マネージメント・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
平成20年 11月 18日	「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」における投資顧問会社の変更など（予定）

第2 手続等

1 申込（販売）手続等

（1）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（2）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＞

- ・収益分配金を自動的に再投資するコースです。
- ・なお、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。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（3）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（4）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。

（5）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、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。

(6) 申込単位

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)

(7) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(8) 受付の中止および取消

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、取得の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申込みの受付を取り消すことができます。

※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。

(9) 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。

(10) 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

<解約請求による換金>

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）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。

（３）解約制限

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、大口の解約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。

（４）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。

- ・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）

（５）手取額

1 口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税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。

（６）解約単位

1 口単位

※販売会社によっては、解約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。

（７）解約代金の支払い

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。

（８）受付の中止および取消

- ・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

① 基準価額の算出

- ・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。なお、ファンドは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。

② 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。

③ 基準価額の照会方法

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、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) その他

① 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。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 ヶ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。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「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 億口を下回るようになった場合
 - 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。

② 償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後 1 ヶ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。

③ 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。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。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 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、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

④ 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。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。

⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 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。

⑦ 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。

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、「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、改正前の「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、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、旧証券取引法第193条の2の規定に、また、第5期計算期間（平成19年1月11日から平成20年1月10日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あらた監査法人による監査を受けております。

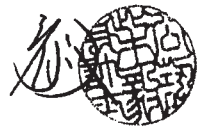
独立監査人の監査報告書

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

独立監査人の監査報告書

平成20年2月19日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指 定 社 員 公認会計士
業 務 執 行 社 員

指 定 社 員 公認会計士
業 務 執 行 社 員

癸
鳥飼裕一

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているGW7つの卵の平成19年1月11日から平成20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20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

GW 7 つの男

(1) 貸借対照表

科 目	期 別	(単位：円)	
		第4期 平成19年1月10日現在	第5期 平成20年1月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,200,939,217	18,777,156,196
親投資信託受益証券		573,995,786,727	492,827,614,367
未収入金		63,000,000,000	600,000,000
流動資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563
資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		54,273,397,421	1,546,911,029
未払解約金		2,319,961,600	857,125,528
未払受託者報酬		163,720,095	151,590,687
未払委託者報酬		5,730,205,563	5,305,676,193
その他未払費用		4,543,227	4,749,596
流動負債合計		62,491,827,906	7,866,053,033
負債合計		62,491,827,906	7,866,053,033
純資産の部			
元本等			
元本		546,981,478,249	515,639,121,751
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金(△)		36,723,419,789	△11,300,404,221
(うち分配準備積立金)			(81,357,500)
剰余金合計		36,723,419,789	△11,300,404,221
元本等合計		583,704,898,038	504,338,717,530
純資産合計		583,704,898,038	504,338,717,530
負債・純資産合計		646,196,725,944	512,204,770,563

(2) 損益及び剰余金計算書

科 目	期 別	(単位：円)	
		第4期 自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	第5期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日
	注記 番号	金 額	金 額
営業収益			
受取利息		9,362,975	36,904,773
有価証券売買等損益		56,327,828,667	△32,391,807,950
その他収益		126,241	2,710,902
営業収益合計		56,337,317,883	△32,352,192,275
営業費用			
受託者報酬		289,225,561	315,363,002
委託者報酬		10,122,898,912	11,037,709,400
その他費用		8,159,290	9,284,063
営業費用合計		10,420,283,763	11,362,356,465
営業利益金額		45,917,034,120	-
営業損失金額		-	43,714,548,740
経常利益金額		45,917,034,120	-
経常損失金額		-	43,714,548,740
当期純利益金額		45,917,034,120	-
当期純損失金額		-	43,714,548,740
当期一部解約に伴う当期純利益金額分配額		3,294,128,667	2,389,245,320
期首剰余金		20,746,912,126	36,723,419,789
剰余金増加額		35,404,143,287	9,299,080,768
(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)		(35,404,143,287)	(9,299,080,768)
剰余金減少額		7,777,143,656	9,672,199,689
(当期一部解約に伴う剰余金減少額)		(7,777,143,656)	(9,672,199,689)
(当期追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(-)
分配金		54,273,397,421	1,546,911,029
期末剰余金又は期末欠損金(△)		36,723,419,789	△11,300,404,221

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	期 別	第4期 自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	第5期 自 平成19年1月11日 至 平成20年1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

(貸借対照表に関する注記)

第4期 平成19年1月10日現在		第5期 平成20年1月10日現在	
1.	期首元本額 期中追加設定元本額 期中解約元本額 計算期間末日における 受益権の総数	257,741,764,372 円 380,068,619,701 円 90,828,906,824 円 546,981,478,249 円	546,981,478,249 円 107,582,341,767 円 138,924,698,265 円 515,639,121,751 円
2.	元本の欠損		
3.	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,300,404,221円であります。		

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日		第5期 自 平成19年1月11日 至 平成20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		
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	2,286,567,357 円	2,419,182,372 円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	9,513,765,757 円	1,628,268,529 円
C	信託約款に定める収益調整金	33,109,139,696 円	0 円
D	信託約款に定める分配準備積立金	48,373,911,757 円	149,235,388 円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	90,996,817,210 円	1,777,503,917 円
F	分配対象収益 (1口当たり)	0.1663 円	0.0034 円
G	分配金額 (1万口当たり)	1,663 円	34 円
H	分配金額 (1口当たり)	54,273,397,421 円	1,546,911,029 円
	分配金額 (1万口当たり)	0.1000 円	0.0030 円
	分配金に加算した外国支払税	1,000 円	30 円
		424,750,403 円	6,336 円

(有価証券に関する注記)

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	(単位：円)
親投資信託受益証券	573,995,786,727	当計算期間の損益に含まれた評価差額 47,873,553,467
合計	573,995,786,727	47,873,553,467

第5期 (自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	(単位：円)
親投資信託受益証券	492,827,614,367	当計算期間の損益に含まれた評価差額 △37,477,352,986
合計	492,827,614,367	△37,477,352,986

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第4期 平成19年1月10日現在	第5期 平成20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)	1.0671 円 (10,671 円) 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	0.9781 円 (9,781 円)

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

- (1) 株式
該当事項はありません。
- (2) 株式以外の有価証券

(親投資信託受益証券)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	(単位：円)
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	83,837,672,120	122,889,259,793	備考
	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	27,550,436,249	49,433,747,761	
	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	62,244,713,936	67,155,821,865	
	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	69,745,098,153	80,764,823,661	
	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	30,638,146,056	66,978,051,093	
	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	8,488,425,372	33,985,108,661	
	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	40,814,224,717	71,620,801,533	
	合計	323,318,716,603	492,827,614,367	

(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」「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、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

(単位：円)			
科 目	対象年月日	平成19年1月10日現在	
		金 額	金 額
資産の部	注記 番号		
流動資産			
コール・ローン		21,791,911,639	1,908,289,649
株式		189,825,749,800	167,152,732,400
未収入金		1,266,403,543	251,425,682
未収配当金		47,852,280	116,439,300
差入委託証拠金		625,930,000	-
流動資産合計		213,557,847,262	169,428,887,031
資産合計		213,557,847,262	169,428,887,031
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		1,209,084,185	118,090,490
未払解約金		16,502,000,000	1,774,795
流動負債合計		18,031,018,685	119,865,285
負債合計		18,031,018,685	119,865,285
純資産の部			
元本等			
元本		112,921,306,554	115,504,522,820
剰余金			
剰余金		82,605,522,023	53,804,498,926
剰余金合計		82,605,522,023	53,804,498,926
元本等合計		195,526,828,577	169,309,021,746
純資産合計		195,526,828,577	169,309,021,746
負債・純資産合計		213,557,847,262	169,428,887,031

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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。	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。	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。	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。
	(2) 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。	(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売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。
	(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な事由をもって時価と認め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、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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	デリバティブ取引
3. 収益及び費用の計上基準	備別法に基づき原則として時価で評価しております。	備別法に基づき原則として時価で評価しております。	同左
	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
	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19年1月10日現在			平成20年1月10日現在		
1.	期首	平成18年1月11日	1.	期首	平成19年1月11日
	期首元本額	63,463,471,328 円		期首元本額	112,921,306,554 円
	期首からの追加設定元本額	65,216,978,373 円		期首からの追加設定元本額	12,592,956,141 円
	期首からの解約元本額	15,759,143,147 円		期首からの解約元本額	10,009,739,875 円
	平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※			平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※	
	GW 7つの卵	85,157,105,124 円		GW 7つの卵	83,837,672,120 円
	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	415,914 円		ス安定型	551,539 円
	グローバル・ラップ・パラン	706,937,003 円		グローバル・ラップ・パラン	833,334,140 円
	ス安定成長型			ス安定成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	1,435,239,565 円		グローバル・ラップ・パラン	1,737,470,615 円
	ス成長型			ス成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	9,760,114,015 円		グローバル・ラップ・パラン	11,772,304,627 円
	ス積極成長型			ス積極成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	3,999,121,669 円		グローバル・ラップ・パラン	4,950,341,282 円
	ス積極型			ス積極型	
	グローバル・ラップ・パラン	4,001,277,016 円		グローバル・ラップ・パラン	4,647,080,045 円
	ス超積極型			ス超積極型	
	GW 7つの卵 (適格機関投資家向け)	6,222,635,326 円		GW 7つの卵 (適格機関投資家向け)	6,059,375,111 円
	日本大型株式ファンド	897,716,195 円		日本大型株式ファンド	627,538,296 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パラン	31,221,884 円		年金積立 グローバル・ラップ・パラン	36,243,332 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パラン	86,191,560 円		年金積立 グローバル・ラップ・パラン	101,227,622 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パラン	107,451,159 円		年金積立 グローバル・ラップ・パラン	144,587,284 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パラン	275,498,034 円		年金積立 グローバル・ラップ・パラン	422,292,706 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パラン	240,382,090 円		年金積立 グローバル・ラップ・パラン	334,504,101 円
	(合計)	112,921,306,554 円		(合計)	115,504,522,820 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	112,921,306,554 口	2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	115,504,522,820 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

(有価証券に関する注記)

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	189,825,749,800	8,843,215,400
合計	189,825,749,800	8,843,215,400

(単位：円)

対象期間 (自 平成19年1月11日 至 平成20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	167,152,732,400	△40,636,868,373
合計	167,152,732,400	△40,636,868,373

(単位：円)

(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18年1月11日 至 平成19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	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、リスク管理業務担当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

(株式関連)					(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		-		

平成 20 年 1 月 10 日現在

該当事項はありません。

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20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)	1,7315 円 (17,315 円)	1口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1,4658 円 (14,658 円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：株、円)					
銘柄	株 数	評価額		備 考	
		単 価	金 額		
1334 マルハニチロホールディングス	3,158,000	132	416,856,000		
1801 大成建設	6,754,000	313	2,114,002,000		
1802 大林組	1,266,000	599	758,334,000		
2267 ヤクルト本社	229,300	2,685	615,670,500		
2331 総合警備保障	220,700	1,725	380,707,500		
2503 キリンホールディングス	1,335,000	1,617	2,158,695,000		
2914 J T	5,927	642,000	3,805,134,000		
3231 野村不動産ホールディングス	341,000	2,455	837,155,000		
3382 セブン&アイ・ホールディングス	513,700	3,080	1,582,196,000		
3436 SUMCO	275,000	2,730	750,750,000		
4004 昭和電工	1,106,000	390	431,340,000		
4118 カネカ	2,426,000	880	2,134,880,000		
4205 日本ゼオン	1,579,000	629	993,191,000		
4208 宇部興産	5,793,000	377	2,183,961,000		
4307 野村総合研究所	318,800	3,620	1,154,056,000		
4519 中外製薬	1,903,000	1,656	3,151,368,000		
4543 テルモ	272,400	6,070	1,653,468,000		
4568 第一三共	901,400	3,450	3,109,830,000		
4684 オービック	37,730	19,380	731,207,400		
4768 大塚商会	170,400	8,900	1,516,560,000		
5019 出光興産	171,900	10,810	1,858,239,000		
5108 プリヂーストン	1,575,200	1,810	2,851,112,000		
5202 日本板硝子	5,120,000	521	2,667,520,000		
5233 太平洋セメント	8,686,000	241	2,093,326,000		
5334 日本特殊陶業	1,671,000	1,880	3,141,480,000		
5411 J F E ホールディングス	782,500	5,490	4,295,925,000		
5803 フジクラ	1,981,000	529	1,047,949,000		
6113 アマダ	851,000	906	771,006,000		
6326 クボタ	3,316,000	689	2,284,724,000		
6367 ダイキン工業	946,400	5,660	5,356,624,000		
6479 ミネベア	3,239,000	643	2,082,677,000		
6481 THK	383,100	2,080	796,848,000		
6503 三菱電機	810,000	1,122	908,820,000		
6504 富士電機ホールディングス	3,013,000	364	1,096,732,000		
6594 日本電産	122,400	7,550	924,120,000		
6665 エルピーダメモリ	1,368,300	3,340	4,570,122,000		
6752 松下電器産業	1,933,000	2,160	4,175,280,000		
6762 T D K	258,200	7,470	1,928,754,000		
6841 横河電機	1,161,700	1,149	1,334,793,300		
6976 太陽誘電	498,000	1,602	797,796,000		
6981 村田製作所	155,300	5,710	886,763,000		
7201 日産自動車	2,054,100	1,096	2,251,293,600		
7203 トヨタ自動車	1,833,200	5,660	10,375,912,000		
7261 マツダ	1,692,000	496	839,232,000		
7267 ホンダ	1,161,500	3,400	3,949,100,000		
7741 HOYA	1,238,700	3,390	4,199,193,000		
7751 キヤノン	159,800	4,890	781,422,000		
8001 伊藤忠商事	1,654,000	1,058	1,749,932,000		
8053 住友商事	2,260,300	1,504	3,399,491,200		

8058	三菱商事	366,200	2,920	1,069,304,000
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	404,000	832	336,128,000
8270	エニジー	568,000	879	499,272,000
8273	イズミ	616,000	1,648	1,015,168,000
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,691,500	1,024	5,828,096,000
8316	三井住友フィナンシャルグループ	7,420	842,000	6,247,640,000
8327	西日本シティ銀行	6,158,000	273	1,681,134,000
8341	七十七銀行	1,686,000	672	1,132,992,000
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	1,361,000	634	862,874,000
8359	八十二銀行	1,882,000	731	1,375,742,000
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	1,133,000	320	362,560,000
8591	オリックス	108,910	17,090	1,861,271,900
8601	大和証券グループ本社	4,056,000	936	3,796,416,000
8752	三井住友海上火災保険	2,212,000	1,044	2,309,328,000
8801	三井不動産	808,000	2,200	1,777,600,000
8815	東急不動産	925,000	869	803,825,000
8830	住友不動産	430,000	2,480	1,066,400,000
9021	西日本旅客鉄道	6,502	545,000	3,543,590,000
9022	東海旅客鉄道	891	971,000	865,161,000
9107	日本電信電話	3,462,000	1,029	3,562,398,000
9432	川崎汽船	12,197	520,000	6,342,440,000
9433	KDD I	2,412	781,000	1,883,772,000
9437	N T T ドコモ	19,560	183,000	3,579,480,000
9501	東京電力	2,205,500	2,770	6,109,235,000
9741	日立情報システムズ	512,700	2,205	1,130,503,500
9843	ニトリ	192,600	5,410	1,041,966,000
9983	ファーストリテイリング	116,500	7,800	908,700,000
9987	スズケン	459,200	3,950	1,813,840,000
9989	サンドラッグ	156,100	2,885	450,348,500
	合計	114,262,149		167,152,732,400

(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引当金の状況表

「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

(単位：円)				
科 目	対象年月日	平成19年1月10日現在		平成20年1月10日現在
		注記 番号	金 額	金 額
資産の部				
流動資産				
コール・ローン			6,881,293,126	2,327,102,893
株式			81,661,866,510	65,524,767,970
未収入金			433,158,841	109,152,112
未収配当金			81,660,150	90,727,700
流動資産合計			89,057,978,627	68,051,750,675
資産合計			89,057,978,627	68,051,750,675
負債の部				
流動負債				
未払金			116,671,244	－
未払解約金			6,601,000,000	1,559,055
流動負債合計			6,717,671,244	1,559,055
負債合計			6,717,671,244	1,559,055
純資産の部				
元本等				
元本			35,857,273,851	37,924,799,100
剰余金				
剰余金			46,483,033,532	30,125,392,520
剰余金合計			46,483,033,532	30,125,392,520
元本等合計			82,340,307,383	68,050,191,620
純資産合計			82,340,307,383	68,050,191,620
負債・純資産合計			89,057,978,627	68,051,750,675

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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。	(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した価額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) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融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した価額で評価しております。
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当該金額を計上して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当該金額を計上して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当該金額を計上して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19年1月10日現在	平成20年1月10日現在
1. 期首	平成18年1月11日	平成19年1月11日
期首元本額	18,219,019,241 円	期首元本額 35,857,273,851 円
期首からの追加設定元本額	21,403,589,543 円	期首からの追加設定元本額 5,377,598,290 円
期首からの解約元本額	3,765,334,933 円	期首からの解約元本額 3,310,073,041 円
平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※	平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※	
GW7つの卵	26,752,718,828 円	GW7つの卵 27,550,436,249 円
グローバル・ラップ・パラン	287,263 円	グローバル・ラップ・パラン 362,337 円
ス安定型		ス安定型
グローバル・ラップ・パラン	346,569,252 円	グローバル・ラップ・パラン 392,749,520 円
ス安定成長型		ス安定成長型
グローバル・ラップ・パラン	598,710,898 円	グローバル・ラップ・パラン 715,379,561 円
ス成長型		ス成長型
グローバル・ラップ・パラン	3,089,299,519 円	グローバル・ラップ・パラン 3,862,732,309 円
ス積極成長型		ス積極成長型
グローバル・ラップ・パラン	1,163,274,069 円	グローバル・ラップ・パラン 1,486,162,948 円
ス積極型		ス積極型
グローバル・ラップ・パラン	1,162,363,287 円	グローバル・ラップ・パラン 1,230,652,512 円
ス超積極型		ス超積極型
GW7つの卵（適格機関投資家向け）	1,999,324,296 円	GW7つの卵（適格機関投資家向け） 1,993,142,803 円
日本小型株式ファンド	476,769,456 円	日本小型株式ファンド 323,667,233 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定型）	21,320,257 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定型） 23,838,129 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定成長型）	42,210,153 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定成長型） 47,203,299 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（成長型）	45,303,222 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（成長型） 59,311,738 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極成長型）	88,517,649 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極成長型） 138,504,519 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極型）	70,605,702 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極型） 100,655,943 円
(合計)	35,857,273,851 円	(合計) 37,924,799,100 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	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 37,924,799,100 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

(有価証券に関する注記)

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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	81,661,866,510	△7,433,769,209
合計	81,661,866,510	△7,433,769,209

対象期間 (自 平成19年1月11日 至 平成20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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	65,524,767,970	△19,658,292,627
合計	65,524,767,970	△19,658,292,627

