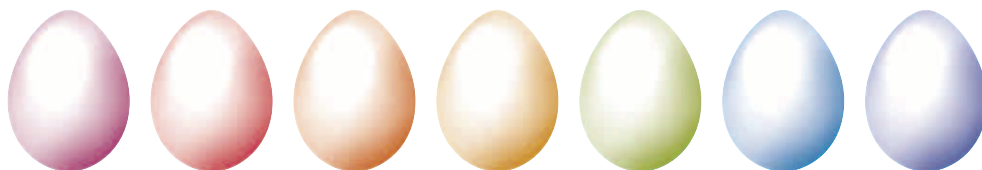


GW 7つの卵

追加型投信／内外／資産複合 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。



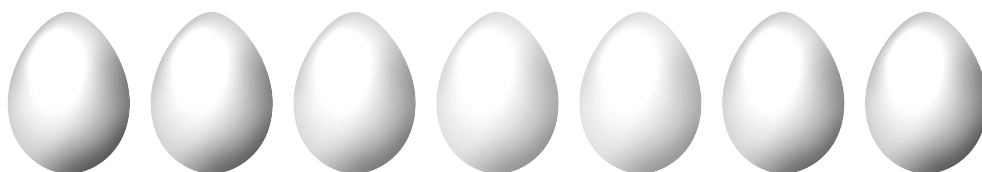
設定・運用は

日興アセットマネジメント

GW 7つの卵

追加型投信／内外／資産複合

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条の規定に基づく目論見書です。

「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22年4月9日に関東財務局長に提出しており、平成22年4月10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。

「GW7つの卵」は、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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。

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
商品分類および属性区分	3

運用の内容について

ファンドの特色	5
投資方針	9
投資方針	
投資対象	
配分方針	
投資制限	
ファンドのリスク	18
ファンドの仕組み・体制	20
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	26
換金手続き	28
費用・税金	29

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	59

その他

約款	61
用語集	75

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	追加型投信 / 内外 / 資産複合 ▶ 詳しくは、後述の『商品分類および属性区分』をご覧ください。
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、組入有効証券の内容および有効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。

商品分類および属性区分

商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

基本情報について

属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

上記は、社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

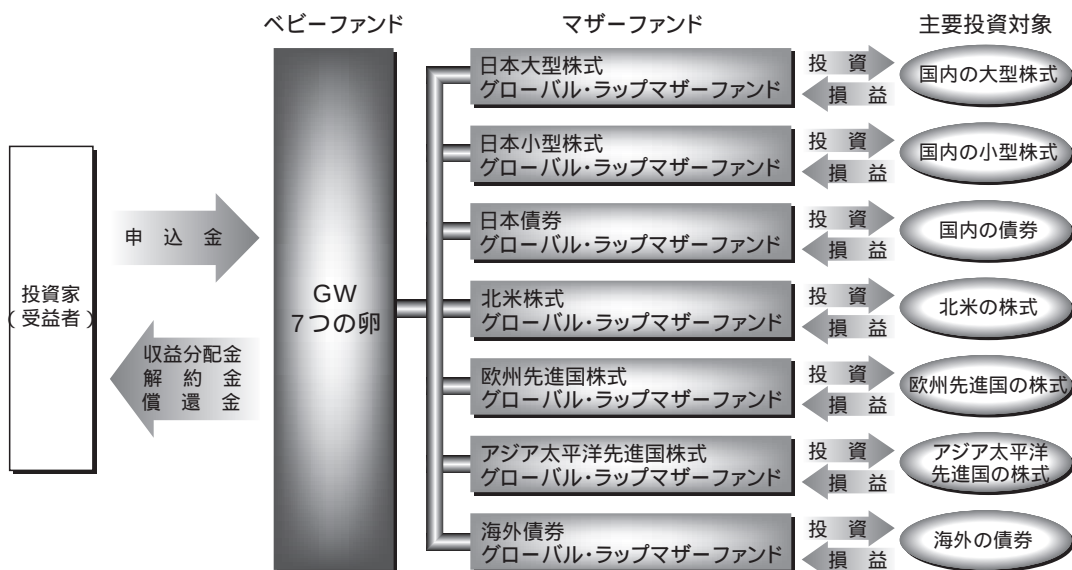
ファンドの特色

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(投資顧問会社)が各マザーファンドを通じて行ないます(ファミリーファンド方式)。

異なる値動きをする傾向のある国内外の株式・債券に分散投資を行なうことで、リターン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。



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。

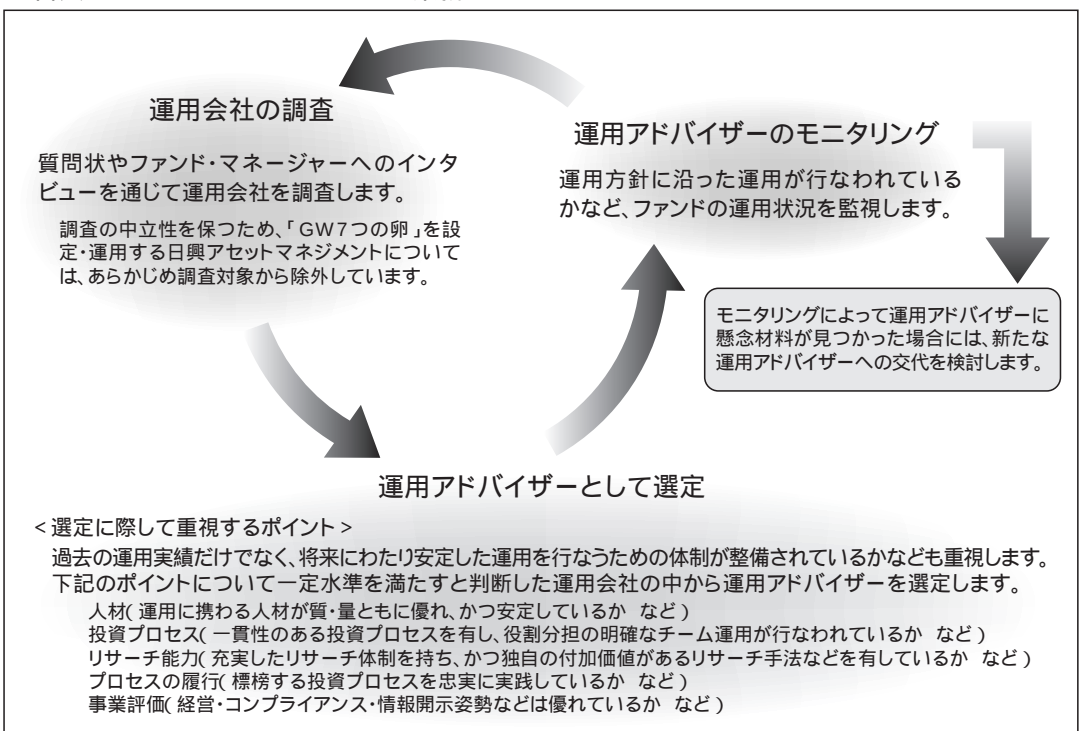
運用の内容について

2

運用成果を向上させるために、日興グローバルラップ株式会社(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・インクからの情報提供や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のファンド・アナリストの業務 >



< 選定に際して重視するポイント >

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

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

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

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。

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の傘下にあるグローバル運用の米国拠点です。

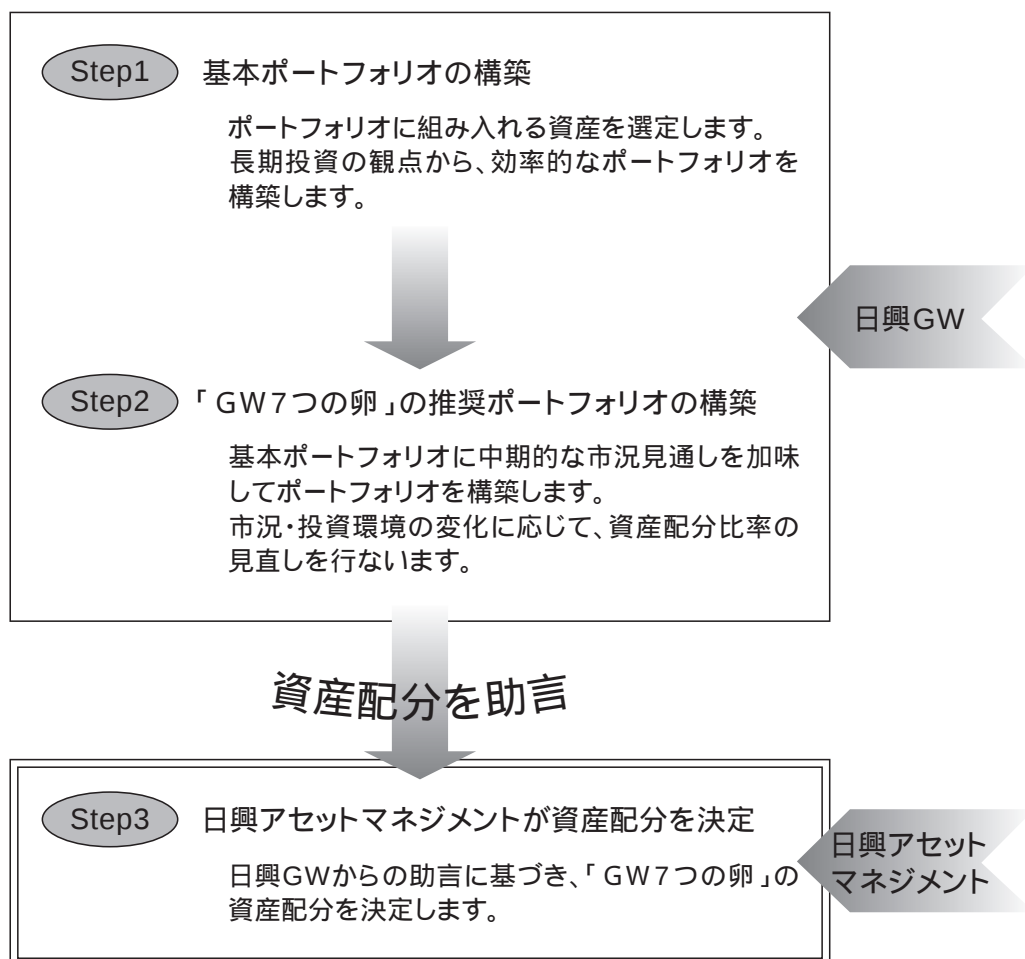
3

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 >



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(投資顧問会社)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。

(有価証券届出書提出日現在)

マザーファンド名		運用アドバイザー(投資顧問会社)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	J P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	ジヤナス・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	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・マネジメント・カンパニー・エルエルシー) < 平成22年5月18日以降 > ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー	14%

平成22年5月18日付で、「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」において、運用アドバイザー(投資顧問会社)をPIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー)からウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに変更する予定です。

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

5

当ファンドならではの充実した情報提供サービス

毎月の運用状況をご説明する「マンスリーレポート」を作成いたします。

四半期ごとに運用状況の分析などを行なう「四半期レビュー」を作成いたします。

ファンドの決算時には、1年間の運用状況の分析などを行なう「スペシャルレビュー」を作成いたします。

上記については、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。

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	NCT信託銀行株式会社
投資顧問会社	JPMorgan・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	NCT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	NCT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	NCT信託銀行株式会社
投資顧問会社	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。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は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	NCT信託銀行株式会社
投資顧問会社	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。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は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	NCT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。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。
 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は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、投資家は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	NCT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) <平成22年5月18日以降> ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー(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。(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・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。

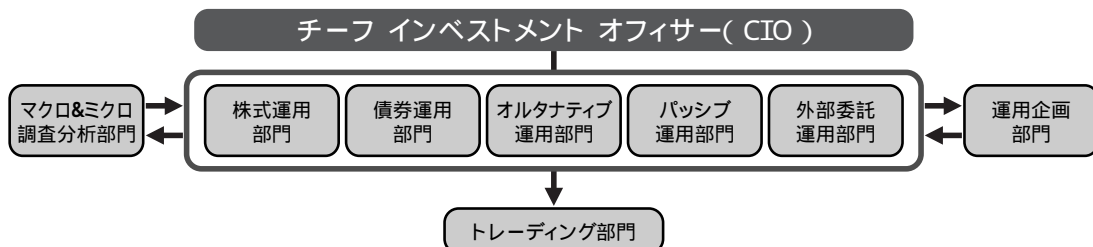
● 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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。

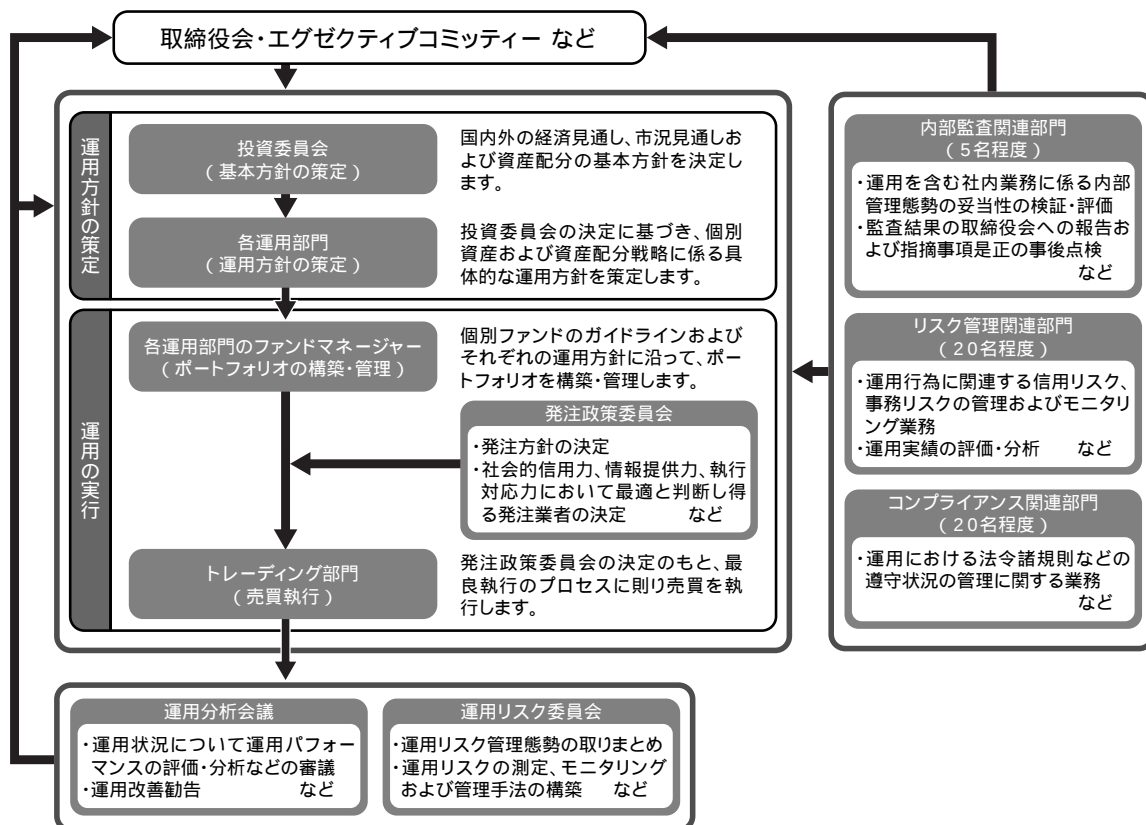
運用体制・リスク管理体制

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なっており、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。

運用の内容について

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。

「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116兆円にのびります(2009年12月末現在)。

同社のJPモルガン(JPM)日本株運用の運用哲学は、アナリスト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乖離を捉えるというものです。また、配当割引モデル(DDM)を活用することにより客観的に銘柄の割安度を判定し、市場タイミングや業種配分の偏りといった銘柄選択以外のリスクは原則として排除するなど、徹底したリスクコントロールのもと、安定的な超過収益の積上げをめざします。

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

スパークス・アセット・マネジメントは、1989年に発足した日本で数少ない独立系の投資顧問会社です。同社は創業以来「マクロはミクロの集積」という投資哲学の下、「徹底した企業調査をベースにした投資」を一貫して行なっています。特に、経済構造が変革する中で成長する新興企業群や、既存の産業の中で自ら体質改善を図りながら成長を捉えようとする企業群に注目しています。2009年12月末現在の同社を含むグループ全体の運用資産額は6,335億円です。

徹底した企業訪問・財務分析から得た調査結果を同社独自の社内データベースに蓄積し活用しています。この中から合議の上で有望銘柄がリストアップされ、ポートフォリオの構築が行なわれます。また、運用はチームによる組織立った運用体制が敷かれています。

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

中央三井アセット信託銀行は、中央三井トラスト・グループに属し、機関投資家向けの業務に特化した信託銀行です。2009年12月末現在の運用資産総額は22兆1,665億円、うち日本債券の運用資産残高は13兆9,902億円にのびります。

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

「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに委託します。

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)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14.9兆円の運用資産総額を有し(2009年12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。

「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、MFSインターナショナル(U.K.)リミテッドに委託します。

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・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17兆円の運用資産を受託しています(2009年12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。

「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19.9兆円(2009年9月末現在)にのびります。

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。

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」の運用は、PIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメン
ト・カンパニー・エルエルシー)に委託します。

PIMCO(パシフィック・インベストメント・マネジメン
ト・カンパニー・エルエルシー)は、ドイツの保険会社アリアン
ツ・グループ傘下の債券を専門とする資産運用会社で、米国に本拠を置いています(2009年12月末現在の運
用資産は約93兆円)。

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ないま
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。

<平成22年5月18日以降>

「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエル
ピーに委託します。

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー(ウエリントン)は、マサチューセッツ州ボストンに本拠を
構えるアメリカの独立系投資運用会社です。その起源は1928年に遡るアメリカでも歴史のある運用会社の一
つです。自社ブランドでの投信販売は行わずに、純粋に資産運用業務のみに専念しています。ウエリントン・マ
ネージメント・グループ全体での運用資産額は約50兆円におよび、アメリカでも大手の一角を担っています
(2009年12月末現在)。

ウエリントンでは、チーム運用アプローチを採用し、マクロ、定量、スプレッド、通貨および新興国市場への機動的
な投資、といった5つのアルファ源泉に配分を行なうことで、安定した超過収益の獲得をめざします。