(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アンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20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)	2,2963 円 (22,963 円)	1,7943 円 (17,943 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：株、円)				
銘柄	株 数	評価額		備 考
		単価	金額	
1379 ホクト	593,500	1,739	1,032,096,500	
1661 関東天然瓦斯開発	707,000	611	431,977,000	
1865 青木あすなろ建設	616,500	679	418,603,500	
1868 三井ホーム	1,900,000	444	843,600,000	
2059 ユニ・チャーム	244,500	5,640	1,378,980,000	
2120 ネクスト	500	265,000	132,500,000	
2135 VSN	247,200	1,630	402,936,000	
2146 ユナイテッド・テクノロジ・ホールディングス	8,469	203,000	1,719,207,000	
2262 雪印乳業	2,488,000	331	823,528,000	
2292 S FOODS	1,063,000	896	952,448,000	
2305 スタジオアリス	557,800	1,161	647,605,800	
2329 東北新社	1,549,700	1,120	1,735,664,000	
2344 平安レイサービス	611,900	540	330,426,000	
2371 カカココム	3,798	504,000	1,914,192,000	
2412 ベネフィット・ワン	7,116	126,000	896,616,000	
2440 ぐるなび	5,900	221,000	1,303,900,000	
2453 ジャパンベンストレスシステム	4,439	88,000	390,632,000	
2674 ハードオフコーポレーション	512,500	388	198,850,000	
2703 日本ライオン	280,700	394	110,595,800	
2726 パル	289,750	2,455	711,336,250	
2761 トシン・グループ	370,200	2,340	866,268,000	
2766 日本風力開発	3,490	284,000	991,160,000	
2778 バレモ	323,700	574	185,803,800	
2780 コメ兵	407,000	827	336,589,000	
3087 ドトール・日レスホールディングス	788,800	1,713	1,351,214,400	
3344 ワンダーコーポレーション	2,259	176,000	397,584,000	
3593 ホギメディカル	227,100	4,490	1,019,679,000	
3738 テレパーク	11,192	114,000	1,275,888,000	
3819 インテックホールディングス	336,100	1,454	488,689,400	
4206 アイカ工業	846,800	996	842,416,800	
4221 大倉工業	626,000	244	152,744,000	
4238 ミライアル	75,000	2,995	224,625,000	
4301 アミューズ	231,800	2,160	500,688,000	
4329 ワークスアブリケーションズ	10,405	129,000	1,342,245,000	
4613 関西ベインント	600,000	736	441,600,000	
4681 リゾートラスト	569,300	2,105	1,198,376,500	
4694 ビー・エム・エル	486,700	1,750	851,725,000	
4696 ワタベウェディング	437,400	1,339	585,678,600	
4719 アルファシステムズ	133,800	2,240	299,712,000	
4799 アグレックス	476,700	1,159	552,495,300	
4822 ハドソン	179,400	1,533	275,020,200	
4839 WOWOW	2,008	219,000	439,752,000	
5344 MARUWA	202,100	1,578	318,913,800	
5384 フジインコーポレーテッド	238,500	1,425	339,862,500	
5445 東京鐵鋼	1,015,000	367	372,505,000	
5930 文化シヤッター	2,360,000	432	1,019,520,000	
5999 イハラサイエンス	393,000	1,129	443,697,000	
6143 ソディック	1,437,000	563	809,031,000	
6287 サトー	823,300	1,539	1,267,058,700	

6323	ロウツェ	54,500	418	22,781,000
6387	サムコ	91,800	1,060	97,308,000
6413	理想科学工業	717,500	1,700	1,219,750,000
6455	モリタ	732,000	512	374,784,000
6482	ユーシン精機	491,500	1,791	880,276,500
6622	ダイヘン	1,300,000	573	744,900,000
6669	シーシーエス	597	239,000	142,683,000
6670	MCJ	17,623	50,300	886,436,900
6676	メルコホールディングス	386,600	1,583	611,987,800
6718	アイホン	543,600	1,689	918,140,400
6788	日本トリム	189,000	2,410	455,490,000
6809	TOA	1,000,000	850	850,000,000
6867	リーダー電子	200,000	1,330	266,000,000
6914	オプテックス	702,900	1,474	1,036,074,600
6915	千代田インテグレ	558,100	1,940	1,082,714,000
6939	ユー・エム・シー・ジャパン	25,779	8,880	228,917,520
6996	ニチコン	406,200	1,039	422,041,800
7105	ニチュ	1,491,000	398	593,418,000
7427	エコートレディング	296,900	1,030	305,807,000
7458	第一興商	600,000	1,210	726,000,000
7483	ドウシシャ	746,400	1,882	1,404,724,800
7514	ヒマラヤ	295,000	465	137,175,000
7524	マルシェ	321,600	861	276,897,600
7631	マクニカ	78,200	2,250	175,950,000
7715	長野計器	250,400	980	245,392,000
7825	SRIスポーツ	2,603	136,000	354,008,000
7864	フジールインターナショナル	399,000	2,030	809,970,000
7905	大建工業	2,300,000	254	584,200,000
7931	未来工業	140,400	1,260	176,904,000
7943	ニチハ	601,800	870	523,566,000
7956	ビジョン	608,100	1,877	1,141,403,700
7971	東リ	1,688,000	193	325,784,000
7994	岡村製作所	900,000	882	793,800,000
8057	内田洋行	700,000	437	305,900,000
8078	阪和興業	2,901,000	439	1,273,539,000
8127	ヤマトインターナショナル	642,800	686	440,960,800
8186	大塚家具	293,900	1,605	471,709,500
8397	沖縄銀行	229,700	3,790	870,563,000
8551	北日本銀行	245,800	3,740	919,292,000
8924	リサ・バートナーズ	5,264	217,000	1,142,288,000
9055	アルプス物流	587,500	974	572,225,000
9603	エイチ・アイ・エス	378,200	1,974	746,566,800
9699	西尾レントオール	625,800	1,531	989,389,800
9719	住商情報システム	609,600	1,708	1,041,196,800
9743	丹青社	1,248,000	357	445,536,000
9830	トラスコ中山	784,500	1,482	1,162,629,000
9948	アークス	567,400	1,342	761,450,800
	合計	53,261,892		65,524,767,970

(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	(単位：円)	
			平成19年1月10日現在	平成20年1月10日現在
		注記 番号	金 額	金 額
資産の部				
流動資産				
コール・ローン			1,978,666,384	478,169,481
国債証券			46,816,042,028	48,157,204,614
地方債証券			5,789,576,210	7,545,922,839
特殊債券			9,915,004,018	8,985,460,305
社債券			19,818,767,558	27,084,807,270
未収入金			22,275,582,000	18,446,934,000
未収利息			224,810,539	264,604,268
前払費用			6,154,321	73,993,819
流動資産合計			106,824,603,058	111,037,096,596
資産合計			106,824,603,058	111,037,096,596
負債の部				
流動負債				
未払金			16,130,240,000	17,936,010,000
未払解約金			7,100,000,000	602,341,057
流動負債合計			23,230,240,000	18,538,351,057
負債合計			23,230,240,000	18,538,351,057
純資産の部				
元本等				
元本			80,061,123,747	85,731,293,726
剰余金				
剰余金			3,533,239,311	6,767,451,813
剰余金合計			3,533,239,311	6,767,451,813
元本等合計			83,594,363,058	92,498,745,539
純資産合計			83,594,363,058	92,498,745,539
負債・純資産合計			106,824,603,058	111,037,096,596

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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、地方債証券、特殊債券及び社債証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。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証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。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証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）又は証券取引所の発表する基準値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 金融商品取引所等において上場されている有価証券 金融商品取引所等において上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。	(1) 金融商品取引所等において上場されている有価証券 金融商品取引所等において上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等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ら入手した価値で評価しております。	(2) 金融商品取引所等において上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価値（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ら入手した価値で評価しております。	(2) 金融商品取引所等において上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価値（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。	(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。	(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。

(貸借対照表に関する注記)

		平成19年1月10日現在		平成20年1月10日現在	
1.	期首	平成18年1月11日	期首	平成19年1月11日	期首
	期首元本額	41,523,629,377 円	期首元本額	80,061,123,747 円	期首元本額
	期首からの追加設定元本額	45,941,299,565 円	期首からの追加設定元本額	17,822,199,992 円	期首からの追加設定元本額
	期首からの解約元本額	7,403,805,195 円	期首からの解約元本額	12,152,030,013 円	期首からの解約元本額
	平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※		平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※		
	GW 7つの卵	59,058,174,475 円	GW 7つの卵	62,244,713,936 円	GW 7つの卵
	グローバル・ラップ・バラン	3,915,084 円	グローバル・ラップ・バラン	4,441,397 円	グローバル・ラップ・バラン
	ス安定型		ス安定型		ス安定型
	グローバル・ラップ・バラン	3,778,448,667 円	グローバル・ラップ・バラン	3,867,716,168 円	グローバル・ラップ・バラン
	ス安定成長型		ス安定成長型		ス安定成長型
	グローバル・ラップ・バラン	4,235,584,760 円	グローバル・ラップ・バラン	4,609,154,855 円	グローバル・ラップ・バラン
	ス成長型		ス成長型		ス成長型
	グローバル・ラップ・バラン	6,863,223,594 円	グローバル・ラップ・バラン	8,887,020,735 円	グローバル・ラップ・バラン
	ス積極成長型		ス積極成長型		ス積極成長型
	GW 7つの卵（適格機関投資家向け）	4,460,735,597 円	GW 7つの卵（適格機関投資家向け）	4,383,429,241 円	GW 7つの卵（適格機関投資家向け）
	日本債券ファンド	395,795,082 円	日本債券ファンド	285,635,501 円	日本債券ファンド
	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	287,356,595 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	291,724,610 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン
	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	461,886,690 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	460,102,618 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン
	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	320,299,169 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	380,792,621 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン
	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	195,704,034 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	316,562,044 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン
	年金積立 グローバル・ラップ・バラン（合計）	80,061,123,747 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン（合計）	85,731,293,726 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン（合計）
	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	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	85,731,293,726 口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数

※ 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

(有価証券に関する注記)

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	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

対象期間 (自 平成19年1月11日 至 平成20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	48,157,204,614	154,087,080
地方債証券	7,545,922,839	121,424,560
特殊債券	8,985,460,305	105,509,405
社債券	27,084,807,270	△19,276,730
合計	91,773,395,028	361,744,315

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年1月10日現在	平成20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)	1,0441 円 (10,441 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,0789 円 (10,789 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 0058 利付国庫債券 (5年) 第58回	1,000,000,000	1,025,550,000	
	0045 0064 利付国庫債券 (5年) 第64回	16,500,000,000	16,949,955,000	
	0067 0208 利付国庫債券 (10年) 第208回	7,300,000,000	7,332,799,614	
	0067 0215 利付国庫債券 (10年) 第215回	12,500,000,000	12,767,000,000	
	0069 0092 利付国庫債券 (20年) 第92回	10,000,000,000	10,081,900,000	
		47,300,000,000	48,157,204,614	
	国債証券 計			
地方債証券	0100 0576 東京都公募公債 576回	310,000,000	315,164,600	
	0100 0620 東京都公募公債 620回	1,500,000,000	1,509,885,000	
	0100 0646 東京都公募公債 646回	600,000,000	623,448,000	
	0103 0107 神奈川県公募公債 107回	104,000,000	104,455,105	
	0103 0114 神奈川県公募公債 114回	100,000,000	101,631,000	
	0103 0129 神奈川県公募公債 129回	250,000,000	255,625,000	
	0104 0261 大阪府公募公債 261回	500,000,000	506,425,000	
	0106 1403 兵庫県公募公債 平成14年度3回	500,000,000	503,245,000	
	0106 1604 兵庫県公募公債 平成16年度4回	590,000,000	600,448,900	
	0106 1712 兵庫県公募公債 平成17年度12回	800,000,000	803,472,000	
	0111 1001 福岡県公募公債 平成10年度1回	103,100,000	103,550,767	
	0111 1201 福岡県公募公債 平成12年度1回	119,000,000	122,283,210	
	0111 1501 福岡県公募公債 平成15年度1回	100,500,000	100,570,769	
	0153 1102 神戸市公募公債 平成11年度2回	101,600,000	102,517,448	
	0155 9001 札幌市公募公債 1回	100,000,000	99,412,000	
	0200 0761 東京都公債 761回	200,000,000	204,734,000	
	0211 1405 埼玉県平成14年度公債ホ号	144,000,000	141,406,560	
	0211 1407 埼玉県平成14年度公債ト号	162,000,000	157,130,280	
	0211 1502 埼玉県平成15年度公債ロ号	350,000,000	353,885,000	
	0214 1501 神奈川県公債平成第15回い号	200,000,000	201,984,000	
	0240 1505 福岡県平成15年度第5回公債	500,000,000	498,845,000	
	0254 1408 横浜市平成14年度第8回事業公債	140,000,000	135,804,200	
	地方債証券 計	7,474,200,000	7,545,922,839	
特殊債券	0903 9042 日本政策投資銀行債券 (財投機関債) 第42回	500,000,000	496,160,000	
	0905 7004 日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債) 第4回	600,000,000	595,308,000	
	0905 7007 日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債) 第7回	100,000,000	104,017,000	
	0905 9020 道路債券 (財投機関債) 第20回	100,000,000	102,635,000	
	0905 9021 道路債券 (財投機関債) 第21回	600,000,000	617,364,000	
	0906 0767 政府保証公営企業債券 政府保証第767回	705,000,000	708,751,705	
	0906 9022 公営企業債券 (財投機関債) 第22回	800,000,000	833,560,000	
	0909 9001 水資源開発債債券 (財投機関債) 第1回	100,000,000	101,981,000	
	0912 9004 日本鉄道建設債債券 (財投機関債) 第4回	700,000,000	678,524,000	
	0914 1016 特別地域振興整備債券 特別第16回	325,000,000	331,974,500	
	0914 1019 特別地域振興整備債券 特別第19回	185,000,000	188,182,000	

特殊債券 計	0917 9010	都市基盤整備債券 (財投機関債) 第10回	200,000,000	206,022,000	
	0920 3138	は号特別道路債券 は号特別第138回	610,000,000	620,132,100	
	0936 1020	特別関西国際空港債券 特別第20回	400,000,000	409,941,000	
	0936 1021	特別関西国際空港債券 特別第21回	600,000,000	611,164,000	
	0936 9003	関西国際空港社債 (財投機関債) 第3回	800,000,000	841,896,000	
	0944 5197	は号特別鉄道建設債券 は号特別第197回	100,000,000	101,637,000	
	0959 1659	みずほコーポレート銀行債券 (5年) 利附い第659号	100,000,000	100,161,000	
	1293 0105	福岡北九州高速道路債券 第105回	200,000,000	201,774,000	
	1293 0107	福岡北九州高速道路債権 第107回	500,000,000	509,995,000	
	1293 0109	福岡北九州高速道路債券 第109回	500,000,000	521,245,000	
	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	104,033,000	
	特殊債券 計		8,825,000,000	8,985,460,305	
社債券	1108 1015	メルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債 (劣後特約付) 1回	400,000,000	358,100,000	
	1210 1002	ゼネラル・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	404,512,000	
	1218 1009	エイチエスビーシー・フアイナンス・コーポレーション 第9回円貨社債 (2005)	800,000,000	776,056,000	
	1218 1013	エイチエスビーシー・フアイナンス・コーポレーション 第13回円貨社債 (2007)	400,000,000	395,028,000	
	1222 1003	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第3回円貨社債 (2004)	500,000,000	495,610,000	
	1222 1008	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第8回円貨社債 (2006)	500,000,000	492,355,000	
	1223 1006	リーマン・ブラザーズ・ホールディングス・インク 第6回円貨社債 (2007)	500,000,000	478,605,000	
	2768 0601	双日 (社債間限定同順位特約付) 6回	400,000,000	401,080,000	
	2768 0701	双日 (社債間限定同順位特約付) 7回	200,000,000	203,450,000	
	2768 0901	双日 (社債間限定同順位特約付) 9回	100,000,000	101,901,000	
	6758 1901	日産自動車 (社債間限定同順位特約付) ソニー 19回	400,000,000	406,684,000	
	7201 4501	マツダ (社債間限定同順位特約付) 23回	300,000,000	303,219,000	
	7261 2301	阪和興業 (社債間限定同順位特約付) 19回	500,000,000	499,315,088	
	8078 1901	りそなホールディングス (社債間限定同順位特約付) 6回	400,000,000	402,056,000	
	8308 0601	みずほコーポレート銀行 (劣後特約付) 2回	800,000,000	825,952,000	
	8310 0204	三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付) 11回	500,000,000	514,000,000	
	8315 1106	千葉銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 2回	400,000,000	404,144,000	
	8331 0202	東京都市銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 1回	400,000,000	400,668,000	
	8339 0102	東京都市銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 2回	800,000,000	803,144,000	
	8339 0202	岩手銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 2回	200,000,000	202,582,000	
	8345 0202	十六銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 1回	700,000,000	704,886,000	
第2	8356 0102	広島銀行 (劣後特約付) 3回	200,000,000	208,688,000	
	8379 0304	広島銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 11回	700,000,000	706,846,000	
	8400 0102	埼玉りそな銀行 (変動劣後特約付) 1回	300,000,000	301,227,000	
	8403 0604	住友信託銀行 (劣後特約付) 6回	400,000,000	394,224,000	
	8410 0201	セブン銀行 (社債間限定同順位特約付) 2回	300,000,000	302,730,000	
	8412 0804	三井住友銀行 (劣後特約付) 8回	1,000,000,000	1,016,980,000	
	8413 0604	みずほ銀行 (劣後特約付) 6回	500,000,000	512,740,000	
	8413 0704	みずほ銀行 (劣後特約付) 7回	500,000,000	496,955,000	
	社債券 計		27,000,000,000	27,084,807,270	
	合計		90,599,200,000	91,773,395,028	

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。

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	100,298,000
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	512,325,000
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	697,447,576
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	501,650,000
8545 0602	関西アーバン銀行期限前償還条項付 (劣後特約付) 6回	800,000,000	803,632,000
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	99,818,000
8572 2701	アコム (特定社債間限定同順位特約付) 27回	100,000,000	100,150,606
8572 4301	アコム (特定社債間限定同順位特約付) 43回	300,000,000	291,042,000
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	974,890,000
8574 3501	プロミス (特定社債間限定同順位特約付) 35回	600,000,000	581,724,000
8583 0101	UFJニコス (社債間限定同順位特約付) 1回	400,000,000	400,520,000
8591 0083	オリックス (社債間限定同順位特約付) 83回	700,000,000	697,424,000
8591 0111	オリックス (社債間限定同順位特約付) 111回	300,000,000	298,170,000
8730 0001	住友生命第2回基金流動化特定目的会社 特定社債1回	400,000,000	406,776,000
8775 0152	フコク生命基金流動化特定目的会社 特定社債1回B号	400,000,000	405,696,000
8776 0001	第一生命第3回基金流動化特定目的会社 特定社債1回	700,000,000	714,315,000
8792 0151	住友生命劣後債権流動化特定目的会社 特定社債1回A号	400,000,000	412,516,000
8830 6201	住友不動産 (社債間限定同順位特約付) 62回	500,000,000	504,840,000
8840 0301	大京 (社債間限定同順位特約付) 3回	300,000,000	300,915,000
8958 0101	グローバル・フロ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	600,000,000	595,884,000
9006 2801	京浜急行電鉄 (社債間限定同順位特約付) 28回	100,000,000	102,387,000
9501 0532	東京電力 532回	300,000,000	303,312,000
9502 0484	中部電力 484回	700,000,000	706,580,000
9503 0451	関西電力 451回	700,000,000	721,364,000
9509 0293	北海道電力 293回	900,000,000	918,783,000
9984 2501	ソフトバンク (社債間限定同順位特約付) 25回	900,000,000	920,961,000
社債券 計		27,000,000,000	27,084,807,270
合計		90,599,200,000	91,773,395,028