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)より情報提供や助言を受けます。

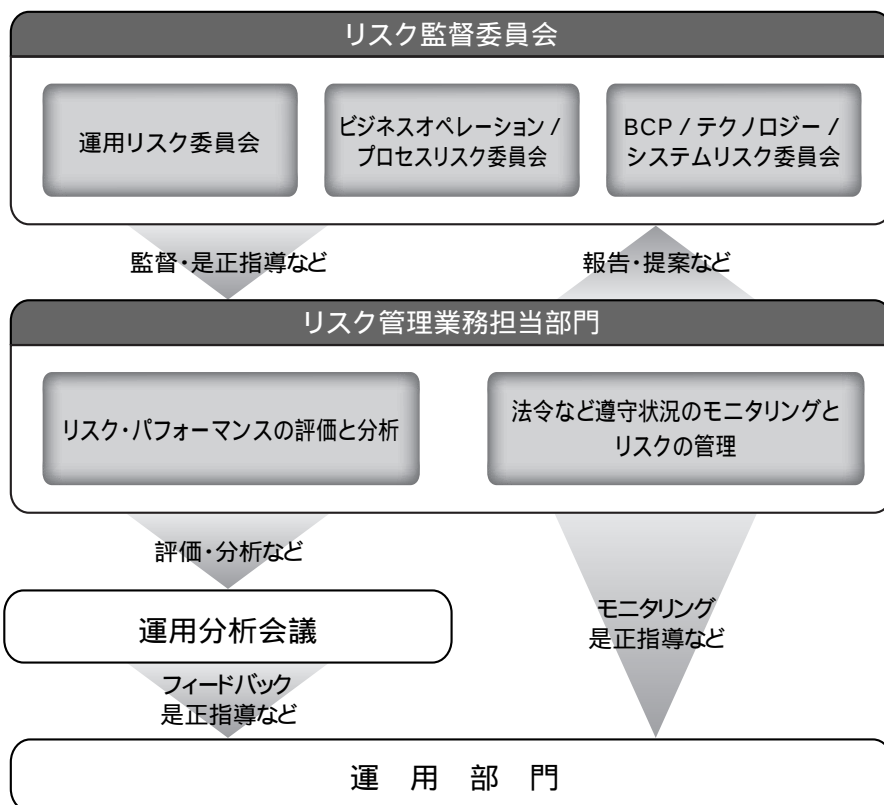
日興GWでは、多角的な視点から資産配分を策定します。月例で投資政策に関する委員会を開催し、投資環
境と中長期的な市況見通しを確認しています。

各マザーファンドの運用アドバイザーの評価・選定などについて、日興アセットマネジメント アメリカズ・インク
より情報提供や助言を受けます。

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。

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 >



■ 全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会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部門別委員会においては、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

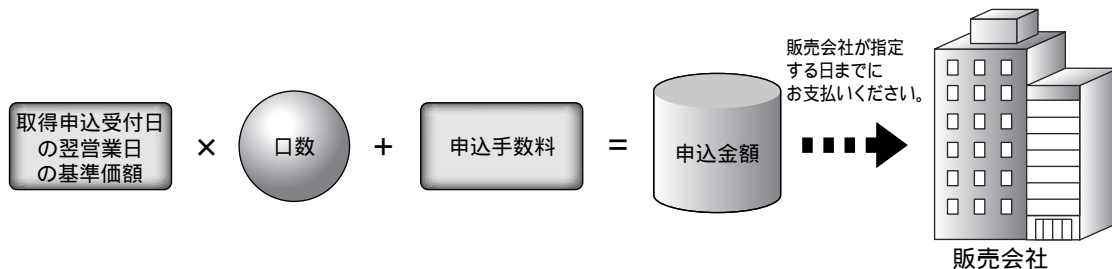
法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果についてはリスク監督委員会、あるいはその部門別委員会へ報告され運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

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。

手続きと費用について

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22年4月10日から平成23年4月8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。

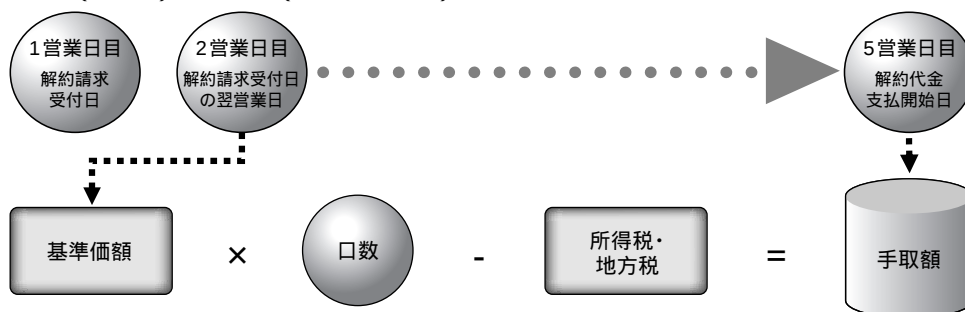
申込みの金額など	
申込価額	取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
申込手数料	販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。 ・販売会社における申込手数料率は3.15%(税抜3%)が上限となっております。 ・申込手数料の額(1口当たり)は、申込価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。 ・＜ 分配金再投資コース ＞ の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。 ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
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。

手続きと費用について

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	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。

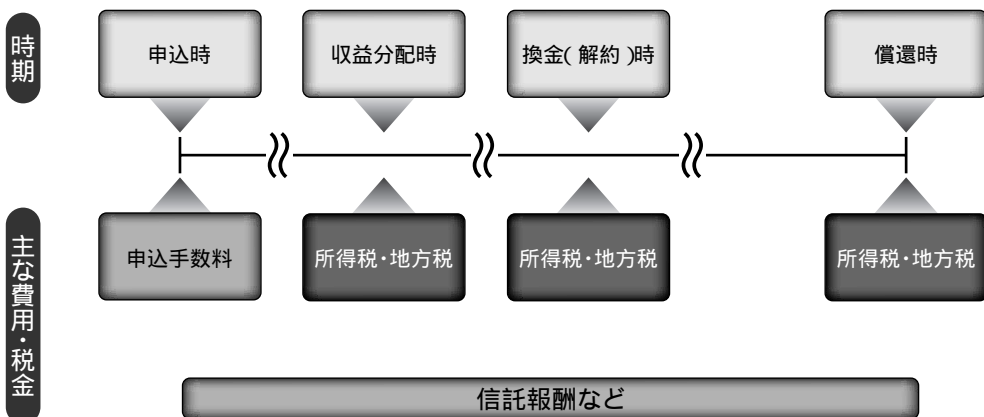
その他

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。

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	普通分配金に対し10%*
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	差益(譲渡益)に対し10%*
償還時	所得税・地方税	差益(譲渡益)に対し10%*

*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24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%となる予定です。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。

手続きと費用について

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。

課税上の取扱い

個人受益者の場合

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については配当所得として、平成23年12月31日まで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(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%(所得税15%および地方税5%)となる予定です。

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)^{*}については譲渡所得として、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%(所得税7%および地方税3%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、10%(所得税7%および地方税3%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

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

・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%(所得税15%および地方税5%)となる予定です。

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、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ます。)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)および普通分配金(申告分離課税を選択したものに限ります。)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

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配当所得として、平成23年12月31日まで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が行なわれます。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。

・なお、平成24年1月1日以降は、上記の7%の税率は15%(所得税のみ)となる予定です。

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。

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。

手続きと費用について

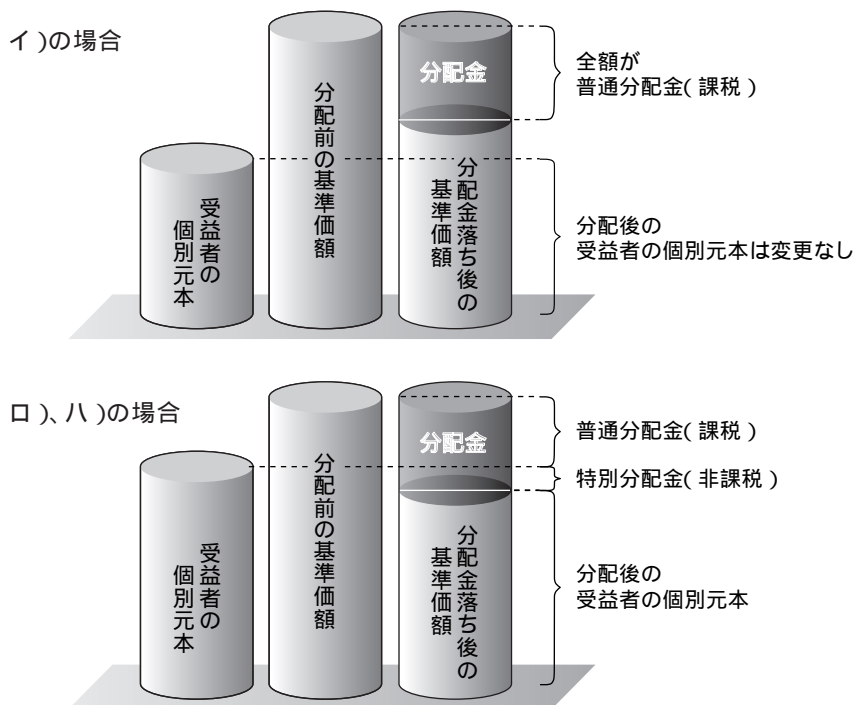
個別元本

- 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。

< 分配金に関するイメージ図 >



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。

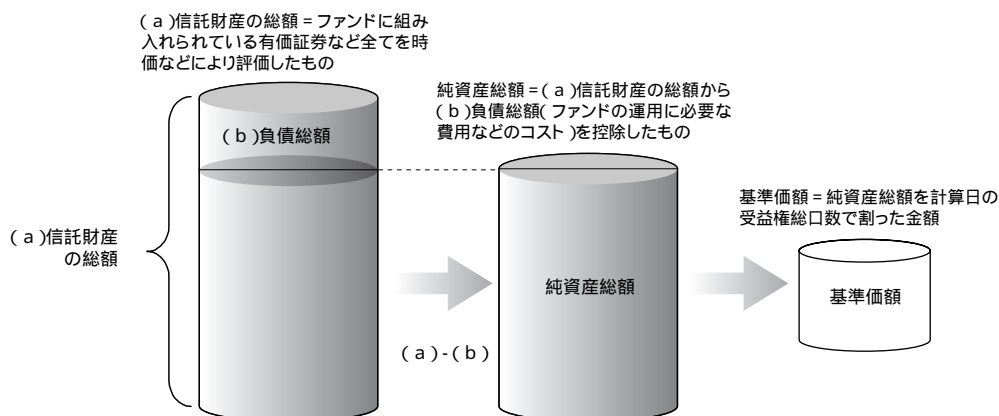
管理および運営

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1万口当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。

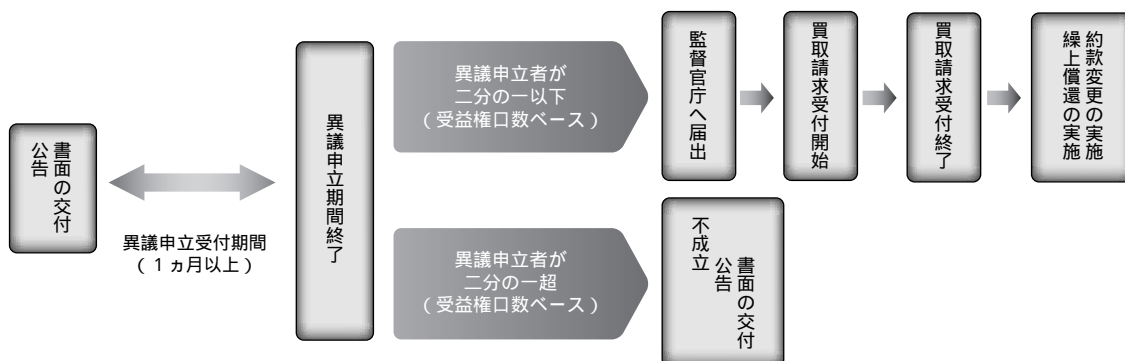
信託約款の変更

- 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

内国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、株式等の振替に関する法律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22年2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
17,363百万円
- 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
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪市中央区北浜四丁目5番33号	194,152,500株	98.54%

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

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、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。

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、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

ファンドの詳細情報の項目

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 22 年 1 月 29 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	236, 049, 208	99. 29
日本	236, 049, 208	99. 29
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1, 681, 577	0. 71
純資産総額	237, 730, 785	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	56, 136, 422, 210	1. 0647 1. 0052	59, 768, 448, 789 56, 428, 331, 605	23. 74
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	52, 487, 181, 489	0. 8740 0. 7971	45, 873, 796, 717 41, 837, 532, 364	17. 60
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	32, 679, 027, 589	1. 1197 1. 1241	36, 590, 929, 760 36, 734, 494, 912	15. 45
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, 226, 545, 810	1. 4995 1. 3414	40, 826, 205, 471 36, 521, 688, 549	15. 36
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	19, 224, 270, 803	1. 6968 1. 6279	32, 619, 582, 699 31, 295, 190, 440	13. 16
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	14, 128, 999, 403	1. 5578 1. 5383	22, 010, 667, 241 21, 734, 639, 781	9. 14
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	3, 986, 453, 518	3. 2356 2. 8841	12, 898, 569, 018 11, 497, 330, 591	4. 84

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. 29
合計	99. 29

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計算期間末 (2009年1月13日)	0.6199	0.6229	255,052	256,286
第7計算期間末 (2010年1月12日)	0.7807	0.7857	256,958	258,604

	1口当たりの純資産額 (円)	純資産総額 (百万円)
2009年1月末日	0.6038	245,850
2009年2月末日	0.6005	240,705
2009年3月末日	0.6209	245,541
2009年4月末日	0.6586	255,853
2009年5月末日	0.6925	265,504
2009年6月末日	0.7112	267,918
2009年7月末日	0.7368	272,722
2009年8月末日	0.7506	273,259
2009年9月末日	0.7468	266,626
2009年10月末日	0.7490	259,872
2009年11月末日	0.7194	243,731
2009年12月末日	0.7652	253,102
2010年1月末日	0.7352	237,730

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計算期間 (2008年1月11日～2009年1月13日)	0.0030
第7計算期間 (2009年1月14日～2010年1月12日)	0.0050

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計算期間 (2008年1月11日～2009年1月13日)	△36.32
第7計算期間 (2009年1月14日～2010年1月12日)	26.75

(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 22 年 1 月 29 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	83,813,876	99.05
日本	83,813,876	99.05
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	804,068	0.95
純資産総額	84,617,945	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	1,300,500	3,286 3,490	4,273,717,505 4,538,745,000	5.36
日本円 日本	株式 電気・ガス業	東京電力	1,338,000	2,573 2,435	3,442,449,530 3,258,030,000	3.85
日本円 日本	株式 情報・通信業	日本電信電話	618,700	3,861 3,810	2,388,761,041 2,357,247,000	2.79
日本円 日本	株式 情報・通信業	ソフトバンク	959,100	1,431 2,301	1,372,339,350 2,206,889,100	2.61
日本円 日本	株式 化学	富士フイルムホールディングス	749,500	2,500 2,893	1,873,970,105 2,168,303,500	2.56
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	732,500	3,554 2,935	2,603,275,746 2,149,887,500	2.54
日本円 日本	株式 鉄鋼	JFEホールディングス	664,600	2,439 3,160	1,621,233,359 2,100,136,000	2.48
日本円 日本	株式 電気機器	リコー	1,520,000	1,236 1,294	1,878,013,117 1,966,880,000	2.32
日本円 日本	株式 情報・通信業	KDDI	3,950	479,606 476,500	1,894,442,839 1,882,175,000	2.22
日本円 日本	株式 卸売業	丸紅	3,465,000	352 527	1,220,689,140 1,826,055,000	2.16
日本円 日本	株式 食料品	JT	4,949	258,001 327,000	1,276,849,151 1,618,323,000	1.91
日本円 日本	株式 医薬品	アステラス製薬	470,300	3,592 3,340	1,689,533,939 1,570,802,000	1.86
日本円 日本	株式 銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,263,700	527 468	1,720,493,329 1,527,411,600	1.81
日本円 日本	株式 海運業	川崎汽船	4,599,000	323 321	1,484,361,269 1,476,279,000	1.74
日本円 日本	株式 卸売業	伊藤忠商事	2,005,000	528 708	1,059,455,400 1,419,540,000	1.68
日本円 日本	株式 その他製品	任天堂	55,600	25,596 25,250	1,423,147,985 1,403,900,000	1.66
日本円 日本	株式 石油・石炭製品	新日鉱ホールディングス	3,549,000	433 391	1,535,368,964 1,387,659,000	1.64
日本円 日本	株式 情報・通信業	大塚商会	277,200	3,915 4,940	1,085,301,148 1,369,368,000	1.62
日本円 日本	株式 電気機器	日本電産	150,800	5,711 8,890	861,145,986 1,340,612,000	1.58
日本円 日本	株式 化学	日東電工	379,500	2,661 3,475	1,009,680,414 1,318,762,500	1.56
日本円 日本	株式 保険業	東京海上ホールディングス	523,800	2,574 2,440	1,348,370,938 1,278,072,000	1.51
日本円 日本	株式 ゴム製品	住友ゴム工業	1,756,300	737 710	1,295,083,050 1,246,973,000	1.47

運用の状況について

日本円 日本	株式 化学	住友化学	3,051,000	359 407	1,096,113,300 1,241,757,000	1.47
日本円 日本	株式 卸売業	スズケン	411,100	2,689 3,020	1,105,554,786 1,241,522,000	1.47
日本円 日本	株式 医薬品	中外製薬	760,700	1,648 1,612	1,253,789,007 1,226,248,400	1.45
日本円 日本	株式 小売業	高島屋	1,837,000	640 660	1,176,119,246 1,212,420,000	1.43
日本円 日本	株式 銀行業	中央三井トラスト・ホールディングス	3,735,000	338 321	1,261,434,310 1,198,935,000	1.42
日本円 日本	株式 輸送用機器	ホンダ	375,600	2,396 3,075	900,121,786 1,154,970,000	1.36
日本円 日本	株式 機械	クボタ	1,379,000	582 813	801,951,720 1,121,127,000	1.32
日本円 日本	株式 輸送用機器	日産自動車	1,510,500	624 736	941,803,994 1,111,728,000	1.31

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	99.05
電気機器	11.26
情報・通信業	10.15
輸送用機器	8.86
銀行業	8.37
化学	8.29
卸売業	5.60
電気・ガス業	5.02
機械	4.71
小売業	3.67
医薬品	3.31
食料品	3.19
鉄鋼	2.92
ゴム製品	2.78
保険業	2.61
陸運業	2.59
海運業	2.33
不動産業	2.17
石油・石炭製品	1.93
建設業	1.73
その他製品	1.66
その他金融業	1.30
金属製品	1.30
ガラス・土石製品	1.23
サービス業	1.01
精密機器	0.83
水産・農林業	0.23
合計	99.05

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 22 年 1 月 29 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	30,584,645	96.68
日本	30,584,645	96.68
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1,049,264	3.32
純資産総額	31,633,910	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 サービス業	メッセージ	4,897	125,200 200,800	613,104,400 983,317,600	3.11
日本円 日本	株式 卸売業	ドウシシャ	347,400	1,300 1,946	451,620,000 676,040,400	2.14
日本円 日本	株式 サービス業	ベネフィット・ワン	8,998	63,900 74,100	574,972,200 666,751,800	2.11
日本円 日本	株式 食料品	S FOODS	814,000	827 802	673,178,000 652,828,000	2.06
日本円 日本	株式 情報・通信業	ティーガイア	4,374	109,400 143,800	478,515,600 628,981,200	1.99
日本円 日本	株式 機械	ユーシン精機	432,100	1,202 1,371	519,384,200 592,409,100	1.87
日本円 日本	株式 情報・通信業	東北新社	1,135,700	714 508	810,889,800 576,935,600	1.82
日本円 日本	株式 ガラス・土石製品	フジミインコーポレーテッド	361,600	1,251 1,594	452,252,581 576,390,400	1.82
日本円 日本	株式 卸売業	トシン・グループ	346,700	1,474 1,580	511,035,800 547,786,000	1.73
日本円 日本	株式 建設業	三井ホーム	1,210,000	446 448	539,660,000 542,080,000	1.71
日本円 日本	株式 情報・通信業	ワークスアプリケーションズ	9,700	43,743 55,800	424,306,327 541,260,000	1.71
日本円 日本	株式 小売業	ヴィレッジヴァンガードコーポレーション	1,409	233,011 371,000	328,312,660 522,739,000	1.65
日本円 日本	株式 サービス業	カカココム	1,545	294,000 333,000	454,230,000 514,485,000	1.63
日本円 日本	株式 小売業	アスクル	290,000	1,622 1,653	470,262,987 479,370,000	1.52
日本円 日本	株式 サービス業	ぐるなび	2,605	209,626 181,900	546,075,236 473,849,500	1.50
日本円 日本	株式 繊維製品	ホギメディカル	106,100	5,122 4,410	543,409,754 467,901,000	1.48
日本円 日本	株式 卸売業	トラスコ中山	358,200	1,244 1,265	445,608,657 453,123,000	1.43
日本円 日本	株式 不動産業	リサ・パートナーズ	8,089	31,767 53,900	256,961,822 435,997,100	1.38
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	235,000	1,602 1,834	376,470,000 430,990,000	1.36
日本円 日本	株式 陸運業	アルプス物流	509,800	718 840	366,036,400 428,232,000	1.35
日本円 日本	株式 卸売業	阪和興業	1,255,000	274 334	343,870,000 419,170,000	1.33

運用の状況について

日本円 日本	株式 電気機器	ニチコン	398,300	771 1,029	307,183,785 409,850,700	1.30
日本円 日本	株式 建設業	青木あすなろ建設	822,500	322 492	265,218,633 404,670,000	1.28
日本円 日本	株式 化学	J S P	354,000	654 1,143	231,501,218 404,622,000	1.28
日本円 日本	株式 小売業	アークス	328,100	1,341 1,231	439,846,212 403,891,100	1.28
日本円 日本	株式 情報・通信業	S R Aホールディングス	498,700	714 806	355,976,903 401,952,200	1.27
日本円 日本	株式 電気機器	ダイヘン	1,027,000	273 367	280,371,000 376,909,000	1.19
日本円 日本	株式 電気機器	日本トリム	205,800	1,855 1,817	381,759,000 373,938,600	1.18
日本円 日本	株式 卸売業	日本風力開発	1,547	262,412 236,100	405,951,690 365,246,700	1.15
日本円 日本	株式 情報・通信業	WOWOW	1,893	139,124 191,000	263,362,546 361,563,000	1.14

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	96.68
サービス業	16.90
電気機器	11.57
卸売業	10.71
情報・通信業	10.18
小売業	10.01
化学	5.14
その他製品	4.59
機械	4.11
ガラス・土石製品	3.95
建設業	3.38
不動産業	2.75
繊維製品	2.52
金属製品	2.46
食料品	2.06
陸運業	1.95
銀行業	1.94
輸送用機器	1.58
その他金融業	0.89
合計	96.68

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 22 年 1 月 29 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	29,045,358	53.13
日本	29,045,358	53.13
地方債証券	5,636,126	10.31
日本	5,636,126	10.31
特殊債券	4,927,014	9.01
日本	4,927,014	9.01
社債券	14,420,561	26.38
日本	12,546,659	22.95
アメリカ	1,873,901	3.43
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	643,544	1.18
純資産総額	54,672,605	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 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (20年) 第92回	2.10000 2026-12-20	7,400,000,000	103.35 101.90	7,648,173,000 7,540,896,000	13.79
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第285回	1.70000 2017-03-20	6,700,000,000	105.57 105.85	7,073,123,000 7,092,017,000	12.97
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第284回	1.70000 2016-12-20	4,600,000,000	105.95 105.94	4,873,800,000 4,873,010,000	8.91
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第293回	1.80000 2018-06-20	4,000,000,000	105.54 105.86	4,221,520,000 4,234,200,000	7.74
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第295回	1.50000 2018-06-20	2,000,000,000	101.06 103.46	2,021,160,000 2,069,280,000	3.78
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (20年) 第114回	2.10000 2029-12-20	1,700,000,000	100.00 99.79	1,700,073,000 1,696,430,000	3.10
日本 日本	地方債証券 —	東京都公募公債 620回	1.35000 2015-03-20	1,500,000,000	101.47 103.58	1,522,095,000 1,553,655,000	2.84
日本 日本	国債証券 —	利付国庫債券 (10年) 第300回	1.59000 2019-03-20	1,500,000,000	100.48 102.64	1,507,250,000 1,539,525,000	2.82
日本 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	98.90 98.90	988,966,196 988,966,196	1.81
日本 日本	社債券 —	北海道電力 293回	1.86000 2017-09-25	900,000,000	103.38 105.49	930,438,000 949,374,000	1.74
日本 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	94.63 101.96	851,670,000 917,595,000	1.68
日本 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	105.06 107.11	840,464,000 856,856,000	1.57
日本 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	104.54 105.23	836,312,000 841,832,000	1.54
日本 アメリカ	社債券 —	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第9回円貨社債 (2005)	0.91000 2010-09-22	800,000,000	98.94 98.94	791,537,712 791,537,712	1.45
日本 日本	社債券 —	関西電力 451回	1.85000 2016-09-20	700,000,000	104.06 106.00	728,385,000 741,979,000	1.36
日本 日本	社債券 —	中部電力 484回	1.41000 2014-09-25	700,000,000	101.69 103.62	711,816,000 725,354,000	1.33
日本 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 2010-03-31	700,000,000	98.99 100.60	692,930,000 704,186,000	1.29

運用の状況について

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	105.16 106.99	630,960,000 641,952,000	1.17
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	105.75 105.84	634,518,000 635,064,000	1.16
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	101.46 104.09	598,637,600 614,107,400	1.12
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	102.33 102.02	613,956,000 612,144,000	1.12
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	101.18 100.99	607,050,000 605,910,000	1.11
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	98.48 98.48	590,891,100 590,891,100	1.08
日本円 日本	特殊債券 —	福岡北九州高速道路債券 第109回	2.09000 2016-09-20	500,000,000	105.20 107.15	525,985,000 535,765,000	0.98
日本円 日本	特殊債券 —	福岡北九州高速道路債券 第107回	1.72000 2015-12-18	500,000,000	102.71 104.98	513,555,000 524,910,000	0.96
日本円 日本	地方債証券 —	大阪府公募公債 261回	1.50000 2013-12-25	500,000,000	101.04 103.54	505,175,000 517,710,000	0.95
日本円 日本	地方債証券 —	兵庫県公募公債 平成14年度3回	1.30000 2012-09-18	500,000,000	100.52 102.31	502,620,000 511,555,000	0.94
日本円 日本	社債券 —	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	2.08000 2010-03-31	500,000,000	99.27 100.78	496,365,000 503,895,000	0.92
日本円 アメリカ	社債券 —	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・リンク 第8回円貨社債（2006）	1.49000 2011-12-28	500,000,000	86.71 100.51	433,545,000 502,540,000	0.92
日本円 日本	社債券 —	ドン・キホーテ（社債間限定同順位特約付）2回	1.67000 2011-02-18	500,000,000	96.02 100.10	480,085,000 500,510,000	0.92

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	53.13
地方債証券	10.31
特殊債券	9.01
社債券	26.38
合計	98.83

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 22 年 1 月 29 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	61,527,645	99.20
アメリカ	56,693,230	91.41
スイス	2,208,506	3.56
アイルランド	1,680,923	2.71
カナダ	944,984	1.52
為替予約取引(売建)	(976)	(0.00)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	494,574	0.80
純資産総額	62,022,220	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 銀行	BANK OF AMERICA CORP	1,321,618	1,141 1,380	1,507,615,430 1,823,522,128	2.94
アメリカドル アメリカ	株式 通信	QUALCOMM INC	499,570	3,509 3,634	1,753,032,100 1,815,382,227	2.93
アメリカドル アメリカ	株式 その他製造	ILLINOIS TOOL WORKS	458,341	3,026 3,944	1,387,048,507 1,807,511,780	2.91
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	JPMORGAN CHASE & CO	503,040	2,410 3,544	1,212,534,851 1,782,833,924	2.87
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	248,707	5,455 6,957	1,356,740,426 1,730,298,123	2.79
アメリカドル スイス	株式 保険	ACE LTD	391,349	3,966 4,383	1,552,008,222 1,715,466,249	2.77
アメリカドル アメリカ	株式 通信	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	510,026	2,006 3,337	1,023,060,866 1,701,829,715	2.74
アメリカドル アイルランド	株式 ヘルスケア製品	COVIDIEN PLC	368,453	2,881 4,562	1,061,674,339 1,680,923,632	2.71
アメリカドル アメリカ	株式 メディア	NEWS CORP-CL A	1,436,065	599 1,124	859,866,752 1,614,022,749	2.60
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	DEVON ENERGY CORPORATION	259,808	4,803 6,151	1,247,836,661 1,598,089,504	2.58
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	EOG RESOURCES INC	194,469	6,830 8,215	1,328,276,744 1,597,534,190	2.58
アメリカドル アメリカ	株式 食品	GENERAL MILLS INC	230,345	4,682 6,459	1,078,497,625 1,487,787,183	2.40
アメリカドル アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	NORTHROP GRUMMAN CORP	284,604	3,956 5,085	1,125,922,170 1,447,089,757	2.33
アメリカドル アメリカ	株式 農業	ALTRIA GROUP INC	784,873	1,523 1,796	1,195,143,049 1,409,865,565	2.27
アメリカドル アメリカ	株式 生活用品	KIMBERLY-CLARK CORP	261,907	4,206 5,306	1,101,485,308 1,389,758,345	2.24
アメリカドル アメリカ	株式 医薬品	ABBOTT LABORATORIES	286,931	4,070 4,843	1,167,690,984 1,389,633,087	2.24
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	BAXTER INTERNATIONAL INC	253,241	4,739 5,225	1,200,021,822 1,323,086,474	2.13
アメリカドル アメリカ	株式 化粧品・パーソナルケア	COLGATE-PALMOLIVE CO	181,428	5,249 7,181	952,288,703 1,302,780,457	2.10

運用の状況について

アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	EXXON MOBIL CORPORATION	223,052	5,846 5,831	1,303,968,167 1,300,718,637	2.10
アメリカドル アメリカ	株式 電力	NRG ENERGY INC	585,076	1,557 2,219	910,736,205 1,298,350,577	2.09
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	GOLDMAN SACHS GROUP INC	93,296	10,108 13,761	943,003,627 1,283,831,637	2.07
アメリカドル アメリカ	株式 半導体	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	766,751	1,088 1,661	834,129,030 1,273,377,889	2.05
アメリカドル アメリカ	株式 バイオテクノロジー	GILEAD SCIENCES INC	273,972	4,033 4,265	1,104,833,467 1,168,483,101	1.88
アメリカドル アメリカ	株式 保険	AFLAC INC	264,607	3,745 4,416	991,025,989 1,168,447,965	1.88
アメリカドル アメリカ	株式 包装・容器	CROWN HOLDINGS INC	520,316	2,106 2,172	1,095,684,819 1,130,352,169	1.82
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	APPLE INC	62,396	11,754 17,890	733,420,210 1,116,280,869	1.80
アメリカドル アメリカ	株式 運輸関連	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	210,732	4,248 5,293	895,168,679 1,115,370,590	1.80
アメリカドル アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	UNITED TECHNOLOGIES CORP	174,624	3,880 6,048	677,516,568 1,056,091,883	1.70
アメリカドル アメリカ	株式 バイオテクノロジー	GENZYME CORP - GENL DIVISION	201,839	5,037 4,858	1,016,637,936 980,604,990	1.58
アメリカドル アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	481,178	1,745 2,022	839,524,791 972,759,261	1.57

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	99.20
石油・ガス	12.54
銀行	9.30
通信	8.37
バイオテクノロジー	4.99
ヘルスケア製品	4.84
保険	4.65
半導体	4.30
航空宇宙・防衛	4.04
小売り	3.74
その他製造	3.58
医薬品	3.24
電力	3.23
化粧品パーソナルケア	2.64
メディア	2.60
インターネット	2.58
運輸関連	2.44
食品	2.40
農業	2.27
生活用品	2.24
その他金融	1.92
包装・容器	1.82
コンピューター	1.80
ソフトウェア	1.77
広告	1.36
住宅建設	1.31
電子機器	1.28
繊維製品	1.25
流通・卸売業	0.96
鉱業	0.92
パイプライン	0.81
合計	99.20

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	売建	977,712	976,732	0.00
合計		977,712	976,732	0.00

運用の状況について

(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 22 年 1 月 29 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	54,045,325	98.75
イギリス	14,623,692	26.72
フランス	9,954,161	18.19
スイス	9,492,089	17.34
ドイツ	7,000,143	12.79
オランダ	5,536,031	10.11
アメリカ	1,319,992	2.41
ジャージー	1,167,425	2.13
イタリア	1,116,244	2.04
フィンランド	944,917	1.73
バミューダ諸島	623,123	1.14
ベルギー	591,050	1.08
スペイン	576,141	1.05
ノルウェー	364,756	0.67
チェコ	263,879	0.48
ギリシャ	167,399	0.31
ポルトガル	163,644	0.30
キプロス	140,632	0.26
為替予約取引(買建)	(103,145)	(0.19)
為替予約取引(売建)	(102,755)	(0.19)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	686,143	1.25
純資産総額	54,731,468	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(%)
スイスフラン スイス	株式 食品	NESTLE SA	737,149	3,313 4,312	2,442,294,379 3,178,310,794	5.81
イギリスポンド イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	14,763,874	178 192	2,624,331,979 2,833,755,829	5.18
スイスフラン スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	164,585	13,212 15,414	2,174,442,148 2,536,993,672	4.64
イギリスポンド イギリス	株式 銀行	HSBC HOLDINGS PLC	2,327,810	618 955	1,439,300,612 2,223,873,284	4.06
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	777,480	2,466 2,506	1,917,127,011 1,948,634,082	3.56
ユーロ フランス	株式 銀行	BNP PARIBAS SA	276,969	5,204 6,383	1,441,316,284 1,767,959,406	3.23
ユーロ フランス	株式 医薬品	SANOFI-AVENTIS SA	266,140	6,148 6,584	1,636,217,506 1,752,391,697	3.20
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	306,948	4,866 5,151	1,493,528,632 1,581,231,219	2.89
ユーロ ドイツ	株式 化学	LINDE AG	153,080	6,926 9,587	1,060,213,652 1,467,537,088	2.68
ユーロ ドイツ	株式 電力	E.ON AG	441,057	2,825 3,315	1,246,115,228 1,461,986,987	2.67
ユーロ オランダ	株式 化学	AKZO NOBEL NV	267,020	3,925 5,302	1,048,125,188 1,415,760,280	2.59
ユーロ フランス	株式 食品	DANONE	267,631	4,512 5,113	1,207,641,472 1,368,321,282	2.50
ユーロ フランス	株式 電力	GDF SUEZ	371,165	3,366 3,427	1,249,380,972 1,272,066,264	2.32
ユーロ オランダ	株式 保険	ING GROEP NV-CVA	1,465,652	800 830	1,172,386,615 1,216,577,032	2.22
イギリスポンド ジャージー	株式 メディア	WPP PLC	1,386,950	600 842	831,763,757 1,167,425,288	2.13
ユーロ オランダ	株式 通信	KONINKLIJKE KPN NV	787,160	1,213 1,477	954,786,760 1,162,935,858	2.12
イギリスポンド イギリス	株式 メディア	REED ELSEVIER PLC	1,548,980	713 715	1,104,395,798 1,107,172,954	2.02
イギリスポンド イギリス	株式 生活用品	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	236,530	3,793 4,670	897,268,279 1,104,508,767	2.02
ユーロ ドイツ	株式 化学	SYMRIS AG	543,701	1,223 1,967	665,208,122 1,069,646,139	1.95
ユーロ ドイツ	株式 化学	BAYER AG	166,796	5,008 6,160	835,293,449 1,027,381,163	1.88
スイスフラン アメリカ	株式 ヘルスケア製品	SYNTHES INC	89,230	10,187 11,367	909,013,957 1,014,278,659	1.85
ユーロ フィンランド	株式 通信	NOKIA OYJ	762,860	1,360 1,239	1,037,774,629 944,917,226	1.73
ユーロ フランス	株式 電気部品・電気機械	SCHNEIDER ELECTRIC SA	95,970	6,563 9,218	629,819,184 884,652,660	1.62
ユーロ フランス	株式 多角産業	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	89,400	6,401 9,763	572,226,463 872,809,420	1.59
スイスフラン スイス	株式 小売り	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	277,770	1,649 3,089	458,060,928 857,993,337	1.57
ユーロ オランダ	株式 飲料	HEINEKEN NV	188,420	2,816 4,412	530,524,763 831,336,738	1.52
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	BG GROUP PLC	495,790	1,627 1,660	806,660,552 822,792,633	1.50
ユーロ ドイツ	株式 医薬品	MERCK KGAA	92,460	8,236 7,959	761,462,787 735,922,721	1.34
スイスフラン スイス	株式 銀行	UBS AG-REGISTERED	581,896	1,143 1,205	665,373,720 701,108,684	1.28
イギリスポンド イギリス	株式 その他製造	TOMKINS PLC	2,565,300	238 271	611,383,985 694,010,490	1.27

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	98.75
銀行	14.21
化学	9.86
通信	9.59
石油・ガス	9.40
医薬品	9.18
食品	8.31
電力	5.48
保険	5.36
メディア	4.16
ヘルスケア製品	3.42
小売り	2.62
生活用品	2.02
その他金融	1.80
電気部品・電気機械	1.62
多角産業	1.59
飲料	1.52
その他製造	1.27
運輸関連	1.11
建築資材	1.02
宿泊施設	0.86
商業サービス	0.70
化粧品パーソナルケア	0.67
電子機器	0.63
繊維製品	0.57
航空宇宙・防衛	0.55
石油・ガス サービス	0.50
ヘルスケア・サービス	0.45
住宅建設	0.30
合計	98.75

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 (%)
イギリスポンド	買建	94,186,670	93,809,109	0.17
ユーロ	買建	9,438,752	9,336,689	0.02
合計		103,625,422	103,145,798	0.19
ユーロ	売建	94,186,670	93,393,283	0.17
イギリスポンド	売建	9,438,752	9,361,783	0.02
合計		103,625,422	102,755,066	0.19