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

科 目		対象年月日		(単位：円)	
		注記 番号	平成19年1月10日現在	平成20年1月10日現在	
資産の部					
流動資産					
預金			205,012,910	4,001,276,716	
コール・ローン			9,844,297,643	150,399,252	
株式			112,569,328,553	106,819,861,935	
社債券			306,194,729	331,011,133	
投資証券			231,207,030	453,645,844	
派生商品評価勘定			121,710	23,864	
未収入金			525,545,324	20,940,127	
未収配当金			113,129,720	126,239,086	
未収利息			763,719	1,047,281	
前払費用			47,627	-	
流動資産合計			123,795,648,965	111,904,445,238	
資産合計			123,795,648,965	111,904,445,238	
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			-	36,304	
未払金			104,063,202	360,960,732	
未払解約金			9,601,000,000	415,208	
流動負債合計			9,705,063,202	361,412,244	
負債合計			9,705,063,202	361,412,244	
純資産の部					
元本等					
元本			88,105,696,555	96,326,865,763	
剰余金					
剰余金			25,984,889,208	15,216,167,231	
剰余金合計			25,984,889,208	15,216,167,231	
元本等合計			114,090,585,763	111,543,032,994	
純資産合計			114,090,585,763	111,543,032,994	
負債・純資産合計			123,795,648,965	111,904,445,238	

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	対象期間 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。	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日 株式及び投資証券は移動平均法、新株予約権付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。	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所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）又は金融商品取引所等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、売気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。	(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提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。	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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となる重要な事項	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。	外貨建取引等の処理基準 同左 同左 同左 同左

(貸借対照表に関する注記)

平成19年1月10日現在			平成20年1月10日現在		
1. 期首	平成18年1月11日	期首	平成19年1月11日	期首	平成20年1月10日現在
期首元本額	48,477,604,275 円	期首元本額	88,105,696,555 円	期首元本額	88,105,696,555 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	22,434,506,320 円	期首からの追加設定元本額	22,434,506,320 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	14,213,337,112 円	期首からの解約元本額	14,213,337,112 円
平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※			平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※		
GW 7 つの卵	66,832,825,642 円	GW 7 つの卵	69,745,098,153 円	GW 7 つの卵	69,745,098,153 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス安定型	402,088 円	ス安定型	541,727 円	ス安定型	541,727 円
グローバル・ラップ・バラン	614,344,943 円	グローバル・ラップ・バラン	736,351,102 円	グローバル・ラップ・バラン	736,351,102 円
ス安定成長型		ス安定成長型		ス安定成長型	
グローバル・ラップ・バラン	1,172,603,643 円	グローバル・ラップ・バラン	1,556,412,638 円	グローバル・ラップ・バラン	1,556,412,638 円
ス成長型		ス成長型		ス成長型	
グローバル・ラップ・バラン	7,564,436,753 円	グローバル・ラップ・バラン	9,957,302,122 円	グローバル・ラップ・バラン	9,957,302,122 円
ス積極成長型		ス積極成長型		ス積極成長型	
グローバル・ラップ・バラン	3,151,004,759 円	グローバル・ラップ・バラン	4,284,086,730 円	グローバル・ラップ・バラン	4,284,086,730 円
ス積極型		ス積極型		ス積極型	
グローバル・ラップ・バラン	2,824,076,150 円	グローバル・ラップ・バラン	3,568,971,431 円	グローバル・ラップ・バラン	3,568,971,431 円
ス超積極型		ス超積極型		ス超積極型	
GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	4,921,469,939 円	GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	5,257,478,137 円	GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	5,257,478,137 円
北米株式ファンド	426,998,076 円	北米株式ファンド	324,257,277 円	北米株式ファンド	324,257,277 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	29,604,403 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	35,693,729 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定型)	35,693,729 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	75,817,592 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	90,130,640 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	90,130,640 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	88,674,555 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	128,823,131 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (成長型)	128,823,131 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	214,703,087 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	353,602,830 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	353,602,830 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型)	188,734,925 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型)	288,116,116 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス (積極型)	288,116,116 円
(合計)	88,105,696,555 円	(合計)	96,326,865,763 円	(合計)	96,326,865,763 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	88,105,696,555 口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	96,326,865,763 口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	96,326,865,763 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

(有価証券に関する注記)

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

(単位：円)

対象期間 (自 平成19年1月11日 至 平成20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	106,819,861,935	△9,427,710,248
社債券	331,011,133	△68,810,738
投資証券	453,645,844	△46,542,590
合 計	107,604,518,912	△9,543,063,576

(単位：円)

(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

	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	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、リスク管理業務担当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

(通貨関連)

区 分	種 類	平成19年1月10日現在			評価損益
		契 約 額	時 価		
			額 等		
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引		うち1年超		
	買建	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

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式（アメリカドル）

(単位：株、アメリカドル)

銘柄	株 数	評価額		備 考
		単価	金額	
00105510 AFLAC INC	94,500	65.55000	6,194,475.00	
00130H10 AES CORPORATION	106,500	21.51000	2,290,815.00	
00282410 ABBOTT LABORATORIES	78,400	60.04000	4,707,136.00	
00819010 AFFILIATED COMPUTER SERVICES INC-A	55,600	41.07000	2,283,492.00	
00846U10 AGILENT TECHNOLOGIES INC	112,500	35.38000	3,980,250.00	
01741R10 ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,800	75.48000	1,117,104.00	
01849010 ALLERGAN INC	126,500	66.13000	8,365,445.00	
02144110 ALTERA CORPORATION	284,800	17.73000	5,049,504.00	
02313910 AMBAC FINANCIAL GROUP INC	168,200	19.25000	3,237,850.00	
02364J10 TIME WARNER INC	196,500	15.93000	3,130,245.00	
02493710 AMERICAN CAPITAL STRATEGIES LTD	83,900	31.21000	2,618,519.00	
02660910 WYETH	45,300	47.36000	2,145,408.00	
02687410 AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	229,400	56.48000	12,956,512.00	
02991220 AMERICAN TOWER CORP	96,400	38.50000	3,711,400.00	
03060R10 AMERICREDIT CORP	113,800	10.69000	1,216,522.00	
03251110 ANADARKO PETROLEUM CORP	41,600	62.92000	2,617,472.00	
03522910 ANHEUSER-BUSCH COMPANIES INC	47,900	53.79000	2,576,541.00	
03822210 APPLIED MATERIALS INC	696,700	16.64000	11,593,088.00	
03938010 ARCH COAL INC	60,500	38.93000	2,355,265.00	
05548210 BJ SERVICES CO	281,300	22.53000	6,337,689.00	
05722410 BAKER HUGHES INC	65,900	78.96000	5,203,464.00	
06751110 BARE ESSENTIALS INC	79,000	21.27000	1,680,330.00	
06790110 BARRICK GOLD CORPORATION	417,800	50.03000	20,902,534.00	
07181310 BAXTER INTERNATIONAL INC	253,800	64.17000	16,286,346.00	
07785310 VERIZON COMMUNICATIONS INC	57,700	42.47000	2,450,519.00	
08467010 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL A	57	130,400,00000	7,432,800.00	
08651610 BEST BUY CO INC	233,900	46.43000	10,859,977.00	
09702310 BOEING CO	91,100	80.30000	7,315,330.00	
11012210 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	200,800	27.08000	5,437,664.00	
11162110 BROCADE COMMUNICATIONS SYSTEM	499,400	6.34000	3,166,196.00	
12485720 CBS CORP	173,950	24.00000	4,174,800.00	
12589610 CMS ENERGY CORP	107,700	16.90000	1,820,130.00	
13321L10 CAMECO CORPORATION	96,800	38.69000	3,745,192.00	
13442910 CAMPBELL SOUP CO	80,000	34.32000	2,745,600.00	
14040H10 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69,200	43.35000	2,999,820.00	
14912310 CATERPILLAR INC	29,900	67.23000	2,010,177.00	
15087010 CELANESE CORP	42,000	38.30000	1,608,600.00	
15678210 CERNER CORP	41,500	58.16000	2,413,640.00	
16161A10 JPMORGAN CHASE & CO	491,200	40.26000	19,775,712.00	
16675110 CHEVRON CORPORATION	48,700	92.57000	4,508,159.00	
17177910 CIENA CORP	23,000	27.39000	629,970.00	
17275R10 CISCO SYSTEMS INC	516,000	26.24000	13,539,840.00	
18589610 CLEVELAND-CLIFFS INC	18,400	89.09000	1,639,256.00	
18975410 COACH INC	37,400	27.32000	1,021,768.00	
19121610 COCA-COLA COMPANY	107,000	65.27000	6,983,890.00	
20030010 COMCAST CORP-CL A	139,500	17.06000	2,379,570.00	
21666910 COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	31,700	48.69000	1,543,473.00	
21935010 CORNING INC	99,400	22.43000	2,229,542.00	

(単位：円)

区 分	種 類	平成20年1月10日現在				評価損益
		契 約 額	時 価			
			額 等	価		
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引		うち1年超			
	売建	3,844,678	-	3,880,982	△36,304	
	アメリカドル	3,844,678	-	3,880,982	△36,304	
	買建	3,844,678	-	3,868,542	23,864	
	カナダドル	3,844,678	-	3,868,542	23,864	
合 計		7,689,356	-	7,749,524	△12,440	

(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仲値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の仲値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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20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)	1,2949 円 (12,949 円)	1口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1,1580 円 (11,580 円)

(3) 附属明細表

22160Q10	COSTCO WHOLESALE CORP	48,600	67.27000	3,269,322.00	
23585110	DANAHER CORP	64,300	81.11000	5,215,373.00	
23918K10	DAVITA INC	111,100	58.79000	6,531,569.00	
23975310	TARGET CORP	378,400	49.92000	18,889,728.00	
24702510	DELL INC	182,800	20.93000	3,826,004.00	
25468710	THE WALT DISNEY CO.	354,500	30.16000	10,691,720.00	
27864210	EBAY INC	395,100	29.87000	11,801,637.00	
28102010	EDISON INTERNATIONAL	119,600	54.64000	6,534,944.00	
29101110	EMERSON ELECTRIC CO	70,000	53.09000	3,716,300.00	
29266R10	ENERGIZER HOLDINGS INC	28,200	104.83000	2,986,206.00	
29356210	EOG RESOURCES INC	20,600	89.18000	1,837,108.00	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	80,200	91.56000	7,343,112.00	
31304N10	FEDEX CORP	50,200	82.78000	4,155,556.00	
31340030	FREDDIE MAC	173,400	27.14000	4,706,076.00	
31358610	FANNIE MAE	173,000	32.71000	5,688,830.00	
31677310	FIFTH THIRD BANCORP	84,200	23.16000	1,950,072.00	
33735810	WACHOVIA CORP	460,466	35.07000	16,148,542.62	
34386110	FLUOR CORP	77,100	137.59000	10,608,189.00	
34537010	FORD MOTOR CO	762,400	6.07000	4,627,768.00	
34583810	FOREST LABORATORIES INC	297,700	37.35000	11,119,095.00	
34963110	FORTUNE BRANDS INC	24,200	67.72000	1,638,824.00	
35671D85	FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	33,900	96.86000	3,283,554.00	
36473010	GANNETT CO	76,300	32.45000	2,475,935.00	
36871010	GENENTECH INC	290,300	70.11000	20,352,933.00	
36960410	GENERAL ELECTRIC COMPANY	293,900	35.80000	21,261,620.00	
37033410	GENERAL MILLS INC	28,700	57.12000	1,639,344.00	
37034210	GENERAL MOTORS CORP	54,700	22.78000	1,246,066.00	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	71,900	191.75000	13,796,825.00	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	41,200	653.20000	26,911,840.00	
41034510	HANSEN BRANDS INC	207,850	24.31000	5,052,833.50	
42823610	HEWLETT-PACKARD CO	34,700	44.44000	1,542,068.00	
43707610	HOME DEPOT INC	124,900	24.73000	3,088,777.00	
44368310	HUSSON CITY BANCORP INC	494,000	14.32000	7,074,080.00	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	137,700	47.54000	6,546,258.00	
45245W10	IMCONE SYSTEMS INC	174,100	38.35000	6,676,735.00	
45660710	INDYMAC BANCORP INC	201,700	4.70000	947,990.00	
45814010	INTEL CORP	154,900	22.75000	3,523,975.00	
46631310	JABIL CIRCUIT INC	403,100	14.46000	5,828,826.00	
47110910	JARDEN CORP	43,000	19.95000	857,850.00	
47836610	JOHNSON CONTROLS INC	70,500	33.62000	2,370,210.00	
48248010	KLA-TENCOR CORPORATION	204,100	42.54000	8,682,414.00	
50075N10	KRAFT FOODS INC-A	358,082	31.79000	11,383,426.78	
51280710	LAM RESEARCH CORPORATION	51,800	38.87000	2,013,466.00	
51783410	LAS VEGAS SANDS CORP	54,800	86.88000	4,761,024.00	
51843910	ESTEEL LAUDER COMPANIES-CL A	50,000	41.96000	2,098,000.00	
52490810	LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC	114,000	54.99000	6,268,860.00	
52605710	LENNAR CORP-CL A	79,400	13.86000	1,100,484.00	
52729N10	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	500,000	2.93000	1,465,000.00	
54866110	LOWE'S COS INC	559,400	20.66000	11,557,204.00	
55262C10	MEDIA INC	209,700	13.40000	2,809,980.00	
57174810	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	187,800	26.50000	4,976,700.00	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	44,400	57.47000	2,551,668.00	
58505510	MEDTRONIC INC	164,500	50.76000	8,350,020.00	
59491810	MICROSOFT CORP	403,044	34.44000	13,880,835.36	
59511210	MICRON TECHNOLOGY INC	848,200	6.20000	5,258,840.00	
59990210	MILLENNIUM PHARMACEUTICALS INC	335,900	15.08000	5,065,372.00	
61166W10	MONSANTO CO	40,600	119.54000	4,853,324.00	
61536910	MOODY'S CORPORATION	45,300	33.18000	1,503,054.00	
64120L10	NETWORK APPLIANCE INC	63,100	22.92000	1,446,252.00	

65163910	NEWMONT MINING CORP	40,000	52.92000	2,116,800.00	
65566410	NORDSTROM INC	63,100	32.31000	2,038,761.00	
68191910	OMNICOM GROUP INC	55,000	46.17000	2,539,350.00	
68389X10	ORACLE CORP	180,500	21.61000	3,900,605.00	
70432610	PAYCHEX INC	67,600	33.51000	2,265,276.00	
70454910	PEABODY ENERGY CORPORATION	59,900	54.89000	3,287,911.00	
71344810	PEPSICO INC	161,000	78.74000	12,677,140.00	
71708110	PFTIZER INC	234,000	23.92000	5,597,280.00	
71815410	ALTRIA GROUP INC	121,400	79.21000	9,616,094.00	
71850710	CONOCOPHILLIPS	46,800	83.71000	3,917,628.00	
72348410	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	74,600	42.34000	3,158,564.00	
73172K10	POLYCOM INC	79,500	24.00000	1,908,000.00	
73755L10	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	1,200	138.00000	165,600.00	
74331510	PROGRESSIVE CORP	127,900	18.42000	2,355,918.00	
74690410	QUIONDA AG-SPON ADR	232,400	6.40000	1,487,360.00	
74752510	QUALCOMM INC	254,800	37.79000	9,628,892.00	
78025920	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR A	216,800	84.25000	18,265,400.00	
78387G10	AT&T INC	248,100	39.00000	9,675,900.00	
80004C10	SANDISK CORPORATION	349,200	28.98000	10,119,816.00	
80105N10	SANOFI-AVENTIS -ADR	188,700	48.78000	9,204,786.00	
80305420	SAP AG-SPONSORED ADR	30,100	48.10000	1,447,810.00	
80311110	SARA LEE CORP	476,500	15.79000	7,523,935.00	
80685710	SCHLUMBERGER LTD	148,800	98.61000	14,673,168.00	
81731510	SEPRACOR INC	189,500	28.51000	5,402,645.00	
82619750	SIEMENS AG	15,000	144.19000	2,162,850.00	
82691910	SILICON LABORATORIES INC	14,800	31.35000	463,980.00	
84474110	SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	157,900	11.27000	1,779,533.00	
85524410	STARBUCKS CORP	101,900	19.46000	1,982,974.00	
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	22,500	38.84000	873,900.00	
86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	110,400	15.66000	1,728,864.00	
86791410	SUNTRUST BANKS INC	65,600	59.75000	3,919,600.00	
87294110	MONSTER WORLDWIDE INC	43,600	29.06000	1,267,016.00	
88490310	THOMSON CORP/THE	27,600	37.36000	1,031,136.00	
88731910	TIME WARNER TELECOM INC	348,300	18.19000	6,335,577.00	
88732J10	TIME WARNER CABLE INC	58,600	24.19000	1,417,534.00	
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	39,325	37.34000	1,468,395.50	
90390U10	SLM CORP	432,100	18.64000	8,054,344.00	
90478450	UNITLEVER N V -NY SHARES	108,600	35.69000	3,875,934.00	
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	432,200	56.19000	24,285,318.00	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	234,600	66.71000	15,650,166.00	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	93,300	71.96000	6,713,868.00	
91704710	URBAN OUTFITTERS INC	131,500	25.74000	3,384,810.00	
92342Y10	VERIFONE HOLDINGS INC	133,100	15.88000	2,113,628.00	
92552430	VIACOM INC-CLASS B	86,550	40.28000	3,486,234.00	
93932210	WASHINGTON MUTUAL INC	507,700	12.34000	6,265,018.00	
93932281	WASHINGTON MUTUAL INC 7.75% SERIES R	5,090	752.98450	3,832,691.10	
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	100,200	67.68000	6,781,536.00	
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	260,000	27.04000	7,030,400.00	
98391910	XILINX INC	74,200	20.00000	1,484,000.00	
98433210	YAHOO! INC	328,500	22.56000	7,410,960.00	
98934D10	ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	264,200	45.30000	11,968,260.00	
99990000	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	179,400	10.90000	1,955,460.00	
G7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	155,100	23.51000	3,646,401.00	
G9825510	XL CAPITAL LTD -CLASS A	63,500	47.50000	3,016,250.00	
N0705911	ASML HOLDING NV-NY REG SHS	69,244	28.29000	1,958,912.76	
アメリカドル 計		26,807,458		913,029,139.62	
(邦貨換算額)				(100,551,899,146)	

外国株式（カナダドル）

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ABX	BARRICK GOLD CORP	12,900	50.65000	653,385.00	
CCO	CAMECO CORP CORPORATION	33,800	39.13000	1,322,594.00	
CNR	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	31,800	44.50000	1,415,100.00	
ECA	ENCANA CORP	21,600	69.35000	1,497,960.00	
PFH	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	6,200	284.62000	1,764,644.00	
FTT	FINNING INTERNATIONAL INC	47,000	27.01000	1,269,470.00	
GIL	GILDED ACTIVEWEAR INC	85,400	40.05000	3,420,270.00	
IMN	IMMET MINING CORP	77,000	76.91000	5,922,070.00	
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	82,000	38.78000	3,179,960.00	
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	109,300	139.07000	15,200,351.00	
POW	POWER CORP OF CANADA	66,000	36.79000	2,428,140.00	
RCI/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	43,400	40.95000	1,777,230.00	
RIM	RESEARCH IN MOTION	20,600	99.42000	2,048,062.00	
SC	SHOPPERS DRUG MART CORP	77,400	53.45000	4,137,030.00	
SJRB	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	146,000	22.50000	3,285,000.00	
SLC	SUN LIFE FINANCIAL INC	78,700	52.84000	4,158,508.00	
SU	SUNCOR ENERGY INC	18,600	109.16000	2,030,376.00	
TD	TORONTO-DOMINION BANK	30,400	66.29000	2,015,216.00	
カナダドル 計		988,100		57,525,356.00	
(邦貨換算額)				(6,267,962,789)	

(単位：株、カナダドル)

外貨建債券

種類	銘柄	評価額	備考
社債券	536102 Ford Motor Company 4.25% 20361215	3,267,000.00	3,005,640.00
社債券 計		3,267,000.00	3,005,640.00
アメリカドル 計		3,267,000.00	3,005,640.00
(邦貨換算額)		(359,794,710)	(331,011,133)

(単位：アメリカドル)

総合計		(359,794,710)	(331,011,133)
359,794,710		331,011,133	

(単位：円)

(注) 総合計の（ ）内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価比率 (%)	組入債券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	株式 162銘柄	99.3	-	-	93.5
アメリカドル	社債券 1銘柄	-	-	0.3	0.3
アメリカドル	投資証券 2銘柄	-	0.4	-	0.4
カナダドル	株式 18銘柄	100.0	-	-	5.8

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) 株式以外の有価証券

(外国投資証券)

外国投資証券（アメリカドル）

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
25960P10	DOUGLAS EMMETT INC	84,300		1,793,061.00	
80660570	SCHERING-PLOUGH CORP	9,400		2,326,124.00	
アメリカドル 計		93,700		4,119,185.00	
(邦貨換算額)				(453,645,844)	

(単位：アメリカドル)

総合計				(453,645,844)	
453,645,844				(453,645,844)	

(単位：円)

(注1) 総合計の（ ）内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

対象年月日			平成19年1月10日現在		平成20年1月10日現在	
科 目	注記 番号		金 額		金 額	
資産の部						
流動資産						
預金			95,339,946			-
コール・ローン			8,828,049,171			810,931,110
株式			108,809,827,126			91,324,336,915
投資証券			1,145,519,971			909,138,224
未収入金			-			2,054,466
未収配当金			118,323,479			139,622,012
流動資産合計			118,997,059,693			93,186,082,727
資産合計			118,997,059,693			93,186,082,727
負債の部						
流動負債						
未払解約金			8,502,000,000			442,984
流動負債合計			8,502,000,000			442,984
負債合計			8,502,000,000			442,984
純資産の部						
元本等						
元本			48,928,939,986			42,626,181,983
剰余金						
剰余金			61,566,119,707			50,559,457,760
剰余金合計			61,566,119,707			50,559,457,760
元本等合計			110,495,059,693			93,185,639,743
純資産合計			110,495,059,693			93,185,639,743
負債・純資産合計			118,997,059,693			93,186,082,727

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	対象期間	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つ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) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売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、投資信託委託会社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額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもつ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)

平成19年1月10日現在		平成20年1月10日現在	
1. 期首	平成18年1月11日	期首	平成19年1月11日
期首元本額	26,439,944,000 円	期首元本額	48,928,939,986 円
期首からの追加設定元本額	30,437,435,251 円	期首からの追加設定元本額	9,052,727,704 円
期首からの解約元本額	7,948,439,265 円	期首からの解約元本額	15,355,485,707 円
平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※		平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※	
GW 7 つの卵	37,157,090,082 円	GW 7 つの卵	30,638,146,056 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス安定型	181,279 円	ス安定型	183,654 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス安定成長型	275,361,301 円	ス安定成長型	320,702,419 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス成長型	629,685,577 円	ス成長型	643,778,608 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス積極成長型	4,129,511,224 円	ス積極成長型	4,401,053,696 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス積極型	1,703,619,277 円	ス積極型	1,855,223,966 円
グローバル・ラップ・バラン		グローバル・ラップ・バラン	
ス超積極型	1,805,532,150 円	ス超積極型	1,805,177,377 円
GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)		GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	
2,585,585,482 円		2,317,643,609 円	
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・バラン	331,724,681 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	260,314,226 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	12,157,345 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	12,141,719 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	34,161,045 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	38,259,839 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	46,577,132 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	52,942,027 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	115,463,910 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	155,662,660 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	102,289,501 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン	124,902,127 円
(合計)	48,928,939,986 円	(合計)	42,626,181,983 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期末日における当該親投資信託の受益権の総数		2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期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	7,166,959,630
投資証券	1,145,519,971	234,645,611
合計	109,955,347,097	7,401,605,241

対象期間 (自 平成19年1月11日 至 平成20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	91,324,336,915	△8,140,155,741
投資証券	909,138,224	△419,886,233
合計	92,233,475,139	△8,560,041,974

(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)

1 取引の状況に関する事項

取引の内容	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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、通貨オプション取引、金利先物取引、金利先渡し取引、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、リスク管理業務担当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

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20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)	2,2583 円 (22,583 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1861 円 (21,861 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)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
AAL	142,105	28,65000	4,071,308.25	
ABF	475,582	3,754,719.89		
BCS	2,794,505	4,58750	12,819,791.68	
BP	3,568,669	6,10500	21,786,724.24	
BSY	1,024,184	5,58500	5,720,067.64	
CBRY	1,238,219	6,02500	7,460,269.47	
CNA	2,391,066	3,45000	8,249,177.70	
COB	1,054,023	2,06750	2,179,192.55	
KGF	3,584,549	4,132,984.99		
LOG	2,086,479	1,07250	2,237,748.72	
POC	200,987	19,79000	3,977,532.73	
PRU	1,407,645	6,87500	9,677,659.37	
RIO	103,343	50,01000	5,168,183.43	
SSE	243,319	16,59000	4,036,662.21	
TNN	1,036,393	1,93000	2,000,238.49	
TSCO	1,808,151	4,18750	7,571,632.31	
VOD	9,794,656	1,88100	18,423,747.93	
WOS	1,112,129	6,53000	7,262,202.37	
イギリスポンド 計	34,066,004		130,529,743.97	
(邦貨換算額)			(28,153,960,477)	

外国株式 (スイスフラン)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
CS	404,602	62,70000	25,368,545.40	
HOL	85,090	113,70000	9,674,733.00	
NOVN	566,260	65,05000	36,835,213.00	
ROCF	195,955	207,70000	40,699,853.50	
SYST	37,028	139,60000	5,169,108.80	
スイスフラン 計	1,288,935		117,747,453.70	
(邦貨換算額)			(11,621,673,680)	

外国株式 (スウェーデンクローナ)

(単位：株、スウェーデンクローナ)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
LMBB	3,829,000	13,95000	53,414,550.00	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS				
MODO	98,300	222,50000	21,871,750.00	
SCAB	509,800	110,75000	56,460,350.00	
SEBA	323,000	155,50000	50,226,500.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A				
スウェーデンクローナ 計	4,760,100		181,973,150.00	
(邦貨換算額)			(3,122,659,254)	

外国株式 (ユーロ)

(単位：株、ユーロ)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
AEGO	685,305	11,39000	7,805,623.95	
AI	49,598	104,70000	5,192,910.60	
AIB	577,969	9,82200	5,676,811.51	
ALPHA	205,401	24,90000	5,114,484.90	
ASML	184,490	19,20000	3,542,208.00	
BAYE	109,389	65,68000	7,184,669.52	
BCSA	909,904	13,65000	12,420,189.60	
BI	1,793,254	5,12000	9,181,460.48	
BKIR	768,564	10,11700	7,775,561.98	
BNP	155,132	71,22000	11,048,501.04	
CRH	250,655	22,85000	5,727,466.75	
DBK	183,075	84,80000	15,524,760.00	
DCYG	254,472	56,70000	14,428,562.40	
DPW	543,500	24,18000	13,141,830.00	
FTE	910,531	25,87000	23,555,436.97	
HEN	353,931	36,19000	12,808,762.89	
IPM	229,157	11,20000	2,566,558.40	
LYOE	334,804	48,30000	16,171,033.20	
MEG	197,883	51,08000	10,107,863.64	
MIDI	455,185	25,56000	11,634,528.60	
MT	119,286	46,70000	5,570,656.20	
ORDN	226,336	10,36000	2,344,840.96	
PHG	100,498	27,15000	2,728,520.70	
RENA	115,519	82,78000	9,562,662.82	
SAP	261,168	32,70000	8,540,193.60	
SM	199,136	98,13000	19,541,215.88	
STER	377,956	9,98000	3,772,000.88	
TKAV	156,141	19,05000	2,974,486.05	
TOL	552,858	58,74000	32,474,878.92	
TP	448,491	25,83000	11,584,522.53	
ユーロ 計	11,709,588		299,703,202.77	
(邦貨換算額)			(48,426,043,504)	

(単位：円)

総合計				(91,324,336,915)
-----	--	--	--	------------------

(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

(外国投資証券)

(単位：ユーロ)				
外国投資証券 (ユーロ)				
銘柄	銘柄	券面総額	評価額	備考
UL	UNIBAIL-RODAMCO	38,459	5,626,551.70	
ユーロ計		38,459	5,626,551.70	
(邦貨換算額)			(909,138,224)	

(単位：円)			
総合計			
		(909,138,224)	909,138,224

(注1) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	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 18銘柄	100.0	-	30.5
スイスフラン	株式 5銘柄	100.0	-	12.6
スウェーデンクローナ	株式 4銘柄	100.0	-	3.4
ユーロ	株式 30銘柄	98.2	-	52.5
ユーロ	投資証券 1銘柄	-	1.8	1.0

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。

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	平成19年1月10日現在	
		注記 番号	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン			3,101,422,331
株式			40,768,616,377
投資証券			789,791,317
未収入金			223,666,435
未収配当金			33,065,192
流動資産合計			44,916,561,652
資産合計			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			3,001,000,000
流動負債合計			3,023,322,476
負債合計			3,023,322,476
純資産の部			
元本等			
元本			12,796,318,061
剰余金			
剰余金			29,096,921,115
剰余金合計			29,096,921,115
元本等合計			41,893,239,176
純資産合計			41,893,239,176
負債・純資産合計			44,916,561,652
			48,567,894,310

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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。	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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売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から入手し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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売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から入手し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	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 同左
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 同左
4. その他財務諸表作成のための基となる重要な事項	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。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

	平成19年1月10日現在	平成20年1月10日現在
1. 期首	平成18年1月11日 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 期首元本額 12,796,318,061 円 期首からの追加設定元本額 3,138,670,792 円 期首からの解約元本額 3,804,591,393 円
2. 期末	平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW 7 つの卵 9,451,303,674 円 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 52,578 円 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 82,341,292 円 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 176,590,017 円 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 1,069,888,662 円 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 489,182,408 円 グローバル・ラップ・バラン ス 超積極型 613,661,611 円 GW 7 つの卵（適格機関投資家向け） 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. 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	平成20年1月10日現在の元本の内訳 ※ GW 7 つの卵 8,488,425,372 円 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 62,187 円 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 89,785,748 円 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 180,346,839 円 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 1,225,020,089 円 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 544,513,422 円 グローバル・ラップ・バラン ス 超積極型 701,940,292 円 GW 7 つの卵（適格機関投資家向け） 652,948,584 円 アジア太平洋先進国株式ファンド 137,401,467 円 年金積立 グローバル・ラップ・バラン ス（安定型） 4,095,592 円 年金積立 グローバル・ラップ・バラン ス（安定成長型） 10,505,912 円 年金積立 グローバル・ラップ・バラン ス（成長型） 14,840,675 円 年金積立 グローバル・ラップ・バラン ス（積極成長型） 43,546,205 円 年金積立 グローバル・ラップ・バラン ス（積極型） 36,965,076 円 （合計） 12,130,397,460 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 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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
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

対象期間 (自 平成 19 年 1 月 11 日 至 平成 20 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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	46,607,128,830	3,235,641,754
投資証券	1,163,566,217	△161,363,507
合計	47,770,695,047	3,074,278,247

(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

	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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、通貨オプシオン取引、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
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	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、リスク管理業務担当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

(単位：円)

(通貨関連)				
区 分	種 類	平成19年1月10日現在		評価損益
		契 約 額	時 価	
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引			
	売建	166,796,125	167,539,748	△743,623
	アメリカドル	166,796,125	167,539,748	△743,623
合計		166,796,125	167,539,748	△743,623

(単位：円)

(単位：円)				
区 分	種 類	平成20年1月10日現在		評価損益
		契 約 額	時 価	
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引			
	売建	84,616,056	85,414,817	△798,761
	オーストラリアドル	84,616,056	85,414,817	△798,761
合計		84,616,056	85,414,817	△798,761

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20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)	3,2739 円 (32,739 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4,0037 円 (40,037 円)

(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）		（単位：株、アメリカドル）			
銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
DCFT	DATA-CRAFT ASIA LTD	1,291,000	1,523,380.00		
HKLD	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,293,000	6,283,960.00		
JMH	JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	317,600	8,479,920.00		
JS	JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	463,000	7,408,000.00		
アメリカドル 計		3,364,600	23,695,280.00		
（邦貨換算額）			(2,609,561,186)		
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	689,596	18,170,854.60		
BHP	BHP BILLITON LTD	1,223,443	47,958,965.60		
BXAU	BRAMBLES LTD	1,383,320	10,73000		
CBA	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	405,780	23,064,535.20		
CCL	COCA-COLA AMATIL LIMITED	427,704	9,70000		
CSL	CSL LIMITED	343,140	35,01000		
CWN	CROWN LTD	110,362	12,65000		
DXL	DYNO NOBEL LTD	1,809,890	3,909,362.40		
FBG	FOSTER'S GROUP LTD	1,035,760	6,40000		
JHX	JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	676,551	5,93000		
LLC	LEND LEASE CORP LIMITED	199,230	16,33000		
LNN	LION NATHAN LIMITED	652,910	9,34000		
MAY	SYMBION HEALTH LTD	1,038,511	3,87000		
MCG	MACQUARIE COMMUNICATIONS INFRASTRUCTURE GROUP	809,425	5,40000		
NAB	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	499,861	35,59000		
NVA	CONSOLIDATED MEDIA HOLDINGS LTD	266,472	3,98000		
NRM	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	51,580	3,83000		
ORI	ORICA LTD	280,670	30,87000		
QBE	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	587,730	31,43000		
RIO	RIO TINTO LIMITED	206,320	126,69000		
RMD	RESMED INC-COI	633,390	5,62000		
SUN	SUNCORP-METWAY LIMITED	468,957	15,55000		
TAH	TABCORP HOLDINGS LIMITED	278,280	14,47000		
WBC	WESTPAC BANKING CORPORATION	624,780	26,96000		
WOW	WOOLWORTHS LIMITED	641,430	32,33000		
WPL	WOODSIDE PETROLEUM LTD	205,840	52,01000		
オーストラリアドル 計		15,550,932			
（邦貨換算額）			(28,165,023,952)		

外国株式（香港ドル）		（単位：株、香港ドル）			
銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ASMP	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	771,000	38,550,000.00		
CNOOC	CNOOC LTD	2,401,000	13,90000		
DASB	DAH SING BANKING GROUP LIMITED	2,618,000	18,00000		
FLGL	COSCO PACIFIC LIMITED	2,060,000	19,18000		
FRPA	FIRST PACIFIC CO	4,192,000	5,90000		
HL	HANG LUNG GROUP LIMITED	830,000	41,60000		
HSCH	HANG SENG BANK LTD	379,200	162,90000		
HTW	HUTCHISON WHAMPOA LTD	264,000	89,80000		
KERP	KERRY PROPERTIES LTD	1,451,500	61,30000		
LIFU	LI & FUNG LTD	2,420,400	27,40000		
MTRC	MTR CORP	1,076,000	34,25000		
SHGH	SHANGRI-LA ASIA LTD.	3,002,000	24,50000		
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,181,000	110,00000		
SWPB	SWIRE PACIFIC LTD B	1,195,000	21,00000		
WHB	WING HANG BANK LIMITED	362,000	112,40000		
香港ドル 計		24,203,100			
（邦貨換算額）			(10,789,777,170)		

外国株式（シンガポールドル）		（単位：株、シンガポールドル）			
銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
CAPL	CAPITALAND LTD	352,000	5,95000		
CYCM	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	489,000	20,30000		
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,009,000	12,60000		
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	389,692	20,30000		
SCIL	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	652,000	5,47000		
SGX	SINGAPORE EXCHANGE LTD	586,000	12,10000		
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	2,245,020	3,78000		
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	725,192	19,00000		
シンガポールドル 計		6,447,904			
（邦貨換算額）			(5,042,766,522)		

（単位：円）					
総合計				(46,607,128,830)	
				46,607,128,830	

(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

(外国投資証券)

外国投資証券 (オーストラリアドル)

(単位：オーストラリアドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
WDC	WESTFIELD GROUP	326,530	6,233,457.70	
オーストラリアドル 計		326,530	6,233,457.70	
(邦貨換算額)			(606,702,438)	

外国投資証券 (シンガポールドル)

(単位：シンガポールドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
SUN	SUNTEC REIT	4,442,000	7,240,460.00	
シンガポールドル 計		4,442,000	7,240,460.00	
(邦貨換算額)			(556,863,779)	

(単位：円)

総合計		(1,163,566,217)	1,163,566,217	
-----	--	-----------------	---------------	--

(注1) 総合計の () 内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	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 4銘柄	100.0	-	5.5
オーストラリアドル	株式 26銘柄	97.9	-	58.8
オーストラリアドル	投資証券 1銘柄	-	2.1	1.3
香港ドル	株式 15銘柄	100.0	-	22.6
シンガポールドル	株式 8銘柄	90.1	-	10.6
シンガポールドル	投資証券 1銘柄	-	9.9	1.2