(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 22 年 1 月 29 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	16,864,351	97.22
オーストラリア	10,591,808	61.06
香港	3,177,881	18.32
シンガポール	2,187,297	12.61
アメリカ	396,882	2.29
バミューダ諸島	369,455	2.13
中国	141,025	0.81
投資証券	377,004	2.17
香港	221,329	1.28
オーストラリア	155,674	0.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	105,646	0.61
純資産総額	17,347,002	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	BHP BILLITON LTD	624,843	2,673 3,255	1,670,155,670 2,033,725,875	11.72
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	206,150	2,828 4,406	582,898,509 908,368,434	5.24
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	428,758	1,248 1,771	535,236,802 759,474,266	4.38
オーストラリアドル オーストラリア	株式 食品	WOOLWORTHS LIMITED	356,760	2,032 2,094	724,920,948 747,203,246	4.31
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	WESTPAC BANKING CORPORATION	342,750	1,531 1,966	524,732,535 673,730,856	3.88
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	306,611	1,647 2,134	505,099,607 654,430,304	3.77
オーストラリアドル オーストラリア	株式 保険	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	306,268	1,562 1,851	478,288,340 566,995,633	3.27
シンガポールドル シンガポール	株式 銀行	UNITED OVERSEAS BANK LTD	385,192	747 1,168	287,622,175 449,727,068	2.59
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	825,680	454 532	374,452,206 439,097,037	2.53
オーストラリアドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	RESMED INC-CDI	848,358	413 468	350,713,329 396,882,657	2.29
香港ドル 香港	株式 多角産業	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	393,500	733 1,001	288,539,356 394,044,998	2.27
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	RIO TINTO LIMITED	67,640	4,013 5,713	271,408,144 386,431,162	2.23
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	ORICA LTD	191,101	1,335 1,998	255,164,933 381,905,851	2.20
シンガポールドル シンガポール	株式 銀行	DBS GROUP HOLDINGS LTD	410,538	701 914	287,856,761 375,074,085	2.16
アメリカドル バミューダ諸島	株式 多角産業	JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	239,000	1,087 1,546	259,737,999 369,455,617	2.13
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	137,815	2,430 2,467	334,941,445 339,999,872	1.96

運用の状況について

香港ドル 香港	株式 多角産業	HUTCHISON WHAMPOA LTD	541,000	540 623	292,297,454 336,796,845	1.94
香港ドル 香港	株式 不動産	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	277,000	961 1,173	266,145,497 325,053,960	1.87
アメリカドル 香港	株式 多角産業	JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	114,800	1,919 2,691	220,293,035 308,961,768	1.78
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	88,080	3,278 3,493	288,708,735 307,671,332	1.77
オーストラリアドル オーストラリア	株式 飲料	COCA-COLA AMATIL LIMITED	341,454	704 874	240,424,321 298,455,415	1.72
アメリカドル 香港	株式 不動産	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	713,000	250 418	178,578,938 298,268,007	1.72
オーストラリアドル オーストラリア	株式 通信	TELSTRA CORP LTD	1,059,195	258 273	273,359,052 289,687,079	1.67
オーストラリアドル オーストラリア	株式 銀行	SUNCORP-METWAY LIMITED	393,226	512 720	201,288,441 283,016,549	1.63
オーストラリアドル オーストラリア	株式 保険	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	916,754	278 303	255,006,879 277,855,578	1.60
オーストラリアドル オーストラリア	株式 建築資材	JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	375,271	328 629	123,214,548 236,182,020	1.36
シンガポールドル シンガポール	株式 宿泊施設	CITY DEVELOPMENTS LTD	336,000	392 685	131,603,498 230,231,232	1.33
オーストラリアドル オーストラリア	株式 コンピューター	COMPUTERSHARE LIMITED	236,570	707 952	167,326,288 225,130,185	1.30
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	127,000	823 1,623	104,464,264 206,130,144	1.19
シンガポールドル シンガポール	株式 通信	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	1,029,020	173 191	178,441,501 196,297,913	1.13

<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(%)
香港ドル 香港	投資証券 —	LINK REIT	1,046,000	194 212	202,511,593 221,329,416	1.28
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 —	WESTFIELD GROUP	153,160	844 1,016	129,284,520 155,674,688	0.90

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 (%)
株式	97.22
銀行	26.63
鉱業	16.15
多角産業	10.67
不動産	6.97
保険	5.68
食品	4.31
宿泊施設	3.08
通信	2.89
ヘルスケア製品	2.82
商業サービス	2.53
石油・ガス	2.25
小売り	1.98
バイオテクノロジー	1.96
飲料	1.72
建築資材	1.36
コンピューター	1.30
流通・卸売業	1.19
化学	1.03
農業	0.95
エンジニアリング建設	0.93
木材・紙	0.69
航空	0.12
投資証券	2.17
合計	99.39

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) 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 22 年 1 月 29 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	22,564,366	51.95
ドイツ	11,763,442	27.08
カナダ	5,185,274	11.94
アメリカ	2,615,990	6.02
イギリス	1,368,892	3.15
ギリシャ	786,558	1.81
デンマーク	430,986	0.99
カタール	353,366	0.81
パナマ	30,364	0.07
南アフリカ	29,489	0.07
地方債証券	541,247	1.25
アメリカ	541,247	1.25
特殊債券	7,275,658	16.75
フランス	1,858,059	4.28
国際機関	1,636,998	3.77
ドイツ	1,612,714	3.71
アメリカ	1,172,810	2.70
ノルウェー	741,111	1.71
カナダ	149,983	0.35
韓国	103,981	0.24
社債券	11,296,787	26.01
アメリカ	7,596,869	17.49
スペイン	1,309,768	3.02
フランス	621,105	1.43
シンガポール	468,026	1.08
イギリス	459,345	1.06
ルクセンブルグ	448,894	1.03
オーストラリア	149,231	0.34
カナダ	147,115	0.34
アイルランド	96,429	0.22
有価証券先物取引等(買建)	(22,310,903)	(51.36)
アメリカ	(18,565,965)	(42.74)
ドイツ	(3,744,937)	(8.62)
為替予約取引(買建)	(15,077,330)	(34.71)
為替予約取引(売建)	(14,372,617)	(33.09)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1,758,431	4.05
純資産総額	43,436,491	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 (%)
ユーロ ドイツ	国債証券 —	ドイツ国債	3.25000 2020-01-04	93,500,000	12,613.94 12,570.79	11,794,030,152 11,753,692,629	27.06
カナダドル カナダ	国債証券 —	カナダ国債	1.50000 2012-03-01	40,400,000	8,407.91 8,426.13	3,396,795,495 3,404,157,853	7.84
アメリカドル アメリカ	国債証券 —	アメリカ国債	3.62500 2019-08-15	19,100,000	9,106.54 8,966.48	1,739,349,399 1,712,597,652	3.94
ユーロ フランス	特殊債券 —	フランス貯蓄共済金庫全国金庫 (CDEE)	5.25000 2010-09-17	13,000,000	12,870.55 12,837.44	1,673,170,886 1,668,866,605	3.84
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	16,322.49 16,369.98	1,632,248,768 1,636,998,015	3.77
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	15,959.58 16,127.15	1,595,958,495 1,612,714,755	3.71
イギリスポンド イギリス	国債証券 —	イギリス国債	2.25000 2014-03-07	9,600,000	14,030.78 14,259.29	1,346,955,203 1,368,892,181	3.15
カナダドル カナダ	国債証券 —	カナダ国債	2.50000 2015-06-01	14,400,000	8,345.09 8,368.36	1,201,693,334 1,205,043,129	2.77
ユーロ スペイン	社債券 —	Banco Santander Central Hispano SA	4.50000 2012-11-14	8,000,000	12,811.99 13,195.89	1,024,958,997 1,055,671,540	2.43
アメリカドル アメリカ	社債券 —	Cellco Partnership / Verizon Wireless Capital LLC	3.75000 2011-05-20	10,000,000	9,101.33 9,277.43	910,133,145 927,743,326	2.14
アメリカドル アメリカ	国債証券 —	アメリカ国債	3.37500 2019-11-15	10,300,000	8,677.54 8,770.81	893,787,010 903,393,335	2.08
ユーロ ギリシャ	国債証券 —	ギリシャ国債	4.30000 2012-03-20	6,700,000	12,531.55 11,739.69	839,614,076 786,558,945	1.81
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	9,340.34 9,624.83	719,205,803 741,111,541	1.71
カナダドル カナダ	国債証券 —	カナダ国債	2.00000 2014-12-01	7,000,000	8,209.05 8,229.62	574,633,150 576,073,407	1.33
アメリカドル アメリカ	社債券 —	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1	5.72848 2036-08-20	9,507,054	3,188.70 5,301.60	303,151,743 504,025,586	1.16
アメリカドル アメリカ	特殊債券 —	政府抵当金庫 (GNMA) POOL 004164	6.00000 2038-06-20	5,039,975	9,278.28 9,474.94	467,622,971 477,534,860	1.10
アメリカドル シンガポール	社債券 —	Temasek Financial I Ltd	4.30000 2019-10-25	5,300,000	8,956.80 8,830.69	474,710,493 468,026,721	1.08
アメリカドル ルクセンブルグ	社債券 —	GAO Gazprom	6.21200 2016-11-22	5,000,000	6,162.35 8,977.90	308,117,571 448,894,885	1.03
デンマーククローネ デンマーク	国債証券 —	デンマーク国債	4.00000 2019-11-15	24,700,000	1,751.70 1,744.89	432,670,073 430,986,753	0.99
アメリカドル アメリカ	地方債証券 —	CALIFORNIA ST-Taxable Various Purpose	7.50000 2034-04-01	4,700,000	9,042.98 8,808.95	425,020,105 414,020,676	0.95
アメリカドル アメリカ	社債券 —	Hewlett-Packard Company	1.30563 2011-05-27	3,700,000	8,977.00 9,095.94	332,149,000 336,549,642	0.77
アメリカドル フランス	社債券 —	Electricite de France (EDF)	6.50000 2019-01-26	3,200,000	10,221.30 10,161.88	327,081,663 325,180,263	0.75
アメリカドル アメリカ	社債券 —	Priscoa Global Funding I	0.45063 2013-09-27	3,600,000	5,995.85 8,542.33	215,850,457 307,524,012	0.71
ユーロ フランス	社債券 —	BNP Paribas	4.75000 2013-05-28	2,200,000	13,000.93 13,451.15	286,020,567 295,925,274	0.68
アメリカドル カタール	国債証券 —	カタール共和国	4.00000 2015-01-20	3,100,000	9,002.77 9,053.30	279,085,953 280,652,440	0.65
アメリカドル アメリカ	社債券 —	American Express Centurion Bank	0.38313 2012-06-12	3,000,000	7,468.11 8,824.38	224,043,298 264,731,461	0.61
ユーロ スペイン	社債券 —	Banco Santander Central Hispano SA	4.00000 2010-09-10	2,000,000	12,677.36 12,704.87	253,547,215 254,097,421	0.58
アメリカドル アメリカ	社債券 —	THORNBURG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-5 A1	0.35063 2036-06-25	2,923,794	7,399.48 8,676.87	216,345,742 253,693,855	0.58
アメリカドル アメリカ	社債券 —	THORNBURG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-6 A1	0.34063 2011-11-25	2,764,806	7,394.82 8,806.81	204,452,390 243,491,149	0.56
アメリカドル イギリス	社債券 —	Barclays Bank Plc	0.45063 2016-06-27	2,900,000	6,463.44 8,285.11	187,439,760 240,268,094	0.55

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 (%)
国債証券	51.95
地方債証券	1.25
特殊債券	16.75
社債券	26.01
合計	95.96

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 (%)
アメリカ	ユーロドル金利3ヶ月 (CME) 1012	買建	525	11,571,998,222	11,662,132,913	26.85
アメリカ	US T-NOTE 5YR FUTURES 2010-03	買建	662	6,905,069,366	6,903,832,280	15.89
ドイツ	DEUTSCHLAND 10YR (BUND) FUTURES 2010-03	買建	243	3,747,426,432	3,744,937,881	8.62
合計			—	22,224,494,020	22,310,903,074	51.36

<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	7,526,363,405	7,394,980,133	17.02
ユーロ	買建	5,213,125,431	5,058,755,680	11.65
ポーランドズロチ	買建	829,933,234	824,347,936	1.90
デンマーククローネ	買建	394,949,651	386,930,020	0.89
ノルウェークローネ	買建	372,941,089	353,602,920	0.81
スイスフラン	買建	336,172,338	331,807,740	0.76
スウェーデンクローナ	買建	313,800,379	306,355,410	0.71
シンガポールドル	買建	296,806,700	292,695,832	0.67
オーストラリアドル	買建	137,074,353	127,854,840	0.29
合計		15,421,166,580	15,077,330,511	34.71
アメリカドル	売建	8,234,803,175	8,133,172,957	18.72
カナダドル	売建	4,308,836,980	4,150,982,400	9.56
イギリスポンド	売建	1,681,234,720	1,632,583,440	3.76
ポーランドズロチ	売建	417,042,165	415,148,977	0.96
ユーロ	売建	42,129,540	40,729,400	0.09
合計		14,684,046,580	14,372,617,174	33.09

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

GW 7つの卵

＜貸借対照表＞

(単位：円)

科目	期別	第6期	第7期
		平成21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,945,306,415	4,215,097,534
親投資信託受益証券		253,220,066,110	255,214,567,410
未収入金		1,460,000,000	2,196,623,968
流動資産合計		259,625,372,525	261,626,288,912
資産合計		259,625,372,525	261,626,288,912
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		1,234,376,656	1,645,685,515
未払解約金		218,058,703	497,894,141
未払受託者報酬		86,553,667	70,013,687
未払委託者報酬		3,029,380,564	2,450,481,044
その他未払費用		4,454,945	3,660,231
流動負債合計		4,572,824,535	4,667,734,618
負債合計		4,572,824,535	4,667,734,618
純資産の部			
元本等			
元本		411,459,918,326	329,137,103,022
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△156,407,370,336	△72,178,548,728
(分配準備積立金)		1,017,072,393	3,980,674,944
元本等合計		255,052,547,990	256,958,554,294
純資産合計		255,052,547,990	256,958,554,294
負債純資産合計		259,625,372,525	261,626,288,912

運用の状況について

<損益及び剰余金計算書>

(単位：円)

科目	期別	第6期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	第7期 自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		21,042,873	3,025,389
有価証券売買等損益		△150,226,241,478	65,958,884,417
営業収益合計		△150,205,198,605	65,961,909,806
営業費用			
受託者報酬		203,860,748	135,021,514
委託者報酬		7,135,130,549	4,725,757,221
その他費用		10,378,021	7,067,297
営業費用合計		7,349,369,318	4,867,846,032
営業利益又は営業損失(△)		△157,554,567,923	61,094,063,774
経常利益又は経常損失(△)		△157,554,567,923	61,094,063,774
当期純利益又は当期純損失(△)		△157,554,567,923	61,094,063,774
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		△12,040,632,124	6,695,369,780
期首剰余金又は期首欠損金(△)		△11,300,404,221	△156,407,370,336
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,470,433,351	33,074,010,552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,470,433,351	33,074,010,552
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		829,087,011	1,598,197,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		829,087,011	1,598,197,423
分配金		1,234,376,656	1,645,685,515
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△156,407,370,336	△72,178,548,728

<重要な会計方針に係る事項に関する注記>

項 目	期 別	第6期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	第7期 自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成20年1月11日から平成21年1月13日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成21年1月14日から平成22年1月12日までとなっております。

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 GW7つの卵 約款

(信託の種類、委託者および受託者)

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

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、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

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、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）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。

(追加日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社振法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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（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 委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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っては、延長前の信託終了日（以下「当初の信託終了日」といいます。）以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行なわないものをいいます。以下本項において同じ。）にあっては、当初の信託終了日まで当該信託の受益証券または受益権を保有した受益者をいいます。以下本項において同じ。）が、その償還金（信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取請求にかかる売却代金または一部解約金を含みます。以下本項において同じ。）をもって、当該信託終了日（信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取約定日または一部解約請求日を含みます。）の属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に、当該償還金の支払いを受けた委託者の指定する第一種金融商品取引業者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第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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第一種金融商品取引業者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第一種金融商品取引業者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第一種金融商品取引業者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す。）
- 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、NCT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書
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します。）
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します。）
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。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

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

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、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 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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できます。
- 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できます。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

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

(再投資の指図)

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

(資金の借入れ)

第38条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- 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 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

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

(受託者による資金の立替え)

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

- 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
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賃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第一種金融商品取引業者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します。）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第一種金融商品取引業者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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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します。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第一種金融商品取引業者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します。）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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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します。

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します。

(受益証券の保護預り等)

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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者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、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な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移し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。

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第一種金融商品取引業者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 N C T 信託銀行株式会社

そ の 他

約款変更実施予定日 平成22年 5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) 第44条 ①～③ (略)	(信託報酬等の額) 第44条 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。 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 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 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30	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 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 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

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

しゅうえきぶんばい

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

じゅうえきしゃ

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

(ど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。



GW 7つの卵

追加型投信／内外／資産複合

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条の規定に基づく目論見書です。

「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22年4月9日に関東財務局長に提出しており、平成22年4月10日にその効力が発生しております。

「GW7つの卵」は、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

- 目 次 -

	頁
第1 ファンドの沿革	1
第2 手続等	1
第3 管理及び運営	3
第4 ファンドの経理状況	6
第5 設定及び解約の実績	41

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
平成 22 年 5 月 18 日	「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」における投資顧問会社の変更（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。

(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。

(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

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

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。

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で評価します。

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

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。

（ 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

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10億口を下回ることとなった場合

ロ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ニ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

ホ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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。

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。

公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社とのマザーファンドにおける運用の指図に関する権限の委託契約または当ファンドにおける投資顧問契約は、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。その後の改正を含みます。)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号。その後の改正を含みます。)に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(平成20年1月11日から平成21年1月13日まで)及び第7期計算期間(平成21年1月14日から平成22年1月12日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成21年2月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士
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21年1月13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21年1月13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22年2月17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

坂本 貴司 

指定社員 公認会計士
業務執行社員

和田 洋 

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21年1月14日から平成22年1月12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22年1月12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

GW7つの卵

(1) 貸借対照表

科目	期別	(単位：円)	
		第 6 期	第 7 期
資産の部		平成 21 年 1 月 13 日現在	平成 22 年 1 月 12 日現在
流動資産			金 額
コール・ローン		4, 945, 306, 415	4, 215, 097, 534
親投資信託受益証券		253, 220, 066, 110	255, 214, 567, 410
未収入金		1, 460, 000, 000	2, 196, 623, 968
流動資産合計		259, 625, 372, 525	261, 626, 288, 912
資産合計		259, 625, 372, 525	261, 626, 288, 912
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		1, 234, 376, 656	1, 645, 685, 515
未払解約金		218, 058, 703	497, 894, 141
未払受託者報酬		86, 553, 667	70, 013, 687
未払委託者報酬		3, 029, 380, 564	2, 450, 481, 044
その他未払費用		4, 454, 945	3, 660, 231
流動負債合計		4, 572, 824, 535	4, 667, 734, 618
負債合計		4, 572, 824, 535	4, 667, 734, 618
純資産の部			
元本等			
元本		411, 459, 918, 326	329, 137, 103, 022
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金 ()		156, 407, 370, 336	72, 178, 548, 728
(分配準備積立金)		1, 017, 072, 393	3, 980, 674, 944
元本等合計		255, 052, 547, 990	256, 958, 554, 294
純資産合計		255, 052, 547, 990	256, 958, 554, 294
負債純資産合計		259, 625, 372, 525	261, 626, 288, 912

(2) 損益及び剰余金計算書

科目	期別	(単位：円)	
		第 6 期	第 7 期
		自 平成 21 年 1 月 13 日	自 平成 21 年 1 月 14 日
		至 平成 21 年 1 月 12 日	至 平成 22 年 1 月 12 日
営業収益			金 額
受取利息		21, 042, 873	3, 025, 389
有価証券売買等損益		150, 226, 241, 478	65, 958, 884, 417
営業収益合計		150, 205, 198, 605	65, 961, 909, 806
営業費用			
受託者報酬		203, 860, 748	135, 021, 514
委託者報酬		7, 135, 130, 549	4, 725, 757, 221
その他費用		10, 378, 021	7, 067, 297
営業費用合計		7, 349, 369, 318	4, 867, 846, 032
営業利益又は営業損失 ()		157, 554, 567, 923	61, 094, 063, 774
経常利益又は経常損失 ()		157, 554, 567, 923	61, 094, 063, 774
当期純利益又は当期純損失 ()		157, 554, 567, 923	61, 094, 063, 774
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		12, 040, 632, 124	6, 695, 369, 780
期首剰余金又は期首欠損金 ()		11, 300, 404, 221	156, 407, 370, 336
剰余金増加額又は欠損金減少額		2, 470, 433, 351	33, 074, 010, 552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2, 470, 433, 351	33, 074, 010, 552
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		829, 087, 011	1, 598, 197, 423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		829, 087, 011	1, 598, 197, 423
分配金		1, 234, 376, 656	1, 645, 685, 515
期末剰余金又は期末欠損金 ()		156, 407, 370, 336	72, 178, 548, 728

(3) 注記表

(重要な会計方針針に係る事項に関する注記)

項 目	第6期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	第7期 自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっており、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当計算期間は平成20年1月11日から平成21年1月13日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっており、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、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当計算期間は平成21年1月14日から平成22年1月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第6期 平成21年1月13日現在	第7期 平成22年1月12日現在
1. 期首元本額	515,639,121,751 円	期首元本額 411,459,918,326 円
期中追加設定元本額	6,547,417,251 円	期中追加設定元本額 4,726,664,478 円
期中解約元本額	110,726,620,676 円	期中解約元本額 87,049,479,782 円
2. 計算期間末日における	411,459,918,326 円	計算期間末日における 329,137,103,022 円
受益権の総数		受益権の総数
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156,407,370,336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72,178,548,728円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第6期 自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	第7期 自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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	1,605,923,703 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 1,210,313,823 円
2. 分配金の計算過程		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	2,187,428,085 円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益 4,822,685,246 円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売却等損益	0 円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売却等損益 0 円
C 信託約款に定める収益調整金	129,474,249 円	C 信託約款に定める収益調整金 117,892,982 円
D 信託約款に定める分配準備積立金	64,020,964 円	D 信託約款に定める分配準備積立金 803,675,213 円
E 分配対象収益 (A + B + C + D)	2,380,923,298 円	E 分配対象収益 (A + B + C + D) 5,744,253,441 円
F 分配対象収益 (1口当たり)	0.0057 円	F 分配対象収益 (1口当たり) 0.0174 円
G 分配金額	1,234,376,656 円	G 分配金額 (1万口当たり) 174 円
H 分配金額 (1万口当たり)	0.0030 円	H 分配金額 (1口当たり) 1,645,685,515 円
分配金に加算した外国支払税	3,098 円	分配金額 (1万口当たり) 0.0050 円

(有価証券に関する注記)

第 6 期 (自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 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)
親投資信託受益証券	253,220,066,110	137,191,395,915
合計	253,220,066,110	137,191,395,915

第 7 期 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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)
親投資信託受益証券	255,214,567,410	53,766,071,706
合計	255,214,567,410	53,766,071,706

(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6期 平成21年1月13日現在	第7期 平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	0.6199 円	1口当たり純資産額 0.7807 円
(1 万口当たり純資産額)	(6,199 円)	(1 万口当たり純資産額) (7,807 円)

(4) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(親投資信託受益証券)

(単位：円)				備 考
種 類	銘 柄	券面総額	評価額	
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	58,896,599,702	62,707,209,702	
	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	14,411,417,455	22,450,106,111	
	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	32,764,797,667	36,686,743,947	
	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	53,135,651,641	46,440,559,534	
	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	27,344,718,131	41,003,404,837	
	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	4,038,793,350	13,067,919,763	
	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	19,365,053,935	32,858,623,516	
合計		209,957,031,881	255,214,567,410	

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

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「日本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、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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,391,260,326	1,285,945,991
株式		78,324,459,800	92,004,734,500
派生商品評価勘定		-	31,421,200
未収入金		122,718,323	5,549,760
未収配当金		123,273,550	97,372,800
差入委託証拠金		-	26,400,000
流動資産合計		79,961,711,999	93,451,424,251
資産合計		79,961,711,999	93,451,424,251
負債の部			
流動負債			
前受金		-	28,320,000
未払金		143,451,433	-
未払解約金		1,016,860,581	284,093,624
流動負債合計		1,160,312,014	312,413,624
負債合計		1,160,312,014	312,413,624
純資産の部			
元本等			
元本		92,244,587,316	87,483,048,210
剰余金			
剰余金又は欠損金 ()		13,443,187,331	5,655,962,417
元本等合計		78,801,399,985	93,139,010,627
純資産合計		78,801,399,985	93,139,010,627
負債純資産合計		79,961,711,999	93,451,424,251

(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20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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) 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）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託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。	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）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 金融商品取引所等の上場されて	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）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 金融商品取引所等の上場されて
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	デリバティブ取引 同左

(貸借対照表に関する注記)

	平成21年1月13日現在	平成22年1月12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20年1月11日 115,504,522,820 円 3,747,922,731 円 27,007,858,235 円	平成21年1月14日 92,244,587,316 円 14,105,315,477 円 18,886,854,583 円
平成21年1月13日現在の元本の内訳 GW7つの卵 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 グローバル・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 グローバル・ラップ・バランス（安定型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型） （合計）	平成22年1月12日現在の元本の内訳 GW7つの卵 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 グローバル・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 グローバル・ラップ・バランス（安定型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型） 年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型） （合計）	平成21年1月14日 92,244,587,316 円 14,105,315,477 円 18,886,854,583 円 58,896,599,702 円 1,014,263 円 1,124,698,946 円 2,101,780,839 円 12,669,242,215 円 5,240,494,640 円 5,083,191,402 円 375,063,282 円 406,591,179 円 56,764,827 円 144,533,990 円 229,948,639 円 654,956,397 円 498,167,889 円 87,483,048,210 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	92,244,587,316 円	87,483,048,210 円
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は13,443,187,331円であります。	92,244,587,316 円	87,483,048,210 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

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 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	78,324,459,800	40,752,024,054
合計	78,324,459,800	40,752,024,054

対象期間 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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	92,004,734,500	11,758,781,963
合計	92,004,734,500	11,758,781,963

(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)

取引の状況に関する事項

	自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 日	自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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。	

取引の時価等に関する事項

平成 21 年 1 月 13 日現在

該当事項はありません。

(株式関連) (単位 : 円)

区 分	種 類	平成22年1月12日現在			評価損益
		契 約 額 等	時 価		
市 場 取 引	株価指数先物取引 買建	638,770,000	-	670,250,000	31,480,000
	合計	638,770,000	-	670,250,000	31,480,000

(注) 時価の算定方法

1. 計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
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 21 年 1 月 13 日現在		平成 22 年 1 月 12 日現在	
1 口当たり純資産額	0.8543 円	1 口当たり純資産額	1.0647 円
(1 万口当たり純資産額)	(8,543 円)	(1 万口当たり純資産額)	(10,647 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	1,557,000	134	208,638,000	
1801	大成建設	2,397,000	183	438,651,000	
1802	大林組	610,000	362	220,820,000	
1878	大東建託	121,500	4,650	564,975,000	
1925	大和ハウス工業	490,000	1,090	534,100,000	
1963	日揮	243,000	1,745	424,035,000	
2502	アサヒビール	256,100	1,764	451,760,400	
2503	キリンホールディングス	385,000	1,503	578,655,000	
2579	コカ・コーラウエスト	100,900	1,639	165,375,100	
2914	J T	5,166	326,000	1,684,116,000	
3231	野村不動産ホールディングス	261,900	1,421	372,159,900	
3407	旭化成	642,000	487	312,654,000	
3436	SUMCO	302,800	1,772	536,561,600	
4005	住友化学	3,185,000	420	1,337,700,000	
4043	トクヤマ	287,000	558	160,146,000	
4208	宇部興産	3,962,000	263	1,042,006,000	
4503	アステラス製薬	490,800	3,500	1,717,800,000	
4519	中外製薬	793,900	1,688	1,340,103,200	
4631	D I C	2,185,000	164	358,340,000	
4768	大塚商会	289,300	4,750	1,374,175,000	
4901	富士フイルムホールディングス	782,400	2,981	2,332,334,400	
4902	コニカミノルタホールディングス	1,170,000	1,007	1,178,190,000	
4911	資生堂	349,600	1,944	679,622,400	
5001	新日本石油	613,000	459	281,367,000	
5016	新日鉱ホールディングス	3,704,000	423	1,566,792,000	
5108	プリヂーストン	799,800	1,556	1,244,488,800	
5110	住友ゴム工業	1,833,000	791	1,449,903,000	
5202	日本板硝子	4,647,000	269	1,250,043,000	
5401	新日本製鐵	1,164,000	395	459,780,000	
5411	J F ホールディングス	693,600	3,770	2,614,872,000	
5938	住生活グループ	112,300	1,620	181,926,000	
6113	アマダ	1,690,000	670	1,132,300,000	
6302	住友重機械工業	2,305,000	494	1,138,670,000	
6326	クボタ	1,438,000	937	1,347,406,000	
6367	ダイキン工業	268,200	3,710	995,022,000	
6479	ミネベア	732,000	502	367,464,000	
6503	三菱電機	1,376,000	752	1,034,752,000	
6504	富士電機ホールディングス	2,205,000	173	381,465,000	
6594	日本電産	157,300	8,540	1,343,342,000	
6665	エルピーダメモリ	635,200	1,724	1,095,084,800	
6758	ソニー	226,600	2,916	660,765,600	
6952	カシオ計算機	255,400	728	185,931,200	
6963	ローム	77,000	6,370	490,490,000	
6988	日東電工	379,500	3,520	1,335,840,000	
7201	日産自動車	1,576,600	823	1,297,541,800	
7203	トヨタ自動車	1,290,300	4,115	5,309,584,500	
7259	アイシン精機	302,900	2,675	810,257,500	
7267	ホンダ	475,300	3,315	1,575,619,500	
7453	良品計画	66,800	3,480	232,464,000	

7733 オリンバス	270,200	2,990	807,898,000		
7751 キヤノン	160,900	3,950	635,555,000		
7752 リコー	1,586,000	1,371	2,174,406,000		
7974 任天堂	58,100	26,080	1,515,248,000		
8001 伊藤忠商事	2,093,000	777	1,626,261,000		
8002 丸紅	3,617,000	547	1,978,499,000		
8031 三井物産	196,600	1,457	286,446,200		
8035 東京エレクトロン	137,900	6,000	827,400,000		
8233 高島屋	1,918,000	637	1,221,766,000		
8267 イオン	363,400	880	319,792,000		
8273 イズミ	507,500	1,205	611,537,500		
8306 三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,406,300	488	1,662,274,400		
8309 中央三井トラスト・ホールディングス	3,899,000	338	1,317,862,000		
8316 三井住友フィナンシャルグループ	591,800	2,875	1,701,425,000		
8327 西日本シティ銀行	4,186,000	242	1,013,012,000		
8331 千葉銀行	653,000	570	372,210,000		
8354 ふくおかフィナンシャルグループ	1,541,000	342	527,022,000		
8377 ほくほくフィナンシャルグループ	2,429,000	204	495,516,000		
8591 オリックス	168,520	7,170	1,208,288,400		
8729 ソニーフィナンシャルホールディングス	3,920	262,500	1,029,000,000		
8766 東京海上ホールディングス	546,700	2,706	1,479,370,200		
8801 三井不動産	448,000	1,695	759,360,000		
8830 住友不動産	543,000	1,802	978,486,000		
9020 東日本旅客鉄道	139,800	6,130	856,974,000		
9021 西日本旅客鉄道	2,946	328,000	966,288,000		
9022 東海旅客鉄道	783	674,000	527,742,000		
9101 日本郵船	1,659,000	339	562,401,000		
9107 川崎汽船	4,801,000	321	1,541,121,000		
9432 日本電信電話	645,800	3,825	2,470,185,000		
9433 K D D I	4,121	513,000	2,114,073,000		
9501 東京電力	1,396,500	2,445	3,414,442,500		
9513 J - P O W E R	143,300	2,730	391,209,000		
9531 東京ガス	1,800,000	375	675,000,000		
9697 カブコン	514,700	1,643	845,652,100		
9783 ベネッセホールディングス	234,300	3,885	910,255,500		
9831 ヤマダ電機	105,300	6,240	657,072,000		
9984 ソフトバンク	1,001,000	2,187	2,189,187,000		
9987 スズケン	429,000	3,080	1,321,320,000		
9989 サンドラッグ	102,400	2,120	217,088,000		
合計	92,195,956		92,004,734,500		

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記) 」に記載しております。

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

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

(1) 貸借対照表

科目	対象年月日	(単位：円)	
		平成21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
資産の部		金 額	金 額
流動資産			
コール・ローン		1,689,143,024	1,277,706,759
株式		33,549,535,530	31,225,099,650
未収入金		114,168,413	-
未収配当金		99,661,900	66,440,900
流動資産合計		35,452,508,867	32,569,247,309
資産合計		35,452,508,867	32,569,247,309
負債の部			
流動負債			
未払金		380,989,058	57,438,464
未払解約金		340,389,239	1,763,666
流動負債合計		721,378,297	59,202,130
負債合計		721,378,297	59,202,130
純資産の部			
元本等			
元本		27,022,765,054	20,869,567,678
剰余金			
剰余金又は欠損金 ()		7,708,365,516	11,640,477,501
元本等合計		34,731,130,570	32,510,045,179
純資産合計		34,731,130,570	32,510,045,179
負債純資産合計		35,452,508,867	32,569,247,309

(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20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12日
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) 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する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託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。	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）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 (3) 時価が入手できなかった有価証券

(貸借対照表に関する注記)

平成21年1月13日現在		平成22年1月12日現在	
1. 期首	平成20年1月11日	期首	平成21年1月14日
期首元本額	37,924,799,100 円	期首元本額	27,022,765,054 円
期首からの追加設定元本額	1,438,241,592 円	期首からの追加設定元本額	960,621,028 円
期首からの解約元本額	12,340,275,638 円	期首からの解約元本額	7,113,818,404 円
平成21年1月13日現在の元本の内訳		平成22年1月12日現在の元本の内訳	
GW7つの卵	19,111,151,772 円	GW7つの卵	14,411,417,455 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	553,951 円	ス安定型	447,421 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	439,615,171 円	ス安定成長型	359,547,300 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	755,526,806 円	ス成長型	595,047,301 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	3,564,600,526 円	ス積極成長型	2,931,165,706 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	1,175,679,568 円	ス積極型	1,097,280,374 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	1,086,942,795 円	ス超積極型	770,524,934 円
GW7つの卵 (適格機関投資家向け)	231,551,079 円	GW7つの卵 (適格機関投資家向け)	87,044,013 円
日本小型株式ファンド		日本小型株式ファンド	
年金積立グローバル・ラップ・バランス (安定型)	272,143,058 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (安定型)	205,247,198 円
年金積立グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	28,422,614 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (安定成長型)	26,339,987 円
年金積立グローバル・ラップ・バランス (成長型)	48,606,062 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (成長型)	47,633,011 円
年金積立グローバル・ラップ・バランス (超成長型)	68,168,430 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (超成長型)	67,892,829 円
年金積立グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	143,911,758 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (積極成長型)	160,776,096 円
年金積立グローバル・ラップ・バランス (積極型)	95,891,464 円	年金積立グローバル・ラップ・バランス (積極型)	109,204,053 円
(合計)	27,022,765,054 円	(合計)	20,869,567,678 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投資信託の受益権の総数	27,022,765,054 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投資信託の受益権の総数	20,869,567,678 口

当該投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 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	33,549,535,530	12,261,279,449
合計	33,549,535,530	12,261,279,449

対象期間 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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	31,225,099,650	3,401,613,893
合計	31,225,099,650	3,401,613,893

(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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1口当たり純資産額	1.2853 円
(1万口当たり純資産額)	(12,853 円)
1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)	(1万口当たり純資産額)
	1.5578 円
	(15.578 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	
1861	熊谷組	2,101,000	62	130,262,000	
1865	青木あすなろ建設	822,500	510	419,475,000	
1868	三井ホーム	1,210,000	471	569,910,000	
1954	日本工営	430,000	284	122,120,000	
2120	ネクスト	3,137	98,900	310,249,300	
2135	V S N	290,100	690	200,169,000	
2151	タケエイ	35,000	1,351	47,285,000	
2292	S F O O D S	826,500	834	689,301,000	
2306	ビック東海	190,900	900	171,810,000	
2329	東北新社	1,135,700	485	550,814,500	
2344	平安レイサービス	643,700	402	258,767,400	
2371	カガクコム	1,545	350,000	540,750,000	
2400	メッセージ	5,110	186,400	952,504,000	
2412	ペネフィット・ワン	8,998	73,400	660,453,200	
2440	ぐるなび	2,605	189,200	492,866,000	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	3,033	69,900	212,006,700	
2674	ハードオフコーポレーション	405,300	447	181,169,100	
2678	アスクル	290,000	1,666	483,140,000	
2715	エレマテック	191,900	1,042	199,959,800	
2738	バルス	3,071	72,400	222,340,400	
2761	トシン・グループ	346,700	1,581	548,132,700	
2766	日本風力開発	1,547	268,000	414,596,000	
2769	ヴィレッジヴァンガードコーポレーション	1,409	354,000	498,786,000	
2778	バレモ	313,700	302	94,737,400	
3087	ドトール・日レスホールディングス	172,900	1,205	208,344,500	
3268	一建設	68,900	3,000	206,700,000	
3344	ワンダーコーポレーション	2,396	84,000	201,264,000	
3433	トーカロ	225,800	1,579	356,538,200	
3569	セーレン	91,200	640	58,368,000	
3593	ホギメディカル	106,100	4,530	480,633,000	
3636	三菱総合研究所	123,900	2,000	247,800,000	
3730	マクロミル	2,378	134,200	319,127,600	
3738	ティーガイア	4,797	163,600	784,789,200	
3817	S R Aホールディングス	498,700	817	407,437,900	
4206	アイカ工業	379,300	977	370,576,100	
4221	大倉工業	861,000	263	226,443,000	
4329	ワークスアプリケーションズ	9,700	51,200	496,640,000	
4401	A D E K A	408,200	864	352,684,800	
4681	リゾートトラスト	232,400	1,174	272,837,600	
4696	ウタペウエディング	315,000	997	314,055,000	
4775	総合メディカル	71,500	2,091	149,506,500	
4839	WOWOW	1,893	178,300	337,521,900	
5344	M A R U W A	238,400	2,029	483,713,600	
5384	フジミニコンコーポレートー	361,600	1,598	577,836,800	
5930	文化シャッター	1,060,000	337	357,220,000	
5999	イハラサイエンス	257,000	447	114,879,000	
6145	日特エンジニアリング	91,500	598	54,717,000	
6255	エヌ・ピー・シー	91,900	2,459	225,982,100	
6332	月島機械	285,000	577	164,445,000	