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。

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	平成9年1月10日現在		平成20年1月10日現在	
		注記 番号	金 額	金 額	
資産の部					
流動資産					
コール・ローン			12,692,685,072	16,243,233	
国債証券			65,004,816,656	47,178,977,170	
地方債証券			214,519,756	227,407,474	
特殊債券			26,846,479,590	26,278,136,046	
社債券			47,711,491,822	32,508,094,894	
コモディヤル・ペーパー			-	943,523,687	
派生商品評価勘定			648,709,762	2,254,644,606	
未収入金			32,586,592,288	26,129,541,263	
未収利息			1,029,850,612	1,029,677,143	
前払費用			118,924,566	59,102,312	
差入委託証拠金			1,691,585,706	1,232,281,584	
流動資産合計			188,545,655,810	137,857,629,412	
資産合計			188,545,655,810	137,857,629,412	
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			2,583,763,848	1,638,276,652	
未払金			44,692,002,298	41,811,285,369	
未払解約金			11,715,100,000	67,560	
流動負債合計			58,990,866,146	43,449,629,581	
負債合計			58,990,866,146	43,449,629,581	
純資産の部					
元本等					
元本			76,792,032,001	53,799,116,529	
剰余金					
剰余金			52,762,757,663	40,608,883,302	
剰余金合計			52,762,757,663	40,608,883,302	
元本等合計			129,554,789,664	94,407,999,831	
純資産合計			129,554,789,664	94,407,999,831	
負債・純資産合計			188,545,655,810	137,857,629,412	

(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19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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、地方債証券、社債証券及びコモダティ・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。	国債証券、地方債証券、社債証券及びコモダティ・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) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。	国債証券、地方債証券、社債証券及びコモダティ・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) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。
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買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 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) 為替予約取引 同左	(1) デリバティブ取引 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的理由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2) 為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「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。	同左	同左

(貸借対照表に関する注記)

	平成19年1月10日現在	平成20年1月10日現在
1. 期首	平成18年1月11日	平成19年1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	44,086,015,461 円	2,138,584,995 円
期首からの解約元本額	8,474,167,638 円	25,131,500,467 円
平成19年1月10日現在の元本の内訳 ※		
GW 7 つの卵	60,491,402,667 円	40,814,224,717 円
グローバル・ラップ・バラン	515,312 円	479,678 円
ス安定型		
グローバル・ラップ・バラン	672,814,301 円	575,431,337 円
ス安定成長型		
グローバル・ラップ・バラン	1,208,310,526 円	1,017,163,234 円
ス成長型		
グローバル・ラップ・バラン	6,935,974,116 円	5,839,776,930 円
ス積極成長型		
グローバル・ラップ・バラン	1,988,028,842 円	1,738,257,738 円
ス積極型		
GW 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	4,459,573,344 円	2,935,399,470 円
海外債券ファンド	503,697,815 円	371,262,852 円
ブ・バラン	38,797,054 円	31,563,208 円
ブ・バラン (安定型)		
年金積立 グローバル・ラップ・バラン	82,109,379 円	68,201,940 円
ブ・バラン (安定成長型)		
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型)	92,704,907 円	83,901,524 円
ブ・バラン (成長型)		
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積極成長型)	197,566,834 円	207,161,632 円
ブ・バラン (積極成長型)		
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積極型)	120,536,904 円	116,292,269 円
ブ・バラン (積極型)		
(合計)	76,792,032,001 円	53,799,116,529 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	76,792,032,001 口	53,799,116,529 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

(有価証券に関する注記)

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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
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
社債券	47,711,491,822	46,130,794
合計	139,777,307,824	△1,039,144,810

対象期間（自 平成 19 年 1 月 11 日 至 平成 20 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	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	47,178,977,170	△88,405,501
地方債証券	227,407,474	107,435
特殊債券	26,278,136,046	192,270,576
社債券	32,508,094,894	△495,427,056
コマーシャル・ペーパー	943,523,687	0
合計	107,136,139,271	△391,454,546

(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ด์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

	自 平成18年1月11日 至 平成19年1月10日	自 平成19年1月11日 至 平成20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、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オペレーション取引、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
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	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

(債券関連) (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 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

(単位：円)

区 分	種 類	平成20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 売建 買建	35,002,966,312 35,198,460,007	- -	35,379,424,994 35,513,185,827	△376,458,682 314,725,820
	合 計	70,201,426,319	-	70,892,610,821	△61,732,862

(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)		(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	
		うち1年超		
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
スウェーデンクローナ		116,940,924	115,884,230	1,056,694
デンマーククローネ		107,124,355	106,553,850	570,505
ユーロ		8,000,325,029	8,005,749,139	△5,424,110
買建		106,171,928,282	106,688,140,842	516,212,560
アメリカドル		38,704,567,803	39,014,271,522	309,703,719
カナダドル		6,539,466,635	6,513,828,750	△25,637,885
オーストラリアドル		1,187,202,794	1,198,919,580	11,716,786
イギリスポンド		7,824,922,769	7,856,298,580	31,375,811
スイスフラン		1,218,663,414	1,191,091,490	△27,571,924
スウェーデンクローナ		1,493,952,120	1,477,071,590	△16,880,530
シンガポールドル		504,522,737	517,851,840	13,329,103
デンマーククローネ		1,375,210,658	1,368,250,650	△6,960,008
ノルウェークローネ		340,949,473	335,065,900	△5,883,573
ポーランドズロチ		1,147,345,041	1,120,924,240	△26,420,801
ユーロ		45,835,124,838	46,094,566,700	259,441,862
合 計		215,357,865,564	217,964,833,692	△1,574,543,008

(単位：円)		平成20年1月10日現在		
区分	種 類	契 約 額 等	時 価	評価損益
		うち1年超		
為替予約取引				
売建		68,217,947,790	66,533,169,333	1,684,778,457
アメリカドル		46,082,583,749	45,480,948,826	601,634,923
カナダドル		1,658,424,501	1,613,661,930	44,762,571
オーストラリアドル		70,898,845	72,735,000	△1,836,155
イギリスポンド		17,557,699,018	16,532,984,520	1,024,714,498
シンガポールドル		176,177,810	172,570,760	3,607,050
ニューゼーランドドル		441,677,469	429,171,300	12,506,169
ポーランドズロチ		327,323,000	323,285,637	4,037,363
ユーロ		1,903,163,398	1,907,811,360	△4,647,962
買建		64,883,280,150	63,876,602,509	△1,006,677,641
アメリカドル		22,710,680,401	22,104,469,657	△606,210,744
オーストラリアドル		2,998,787,534	2,919,873,840	△78,913,694
イギリスポンド		135,286,898	129,048,000	△6,238,898
スイスフラン		1,046,408,511	1,040,693,080	△5,715,431
スウェーデンクローナ		2,277,548,789	2,241,648,750	△35,900,039
シンガポールドル		1,225,429,052	1,153,930,746	△71,498,306
デンマーククローネ		887,109,708	876,047,480	△11,062,228
ノルウェークローネ		914,619,910	928,441,120	13,821,210
ポーランドズロチ		2,155,415,687	2,246,642,936	91,227,249
ユーロ		30,531,993,660	30,235,806,900	△296,186,760
合 計		133,101,227,940	130,409,771,842	678,100,816

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成19年1月10日現在		平成20年1月10日現在	
1口当たり純資産額	1,6871 円	1口当たり純資産額	1,7548 円
(1万口当たり純資産額)	(16,871 円)	(1万口当たり純資産額)	(17,548 円)

(3) 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

(外貨建債券)

外貨建債券 (アメリカドル) (単位：アメリカドル)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	210C00 ロシア国債 8.25% 20100331	333,348.06	347,115.32	
	214A03 メキシコ国債 5.875% 20140115	631,500.00	631,500.00	
	214F00 ナアフリカ国債 6.5% 20140602	300,000.00	316,500.00	
	214G01 ブラジル国債 10.5% 20140714	800,000.00	1,022,000.00	
	215G01 パナマ国債 7.25% 20150315	300,000.00	333,750.00	
	230C01 ロシア国債 7.5% 20300331	693,000.00	796,950.00	
	計	3,026,348.00	3,447,815.32	
特殊債券	809J00 連邦住宅貸付銀行 (FHLB) 5% 20091002	4,600,000.00	4,735,125.00	
	812B00 ノルウェー輸出金融公社 (EXPT) 5%	7,700,000.00	8,070,847.40	
	815F00 日本政策投資銀行 4.25% 20150609	3,600,000.00	3,631,748.40	
	840I81 政府抵当金庫 (GNMA) 008770 6.125%	9,794.82	9,930.25	
	20251220			
	850I71 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W2 5AF	116,435.20	115,266.95	
	5.215% 20440325			
	850I82 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W8 2A 6.5%	212,969.99	226,394.12	
	20440625			
	850I83 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W8 1AF	64,115.01	63,946.60	
	5.115% 20440625			
	850I92 連邦抵当金庫 (FNMA) 1999-37 F 5.265%	64,880.12	64,962.48	
	20290625			
	850233 FANNIE MAE WHOLE LOAN 2004-W12 1A1	601,261.52	629,192.04	
	6% 20440725			
	850264 FANNIE MAE GRANTOR TRUST 2004-T3 1A1	73,403.43	76,748.05	
	6% 20440225			
	850271 連邦抵当金庫 (FNMA) 5.5% 20280325	3,750,995.09	3,812,419.13	
	850302 連邦抵当金庫 (FNMA) 7.143% 20301001	12,913.62	13,117.25	
	850303 連邦抵当金庫 (FNMA) 4.537% 20351001	2,401,975.17	2,399,979.84	
	850365 連邦抵当 (FNMA) TBA 5.5% 20380212	30,500,000.00	30,743,048.40	
	850366 連邦抵当金庫 (FNMA) TBA 5% 20380212	139,100,000.00	137,643,803.83	
特殊債券 計	860I07 FILMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-21 A 5.225% 20291025	79,898.14	79,914.78	
	860I08 FILMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-62 1A1 6.06259%	833,314.06	838,759.43	
	20441025			
	860I09 FREDDIE MAC 2770 YW 4% 20220615	1,121,225.13	1,116,734.84	
	860I10 連邦住宅貸付抵当公社 (FILMC) 4.707% 20350901	3,068,324.36	3,071,759.34	
	870I24 連邦抵当金庫 (FNMA) 2000-13 F 5.515%	62,504.70	63,224.69	
	20230925			
	870276 FILMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-61 1A1 6.26277%	311,353.08	311,982.13	
	20440725			
	計	198,285,363.00	197,718,904.95	

社債券	508B05	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 7.875% 20080201	1,000,000.00	1,002,500.00
	508C01	Service Corporation International 6.5% 20080315	3,000,000.00	3,003,432.00
	508E09	HSBC Finance Corporation 4.98188% 20080521	3,900,000.00	3,900,284.70
	508F03	Westpac Banking Corp/NY 4.5% 20080606	3,000,000.00	2,998,590.00
	508G08	Royal Bank of Scotland Plc 5.23% 20080721	2,800,000.00	2,799,011.60
	508H08	Mandalay Resort Group 9.5% 20080801	3,000,000.00	3,045,000.00
	508I09	VTB Capital S.A. 5.49375% 20080801	1,300,000.00	1,289,600.00
	508K07	West. Corporation 5.625% 20081115	1,500,000.00	1,492,500.00
	508K09	Intelsat Ltd 5.25% 20081101	2,400,000.00	2,352,000.00
	508L08	The Goldman Sachs Group, Inc. 4.92375% 20081223	3,800,000.00	3,790,788.80
	509A09	Citigroup Inc. 5.02375% 20090130	3,650,000.00	3,634,224.70
	509A12	Ford Motor Credit Company 5.8% 20090112	2,500,000.00	2,372,500.00
	509B15	Banco Santander Central Hispano SA 4.925% 20090206	2,200,000.00	2,188,089.20
	509D06	Charter One Bank NA 5.115% 20090424	950,000.00	946,197.15
	509J10	General Electric Capital Corporation 5.095% 20091026	1,800,000.00	1,795,698.00
	509J11	HSBC Finance Corporation 5.24% 20091021	3,000,000.00	2,985,209.00
	509K11	Bank of America Corporation 4.875% 20091106	900,000.00	897,018.30
	510F08	Goldman Sachs Group LP 5.1425% 20100628	900,000.00	885,946.50
	511C05	Celestica Inc. 7.875% 20110701	2,000,000.00	1,910,000.00
	512F04	Ford Motor Credit Company 7.8% 20120601	2,500,000.00	2,136,327.50
	512I00	Barclays Bank Plc 5.45% 20120912	7,900,000.00	8,208,834.70
	512J02	General Electric Capital Corporation 5.25% 20121019	3,400,000.00	3,498,222.60
	513D02	Allied Waste North America 7.875% 20130415	2,500,000.00	2,537,500.00
	513G00	Nortel Networks Ltd 10.125% 20130715	2,000,000.00	1,990,000.00
	513G02	The Goldman Sachs Group, Inc. 4.75% 20130715	4,400,000.00	4,369,706.00
	514B01	Qwest Communications International Inc. 7.5% 20140215	2,500,000.00	2,468,750.00
	516G00	OAO Gazprom 6.212% 20161122	10,000,000.00	9,707,500.00
	517A00	Georgia-Pacific Corp 7.125% 20170115	2,500,000.00	2,393,750.00
	517B00	Kinder Morgan Energy Partners, L.P 6% 20170201	4,900,000.00	4,964,616.30
	517C00	TRW Automotive Inc. 7.25% 20170315	2,500,000.00	2,175,000.00
	517D00	Morgan Stanley 5.55% 20170427	2,900,000.00	2,863,190.30
	517E00	Canadian Natural Resources Ltd 5.7% 20170515	5,000,000.00	5,050,020.00
	517F00	Bank of America Corporation 6.1% 20170615	4,200,000.00	4,339,305.60
	517H00	XTO Energy, Inc. 6.25% 20170801	4,500,000.00	4,803,007.50
	517K00	Citigroup Inc. 6.125% 20171121	800,000.00	830,992.80
	517L00	UBS AG 5.875% 20171220	4,400,000.00	4,595,360.00
	518B00	Comcast Corporation 5.875% 20180215	4,500,000.00	4,501,422.00
	518C00	Petrobras International Finance Co 5.875% 20180301	2,500,000.00	2,500,740.00

520101	H. J. HEINZ COMPANY 6.428% 20201201	2,600,000.00	2,653,560.00
531K01	General Motors Acceptance Corporation 8% 20311101	2,600,000.00	1,989,273.00
536E00	HSBC Holdings plc 6.5% 20360502	3,600,000.00	3,535,588.80
536L00	Wells Fargo & Company 5.95% 20361215	1,200,000.00	1,140,662.40
557L00	Citigroup Inc. 8.3% 20571221	3,000,000.00	3,107,070.00
870204	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-AR1 1A2 5.315% 20340319	107,690.20	104,550.33
870212	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-AR3 1A2 5.255% 20340719	30,370.74	30,231.30
870216	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 5 A 5.315% 20261019	99,601.09	96,334.62
870237	WASHINGTON MUTUAL 2003-R1 A1 5.405% 20271225	3,100,714.59	2,964,174.92
870254	WASHINGTON MUTUAL 2005-AR1 A1A 5.185% 20450125	171,688.64	162,638.89
870255	WASHINGTON MUTUAL 2005-AR2 2A1A 5.175% 20450125	177,303.01	167,899.79
870256	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2005-2 2A1 5.185% 20350325	214,877.04	203,533.80
870258	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-3 2A1 5.155% 20350425	154,606.46	146,904.08
870278	MASTR SEASONED SECURITIES TRUST 2005-1 2A1 6.19986% 20170925	548,942.67	558,377.89
870279	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2005-3 2A2A 4.67918% 20350825	2,104,241.65	2,090,405.20
870283	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2003-11 1A11 4.75% 20181025	1,515,103.34	1,502,666.91
870286	BANC OF AMERICA MORTGAGE SECURITIES 2004-4 1A9 5% 20340525	2,934,919.01	2,834,361.64
870287	GMAC MORTGAGE CORPORATION LOAN TRUST 2004-J4 A1 5.5% 20340925	2,239,167.22	2,256,768.19
870293	GSR MORTGAGE LOAN TRUST 2005-AR6 2A1 4.53929% 20350925	2,242,748.91	2,206,896.32
870294	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 2005-4 2A1 4.07954% 20350420	279,213.05	279,786.49
870299	FIRST HORIZON ALTERNATIVE MORTGAGE SECURITIES 2004-AA1 A1 4.72797% 20340625	31,605.33	31,436.23
870301	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 3A2A 5.25% 20360220	1,113,489.93	1,109,227.36
870302	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 5A1 5.25% 20360220	1,010,680.11	992,831.59
870305	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENT INC 2005-AR8 A1 5.145% 20350225	1,258,254.74	1,195,351.56
870311	GSAMP TRUST 2006-SD1 A1 4.985% 20351225	27,095.64	26,900.89
870312	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORPORATION 2005-S7 A1 4.995% 20351225	15,932.77	15,879.67
870313	COMMERCIAL MORTGAGE PASS THROUGH CERTIFICATES 2006-CN2A A2FL 4.76% 20190205	3,700,000.00	3,649,221.20
870314	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-0A1 2A1 5.15875% 20460401	2,303,599.93	2,172,954.48

870315	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR2 2A1 4.95% 20360325	1,603,942.22	1,596,000.62
870316	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS3 A11 4.935% 20360425	302,523.33	301,904.18
870317	MORGAN STANLEY CAPITAL I 2006-NC2 A2A 4.935% 20360225	417,056.59	416,331.82
870318	RESIDENTIAL ACCREDITED LOANS INC 2006-Q03 A1 5.075% 20460425	3,050,721.43	2,868,203.47
870319	MORGAN STANLEY HOME EQUITY LOANS 2006-2 A1 4.935% 20360225	13,295.99	13,227.79
870320	LEHMAN XS TRUST 2006-4N A1A 4.945% 20460425	821,038.45	815,067.85
870322	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-RM1 A2A 4.935% 20370225	169,705.10	168,535.67
870326	ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY 2006-HE3 A3 4.925% 20360325	409,616.49	408,300.55
870328	MASTR ADJUSTABLE RATE MORTGAGES TRUST 2004-4 4A1 5.1855% 20340525	1,925,062.87	1,921,056.81
870329	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2006-AR3 12A1 5.085% 20350925	3,299,473.93	3,110,807.37
870330	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR8 1A1 5.62528% 20360420	1,285,811.22	1,258,882.46
870331	MORGAN STANLEY CAPITAL I 2006-HE2 A2A 4.935% 20360325	28,813.20	28,616.07
870333	CARRINGTON MORTGAGE LOAN TRUST 2006-RFC1 A1 4.905% 20360525	514,305.51	509,766.76
870335	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-RM2 A2A 4.895% 20370525	2,498,038.98	2,462,701.97
870336	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2006-FF7 2A1 4.895% 20360525	1,761,927.17	1,737,465.45
870338	BEAR STEARNS COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES 2006-BB47 A1 5.1375% 20190315	3,906,217.03	3,787,382.87
870340	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-8 2A1 4.895% 20460125	2,367,948.39	2,324,568.51
870341	CARRINGTON MORTGAGE LOAN TRUST 2006-FRE1 A1 4.93% 20360725	681,897.10	677,727.43
870343	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2006-NC1 A2A 4.935% 20360825	1,107,711.05	1,099,354.25
870344	NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-2 A2A 4.935% 20360825	1,322,564.91	1,311,608.65
870345	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS5 A1 4.935% 20360625	1,174,952.97	1,165,956.82
870346	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-HY12 A1 6.17471% 20360625	3,720,182.93	3,754,238.60
870347	LEHMAN XS TRUST 2006-10N 1A1A 4.945% 20360625	1,438,578.40	1,427,671.24
870348	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1 5.84498% 20360820	12,089,968.13	12,086,563.59
870349	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-13 3AV1 4.915% 20370125	1,531,147.53	1,511,075.70
870351	LEHMAN BROTHERS FLOATING RATE COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2006-L1FA A1 5.1075% 20210915	888,870.71	888,353.12