6413 理想科学工業	396,800	755	299,584,000
6482 ユーシン精機	452,100	1,384	625,706,400
6622 タイヘン	1,027,000	373	383,071,000
6651 日東工業	247,800	993	246,065,400
6669 シーシーエス	577	205,500	118,573,500
6670 M C J	20,525	8,850	181,646,250
6768 タムラ製作所	1,283,000	322	413,126,000
6788 日本トリム	205,800	1,862	383,199,600
6809 T O A	610,000	509	310,490,000
6817 スミダ コーポレーション	346,200	709	245,455,800
6908 イリソ電子工業	223,900	1,542	345,253,800
6914 オプテックス	320,400	904	289,641,600
6957 芝浦電子	215,600	930	200,508,000
6966 三井ハイテック	297,600	793	235,996,800
6996 ニチコン	398,300	1,003	399,494,900
7105 ニチユ	1,671,000	193	322,503,000
7236 ティラド	900,000	220	198,000,000
7427 エコトレーディング	286,100	992	283,811,200
7483 ドウシシャ	387,600	1,979	767,060,400
7514 ヒマラヤ	315,000	332	104,580,000
7581 サイゼリヤ	200,000	1,566	313,200,000
7631 マクニカ	207,200	1,353	280,341,600
7825 S R I スポーツ	1,998	85,900	171,628,200
7826 フルヤ金属	34,500	9,600	331,200,000
7856 萩原工業	128,800	845	108,836,000
7864 フジシールインターナショナル	235,000	1,909	448,615,000
7942 J S P	354,000	989	350,106,000
7943 ニチハ	501,800	611	306,599,800
7960 パラマウントベッド	105,000	1,909	200,445,000
7971 東リ	1,688,000	173	292,024,000
7994 岡村製作所	455,000	459	208,845,000
8057 内田洋行	600,000	243	145,800,000
8078 阪和興業	1,255,000	359	450,545,000
8127 ヤマトインターナショナル	739,200	332	245,414,400
8186 大塚家具	413,700	745	308,206,500
8397 沖縄銀行	90,500	3,640	329,420,000
8551 北日本銀行	118,200	2,633	311,220,600
8793 N E Cキヤピタルソリューション	218,500	1,252	273,562,000
8876 リロ・ホールディング	145,400	1,260	183,204,000
8924 リサ・パートナーズ	8,089	60,500	489,384,500
9039 サカイ引越センター	97,800	2,130	208,314,000
9055 アルプス物流	509,800	830	423,134,000
9603 エイチ・アイ・エス	178,700	1,806	322,732,000
9619 イチネンホールディングス	320,000	360	115,200,000
9699 西尾レントオール	441,700	579	255,744,300
9743 丹青社	907,000	181	164,167,000
9830 トラスコ中山	358,200	1,319	472,465,800
9948 アークス	328,100	1,278	419,311,800
合計	35,471,408		31,225,099,650

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
資産の部		金額	金額
流動資産			
コール・ローン		664,423,190	526,451,950
国債証券		41,658,647,000	28,919,322,000
地方債証券		6,460,386,900	5,628,958,500
特殊債券		6,977,272,450	4,918,167,000
社債券		19,333,558,612	14,391,233,242
未収入金		-	7,065,932,000
未収利息		225,175,560	150,467,738
前払費用		53,236,696	14,224,106
流動資産合計		75,372,700,408	61,614,756,536
資産合計		75,372,700,408	61,614,756,536
負債の部			
流動負債			
未払金		-	7,073,123,000
未払解約金		1,094,940	33,611
流動負債合計		1,094,940	7,073,156,611
負債合計		1,094,940	7,073,156,611
純資産の部			
元本等			
元本		68,694,080,306	48,710,562,601
剰余金			
剰余金又は欠損金()		6,677,525,162	5,831,037,324
元本等合計		75,371,605,468	54,541,599,925
純資産合計		75,371,605,468	54,541,599,925
負債純資産合計		75,372,700,408	61,614,756,536

(貸借対照表に関する注記)

平成22年1月12日現在

1.	平成21年1月13日現在の元本の内訳	平成22年1月12日現在の元本の内訳	
期首元本額	85,731,293.726	68,694,080.306	
期首からの追加設定元本額	23,726,043.082	8,583,278.574	
期首からの解約元本額	40,763,256.502	28,566,796.279	
円		円	
平成21年1月13日現在の元本の内訳		平成22年1月12日現在の元本の内訳	
GW7つの卵	48,882,566.285	GW7つの卵	32,764,797.667
ス安定型	5,109,607	ス安定型	4,860,718
ス安定成長型	3,694,509,700	ス安定成長型	3,350,195.913
ス成長型	4,174,885,146	ス成長型	3,646,046.839
ス精極成長型	9,073,441,032	ス精極成長型	7,072,627,295
ス精極型	554,842,430	ス精極型	736,274
GW7つの卵（適格機関投資家向け）	574,279,905	GW7つの卵（適格機関投資家向け）	211,309,935
日本債券ファンド	245,709,683	日本債券ファンド	169,693,635
年金積立グローバル・ラップ・バランス（安定型）	276,252,228	年金積立グローバル・ラップ・バランス（安定型）	287,857,010
年金積立グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	421,916,125	年金積立グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	441,329,664
年金積立グローバル・ラップ・バランス（成長型）	378,929,790	年金積立グローバル・ラップ・バランス（成長型）	397,845,447
年金積立グローバル・ラップ・バランス（精極成長型）	367,276,094	年金積立グローバル・ラップ・バランス（精極成長型）	363,259,571
年金積立グローバル・ラップ・バランス（精極型）	44,362,281	年金積立グローバル・ラップ・バランス（精極型）	2,633
（合計）	68,694,080.306	（合計）	48,710,562,601
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	68,694,080.306	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	48,710,562,601
2.			

元本額

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 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	41,658,647,000	792,720,000	
地方債証券	6,460,396,900	20,944,920	
特殊債券	6,977,272,450	31,542,100	
社債券	19,333,558,612	554,283,378	
合計	74,429,864,962	290,923,642	

対象期間 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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	28,919,322,000	125,777,000	
地方債証券	5,628,958,500	102,682,600	
特殊債券	4,918,167,000	34,473,000	
社債券	14,391,233,242	580,027,242	
合計	53,857,680,742	591,405,842	

(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 21 年 1 月 13 日現在			平成 22 年 1 月 12 日現在		
1 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)			(1 万口当たり純資産額)		
1.0972 円			1.1197 円		
(10,972 円)			(11,197 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)

(単位 : 円)						
種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考		
国債証券	0067 0284 利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 8 4 回	4,600,000,000	4,855,806,000			
	0067 0285 利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 8 5 回	6,700,000,000	7,063,609,000			
	0067 0293 利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 9 3 回	4,000,000,000	4,215,920,000			
	0067 0295 利付国庫債券 (1 0 年) 第 2 9 5 回	2,000,000,000	2,060,100,000			
	0067 0300 利付国庫債券 (1 0 年) 第 3 0 0 回	1,500,000,000	1,532,745,000			
	0069 0092 利付国庫債券 (2 0 年) 第 9 2 回	7,400,000,000	7,503,008,000			
	0069 0114 利付国庫債券 (2 0 年) 第 1 1 4 回	1,700,000,000	1,688,134,000			
	計	27,900,000,000	28,919,322,000			
	国債証券 計					
	地方債証券					
	0100 0617 東京都公募公債 6 1 7 回	100,000,000	103,734,000			
	0100 0618 東京都公募公債 6 1 8 回	100,000,000	103,981,000			
	0100 0620 東京都公募公債 6 2 0 回	1,500,000,000	1,551,780,000			
地方債証券	0100 0646 東京都公募公債 6 4 6 回	600,000,000	639,312,000			
	0103 0129 神奈川県公募公債 1 2 9 回	250,000,000	261,352,500			
	0104 0261 大阪府公募公債 2 6 1 回	500,000,000	517,415,000			
	0106 1403 兵庫県公募公債 平成 1 4 年度 3 回	500,000,000	511,485,000			
	0106 1604 兵庫県公募公債 平成 1 6 年度 4 回	590,000,000	613,505,600			
	0155 9001 札幌市公募公債 1 回	100,000,000	101,068,000			
	0200 0761 東京都公債 第 7 6 1 回	200,000,000	208,268,000			
	0211 1405 埼玉県平成 1 4 年度公債ホ号	144,000,000	145,661,760			
	0211 1407 埼玉県平成 1 4 年度公債ト号	162,000,000	162,724,140			
	0211 1502 埼玉県平成 1 5 年度公債ロ号	350,000,000	361,343,500			
	0214 1501 神奈川県公債平成第 1 5 回イ号	200,000,000	206,698,000			
	0254 1408 横浜市平成 1 4 年度第 8 回事業公債	140,000,000	140,630,000			
	計	5,436,000,000	5,628,958,500			
	地方債証券 計					
特殊債券	0905 7004 日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機構債) 第 4 回	600,000,000	609,672,000			
	0905 7007 日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機構債) 第 7 回	100,000,000	106,260,000			
	0905 9021 道路債券 (財投機構債) 第 2 1 回	600,000,000	632,040,000			
	0906 9022 公営企業債券 (財投機構債) 第 2 2 回	800,000,000	854,256,000			
	0936 1021 特別関西国際空港債券 特別第 2 1 回	600,000,000	605,940,000			
	0936 9003 関西国際空港社債 (財投機構債) 第 3 回	800,000,000	844,544,000			
	1293 0105 福岡北九州高速道路債券 第 1 0 5 回	200,000,000	207,550,000			
	1293 0107 福岡北九州高速道路債券 第 1 0 7 回	500,000,000	523,755,000			
	1293 0109 福岡北九州高速道路債券 第 1 0 9 回	500,000,000	534,150,000			
	計	4,700,000,000	4,918,167,000			
社債券	1108 1015 メリリンチ・アンド・カンパニー・インク 第 1 回円貨社債 (2 0 0 7) (劣後特約付)	200,000,000	172,762,000			
	1218 1009 エイチエスピー・ファイナンス・コーポレーション 第 9 回円貨社債 (2 0 0 5)	800,000,000	790,928,160			

第2

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

1218 1013	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第13回円貨社債(2007)	400,000,000	396,692,000
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	500,915,000
2768 0701	双日(社債間限定同順位特約付) 7回	200,000,000	199,767,070
2768 0901	双日(社債間限定同順位特約付) 9回	100,000,000	99,853,920
4523 0501	エーザイ(社債間限定同順位特約付) 5回	300,000,000	304,158,000
7532 0201	トン・キホーテ(社債間限定同順位特約付) 2回	500,000,000	500,470,000
8331 0202	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
8339 0102	東京都民銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 1回	400,000,000	398,312,000
8339 0202	東京都民銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 2回	200,000,000	198,644,000
8345 0202	岩手銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 2回	200,000,000	201,846,000
8356 0102	十六銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 1回	200,000,000	196,638,000
8379 0304	広島銀行(劣後特約付) 3回	200,000,000	201,868,796
8400 0102	埼玉りそな銀行期限前償還条項付(劣後特約付) 1回	300,000,000	304,458,000
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	503,885,000
8572 4301	アコム(特定社債間限定同順位特約付) 43回	300,000,000	296,823,440
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	986,650,473
8583 0101	三菱UFJニコス(社債間限定同順位特約付) 1回	400,000,000	399,200,000
8591 0111	オリックス(社債間限定同順位特約付) 111回	300,000,000	293,103,000
8593 0405	三菱UFJリース(社債間限定同順位特約付) 4回	300,000,000	303,702,000
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	403,316,000
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	398,248,000
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	704,130,000
8840 0301	大京(社債間限定同順位特約付) 3回	300,000,000	270,223,590
8958 0101	クローバル・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	600,000,000	590,306,793
9006 2801	京浜急行電鉄(社債間限定同順位特約付) 28回	100,000,000	103,770,000
9501 0510	東京電力 510回	100,000,000	103,540,000
9501 0511	東京電力 511回	300,000,000	313,206,000
9501 0532	東京電力 532回	300,000,000	313,323,000
9502 0484	中部電力 484回	700,000,000	724,262,000
9503 0438	関西電力 438回	200,000,000	209,132,000
9503 0451	関西電力 451回	700,000,000	739,676,000
9509 0293	北海道電力 293回	900,000,000	945,261,000
9984 2501	ソフトバンク(社債間限定同順位特約付) 25回	900,000,000	918,018,000
社債券 計		14,300,000,000	14,391,233,242
	合計	52,336,000,000	53,857,680,742

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)	
		平成21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
資産の部		金 額	金 額
流動資産			
預金			
コール・ローン	904,341,195		1,314,809,094
株式	100,311,375		90,716,946
派生商品評価勘定	52,026,819,309		67,887,078,733
未収入金	161,634		8,889,228
未収配当金	-		459,927,704
流動資産合計	36,849,329		41,185,702
資産合計	53,068,482,842		69,812,607,407
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定	703		553,942
未払金	4,094,349		-
未払解約金	11,901,813		945,771,745
流動負債合計	15,996,865		946,325,687
負債合計	15,996,865		946,325,687
純資産の部			
元本等			
元本	90,654,052,482		78,797,517,901
剰余金			
剰余金又は欠損金 ()	37,601,566,505		9,931,236,181
元本等合計	53,052,485,977		68,866,281,720
純資産合計	53,052,485,977		68,866,281,720
負債純資産合計	53,068,482,842		69,812,607,407

(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20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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、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評価してあります。 (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価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）又は気配提供会社の提示する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が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理由をもつて時価と認めた価額で評価してあります。	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等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 時価が入手できなかった有価証券	
2. 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. その他財務諸表作成のための基となる重要な事項	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲間で評価しております。 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。	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲間で評価しております。 外貨建取引等の処理基準	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲間で評価しております。 外貨建取引等の処理基準

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

区分	種類	平成21年1月13日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	為替予約取引			
	売建	12,007,804	11,866,107	141,697
	アメリカドル	12,007,804	11,866,107	141,697
	買建	3,000,000	3,019,234	19,234
	アメリカドル	3,000,000	3,019,234	19,234
取引	合計	15,007,804	14,885,341	160,931

(単位:円)

(単位:円)

区分	種類	平成22年1月12日現在		評価損益
		契約額等	時価	
市場取引	為替予約取引			
	売建	1,057,541,498	1,049,154,688	8,386,810
	アメリカドル	1,052,802,184	1,044,468,920	8,333,264
	カナダドル	4,739,314	4,685,768	53,546
	買建	4,739,314	4,687,790	51,524
取引	アメリカドル	4,739,314	4,687,790	51,524
引	合計	1,062,280,812	1,053,842,478	8,335,286

(注)時価の算定方法

- 計算期間末日に對顧客先物相場の時価が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
・計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
・計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
・計算期間末日に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21年1月13日現在		平成22年1月12日現在	
1口当たり純資産額	0.5852円	1口当たり純資産額	0.8740円
(1万口当たり純資産額)	(5,852円)	(1万口当たり純資産額)	(8,740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	
00105510	AFLAC INC	265,966	50.71000	13,487,135.86	
00130H10	AES CORPORATION	621,881	13.87000	8,625,489.47	
0025690	AWDOS LIMITED	270,448	28.82000	7,794,311.36	
00282410	ABBOTT LABORATORIES	297,712	55.33000	16,472,404.96	
03209510	AMPHENOL CORPORATION-CL A	262,158	45.29000	11,873,135.82	
03783310	APPLE INC	62,717	210.11000	13,177,468.87	
04951310	ATMEL CORP	1,040,757	5.05000	5,255,822.85	
06605F10	BANK OF AMERICA CORP	1,328,407	16.93000	22,489,930.51	
07181310	BAXTER INTERNATIONAL INC	254,542	58.83000	14,974,705.86	
08651610	BEST BUY CO INC	88,487	39.23000	3,471,345.01	
12541W20	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	78,341	57.72000	4,521,842.52	
15102010	CELGENE CORPORATION	137,660	57.27000	7,883,788.20	
16161A10	JPMORGAN CHASE & CO	505,624	44.53000	22,515,436.72	
16776010	CME GROUP INC	34,287	349.25000	11,974,734.75	
17275R10	CISCO SYSTEMS INC	310,714	24.59000	7,640,457.26	
19416210	COLGATE-PALMOLIVE CO	182,360	81.15000	14,798,514.00	
21935010	CORNING INC	322,693	20.49000	6,611,979.57	
22822710	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	510,026	38.97000	19,875,713.22	
22825510	CROWN HOLDINGS INC	422,551	25.97000	10,973,649.47	
23585110	DANAHER CORP	63,534	77.75000	4,939,768.50	
25179M10	DEVON ENERGY CORPORATION	261,143	75.08000	19,606,616.44	
27864210	EBAY INC	188,708	23.45000	4,425,202.60	
29356210	EOG RESOURCES INC	195,488	98.14000	19,183,229.52	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	224,198	70.30000	15,761,119.40	
30700010	FAMILY DOLLAR STORES	121,215	30.55000	3,703,118.25	
31190010	FASTENAL COMPANY	160,059	46.06000	7,372,317.54	
36476010	GAP INC	207,995	20.62000	4,288,856.90	
37033410	GENERAL MILLS INC	231,528	70.79000	16,389,867.12	
37291710	GENZYME CORP - GENL DIVISION	202,876	53.70000	10,894,441.20	
37555810	GILEAD SCIENCES INC	275,379	44.89000	12,361,763.31	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	93,775	171.56000	16,088,039.00	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	8,705	601.11000	5,232,662.55	
42345210	HELMERICH & PAYNE INC	154,314	46.46000	7,169,428.44	
43707610	HOME DEPOT INC	160,614	28.16000	4,522,890.24	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	460,695	49.95000	23,011,715.25	
48248010	KLA-TENCOR CORPORATION	360,614	36.96000	13,328,293.44	
49436810	KIMBERLY-CLARK CORP	263,252	62.63000	16,487,472.76	
49455U10	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	99,957	56.60000	5,657,566.20	
51281510	LANAR ADVERTISING COMPANY-CL A	354,258	33.06000	11,711,769.48	
55354G10	MSCI INC-A SHS	165,645	34.21000	5,666,715.45	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	170,542	62.32000	10,628,177.44	
58933110	MERCK & CO. INC.	183,096	37.85000	6,930,183.60	
61744644	MORGAN STANLEY	356,732	32.04000	11,429,693.28	
62855J10	MYRIAD GENETICS INC	124,931	25.57000	3,194,485.67	
62937750	NRG ENERGY INC	588,081	24.73000	14,543,243.13	
62944T10	NVR INC	13,558	709.90000	9,624,824.20	
65163910	NEWMONT MINING CORP	73,939	50.18000	3,710,259.02	
65248780	NEWS CORP-CL A	1,443,442	14.08000	20,323,663.36	
65410610	NIKE INC -CL B	136,818	64.91000	8,880,856.38	

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21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
現金		1,025,254,127	669,528,636
株式		42,039,795,175	60,577,205,265
コール・ローン		23,574,621	20,787,306
派生商品評価勘定		43,156,035	825,290
未収入金		1,013,563,334	1,412,416,496
未収配当金		46,938,076	91,561,824
流動資産合計		44,192,281,968	62,772,324,817
資産合計		44,192,281,968	62,772,324,817
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		42,974,107	3,836,274
未払金		380,570,363	535,957,847
未払解約金		3,720,533	775,045,348
流動負債合計		427,265,003	1,314,839,469
負債合計		427,265,003	1,314,839,469
純資産の部			
元本等			
元本		43,668,964,957	40,984,197,084
剰余金			
剰余金又は欠損金 ()		96,052,008	20,473,288,264
元本等合計		43,765,016,965	61,457,485,348
純資産合計		43,765,016,965	61,457,485,348
負債純資産合計		44,192,281,968	62,772,324,817

66680710	NORTHROP GRUMMAN CORP	286,066	57,50000	16,448,795.00	
67459910	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	249,985	82,96000	20,738,755.60	
68389X10	ORACLE CORP	231,574	24,69000	5,717,562.06	
69076840	OWENS-ILLINOIS INC	170,494	32,64000	5,564,924.16	
71815410	ALTRIA GROUP INC	788,905	20,26000	15,983,215.30	
74752510	QUALCOMM INC	502,136	49,29000	24,750,283.44	
87150310	SYMANTEC CORP	553,191	18,36000	10,156,586.76	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	211,815	62,82000	13,306,218.30	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	175,521	72,16000	12,665,595.36	
98433210	YAHOO! INC	214,859	16,74000	3,596,739.66	
G0070K10	ACE LTD	393,359	48,01000	18,885,165.59	
G2552X10	COVIDIEN PLC	370,346	49,06000	18,169,174.76	
G5876H10	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	770,690	21,21000	16,346,334.90	
アメリカドル 計		19,261,343		723,815,456.84	
(邦貨換算額)				(66,808,166,666)	

(単位：株、カナダドル)				
銘柄	株 数	評価額		備 考
		単価	金額	
CNO	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	163,775	74,48000	12,197,962.00
カナダドル 計	163,775		12,197,962.00	
(邦貨換算額)			(1,088,912,067)	

(単位：円)		
総合計		(67,897,078,733)
(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。		67,897,078,733

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	株式 62銘柄	100.0	98.4
カナダドル	株式 1銘柄	100.0	1.6

第 2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

(2) 注記表

(重要な会計方針にに係る事項に関する注記)

項 目	対象期間	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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) 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価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。 為替予約取引	株式及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (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）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 金融商品取引所等に入手できなかった有価証券の時価が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。 為替予約取引等の処理基準 外貨建取引等の処理基準	株式及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (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）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 金融商品取引所等に入手できなかった有価証券の時価が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。 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		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	同左
3. その他財務諸表作成のための基となる重要な事項		「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

(貸借対照表に関する注記)

	平成21年1月13日現在	平成22年1月12日現在
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額 平成21年1月13日現在の元本の内訳 GW 7 つの卵 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 グローバル・ラップ・バラン ス 超積極型 GW 7 つの卵（適格機関投資 家向け） 欧州先進国株式ファンド 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（安定型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（安定成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（積極成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（積極型） 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	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額 平成22年1月12日現在の元本の内訳 GW 7 つの卵 グローバル・ラップ・バラン ス 安定型 グローバル・ラップ・バラン ス 安定成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極成長型 グローバル・ラップ・バラン ス 積極型 グローバル・ラップ・バラン ス 超積極型 GW 7 つの卵（適格機関投資 家向け） 欧州先進国株式ファンド 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（安定型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（安定成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（積極成長型） 年金積立 グローバル・ラッ プ・バランス（積極型） 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
	42,626,181,983 円 7,836,081,780 円 6,793,298,806 円 30,283,900,581 円 459,179 円 520,646,504 円 944,768,396 円 5,693,712,088 円 2,314,273,082 円 2,735,946,900 円 332,129,173 円 223,788,468 円 24,630,251 円 61,082,615 円 91,817,989 円 254,063,382 円 187,746,349 円 43,668,964,957 円	43,668,964,957 円 9,236,705,174 円 11,921,473,047 円 27,344,718,131 円 475,998 円 502,335,588 円 983,333,959 円 5,914,319,901 円 2,456,233,868 円 2,695,231,106 円 173,951,371 円 179,808,686 円 27,486,997 円 66,962,273 円 108,683,324 円 301,554,022 円 229,101,860 円 40,984,197,084 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	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

総数

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21年1月14日現在
43,668,964,957 円
9,236,705,174 円
11,921,473,047 円

総数

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21年1月14日現在
43,668,964,957 円
9,236,705,174 円
11,921,473,047 円

(有価証券に関する注記)

対象期間 (自 平成 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 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	42,039,795,175	1,896,789,469
合計	42,039,795,175	1,896,789,469

対象期間 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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	60,577,205,265	13,638,326,620
合計	60,577,205,265	13,638,326,620

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

取引の内容	自 平成 21 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 日		自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 日
	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。		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

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 21 年 1 月 13 日現在		評価損益
		契 約 額 等	時 価	
市 場 取 引	為替予約取引	-	-	-
	売建	1,094,686,377	1,051,530,342	43,156,035
	イギリスポンド	25,616,554	24,388,022	1,228,532
	スイスフラン	922,546,828	887,213,362	35,333,466
	ユーロ	146,522,995	139,928,958	6,594,037
	売建	1,094,686,377	1,051,712,270	42,974,107
	の スイスフラン	146,104,488	140,197,789	5,906,699
取 引	デンマーククローネ	418,507	399,632	18,875
	ユーロ	948,163,382	911,114,849	37,048,533
合計		2,189,372,754	2,103,242,612	181,928

区 分	種 類	平成 22 年 1 月 12 日現在		評価損益
		契 約 額 等	時 価	
市 場 取 引	為替予約取引	-	-	-
	売建	1,328,326,285	1,330,769,279	2,442,994
	アメリカドル	7,076,589	6,994,735	81,854
	イギリスポンド	292,840,495	292,132,676	707,819
	ルウェークローネ	7,976,193	8,010,321	34,128
	チェココルナ	220,251,551	221,549,694	1,298,143
	ユーロ	800,181,457	802,081,853	1,900,396
	売建	554,071,240	553,503,250	567,990
	の スイスフラン	25,926,412	25,961,467	35,055
	ユーロ	528,144,828	527,541,783	603,045
合計		1,882,397,525	1,884,272,529	3,010,984

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

平成 21 年 1 月 13 日現在		平成 22 年 1 月 12 日現在	
1 口当たり純資産額	1,002 円	1 口当たり純資産額	1,499 円
(1 万口当たり純資産額)	(10,022 円)	(1 万口当たり純資産額)	(14,995 円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式 (アメリカカドル)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
62940M10 VIRGIN MEDIA INC	276,200	17,14000	4,734,068.00	
アメリカドル 計	276,200		4,734,068.00	
(邦貨換算額)			(436,954,476)	

(単位：株、アメリカカドル)

外国株式 (イギリスポンド)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
ADN ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	1,980,100	1,34100	2,655,314.10	
BG BG GROUP PLC	323,190	12,23000	3,952,613.70	
BNZL BUNZL PLC	524,970	6,74000	3,538,297.80	
BRBY BURBERRY GROUP PLC	353,120	6,00500	2,120,485.60	
CNE CAIRN ENERGY PLC	238,591	3,70300	883,502.47	
CRDA CRODA INTERNATIONAL	379,893	8,35500	3,174,006.01	
FAY SPECTRIS PLC	320,470	7,71000	2,470,823.70	
HSBA HSBC HOLDINGS PLC	2,327,810	7,30000	16,993,013.00	
HSX HISCOX LTD	1,145,557	3,29000	3,768,882.53	
IHG INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	360,197	9,26500	3,337,225.20	
PEC PETROFAC LTD	83,940	9,95000	835,203.00	
RB/ RECKITT BENCKISER GROUP PLC	236,530	32,44000	7,673,033.20	
RDSA ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	823,480	19,27000	15,868,459.60	
REED REED ELSEVIER PLC	1,548,980	5,04000	7,806,859.20	
SWJ SMITH & NEPHEW PLC	442,353	6,41500	2,837,694.49	
TLW TULLOW OIL PLC	267,513	13,30000	3,557,922.90	
TOMK TOMKINS PLC	2,565,300	2,10400	5,397,391.20	
VOD VODAFONE GROUP PLC	14,763,874	1,37850	20,352,000.30	
WPP WPP PLC	1,386,950	6,16000	8,543,612.00	
イギリスポンド 計	30,072,818		115,766,340.00	
(邦貨換算額)			(17,201,720,461)	

(単位：株、イギリスポンド)

外国株式 (スイスフラン)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
ATLN ACTELION LTD	62,016	56,75000	3,519,408.00	
BAERGRP JULIUS BAER GROUP LTD	152,537	36,60000	5,582,854.20	
CS CREDIT SUISSE GROUP AG	106,500	54,90000	5,846,850.00	
GBN GEBERIT AG-REG	35,382	185,80000	6,573,975.60	
NESZ NESTLE SA	737,149	48,83000	35,994,985.67	
RIFZ COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	277,770	36,79000	10,219,158.30	
ROZZ ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	164,585	178,70000	29,411,339.50	
RUKZ SWISS RE INSURANCE COMPANY LTD	106,740	52,05000	5,555,817.00	
SYST SYNTHES INC	89,230	136,70000	12,197,741.00	
UBSZ UBS AG-REGISTERED	581,896	17,04000	9,915,507.84	
ZURN ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	26,670	230,20000	6,139,434.00	
スイスフラン 計	2,340,475		130,957,071.11	
(邦貨換算額)			(11,879,115,920)	

(単位：株、スイスフラン)

外国株式 (ノルウェークローネ)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
STB STOREBRAND ASA	676,040	42,30000	28,596,492.00	
ノルウェークローネ 計	676,040		28,596,492.00	
(邦貨換算額)			(470,126,328)	

(単位：株、ノルウェークローネ)

外国株式 (チェココルナ)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
CEZ CEZ	59,610	919,10000	54,787,551.00	
KOMB KOMERCNI BANKA AS	8,779	3,942,00000	34,606,818.00	
チェココルナ 計	68,389		89,394,369.00	
(邦貨換算額)			(457,699,169)	

(単位：株、チェココルナ)

外国株式 (ユーロ)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
AKZO AKZO NOBEL NV	267,020	44,36000	11,845,007.20	
BAYE BAYER AG	153,706	53,81000	8,270,919.86	
BEI BEIERSDORF AG	69,630	45,21000	3,147,972.30	
BI INTESA SANPAOLO SPA	1,774,421	3,16500	5,616,042.46	
BNP BNP PARIBAS SA	276,969	58,76000	16,274,698.44	
BOC BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	454,550	5,32000	2,418,206.00	
BPU UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	402,092	10,39000	4,177,735.88	
BSN DAHOME	267,631	42,58000	11,395,727.98	
DB1 DEUTSCHE BOERSE AG	95,950	56,26000	5,398,147.00	
ERCK MERCK KGAA	102,660	65,61000	6,735,522.60	
ESS1 ESSLOR INTERNATIONAL SA	87,350	41,29000	3,606,681.50	
GALP GALP ENERGIA SGPS SA	112,190	12,75000	1,430,422.50	
GAZ GDF SUEZ	371,165	30,37500	11,274,136.87	
HEIN HEINEKEN NV	188,420	34,00000	6,406,280.00	
HNSY LVNH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	89,400	81,70000	7,303,980.00	
ING ING GROEP NV-CVA	1,465,652	7,57700	11,105,245.20	
ITX INDITEX	101,800	43,94500	4,473,601.00	
KBC KBC GROUP	149,126	35,53000	5,298,446.78	
KPN KONINKLIJKE KPN NV	787,160	11,96500	9,418,369.40	
LIN LINDE AG	153,080	83,58000	12,794,426.40	
MOH MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFINERIES SA	135,970	11,40000	1,550,058.00	
NOKS NOKIA OYJ	762,860	9,11000	6,949,654.60	
SCHN SCHNEIDER ELECTRIC SA	95,970	80,70000	7,744,779.00	
SOPF SANOFI-AVENTIS SA	266,140	56,08000	14,925,131.20	
SPM SAIPEM	30,090	24,79000	745,931.10	
SR SNS REAAL	583,460	4,84300	2,825,696.78	
SY1 SYMRISE AG	558,255	16,00000	8,932,080.00	
TOL TOTAL SA	324,348	46,26000	15,004,338.48	
TP TNT NV	238,031	22,04500	5,247,393.39	
VEB E.ON AG	441,057	29,36000	12,949,433.52	
ユーロ 計	10,806,153		225,266,065.44	
(邦貨換算額)			(30,131,588,911)	

(単位：株、ユーロ)

総合計				(単位：円)
(60,577,205,265)				
60,577,205,265				

(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
該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率（％）	合計額に対する比率（％）
アメリカドル	株式 1銘柄	100.0	0.7
イギリスポンド	株式 19銘柄	100.0	28.4
スイスフラン	株式 11銘柄	100.0	19.6
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	100.0	0.8
チェココルナ	株式 2銘柄	100.0	0.8
ユーロ	株式 30銘柄	100.0	49.7

- 第 2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

- 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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21年1月13日現在		平成22年1月12日現在	
		金 額		金 額	
資産の部					
流動資産					
預金		99,423,161		-	
コール・ローン		196,392,060		461,713,458	
株式		9,364,040,899		19,078,621,827	
投資証券		232,720,296		405,969,270	
未収入金		-		115,926,536	
未収配当金		7,957,384		13,341,899	
流動資産合計		9,900,533,800		20,075,572,990	
資産合計		9,900,533,800		20,075,572,990	
負債の部					
流動負債					
未払金		-		42,350,037	
未払解約金		921,865		312,866,554	
流動負債合計		921,865		355,216,591	
負債合計		921,865		355,216,591	
純資産の部					
元本等					
元本		5,834,660,539		6,094,734,674	
剰余金					
剰余金又は欠損金（ ）		4,064,951,396		13,625,621,725	
元本等合計		9,899,611,935		19,720,356,399	
純資産合計		9,899,611,935		19,720,356,399	
負債純資産合計		9,900,533,800		20,075,572,990	

(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20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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) 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）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	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 外貨建取引等の処理基準	同左	同左
3. その他財務諸表作成のための基となる重要な事項	「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21年1月13日現在			平成22年1月12日現在		
1. 期首	期首	1. 期首	期首	期首	平成21年1月14日現在
期首元本額	12,130,397,460 円	期首元本額	5,834,660,539 円	期首元本額	5,834,660,539 円
期首からの追加設定元本額	2,076,871,020 円	期首からの追加設定元本額	2,912,778,502 円	期首からの追加設定元本額	2,912,778,502 円
期首からの解約元本額	8,372,607,941 円	期首からの解約元本額	2,652,704,367 円	期首からの解約元本額	2,652,704,367 円
平成21年1月13日現在の元本の内訳		平成22年1月12日現在の元本の内訳		平成22年1月12日現在の元本の内訳	
GW7つの卵	3,887,797,491 円	GW7つの卵	4,038,793,350 円	GW7つの卵	4,038,793,350 円
ス安定型	54,297 円	ス安定型	64,290 円	ス安定型	64,290 円
グローバル・ラップ・バラン	43,181,014 円	グローバル・ラップ・バラン	52,474,276 円	グローバル・ラップ・バラン	52,474,276 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	116,037,463 円	グローバル・ラップ・バラン	115,927,420 円	グローバル・ラップ・バラン	115,927,420 円
ス成長型		ス成長型		ス成長型	
グローバル・ラップ・バラン	701,743,914 円	グローバル・ラップ・バラン	872,277,094 円	グローバル・ラップ・バラン	872,277,094 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	314,136,459 円	グローバル・ラップ・バラン	346,205,894 円	グローバル・ラップ・バラン	346,205,894 円
ス積極型		ス積極型		ス積極型	
グローバル・ラップ・バラン	532,292,162 円	グローバル・ラップ・バラン	448,316,727 円	グローバル・ラップ・バラン	448,316,727 円
ス超積極型		ス超積極型		ス超積極型	
GW7つの卵（適格機関投資家向け）	42,525,012 円	GW7つの卵（適格機関投資家向け）	25,426,074 円	GW7つの卵（適格機関投資家向け）	25,426,074 円
アジア太平洋先進国株式ファンド	114,154,781 円	アジア太平洋先進国株式ファンド	94,530,815 円	アジア太平洋先進国株式ファンド	94,530,815 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	2,920,634 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	3,676,445 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	3,676,445 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	5,252,900 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	6,988,104 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	6,988,104 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	12,067,542 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	12,890,146 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	12,890,146 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	34,898,868 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	44,616,627 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	44,616,627 円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	27,598,002 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	32,547,412 円	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	32,547,412 円
(合計)	5,834,660,539 円	(合計)	6,094,734,674 円	(合計)	6,094,734,674 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報投資信託の受益権の総数	5,834,660,539 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報投資信託の受益権の総数	6,094,734,674 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報投資信託の受益権の総数	6,094,734,674 口

当該報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20年1月11日 至 平成21年1月13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	9,364,040,899	4,091,164,780
投資証券	232,720,296	117,151,815
合計	9,596,761,195	4,208,316,595

(単位：円)

対象期間（自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 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	19,078,621,827	5,142,952,797	
投資証券	405,969,270	58,821,464	
合計	19,484,591,097	5,201,774,261	

（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）

取引の状況に関する事項

	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	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