870353	THORNBURG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-5 A1 4.985% 20360625	4,381,843.48	4,202,785.58	
870354	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A2 4.915% 20360825	2,725,537.85	2,677,020.00	
870355	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-FH1 A1 4.915% 20360901	2,466,807.13	2,418,751.74	
870356	BEAR STEARNS ALT-A TRUST 2006-6 32A1 5.81136% 20361025	4,272,460.06	4,175,099.42	
870357	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-15 A1 4.975% 20361025	2,686,748.58	2,663,846.46	
870358	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-4 A111 4.985% 20351225	133,677.52	133,630.00	
870359	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A11A 5.095% 20351025	2,689,115.09	2,595,819.19	
870360	ACE SECURITIES CORP 2006-NC1 A2A 4.935% 20351225	80,234.40	79,998.11	
870363	CENTEX HOME EQUITY 2006-A AV1 4.915% 20360625	104,182.16	103,821.51	
870364	FIRST FRANKLIN MORTGAGE LOAN ASSET BACKED CERTIFICATES 2006-FF1 2A1 4.955% 20360125	453,348.64	451,208.23	
870366	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2005-0PT1 A3 5.075% 20350625	212,251.89	212,171.74	
870367	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I 2006-WMC2 A2A 4.905% 20360725	580,477.90	570,257.25	
870368	RESIDENTIAL ACCREDIT LOANS INC 2005-Q01 A1 5.165% 20350825	3,524,156.68	3,328,431.71	
870370	ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2006-0PT1 A3A 4.905% 20360925	711,075.86	700,411.70	
870371	ACCREDITED MORTGAGE LOAN TRUST 2006-2 A1 4.905% 20360925	474,939.56	468,972.08	
870372	ACE SECURITIES CORP 2006-HE1 A2A 4.945% 20360225	156,041.07	155,455.32	
870374	ARGENT SECURITIES INC 2006-W3 A2A 4.935% 20360425	101,881.26	101,706.01	
870375	ARGENT SECURITIES INC 2006-W2 A2A 4.915% 20360925	488,221.86	480,901.51	
870376	ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2004-0PT5 A1 5.215% 20340625	591,162.56	563,255.84	
870377	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-3 2A1 4.935% 20360625	201,259.39	200,387.89	
870378	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-4 2A1 4.935% 20360725	104,120.80	103,690.82	
870379	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-5 2A1 4.935% 20360825	232,082.92	231,525.50	
870382	INDYMAC RESIDENTIAL ASSET BACKED TRUST 2006-C 3A1 4.905% 20360825	243,424.25	242,438.64	
870384	LEHMAN XS TRUST 2006-11 1A1 4.945% 20460625	979,469.11	966,961.08	
870386	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-KS9 A11 4.935% 20361125	3,198,143.14	3,121,298.79	
870387	ACE SECURITIES CORP 2006-NC1 A2B 5.015% 20351225	250,000.00	244,246.42	
870388	ARGENT SECURITIES INC 2006-W1 A2A 4.945% 20360325	18,468.70	18,444.33	

870389	ARGENT SECURITIES INC 2006-W4 A2A 4.925% 20360525	90,583.51	90,381.49	
870391	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-1 AF1 4.995% 20360725	15,982.53	15,917.39	
870393	FREMONT HOME LOAN TRUST 2005-E 2A2 5.035% 20360125	93,265.86	93,082.24	
870395	GSR MORTGAGE LOAN TRUST 2005-HEL1 A2A 4.965% 20301125	34,883.55	34,623.09	
870396	HSI ASSET SECURITIZATION CORP TRUST 2006-0PT1 2A1 4.945% 20351225	138,965.41	137,982.25	
870398	INDYMAC RESIDENTIAL ASSET BACKED TRUST 2006-D 2A1 4.915% 20361125	560,794.13	553,283.47	
870399	MERRILL LYNCH MORTGAGE INVESTORS INC 2006-HE1 A2A 4.945% 20361225	64,219.91	63,794.06	
870400	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-RS6 A1 4.935% 20361125	2,321,378.84	2,279,344.93	
870403	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-WF1 A1A 4.965% 20361025	1,922,820.64	1,894,971.65	
870404	STRUCTURED ASSET INVESTMENT LOAN TRUST 2005-11 A4 4.955% 20360125	64,579.59	64,507.05	
870406	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC1 A2 4.935% 20360325	141,173.52	140,608.32	
870407	GSAMP TRUST 2006-HE7 A2A 4.905% 20461125	3,202,672.45	3,129,337.65	
870408	ACE SECURITIES CORP 2006-ASP4 A2A 4.915% 20360825	577,501.05	568,534.82	
870409	INDYMAC INDEX MORTGAGE LOAN TRUST 2006-AR14 1A1A 4.958% 20461125	3,270,112.25	3,187,983.38	
870410	STRUCTURED ASSET SEC CORP 2006-11 A1 5.33067% 20351025	1,850,579.45	1,841,927.98	
870411	ACE SECURITIES CORP 2006-HE4 A2A 4.925% 20361025	194,363.83	187,225.50	
870412	RESIDENTIAL ASSET MORTGAGE PRODUCTS INC 2006-RZ4 A1A 4.945% 20361025	177,795.54	172,763.69	
870413	RESIDENTIAL ASSET SECURITIES CORP 2006-RS7 A1 4.915% 20360925	103,901.41	102,988.86	
870414	SPECIALTY UNDERWRITING & RESIDENTIAL FINANCE 2006-BC1 A2A 4.945% 20361225	204,179.43	202,749.16	
870417	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-CH1 A2 4.915% 20281125	2,712,880.77	2,659,456.82	
870418	THORNBURG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-6 A1 4.975% 20111125	4,614,009.27	4,505,657.56	
870419	HSI ASSET SECURITIZATION CORP TRUST 2006-HE2 2A1 4.915% 20361225	4,376,935.34	4,207,350.98	
870428	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-WF2 A2A 4.925% 20361225	2,667,228.05	2,628,934.39	
870429	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2005-14 2A1 5.075% 20350525	221,397.81	213,356.28	
870430	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2004-16 1AAA 5.245% 20340925	15,093.34	14,586.56	
870432	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-3 A112 5.105% 20351125	430,047.74	426,607.35	
870434	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-NLC1 A1 4.925% 20361125	484,481.83	474,640.79	
870437	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2005-AR10 2A12 4.10921% 20350625	148,611.78	148,017.36	

		WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2004-EE 2A1 3.98878% 2034I225	131, 884. 22	129, 647. 52
870438				
870439		SAXON ASSET SECURITIES TRUST 2006-3 A1 4. 925% 2036I125	366, 452. 07	356, 669. 52
870440		STRUCTURED ASSET SECURITIES CORP 2006-BC3 A2 4. 915% 2036I025	485, 126. 10	465, 836. 46
870441		COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2004-12 12A1 4. 71104% 20340825	315, 792. 30	314, 391. 98
870442		HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST 2004- C1 3A1A 5. 315% 20350I119	216, 748. 15	209, 301. 83
870444		GS MORTGAGE SECURITIES CORP II 1998- C1 A2 6. 62% 2030I018	257, 040. 40	257, 481. 07
870445		AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT TRUST 2004-3 5A 4. 29% 2034I025	116, 651. 94	115, 239. 82
870446		FREMONT HOME LOAN TRUST 2006-C 2A1 4. 915% 2036I025	605, 930. 75	588, 029. 67
870447		SPECIALTY UNDERWRITING & RESIDENTIAL FINANCE 2006-BC2 A2A 4. 925% 20370225	1, 087, 405. 46	1, 080, 675. 72
870448		WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A1I2 5. 105% 2035I025	1, 133, 577. 32	1, 111, 465. 08
870450		MORGAN STANLEY HOME EQUITY LOANS 2006-2 A2 4. 975% 20360225	100, 000. 00	98, 336. 56
870451		COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-25 2A1 4. 935% 20460I25	4, 323, 314. 08	4, 210, 536. 10
870452		CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2006-WFH3 A2 4. 965% 2036I025	100, 000. 00	94, 800. 18
870453		GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR8 1A1A 4. 945% 20470I25	5, 108, 460. 54	5, 012, 748. 42
870454		JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A3 4. 975% 20360825	100, 000. 00	95, 972. 61
870455		ARRAN RESIDENTIAL MORTGAGES FUNDING PLC 2006-1A A1B 5. 25188% 20360412	958, 133. 48	957, 579. 10
870456		ACE SECURITIES CORP 2006-FM2 A2A 4. 915% 20360825	129, 012. 16	121, 943. 20
870457		MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I 2006- HE4 A1 4. 905% 20360625	107, 487. 59	105, 962. 31
870458		ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2006-0PT2 A3A 4. 925% 2036I025	129, 769. 71	128, 119. 72
870460		GREENWICH CAPITAL COMMERCIAL FUNDING CORP 2007-GG9 A4 5. 444% 20390310	4, 500, 000. 00	4, 570, 934. 85
社債券 計			287, 247, 724. 00	283, 328, 516. 08
アメリカドル 計			488, 559, 436. 00	484, 495, 236. 35
(邦貨換算額)			(53, 805, 050, 704)	(53, 357, 460, 379)

(単位：カナダドル)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券 計	325F00 カナダ国債 9% 20250601	600, 000. 00	968, 880. 00	
国債証券 計		600, 000. 00	968, 880. 00	
地方債証券 計	431F00 Province of Ontario 6. 2% 20310602	1, 700, 000. 00	2, 087, 073. 00	
地方債証券 計		1, 700, 000. 00	2, 087, 073. 00	
特殊債証券 計	812L00 Canada Housing Trust 4. 55% 20121215	38, 000, 000. 00	39, 062, 100. 00	
特殊債証券 計		38, 000, 000. 00	39, 062, 100. 00	
社債券 計	511L00 Rogers Cable Inc 7. 25% 20111215	300, 000. 00	321, 375. 00	
社債券 計		300, 000. 00	321, 375. 00	
カナダドル 計		40, 600, 000. 00	42, 439, 428. 00	
(邦貨換算額)		(4, 423, 776, 000)	(4, 624, 200, 075)	

外貨建債券 (イギリスポンド)

(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 計	309C00 イギリス国債 4% 20090307	5, 800, 000. 00	5, 778, 922. 80	
国債証券 計		5, 800, 000. 00	5, 778, 922. 80	
国債証券 計	310F00 イギリス国債 4. 75% 20100607	5, 100, 000. 00	5, 162, 342. 40	
国債証券 計		5, 100, 000. 00	5, 162, 342. 40	
国債証券 計	311C00 イギリス国債 4. 25% 20110307	63, 300, 000. 00	63, 230, 116. 80	
国債証券 計		63, 300, 000. 00	63, 230, 116. 80	
国債証券 計	311G00 イギリス国債 9% 20110712	16, 000, 000. 00	18, 424, 416. 00	
国債証券 計		16, 000, 000. 00	18, 424, 416. 00	
国債証券 計	314I00 イギリス国債 5% 20140907	5, 700, 000. 00	5, 903, 626. 80	
国債証券 計		5, 700, 000. 00	5, 903, 626. 80	
国債証券 計	315I00 イギリス国債 4. 75% 20150907	380, 000. 00	389, 039. 06	
国債証券 計		380, 000. 00	389, 039. 06	
イギリスポンド 計		96, 280, 000. 00	98, 888, 463. 86	
イギリスポンド 計		96, 280, 000. 00	98, 888, 463. 86	
(邦貨換算額)		(20, 766, 633, 200)	(21, 329, 252, 770)	

外貨建債券 (ブラジルレアル)

(単位：ブラジルレアル)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券 計	322A00 ブラジル国債 12. 5% 20220105	35, 500, 000. 00	38, 840, 550. 00	
国債証券 計		35, 500, 000. 00	38, 840, 550. 00	
国債証券 計	328A00 ブラジル国債 10. 25% 20280110	23, 300, 000. 00	21, 976, 560. 00	
国債証券 計		23, 300, 000. 00	21, 976, 560. 00	
国債証券 計		58, 800, 000. 00	60, 817, 110. 00	
国債証券 計		58, 800, 000. 00	60, 817, 110. 00	
ブラジルレアル 計		58, 800, 000. 00	60, 817, 110. 00	
(邦貨換算額)		(3, 666, 180, 000)	(3, 791, 946, 809)	

外貨建債券 (ユーロ)

(単位：ユーロ)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券 計	304D00 フランス国債 5. 5% 20290425	2, 800, 000. 00	3, 167, 511. 20	
国債証券 計		2, 800, 000. 00	3, 167, 511. 20	
国債証券 計	308A01 スペイン国債 6% 20080131	0. 52	0. 52	
国債証券 計		0. 52	0. 52	
国債証券 計	308D01 フィンランド国債 6% 20080425	336, 375. 00	337, 931. 07	
国債証券 計		336, 375. 00	337, 931. 07	
国債証券 計	309G01 ドイツ国債 4. 5% 20090704	2, 100, 000. 00	2, 117, 537. 10	
国債証券 計		2, 100, 000. 00	2, 117, 537. 10	
国債証券 計	309G02 ドイツ国債 4% 20090704	2, 300, 000. 00	2, 303, 477. 60	
国債証券 計		2, 300, 000. 00	2, 303, 477. 60	
国債証券 計	310G00 ドイツ国債 5. 25% 20100704	1, 800, 000. 00	1, 861, 180. 20	
国債証券 計		1, 800, 000. 00	1, 861, 180. 20	
国債証券 計	311A00 ドイツ国債 5. 25% 20110104	11, 800, 000. 00	12, 271, 551. 60	
国債証券 計		11, 800, 000. 00	12, 271, 551. 60	
国債証券 計	311G00 ドイツ国債 5% 20110704	6, 400, 000. 00	6, 639, 129. 60	
国債証券 計		6, 400, 000. 00	6, 639, 129. 60	
国債証券 計	311J00 スペイン国債 5. 35% 20111031	3, 400, 000. 00	3, 566, 270. 20	
国債証券 計		3, 400, 000. 00	3, 566, 270. 20	
国債証券 計	312A00 ドイツ国債 5% 20120104	800, 000. 00	833, 540. 80	
国債証券 計		800, 000. 00	833, 540. 80	
国債証券 計	312D01 ドイツ国債 4% 20120413	2, 700, 000. 00	2, 716, 966. 80	
国債証券 計		2, 700, 000. 00	2, 716, 966. 80	
国債証券 計	312J00 フランス国債 4. 75% 20121025	3, 000, 000. 00	3, 106, 617. 00	
国債証券 計		3, 000, 000. 00	3, 106, 617. 00	
国債証券 計	313G02 ドイツ国債 3. 75% 20130704	300, 000. 00	298, 443. 60	
国債証券 計		300, 000. 00	298, 443. 60	
国債証券 計	313J00 オーストリア国債 3. 8% 20131020	200, 000. 00	198, 508. 40	
国債証券 計		200, 000. 00	198, 508. 40	
国債証券 計	315A01 ドイツ国債 3. 75% 20150104	7, 900, 000. 00	7, 797, 055. 10	
国債証券 計		7, 900, 000. 00	7, 797, 055. 10	
国債証券 計	327070 ドイツ国債 6. 5% 20270704	9, 900, 000. 00	12, 485, 117. 70	
国債証券 計		9, 900, 000. 00	12, 485, 117. 70	
国債証券 計	328010 ドイツ国債 5. 625% 20280104	19, 904, 215. 00	22, 871, 316. 42	
国債証券 計		19, 904, 215. 00	22, 871, 316. 42	
国債証券 計	328070 ドイツ国債 4. 75% 20280704	4, 600, 000. 00	4, 764, 574. 20	
国債証券 計		4, 600, 000. 00	4, 764, 574. 20	
国債証券 計	330A00 ドイツ国債 6. 25% 20300104	3, 150, 000. 00	3, 904, 992. 00	
国債証券 計		3, 150, 000. 00	3, 904, 992. 00	
国債証券 計	331A00 ドイツ国債 5. 5% 20310104	31, 400, 000. 00	35, 801, 306. 60	
国債証券 計		31, 400, 000. 00	35, 801, 306. 60	
国債証券 計	332C00 スペイン国債 5. 75% 20320730	800, 000. 00	931, 756. 00	
国債証券 計		800, 000. 00	931, 756. 00	
国債証券 計	332J00 フランス国債 5. 75% 20321025	3, 600, 000. 00	4, 233, 996. 00	
国債証券 計		3, 600, 000. 00	4, 233, 996. 00	
国債証券 計	334G00 ドイツ国債 4. 75% 20340704	200, 000. 00	207, 737. 20	
国債証券 計		200, 000. 00	207, 737. 20	
国債証券 計	335D00 フランス国債 4. 75% 20350425	100, 000. 00	102, 992. 80	
国債証券 計		100, 000. 00	102, 992. 80	
国債証券 計	355D00 フランス国債 4% 20550425	1, 100, 000. 00	990, 210. 10	
国債証券 計		1, 100, 000. 00	990, 210. 10	
国債証券 計		120, 590, 590. 00	133, 509, 719. 81	
国債証券 計		120, 590, 590. 00	133, 509, 719. 81	
特殊債証券 計	310040 フランス鉄道線路公社 (RFF) 5. 25% 20100414	1, 500, 000. 00	1, 529, 562. 00	
特殊債証券 計		1, 500, 000. 00	1, 529, 562. 00	

社債券	509L00	France Telecom SA 7% 20091223	200,000.00	207,961.00
	510A00	DEPFA Deutsche Pfandbriefbank AG 5.5% 20100115	1,500,000.00	1,537,437.00
	518B00	OAO Gazprom 6.605% 20180213	6,100,000.00	5,852,645.00
	870004	DUTCH MBS BV IX A 4.544% 20770702	77,829.05	77,759.62
	870006	Delphinus BV 2002-I A1 4.88% 20920425	185,253.00	184,751.89
社債券 計				
ユーロ 計				
(邦貨換算額)			(21,030,230,414)	(23,089,755,551)

(単位：円)				
総合計			(103,691,870,318)	(106,192,615,584)
(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。			103,691,870,318	106,192,615,584

(外国コマーシヤル・ペーパー)

種 類		銘 柄	券面総額	評価額	備 考
コマーシヤル・ペーパー		PALISADES COM PA	8,600,000.00	8,567,363.00	
アメリカドル 計			8,600,000.00	8,567,363.00	
(邦貨換算額)			(947,118,000)	(943,523,687)	

(単位：円)				
総合計			(947,118,000)	(943,523,687)
(注) 総合計の () 内の金額は外貨建コマーシヤル・ペーパーの邦貨換算額合計であります。			947,118,000	943,523,687

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率 (%)	組入その他有価証券 時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	国債証券 6銘柄	0.7	-	0.4
アメリカドル	特殊債券 21銘柄	40.1	-	20.3
アメリカドル	社債券 167銘柄	57.5	-	29.2
アメリカドル	コマーシヤル・ペーパー 1銘柄	-	1.7	0.9
カナダドル	国債証券 1銘柄	2.3	-	0.1
カナダドル	地方債証券 1銘柄	4.9	-	0.2
カナダドル	特殊債券 1銘柄	92.0	-	4.0
カナダドル	社債券 1銘柄	0.8	-	0.0
イギリスポンド	国債証券 6銘柄	100.0	-	19.9
ブラジルレアル	国債証券 2銘柄	100.0	-	3.5
ユーロ	国債証券 25銘柄	93.4	-	20.1
ユーロ	特殊債券 1銘柄	1.1	-	0.2
ユーロ	社債券 5銘柄	5.5	-	1.2

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。

- (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、前中間計算期間(平成19年1月11日から平成19年7月10日まで)については、改正前の「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、当中間計算期間(平成20年1月11日から平成20年7月10日まで)については、改正後の「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)に基づき作成しております。

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、前中間計算期間(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、旧証券取引法第193条の2の規定に、また、当中間計算期間(平成20年1月11日から平成20年7月10日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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

松 久
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

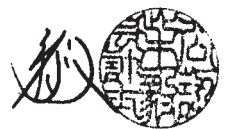
独立監査人の中間監査報告書

平成20年8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

指 定 社 員 公認会計士
業 務 執 行 社 員



当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているGW7つの卵の平成20年1月11日から平成20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20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20年1月11日から平成20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

中間財務諸表

GW 7 つの卵

(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19年7月10日現在	当中間計算期間末 平成20年7月10日現在
	注記 番号	金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,739,414,892	7,023,132,759
親投資信託受益証券		635,245,508,966	408,063,382,420
未収入金		680,000,000	840,000,000
流動資産合計		646,664,923,858	415,926,515,179
資産合計		646,664,923,858	415,926,515,179
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,176,867,552	762,446,884
未払受託者報酬		163,772,315	117,307,081
未払委託者報酬		5,732,033,207	4,105,749,985
その他未払費用		4,534,467	5,923,076
流動負債合計		7,077,207,541	4,991,427,026
負債合計		7,077,207,541	4,991,427,026
純資産の部			
元本等			
剰余金		556,282,022,518	456,962,731,674
中間剰余金又は中間欠損金(△)			
(うち分配準備積立金)		83,305,693,799	△46,027,643,521
剰余金合計		(-)	(71,460,126)
元本等合計		83,305,693,799	△46,027,643,521
純資産合計		639,587,716,317	410,935,088,153
負債・純資産合計		639,587,716,317	410,935,088,153
		646,664,923,858	415,926,515,179

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	当中間計算期間 自 平成20年1月11日 至 平成20年7月10日
	注記 番号	金 額	金 額
営業収益			
受取利息		19,281,760	13,277,359
有価証券売買等損益		52,805,086,649	△34,941,725,168
営業収益合計		52,824,368,409	△34,928,447,809
営業費用			
受託者報酬		163,772,315	117,307,081
委託者報酬		5,732,033,207	4,105,749,985
その他費用		4,534,467	5,923,076
営業費用合計		5,900,339,989	4,228,980,142
営業利益金額		46,924,028,420	-
営業損失金額		-	39,157,427,951
経常利益金額		46,924,028,420	-
経常損失金額		-	39,157,427,951
中間純利益金額		46,924,028,420	-
中間純損失金額		-	39,157,427,951
中間一部解約に伴う中間純利益金額分配額		2,881,821,878	-
中間一部解約に伴う中間純損失金額分配額		-	3,315,015,143
期首剰余金又は期首欠損金(△)		36,723,419,789	△11,300,404,221
剰余金増加額		8,010,045,387	1,394,550,268
(中間一部解約に伴う剰余金増加額)		(-)	(1,394,550,268)
(中間追加信託に伴う剰余金増加額)		(8,010,045,387)	(-)
剰余金減少額		5,469,977,919	279,376,760
(中間一部解約に伴う剰余金減少額)		(5,469,977,919)	(-)
(中間追加信託に伴う剰余金減少額)		(-)	(279,376,760)
分配金		-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)		83,305,693,799	△46,027,643,521

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	当中間計算期間 自 平成20年1月11日 至 平成20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	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19年7月10日現在	当中間計算期間末 平成20年7月10日現在
1. 期首元本額	546,981,478,249 円	1. 期首元本額 515,639,121,751 円
期中追加設定元本額	88,825,671,754 円	期中追加設定元本額 4,390,291,957 円
期中解約元本額	79,525,127,485 円	期中解約元本額 63,066,682,034 円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	556,282,022,518 口	2. 中間計算期間末日における 受益権の総数 456,962,731,674 口
3. 元本の欠損		3. 元本の欠損
		中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回ってお り、その差額は46,027,643,521円であります。

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	当中間計算期間 自 平成20年1月11日 至 平成20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	1,254,874,735 円	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 904,695,523 円

(1口当たり情報)

	前中間計算期間末 平成19年7月10日現在	当中間計算期間末 平成20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)	1,1498 円 (11,498 円)	1口当たり純資産額 0.8993 円 (1万口当たり純資産額) (8,993 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

(単位：円)

科 目	対象年月日	平成19年7月10日現在		平成20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			2,617,348,293		2,007,953,377
株式			208,691,492,300		132,864,713,800
派生商品評価勘定			4,614,800		-
未収入金			-		3,762,631,137
未収配当金			53,956,980		102,201,700
差入委託証拠金			17,110,000		-
流動資産合計			211,384,522,373		138,737,500,014
資産合計			211,384,522,373		138,737,500,014
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			-		3,749,989,390
未払解約金			103,388,929		10,918,795
流動負債合計			108,919,404		3,760,908,185
負債合計			108,919,404		3,760,908,185
純資産の部					
元本等					
元本			113,993,046,701		98,356,000,520
剰余金					
剰余金			97,282,556,268		36,620,591,309
剰余金合計			97,282,556,268		36,620,591,309
元本等合計			211,275,602,969		134,976,591,829
純資産合計			211,275,602,969		134,976,591,829
負債・純資産合計			211,384,522,373		138,737,500,014

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20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な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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売買配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供した価額（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。	
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	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 同左
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 同左

(貸借対照表に関する注記)

	平成19年7月10日現在	平成20年7月10日現在	1. 期首 期首元本額 期首からの追加股定元本額 期首からの解約元本額	平成20年1月11日 115,504,822,820 円 1,952,636,186 円 19,101,158,486 円
1. 期首 期首元本額 期首からの追加股定元本額 期首からの解約元本額	112,921,306,554 円 4,739,589,224 円 3,667,829,077 円	84,648,912,672 円 437,084 円 683,813,205 円 1,509,373,332 円 10,058,396,413 円 4,317,355,281 円 3,913,090,461 円 7,258,494,423 円 734,994,226 円 31,653,169 円 83,897,819 円 122,227,442 円 332,629,075 円 287,772,099 円 113,993,046,701 円	期首元本額 期首からの追加股定元本額 期首からの解約元本額	115,504,822,820 円 1,952,636,186 円 19,101,158,486 円
2. 本報告書における開示対象ファイ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総数	113,993,046,701 円	98,356,000,520 円	GW7つの卵 グローバール・ラップ・バランス 安 定型 グローバール・ラップ・バランス 安 定成長型 グローバール・ラップ・バランス 成長型 グローバール・ラップ・バランス 積 極成長型 グローバール・ラップ・バランス 積 極型 グローバール・ラップ・バランス 超 積極型 GW7つの卵（適格機関投資家向け） 日本大型株式ファンド 年金積立 グローバール・ラップ・ バランス（安定型） 年金積立 グローバール・ラップ・ バランス（安定成長型） 年金積立 グローバール・ラップ・ バランス（成長型） 年金積立 グローバール・ラップ・ バランス（積極成長型） 年金積立 グローバール・ラップ・ バランス（積極型） （合計）	※ 69,446,079,412 円 603,942 円 823,124,427 円 1,736,285,918 円 11,503,469,902 円 5,033,981,097 円 4,615,938,234 円 3,543,476,185 円 555,624,025 円 38,819,330 円 97,228,655 円 148,034,860 円 450,492,158 円 362,842,375 円 98,356,000,520 円

※ 当該親投資信託で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

(株式関連)				平成19年7月10日現在			(単位：円)
区 分	種 類	契 約 額	時 価		評価損益		
			う ち 1 年 超				
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		

平成 20 年 7 月 10 日現在

該当事項はありません。

(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19年7月10日現在			平成20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)	1,8534 円 (18,534 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)		1,3723 円 (13,723 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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
		注記 番号		金 額	
資産の部					
流動資産					
コール・ローン			2,353,945,540		2,879,739,806
株式			80,884,397,420		54,064,156,440
未収入金			99,585,999		125,691,519
未収配当金			31,786,020		57,680,900
流動資産合計			83,369,714,979		57,127,268,665
資産合計			83,369,714,979		57,127,268,665
負債の部					
流動負債					
未払金			581,733,375		431,752,816
未払解約金			1,314,163		4,003,202
流動負債合計			583,047,538		435,756,018
負債合計			583,047,538		435,756,018
純資産の部					
元本等					
元本			36,063,744,961		33,475,797,711
剰余金					
剰余金			46,722,922,480		23,215,714,936
剰余金合計			46,722,922,480		23,215,714,936
元本等合計			82,786,667,441		56,691,512,647
純資産合計			82,786,667,441		56,691,512,647
負債・純資産合計			83,369,714,979		57,127,268,665

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20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、売買配相場の提示する価額は価格提供会社の提供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は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な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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売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又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
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、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、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、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19年7月10日現在	平成20年7月10日現在
1. 期首 期首元本額 期首からの追加股定元本額 期首からの解約元本額	平成19年1月11日 35,857,273,851 円 1,046,519,246 円 840,048,136 円	1. 期首 期首元本額 期首からの追加股定元本額 期首からの解約元本額 平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※ GW7つの卵 グローバール・ラップ・バランス 安 定型 グローバール・ラップ・バランス 安 定成長型 グローバール・ラップ・バランス 成長型 グローバール・ラップ・バランス 積 極成長型 グローバール・ラップ・バランス 積 極型 グローバール・ラップ・バランス 超 積極型 GW7つの卵 (適格機関投資家向け) 日本小型株式ファンド 年金積立 グローバール・ラップ・バ ランス (安定型) 年金積立 グローバール・ラップ・バ ランス (安定成長型) 年金積立 グローバール・ラップ・バ ランス (成長型) 年金積立 グローバール・ラップ・バ ランス (積極成長型) 年金積立 グローバール・ラップ・バ ランス (積極型) (合計) 本報告書における開示対象フアン 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総数
2. 本報告書における開示対象フアン 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総数	平成19年7月10日現在 36,063,744,961 円	平成20年7月10日現在 (合計) 33,475,797,711 円

※ 当該親投資信託で受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(1口当たり情報)

平成19年7月10日現在	平成20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口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
2,2956 円 (22,956 円)	1,6935 円 (16,935 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	平成19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
			注記 番号	金 額	金 額	(単位：円)
資産の部						
流動資産						
コール・ローン				1,150,994,323	504,700,929	
国債証券				49,702,180,000	54,871,819,000	
地方債証券				7,218,788,209	7,385,044,888	
特殊債券				8,762,549,178	7,316,653,200	
社債券				24,910,867,756	24,537,237,805	
未収入金				4,987,800,000	799,972,000	
未収利息				219,897,341	245,880,011	
前払費用				55,843,256	3,739,724	
流動資産合計				97,008,920,063	95,665,047,557	
資産合計				97,008,920,063	95,665,047,557	
負債の部						
流動負債						
未払金				4,910,750,000	-	
未払解約金				-	340,916,990	
流動負債合計				4,910,750,000	340,916,990	
負債合計				4,910,750,000	340,916,990	
純資産の部						
元本等						
元本				88,013,524,223	88,743,352,566	
剰余金						
剰余金				4,084,645,840	6,580,778,001	
剰余金合計				4,084,645,840	6,580,778,001	
元本等合計				92,098,170,063	95,324,130,567	
純資産合計				92,098,170,063	95,324,130,567	
負債・純資産合計				97,008,920,063	95,665,047,557	

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20年7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。	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。	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）又は金取引所の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。	(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日の最終相場）又は金取引所の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日の最終相場）又は金融商品取引所等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、売買配相場の提供しない）又は価格提供会社のいづれかから入手した価額で評価しております。	(2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売買配相場の提供しない）又は価格提供会社のいづ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、投資信託委託業者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。	(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、投資信託委託業者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。

(貸借対照表に関する注記)

平成19年7月10日現在			平成20年7月10日現在		
期首	平成19年7月10日現在	期首	平成20年7月10日現在	期首	平成20年1月11日
1. 期首元本額	80,061,123,747 円	1. 期首元本額	85,731,293,726 円	期首元本額	85,731,293,726 円
期首からの追加設定元本額	9,275,227,909 円	期首からの追加設定元本額	20,284,284,762 円	期首からの追加設定元本額	20,284,284,762 円
期首からの解約元本額	1,322,827,433 円	期首からの解約元本額	17,272,225,922 円	期首からの解約元本額	17,272,225,922 円
平成19年7月10日現在の元本の内訳 ※			平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※		
G W 7 つの卵	64,685,137,232 円	G W 7 つの卵	63,505,131,866 円	G W 7 つの卵	63,505,131,866 円
グローバル・ラップ・バラン	4,206,954 円	グローバル・ラップ・バラン	4,622,969 円	グローバル・ラップ・バラン	4,622,969 円
ス安定型	3,844,221,125 円	ス安定型	4,146,078,489 円	ス安定型	4,146,078,489 円
グローバル・ラップ・バラン	4,602,187,098 円	グローバル・ラップ・バラン	5,056,786,821 円	グローバル・ラップ・バラン	5,056,786,821 円
ス安定成長型	7,597,517,489 円	ス安定成長型	10,689,206,770 円	ス安定成長型	10,689,206,770 円
グローバル・ラップ・バラン	5,562,973,251 円	グローバル・ラップ・バラン	3,449,046,261 円	グローバル・ラップ・バラン	3,449,046,261 円
ス積極成長型	332,101,369 円	ス積極成長型	274,071,383 円	ス積極成長型	274,071,383 円
G W 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	306,187,007 円	G W 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	292,571,233 円	G W 7 つの卵 (適格機関投資家向け)	292,571,233 円
日本債券ファンド	456,373,343 円	日本債券ファンド	481,308,881 円	日本債券ファンド	481,308,881 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定型)	366,757,463 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定型)	432,185,092 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定型)	432,185,092 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定成長型)	255,861,892 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定成長型)	412,342,801 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (安定成長型)	412,342,801 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型)	88,013,524,223 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型)	88,743,352,566 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (成長型)	88,743,352,566 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積極成長型)	88,013,524,223 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積極成長型)	88,743,352,566 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (積極成長型)	88,743,352,566 円
年金積立 グローバル・ラップ・バラン (合計)	88,013,524,223 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (合計)	88,743,352,566 円	年金積立 グローバル・ラップ・バラン (合計)	88,743,352,566 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総数	88,013,524,223 口	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総数	88,743,352,566 口	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総数	88,743,352,566 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

(1 口当たり情報)

平成19年7月10日現在			平成20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. 0464 円 (10,464 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0742 円 (10,742 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1. 0742 円 (10,742 円)

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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
		注記 番号	金 額	注記 番号	金 額
資産の部					
流動資産					
預金			1,826,147,516		2,688,586,916
コール・ローン			451,770,637		110,575,351
株式			145,051,000,213		91,664,139,740
社債券			493,415,827		253,708,400
投資証券			511,896,687		259,896,787
派生商品評価勘定			364,787		104,273
未収入金			286,119,827		237,862,400
未配当金			117,494,464		107,183,855
未収利息			1,125,529		976,177
流動資産合計			148,739,335,487		95,323,033,899
資産合計			148,739,335,487		95,323,033,899
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			-		102,254
未払金			707,630,817		304,222,053
未払解約金			502,784,794		1,506,187
流動負債合計			1,210,415,611		305,830,494
負債合計			1,210,415,611		305,830,494
純資産の部					
元本等					
元本			100,847,762,906		95,546,506,669
剰余金					
剰余金又は欠損金(△)			46,681,156,970		△529,303,264
剰余金合計			46,681,156,970		△529,303,264
元本等合計			147,528,919,876		95,017,203,405
純資産合計			147,528,919,876		95,017,203,405
負債・純資産合計			148,739,335,487		95,323,033,899

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20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、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合は計算期間末日におけ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、売気配相場は使用しない)又は売気配相場の提示する価額(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つ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つ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つて時価と認めた価額で評価しております。 為替予約取引	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、売気配相場は使用しない)又は売気配相場の提示する価額(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つ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つ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つて時価と認めた価額で評価しております。 為替予約取引	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法			
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)

	平成19年7月10日現在	平成19年1月11日	平成20年7月10日現在	平成20年1月11日
1. 期首	期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	88,105,696,555 円 18,653,324,586 円 5,911,258,235 円	期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	96,326,865,763 円 17,517,967,542 円 18,298,326,636 円
	平成19年7月10日現在の元本の内訳 ※		平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※	
	GW 7つの卵	75,235,821,178 円	GW 7つの卵	67,698,412,389 円
	グローバル・ラップ・パラン	482,540 円	グローバル・ラップ・パラン	661,266 円
	ス安定型		ス安定型	
	グローバル・ラップ・パラン	645,139,417 円	グローバル・ラップ・パラン	868,768,116 円
	ス安定成長型		ス安定成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	1,399,491,864 円	グローバル・ラップ・パラン	1,670,865,368 円
	ス成長型		ス成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	8,988,831,315 円	グローバル・ラップ・パラン	11,083,574,880 円
	ス積極成長型		ス積極成長型	
	グローバル・ラップ・パラン	3,869,347,883 円	グローバル・ラップ・パラン	4,575,971,757 円
	ス積極型		ス積極型	
	グローバル・ラップ・パラン	3,094,435,390 円	グローバル・ラップ・パラン	4,792,136,856 円
	ス超積極型		ス超積極型	
	GW 7つの卵 (通格機関投資家向け)	6,474,739,633 円	GW 7つの卵 (通格機関投資家向け)	3,500,349,303 円
	北米株式ファンド	372,376,916 円	北米株式ファンド	295,659,328 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定型)	32,476,549 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定型)	42,500,295 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定成長型)	76,440,780 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (安定成長型)	102,097,334 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (成長型)	112,518,162 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (成長型)	143,696,150 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極成長型)	288,625,763 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極成長型)	438,924,741 円
	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極型)	257,035,516 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス (積極型)	332,888,886 円
	(合計)	100,847,762,906 円	(合計)	95,546,506,669 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総数	100,847,762,906 口	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総数	95,546,506,669 口
3.	元本の欠損		元本の欠損	
	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は29,303,264円であります。		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は29,303,264円であります。	

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(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		うち1年超		
	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

区分	種 類	平成20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		うち1年超		
	売建	53,933,645	-	54,035,899	△102,254
	カナダドル	53,933,645	-	54,035,899	△102,254
	以 外 アメリカドル	53,933,645	-	54,037,918	104,273
合 計		107,867,290	-	108,073,817	2,019

(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。
- ① 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。
- ② 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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
1口当たり純資産額	1,4629 円	1口当たり純資産額	0,9945 円
(1万口当たり純資産額)	(14,629 円)	(1万口当たり純資産額)	(9,945 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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
		注記 番号	金 額	金 額	(単位：円)
資産の部					
流動資産					
預金			199,250,804	639,286,918	
コール・ローン			507,667,704	1,377,444,735	
株式			136,515,678,931	72,674,116,035	
投資証券			1,087,761,049	-	
派生商品評価勘定			-	367,045	
未収入金			5,678,221,730	886,491,972	
未配当金			289,884,608	241,957,920	
流動資産合計			144,278,464,826	75,819,664,625	
資産合計			144,278,464,826	75,819,664,625	
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			1,580,652	595,346	
未払金			4,195,143,206	833,810,045	
未払解約金			359,882,207	3,393,386	
流動負債合計			4,556,606,065	837,798,777	
負債合計			4,556,606,065	837,798,777	
純資産の部					
元本等					
元本			53,176,614,078	40,215,265,663	
剰余金					
剰余金			86,545,244,683	34,766,600,185	
剰余金合計			86,545,244,683	34,766,600,185	
元本等合計			139,721,858,761	74,981,865,848	
純資産合計			139,721,858,761	74,981,865,848	
負債・純資産合計			144,278,464,826	75,819,664,625	

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20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、売気配相場は使用しない）又は、売気配相場の提示する価額（ただし、売気配相場のいづ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。 為替予約取引	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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は、売気配相場の提示する価額（ただし、売気配相場のいづ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。 為替予約取引	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	同左
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 外貨建取引等の処理基準
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	「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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

平成19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成19年1月11日 48,928,939,986 円 8,102,174,632 円 3,854,500,540 円	1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成20年1月11日 42,626,181,983 円 2,286,542,403 円 4,697,458,723 円
平成19年7月10日現在の元本の内訳 ※		平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※	
GW 7 つの卵	39,497,937,896 円	GW 7 つの卵	28,266,721,697 円
グローバル・ラップ・パラン	199,983 円	グローバル・ラップ・パラン	223,685 円
安定型		安定型	
グローバル・ラップ・パラン	321,859,429 円	グローバル・ラップ・パラン	327,883,990 円
ス 安定成長型		ス 安定成長型	
グローバル・ラップ・パラン	660,436,513 円	グローバル・ラップ・パラン	684,603,041 円
ス 成長型		ス 成長型	
グローバル・ラップ・パラン	4,723,663,626 円	グローバル・ラップ・パラン	4,621,005,765 円
ス 積極成長型		ス 積極成長型	
グローバル・ラップ・パラン	1,955,068,022 円	グローバル・ラップ・パラン	2,000,869,255 円
ス 積極型		ス 積極型	
グローバル・ラップ・パラン	1,969,189,174 円	グローバル・ラップ・パラン	2,201,744,517 円
ス 超積極型		ス 超積極型	
GW 7 つの卵（適格機関投資家向け）	3,373,450,676 円	GW 7 つの卵（適格機関投資家向け）	1,437,668,625 円
欧州先進国株式ファンド	286,237,852 円	欧州先進国株式ファンド	234,626,929 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定型）	13,551,782 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定型）	14,497,562 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定成長型）	38,543,367 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（安定成長型）	39,099,293 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（成長型）	53,476,616 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（成長型）	58,731,872 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極成長型）	152,468,096 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極成長型）	182,771,815 円
年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極型）	130,531,046 円	年金積立 グローバル・ラップ・パランス（積極型）	144,817,617 円
（合計）	53,176,614,078 円	（合計）	40,215,265,663 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	53,176,614,078 口	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	40,215,265,663 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

(通貨関連)			平成19年7月10日現在			(単位：円)
区 分	種 類	契 約 額	時 価		評 価 損 益	
			額	うち1年超		
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引					
	売建	1, 159, 167, 708	-	1, 160, 748, 360	△1, 580, 652	
	スイスフラン	1, 159, 167, 708	-	1, 160, 748, 360	△1, 580, 652	
	合 計	1, 159, 167, 708	-	1, 160, 748, 360	△1, 580, 652	

区 分	種 類	平成20年7月10日現在				評 価 損 益
		契 約 額	等	時 価		
			うち1年超			
市 場 取 引 以 外 の 取 引	為替予約取引					
	売建	647,895,846	-		647,528,801	367,045
	イギリスポンド	647,895,846	-		647,528,801	367,045
	買建	647,895,846	-		647,300,500	△595,346
	ユーロ	647,895,846	-		647,300,500	△595,346
	合 計	1,295,791,692	-		1,294,829,301	△228,301

(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。
- ①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。
- ②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19年7月10日現在			平成20年7月10日現在		
1口当たり純資産額	2,6275 円	1口当たり純資産額	1,8645 円		
(1万口当たり純資産額)	(26,275 円)	(1万口当たり純資産額)	(18,645 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

科 目	対象年月日	平成19年7月10日現在		平成20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			33,127,844		10,920,666
コール・ローン			224,468,359		833,668,301
株式			45,909,779,502		27,906,566,419
投資証券			682,514,400		665,372,493
派生商品評価勘定			396,945		-
未収入金			227,997,755		-
未分配当金			54,635,610		38,247,856
流動資産合計			47,132,920,415		29,454,775,735
資産合計			47,132,920,415		29,454,775,735
負債の部					
流動負債					
未払金			66,026,867		-
未払解約金			313,313,526		12,577,853
流動負債合計			379,340,393		12,577,853
負債合計			379,340,393		12,577,853
純資産の部					
元本等					
元本			10,985,662,937		8,475,121,466
剰余金					
剰余金			35,767,917,085		20,967,076,416
剰余金合計			35,767,917,085		20,967,076,416
元本等合計			46,753,580,022		29,442,197,882
純資産合計			46,753,580,022		29,442,197,882
負債・純資産合計			47,132,920,415		29,454,775,735

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20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、売気配相場は使用しない）又は、売気配相場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) 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な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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は、売気配相場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。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。	同左
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 — 外貨建取引等の処理基準
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	「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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

平成19年7月10日現在		平成20年7月10日現在		
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成19年1月11日 12,796,318,061 円 59,864,412 円 1,870,519,536 円	1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成20年1月11日 12,130,397,460 円 1,738,657,818 円 5,393,933,812 円
	平成19年7月10日現在の元本の内訳 ※		平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※	
	GW 7 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 積極型 グローバル・ラップ・パラン ス 超積極型 GW 7 つの卵（適格機関投資家向け） アジア太平洋先進国株式ファンド	※ 7,862,833,255 円 46,483 円 68,095,580 円 153,782,079 円 993,372,282 円 454,516,636 円 523,424,958 円 698,590,813 円 146,937,941 円	GW 7 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 積極型 グローバル・ラップ・パラン ス 超積極型 GW 7 つの卵（適格機関投資家向け） アジア太平洋先進国株式ファンド	※ 5,818,001,653 円 47,497 円 75,207,175 円 161,133,851 円 945,017,412 円 462,846,680 円 499,618,665 円 295,724,358 円 121,230,366 円
	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（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） (合計)	2,851,307 円 8,134,215 円 12,356,108 円 30,258,599 円 30,462,681 円 10,985,662,937 円	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（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） (合計)	3,055,795 円 8,770,906 円 13,765,176 円 37,166,295 円 33,535,637 円 8,475,121,466 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	10,985,662,937 口	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	8,475,121,466 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

(通貨関連)			平成19年7月10日現在			(単位：円)
区 分	種 類	契 約 額	等	時 価	評価損益	
			うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	208,994,882	-	208,597,937	396,945	
	アメリカドル	10,961,725	-	10,928,920	32,805	
	オーストラリアドル	198,033,157	-	197,669,017	364,140	
	合計	208,994,882	-	208,597,937	396,945	

平成 20 年 7 月 10 日 現在

該当事項はありません。

(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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
1口当たり純資産額	4,2559 円	1口当たり純資産額	3,4740 円
(1万口当たり純資産額)	(42,559 円)	(1万口当たり純資産額)	(34,740 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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
		注記 番号	金 額	金 額	(単位：円)
資産の部					
流動資産					
預金			5,095,815,428	1,855,604,341	
コール・ローン			1,025,708,422	491,192,461	
国債証券			65,736,594,823	22,503,798,631	
地方債証券			229,737,691	5,204,340,231	
特殊債券			35,924,751,526	31,386,110,007	
社債券			42,619,862,664	38,930,431,655	
コモディシャル・ペーパー			9,637,339,065	-	
派生商品評価勘定			978,709,104	1,069,879,933	
未収入金			27,923,136,747	15,435,632,138	
未収利息			1,303,950,810	901,824,410	
前払費用			158,006,949	241,836,089	
差入委託証拠金			1,073,209,238	1,144,231,713	
流動資産合計			191,706,823,067	119,164,681,609	
資産合計			191,706,823,067	119,164,681,609	
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定			427,406,875	658,359,514	
未払金			60,428,680,537	30,882,591,974	
未払解約金			30,247,882	614,850,494	
流動負債合計			60,886,335,294	32,155,801,982	
負債合計			60,886,335,294	32,155,801,982	
純資産の部					
元本等					
元本			73,939,637,820	49,252,272,050	
剰余金					
剰余金			56,880,849,953	37,756,607,577	
剰余金合計			56,880,849,953	37,756,607,577	
元本等合計			130,820,487,773	87,008,879,627	
純資産合計			130,820,487,773	87,008,879,627	
負債・純資産合計			191,706,823,067	119,164,681,609	

(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19年1月11日 至 平成19年7月10日	自 平成20年1月11日 至 平成20年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		国債証券、地方債証券、特殊債券、社債 券及びコマーション・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。 (1) デリバティブ取引 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算 期間末日の対顧客先物売買相場 の仲値で評価しております。 外貨建取引等の処理基準	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債 券及びコマーション・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) 金融商品取引所等の上場されて いる有価証券 金融商品取引所等の上場されて いる有価証券は、原則として金融 商品取引所等における計算期間 末日の最終相場（外貨建証券の場 合は計算期間末日において知り うる直近の日の最終相場）又は金 融商品取引所等が発表する基準 値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の上場されて いない有価証券 当該有価証券については、原則と して、日本証券業協会等発表の店 頭売買参考統計値（平均値）等、 金融商品取引業者、銀行等の提示 する価額（ただし、売買配相場は 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、投資信託委託会社が 忠実義務に基づいて合理的な事 由をもって時価と認めた価額も しくは受託者と協議のうえ両者 が合理的事由をもって時価と認 めた価額で評価しております。 (1) デリバティブ取引 (2) 為替予約取引 同左 同左 同左 外貨建取引等の処理基準 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び 評価方法			
3. その他財務諸表作成のための基 本となる重要な事項			

(貸借対照表に関する注記)

1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成19年7月10日現在 平成19年1月11日 76,792,032,001 円 1,620,787,766 円 4,473,181,947 円	平成20年7月10日現在 平成20年1月11日 53,799,116,529 円 13,373,025,368 円 17,919,869,847 円
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成19年7月10日現在の元本の内訳 ※ GW 7つの卵 57,732,581,525 円 グローバル・ラップ・パラン ス 安定型 503,333 円 グローバル・ラップ・パラン ス 安定成長型 626,299,406 円 グローバル・ラップ・パラン ス 成長型 1,236,733,499 円 グローバル・ラップ・パラン ス 積極成長型 6,665,695,777 円 グローバル・ラップ・パラン ス 積極型 1,790,209,415 円 GW 7つの卵 (適格機関投資 家向け) 4,924,129,243 円 海外債券ファンド 413,078,002 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (安定型) 36,455,773 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (安定成長型) 74,314,000 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (成長型) 98,577,671 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (積極成長型) 221,491,786 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (積極型) 119,568,390 円 (合計) 73,939,637,820 円	平成20年7月10日現在の元本の内訳 ※ GW 7つの卵 36,284,626,016 円 グローバル・ラップ・パラン ス 安定型 553,261 円 グローバル・ラップ・パラン ス 安定成長型 644,534,404 円 グローバル・ラップ・パラン ス 成長型 1,111,492,494 円 グローバル・ラップ・パラン ス 積極成長型 6,054,017,029 円 グローバル・ラップ・パラン ス 積極型 2,260,348,121 円 GW 7つの卵 (適格機関投資 家向け) 1,962,847,578 円 海外債券ファンド 334,275,896 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (安定型) 35,132,298 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (安定成長型) 74,373,567 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (成長型) 94,903,335 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (積極成長型) 234,524,144 円 年金積立 グローバル・ラッ プ・パランス (積極型) 160,643,907 円 (合計) 49,252,272,050 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	73,939,637,820 円	49,252,272,050 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

(債券関連)		平成19年7月10日現在				(単位：円)
区 分	種 類	契 約 額	等 額	時 価	評価損益	
						うち1年超
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	

区 分		種 類	平成20年7月10日現在				時 価	評価損益	(単位：円)
			契 約 額	等		う ち 1 年 超			
市 場 取 引	債券先物取引 売建 買建	40,457,931,762 56,313,478,811			-	40,867,028,342	△409,096,580		
					-	56,653,168,147	339,689,336		
合 計			96,771,410,573		-	97,520,196,489	△69,407,244		

(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)		平成19年7月10日現在				(単位：円)
区 分	種 類	契 約 額		時 価	評価損益	
		契 約 額	うち1年超			
市 場 取 引 外 の 取 引	為替予約取引					
	売建	65,242,724,809	-	65,084,215,765	158,509,044	
	アメリカドル	50,131,002,744	-	49,969,500,255	161,502,481	
	イギリスポンド	14,406,400,016	-	14,413,977,640	△7,577,624	
	ニュージーランドドル	705,322,049	-	700,737,870	4,584,179	
	買建	65,463,899,522	-	65,980,113,085	516,213,565	
	アメリカドル	15,913,741,778	-	15,787,616,206	△126,125,577	
	カナダドル	3,344,401,185	-	3,374,405,080	30,003,899	
	オーストラリアドル	2,285,611,570	-	2,293,923,560	8,311,999	
	スイスフラン	1,248,723,541	-	1,256,385,740	7,662,197	
	スウェーデンクローナ	2,745,273,933	-	2,814,863,940	69,590,000	
	シンガポールドル	1,197,839,807	-	1,222,798,439	24,958,633	
	ニュージーランドドル	130,677,135	-	130,616,850	△60,285	
	デンマーククローネ	1,351,412,557	-	1,369,737,600	18,325,041	
	ノルウェークローネ	1,098,552,031	-	1,133,744,040	35,192,000	
	ポーランドズロチ	2,151,276,332	-	2,221,118,590	69,842,258	
	ユーロ	33,996,389,653	-	34,374,903,040	378,513,387	
合計		130,706,624,331	-	131,064,328,850	674,722,607	

区分	種類	平成20年7月10日現在			評価損益
		契約額等	時価	うち1年超	
市場取引以外での取引	為替予約取引	54,397,000,010	-	54,340,498,115	56,501,895
	売建	38,903,022,594	-	38,847,274,185	55,748,409
	アメリカドル	1,640,868,679	-	1,653,350,550	△12,481,871
	カナダドル	4,182,560,040	-	4,181,469,600	1,090,440
	オーストラリアドル	8,086,081,364	-	8,070,250,600	15,830,764
	イギリスポンド	355,156,968	-	358,105,200	△2,948,232
	シンガポールドル	439,400,315	-	438,163,730	1,236,585
	ニュージーランドドル	789,910,050	-	791,884,250	△1,974,200
	ユーロ	54,965,308,010	-	55,389,733,778	424,425,768
	買建	18,154,006,416	-	18,032,997,913	△121,008,503
	アメリカドル	125,995,578	-	126,540,000	544,422
	カナダドル	354,871,979	-	354,362,400	△509,579
	スイスフラン	741,708,572	-	760,173,620	18,465,048
	スウェーデンクローナ	1,107,124,569	-	1,129,996,500	22,871,931
	シンガポールドル	2,326,821,912	-	2,368,773,041	41,951,129
	デンマーククローネ	827,119,888	-	854,402,400	27,282,512
	ノルウェークローネ	781,215,736	-	801,932,620	20,716,884
	ポーランドズロチ	1,973,651,219	-	2,111,879,734	138,228,515
	ユーロ	28,572,792,141	-	28,848,675,550	275,883,409
	合計	109,362,308,020	-	109,730,231,893	480,927,663

(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。
 - ① 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。
 - ② 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19年7月10日現在		平成20年7月10日現在	
1口当たり純資産額	1,7693 円	1口当たり純資産額	1,7666 円
(1万口当たり純資産額)	(17,693 円)	(1万口当たり純資産額)	(17,666 円)

2 ファンドの現況

以下のファンドの現況は平成 20 年 7 月 31 日現在です。

純資産額計算書

I 資産総額	409,183,947,834	円
II 負債総額	1,195,990,395	円
III 純資産総額 (I - II)	407,987,957,439	円
IV 発行済数量	448,388,543,204	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	0.9099	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

I 資産総額	136,560,195,267	円
II 負債総額	327,297,427	円
III 純資産総額 (I - II)	136,232,897,840	円
IV 発行済数量	98,382,065,168	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.3847	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

I 資産総額	58,402,463,323	円
II 負債総額	594,751,892	円
III 純資産総額 (I - II)	57,807,711,431	円
IV 発行済数量	33,595,877,096	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.7207	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

I 資産総額	92,042,930,864	円
II 負債総額	218,097,482	円
III 純資産総額 (I - II)	91,824,833,382	円
IV 発行済数量	85,400,382,910	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.0752	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

I 資産総額	98,941,371,583	円
II 負債総額	431,089,516	円
III 純資産総額 (I - II)	98,510,282,067	円
IV 発行済数量	95,506,275,640	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.0315	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

I 資産総額	76,514,644,610	円
II 負債総額	1,152,572,312	円
III 純資産総額 (I - II)	75,362,072,298	円
IV 発行済数量	39,993,979,190	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.8843	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

I 資産総額	29,357,067,467	円
II 負債総額	70,077,425	円
III 純資産総額 (I - II)	29,286,990,042	円
IV 発行済数量	8,433,946,504	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.4725	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

I 資産総額	104,423,102,071	円
II 負債総額	20,403,242,667	円
III 純資産総額 (I - II)	84,019,859,404	円
IV 発行済数量	47,135,635,438	口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.7825	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 (2003年2月28日～2004年1月13日)	2,082,909,813	974,067,175
第2計算期間 (2004年1月14日～2005年1月11日)	87,363,652,509	2,796,396,521
第3計算期間 (2005年1月12日～2006年1月10日)	203,506,702,073	31,441,036,327
第4計算期間 (2006年1月11日～2007年1月10日)	380,068,619,701	90,828,905,824
第5計算期間 (2007年1月11日～2008年1月10日)	107,582,341,767	138,924,698,265
第6中間計算期間 (2008年1月11日～2008年7月10日)	4,390,291,957	63,066,682,034

(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)



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・休日を除きます。(半休日となる場合は午前9時～正午)