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21年1月13日現在		平成22年1月12日現在	
1口当たり純資産額	1,6967 円	1口当たり純資産額	3,2356 円
（1万口当たり純資産額）	（16,967 円）	（1万口当たり純資産額）	（32,356 円）

（３）附属細表

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	
HKLD HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	713,000	4.86000	3,465,180.00	
JMH JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	114,800	30.10000	3,455,480.00	
JS JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	251,000	17.56000	4,407,560.00	
アメリカドル 計	1,078,800		11,328,220.00	
（邦貨換算額）			（1,045,594,706）	

外国株式（オーストラリアドル）

（単位：株、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	428,758	22.39000	9,599,891.62	
BHP BHP BILLITON LTD	624,843	44.47000	27,786,768.21	
BXBAU BRAVILLES LTD	825,680	7.18000	5,928,382.40	
CBA COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	214,390	56.57000	12,128,042.30	
COL COCA-COLA AMATIL LIMITED	341,454	11.17000	3,814,041.18	
COH COCHLEAR LIMITED	18,093	66.23000	1,198,239.39	
CPU COMPUTERSHARE LIMITED	236,570	11.70000	2,767,869.00	
CSL CSL LIMITED	137,815	31.93000	4,400,432.95	
CWN CROWN LTD	236,983	7.81000	1,850,837.23	
GNS GUINNS LTD	1,706,539	1.00000	1,706,539.00	
IPL INCITEC PIVOT LTD	642,941	3.78000	2,430,316.98	
JHX JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	375,271	8.55000	3,208,567.05	
LLC LEND LEASE CORP LIMITED	67,570	10.28000	694,619.60	
NAB NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	323,911	27.25000	8,826,574.75	
NRM INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	916,754	4.11000	3,767,858.94	
ORI ORICA LTD	220,201	26.25000	5,780,276.25	
QBE QBE INSURANCE GROUP LIMITED	287,138	24.98000	7,172,707.24	
RIO RIO TINTO LIMITED	67,640	80.00000	5,411,200.00	
RMD RESMED INC-COI	743,982	5.61000	4,173,739.02	
SUN SUNCORP-METWAY LIMITED	393,226	8.86000	3,483,982.36	
TLS TELSTRA CORP LTD	1,162,355	3.35000	3,893,889.25	
WBC WESTPAC BANKING CORPORATION	342,750	25.18000	8,630,445.00	
WES WESFARMERS LIMITED	85,722	31.55000	2,704,529.10	
WOW WOOLWORTHS LIMITED	364,950	28.00000	10,218,600.00	
WPL WOODSIDE PETROLEUM LTD	88,080	49.28000	4,340,582.40	
オーストラリアドル 計	10,853,616		145,918,991.22	
（邦貨換算額）			（12,500,879,978）	

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	
1398HK INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA	1,691,000	6.29000	10,636,390.00	
CNOOC CNOOC LTD	629,000	13.24000	8,327,960.00	
DASB DAH SING BANKING GROUP LIMITED	1,060,800	11.30000	11,987,040.00	
EPA ESPRIT HOLDINGS LTD	230,400	57.25000	13,190,400.00	
EPA-1 ESPRIT HOLDINGS LTD(新)	6,430	57.25000	368,117.50	
FRPA FIRST PACIFIC CO	3,004,800	4.76000	14,302,848.00	

HL	HANG LUNG GROUP LIMITED	435,000	39,60000	17,226,000.00	
HSCH	HANG SENG BANK LTD	257,900	114,50000	29,529,550.00	
HTW	HUTCHISON WHARF LTD	465,000	56,80000	26,412,000.00	
KERP	KERRY PROPERTIES LTD	317,500	40,80000	12,954,000.00	
PING	PING AN INSURANCE GROUP COMPANY-H	203,500	71,15000	14,479,025.00	
SHGH	SHANGRI-LA ASIA LTD.	1,012,000	14,76000	14,937,120.00	
SHK	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	247,000	117,70000	29,071,900.00	
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	393,500	99,20000	39,035,200.00	
SWPB	SWIRE PACIFIC LTD B	787,500	17,92000	14,112,000.00	
WHB	WING HANG BANK LIMITED	115,000	74,00000	8,510,000.00	
香港ドル 計		10,856,330		265,079,550.50	
(邦貨換算額)				(3,154,446,651)	

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	381,000	4,30000	1,638,300.00
CYCM	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	127,000	26,50000	3,365,500.00
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	336,000	11,78000	3,958,080.00
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	410,538	15,34000	6,297,652.92
KPL	KEPPEL CORP LTD	138,000	8,71000	1,201,980.00
SCIL	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	708,000	3,73000	2,640,840.00
STH	STARHUB LTD	202,000	2,13000	430,260.00
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	1,159,020	3,02000	3,500,240.40
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	417,192	19,88000	8,293,776.96
UTOS	UOL GROUP LIMITED	412,000	4,17000	1,718,040.00
WIL	WILMAR INTERNATIONAL LTD	388,000	7,11000	2,758,680.00
シンガポールドル 計		4,678,750		35,803,350.28
(邦貨換算額)				(2,377,700,492)

（単位：円）

総合計			(19,078,621,827)	19,078,621,827
-----	--	--	------------------	----------------

(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	153,160	1,937,474.00	
オーストラリアドル		計	153,160	1,937,474.00	
(邦貨換算額)				(165,983,398)	

外国投資証券（香港ドル）（単位：香港ドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
LINK	LINK REIT	1,046,000	20,166,880.00
香港ドル 計	1,046,000	20,166,880.00	
(邦貨換算額)		(239,985,872)	

（単位：円）

総合計			(405,969,270)	405,969,270
-----	--	--	---------------	-------------

(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 3銘柄	100.0	-	5.4
オーストラリアドル	株式 25銘柄	98.7	-	64.1
オーストラリアドル	投資証券 1銘柄	-	1.3	0.9
香港ドル	株式 16銘柄	92.9	-	16.2
香港ドル	投資証券 1銘柄	-	7.1	1.2
シンガポールドル	株式 11銘柄	100.0	-	12.2

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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		(単位：円)	
		平成21年1月13日現在	平成22年1月12日現在	金 額	金 額
資産の部					
流動資産					
預金		5,961,995,383		2,243,149,951	
コール・ローン		368,346,522		302,704,573	
国債証券		12,173,920,262		22,771,717,246	
地方債証券		374,345,128		551,978,552	
特殊債券		44,036,493,620		7,659,752,044	
社債券		18,358,916,954		11,551,936,541	
コモディティ・ペーパー		402,566,046		-	
派生商品評価勘定		2,780,876,844		682,086,530	
未収入金		39,591,446,630		2,302,869,677	
未収利息		531,925,284		315,297,435	
前払費用		33,155,347		42,101,093	
差入委託証拠金		1,605,888,604		475,995,448	
流動資産合計		126,219,676,624		48,899,589,090	
資産合計		126,219,676,624		48,899,589,090	
負債の部					
流動負債					
派生商品評価勘定		2,608,563,002		683,141,935	
未払金		63,274,092,521		2,703,394,170	
未払解約金		164,575,169		-	
流動負債合計		66,047,230,692		3,386,536,105	
負債合計		66,047,230,692		3,386,536,105	
純資産の部					
元本等					
元本		42,854,536,619		26,823,368,077	
剰余金					
剰余金又は欠損金 ()		17,317,909,313		18,689,684,908	
元本等合計		60,172,445,932		45,513,052,985	
純資産合計		60,172,445,932		45,513,052,985	
負債純資産合計		126,219,676,624		48,899,589,090	

(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20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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、社債券及びコモディティ・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 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価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。 (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 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 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 「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。	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券及びコモディティ・ペーパーは個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 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）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 時価が入手できなかった有価証券 (1) デリバティブ取引 (2) 為替予約取引 外貨建取引等の処理基準 同左 同左 同左 同左
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 「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。	(1) デリバティブ取引 (2) 為替予約取引 外貨建取引等の処理基準 同左 同左 同左 同左
3. 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21年1月13日現在			平成20年1月11日			平成21年1月14日現在		
1.	期首	期首元本額	53,799,116,529	円	期首元本額	42,854,536,619	円	期首元本額
	期首からの追加設定元本額	13,575,658,288	円	期首からの追加設定元本額	1,946,289,996	円	期首からの追加設定元本額	1,946,289,996
	期首からの解約元本額	24,520,238,198	円	期首からの解約元本額	17,977,458,538	円	期首からの解約元本額	17,977,458,538
平成21年1月13日現在の元本の内訳								
	GW7つの卵	31,905,674,163	円	GW7つの卵	19,365,053,935	円	GW7つの卵	19,365,053,935
	ス安定型	790,814	円	ス安定型	522,844	円	ス安定型	522,844
	グロ－バル・ラップ・バラン	727,593,587	円	グロ－バル・ラップ・バラン	476,789,473	円	グロ－バル・ラップ・バラン	476,789,473
	ス安定成長型		円	ス安定成長型		円	ス安定成長型	
	グロ－バル・ラップ・バラン	1,103,811,036	円	グロ－バル・ラップ・バラン	772,930,348	円	グロ－バル・ラップ・バラン	772,930,348
	ス成長型		円	ス成長型		円	ス成長型	
	グロ－バル・ラップ・バラン	5,782,733,746	円	グロ－バル・ラップ・バラン	4,095,433,054	円	グロ－バル・ラップ・バラン	4,095,433,054
	ス積極成長型		円	ス積極成長型		円	ス積極成長型	
	グロ－バル・ラップ・バラン	2,045,042,579	円	グロ－バル・ラップ・バラン	1,248,682,958	円	グロ－バル・ラップ・バラン	1,248,682,958
	ス積極型		円	ス積極型		円	ス積極型	
	GW7つの卵 (適格機関投資家向け)	351,769,303	円	GW7つの卵 (適格機関投資家向け)	119,851,921	円	GW7つの卵 (適格機関投資家向け)	119,851,921
	海外債券ファンド	309,267,048	円	海外債券ファンド	233,251,879	円	海外債券ファンド	233,251,879
	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定型)	42,603,446	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定型)	30,930,880	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定型)	30,930,880
	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定成長型)	83,037,531	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定成長型)	63,228,417	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (安定成長型)	63,228,417
	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (成長型)	103,482,377	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (成長型)	84,655,143	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (成長型)	84,655,143
	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極成長型)	238,882,322	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極成長型)	212,073,828	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極成長型)	212,073,828
	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極型)	159,848,667	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極型)	119,963,397	円	年金積立 グロ－バル・ラップ・バランス (積極型)	119,963,397
	(合計)	42,854,536,619	円	(合計)	26,823,368,077	円	(合計)	26,823,368,077
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純投資信託の受益権の総数	42,854,536,619	口	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純投資信託の受益権の総数	26,823,368,077	口	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純投資信託の受益権の総数	26,823,368,077

当該純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 20 年 1 月 11 日 至 平成 21 年 1 月 13 日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	12,173,920,262	294,485,440
地方債証券	374,345,128	22,469,681
特殊債券	44,036,493,620	530,208,432
社債券	18,358,916,954	2,023,716,365
コーポレート・ペーパー	402,566,046	1,291,867
合計	75,346,242,010	1,220,200,307

対象期間 (自 平成 21 年 1 月 14 日 至 平成 22 年 1 月 12 日)

売買目的有価証券

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	22,771,717,246	235,075,546
地方債証券	551,978,552	10,217,333
特殊債券	7,659,752,044	62,107,968
社債券	11,551,936,541	1,454,654,791
合計	42,535,384,383	1,271,469,880

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

取引の内容	自 平成20年1月11日 至 平成21年1月13日	自 平成21年1月14日 至 平成22年1月12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

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21年1月13日現在			評価損益
		契約額等	うち1年超	時価	
債券先物取引 売建 買建 市場取引	債券先物取引	1,197,368,602	-	1,270,695,358	73,326,756
	買建	26,721,954,182	-	27,127,443,750	405,489,568
合計		27,919,322,784	-	28,398,139,108	332,162,812

(債券関連)					(単位：円)
区分	種類	平成22年1月12日現在			評価損益
		契約額等	うち1年超	時価	
債券先物取引 買建 市場取引	債券先物取引	11,315,907,832		11,151,099,215	164,808,617
	買建				
合計		11,315,907,832		11,151,099,215	164,808,617

(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。

(単位：円)

(金利関連)					(単位：円)
区分	種類	平成21年1月13日現在			評価損益
		契約額等	うち1年超	時価	
金利先物取引 買建 市場取引	金利先物取引	55,525,080,595	44,112,137,277	56,222,220,977	697,140,382
	買建				
合計		55,525,080,595	44,112,137,277	56,222,220,977	697,140,382

(単位：円)

(金利関連)					(単位：円)
区分	種類	平成22年1月12日現在			評価損益
		契約額等	うち1年超	時価	
金利先物取引 買建 市場取引	金利先物取引	11,898,133,408	-	11,972,636,812	74,503,406
	買建				
合計		11,898,133,408	-	11,972,636,812	74,503,404

(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21年1月13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				
	アメリカドル	33,833,102,262	-	32,172,421,242	1,660,681,020
	カナダドル	27,658,559,413	-	26,448,825,382	1,209,734,031
	オーストラリアドル	14,352,760	-	14,241,540	111,220
	イギリスポンド	128,542,440	-	129,327,120	784,680
	シンガポールドル	3,695,109,520	-	3,492,192,000	202,917,520
	ポーランドズロチ	1,393,685,166	-	1,320,593,436	73,091,730
	ユーロ	888,904,803	-	715,799,204	173,105,599
	買建				
	アメリカドル	53,948,160	-	51,442,560	2,505,600
	カナダドル	35,413,780,621	-	32,896,110,249	2,517,670,372
	オーストラリアドル	7,855,221,208	-	7,484,401,254	370,819,954
	イギリスポンド	1,200,852,938	-	1,192,692,270	8,160,668
	スイスフラン	64,232,069	-	63,814,320	417,749
	デンマーククローナ	263,576,989	-	250,932,000	12,644,989
	シンガポールドル	574,622,892	-	587,853,900	13,231,008
	ノルウェークローネ	461,374,285	-	450,379,840	10,994,445
	ユーロ	1,656,581,570	-	1,594,447,706	62,133,864
	ポーランドズロチ	610,945,321	-	609,415,200	1,530,121
	ユーロ	183,241,373	-	176,733,150	6,508,223
	ポーランドズロチ	1,973,651,219	-	1,229,251,969	744,399,250
	ユーロ	20,569,480,757	-	19,256,188,640	1,313,292,117
合計		69,246,882,883	-	65,068,531,491	856,989,352

区 分	種 類	平成22年1月12日現在			時 価	評価増益
		契 約 額 等		うち1年超		
市場取引以外での取引	為替予約取引					
	売建			-		
	アメリカドル	21,540,292,407			21,981,551,275	441,258,868
	カナダドル	13,110,085,717		-	13,333,471,752	223,386,035
	オーストラリアドル	3,299,239,350		-	3,529,786,700	230,547,350
	イギリスポンド	137,494,880		-	137,398,640	96,240
	ニュルウェークロネ	4,779,660,720		-	4,766,167,600	13,493,120
	買建			-		
	アメリカドル	213,811,740		-	214,726,583	914,843
	カナダドル	22,277,412,407		-	22,807,921,083	530,508,676
	オーストラリアドル	9,507,326,690		-	9,718,429,116	211,102,426
	イギリスポンド	970,321,335		-	1,011,762,100	41,440,765
	スイスフラン	267,468,960		-	274,139,640	6,670,680
	スウェーデンクローナ	3,080,098,391		-	3,090,464,000	10,365,609
	シンガポールドル	336,172,338		-	353,263,680	17,091,342
	デンマーククローネ	313,800,379		-	329,514,570	15,714,191
	ニュルウェークロネ	296,806,700		-	304,632,393	7,825,693
ポーランドズロチ	403,120,727		-	414,370,230	11,249,503	
ユーロ	583,667,089		-	596,049,363	12,382,274	
	418,785,986		-	444,628,611	25,842,625	
	6,099,843,812		-	6,270,667,380	170,823,568	
合計		43,817,704,814	-	44,789,472,358	89,249,808	

(単位：円)

(注) 時価の算定方法

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

(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21年1月13日現在		平成22年1月12日現在	
1口当たり純資産額	1.4041 円	1口当たり純資産額	1.6968 円
(1万口当たり純資産額)	(14,041 円)	(1万口当たり純資産額)	(16,968 円)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(外貨建債券)

外貨建債券 (アメリカドル)

(単位 : アメリカドル)

種 類	銘柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	119H00 アメリカ国債 3.625% 20190815	19,100,000.00	18,826,929.21	
	119K00 アメリカ国債 3.375% 20191115	30,300,000.00	29,206,357.86	
	214F00 南アフリカ国債 6.5% 20140602	300,000.00	329,250.00	
	215A03 カタール共和国 4% 20150120	3,100,000.00	3,131,000.00	
	215C01 ハナマ国債 7.25% 20150315	300,000.00	342,000.00	
	220A02 カタール共和国 5.25% 20200120	800,000.00	812,000.00	
	310A00 アメリカ国債 0% 20100128	100,000.00	99,998.71	
		54,000,000.00	52,747,535.78	
	計			
	434D00 CALIFORNIA ST-Taxable Various Purpose 7.5% 20340401	4,700,000.00	4,586,636.00	
地方債証券	436E00 PORT SEATTLE WASH REV TAXABLE-SER BI 7% 20360501	1,400,000.00	1,393,630.00	
	計			
国債証券	812B00 ノルウェー輸出金融公社 (EXPT) 5% 20120214	7,700,000.00	8,250,480.70	
	814A01 韓国輸出入銀行 (EIBOR) 8.125% 20140121	1,000,000.00	1,168,694.00	
特殊債券	840180 政府抵当金庫 (GNMA) POOL 004216 6% 20380820	828,635.44	870,622.06	
	840181 政府抵当金庫 (GNMA) 008770 4.125% 20251220	7,810.37	7,994.81	
	840182 政府抵当金庫 (GNMA) POOL 004164 6% 20380620	5,826,259.95	6,121,474.21	
	850171 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W2 5AF 0.58125% 20440325	81,339.36	76,804.92	
	850182 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W8 2A 6.5% 20440625	160,990.15	174,579.73	
	850183 連邦抵当金庫 (FNMA) 2004-W8 1AF 0.48125% 20440625	13,223.83	13,187.71	
	850192 連邦抵当金庫 (FNMA) 1999-37 F 0.63125% 20290625	43,406.58	43,124.68	
	850233 FANNIE WAE WHOLE LOAN 2004-W12 1A1 6% 20440725	461,086.69	483,780.82	
	850264 FANNIE WAE GRANTOR TRUST 2004-T3 1A1 6% 20440225	58,287.98	61,885.44	
	850271 連邦抵当金庫 (FNMA) 5.5% 20280325	1,675,069.76	1,737,967.95	
	850302 連邦抵当金庫 (FNMA) 3.569% 20301001	7,983.53	8,120.81	
	850303 連邦抵当金庫 (FNMA) 4.544% 20351001	1,506,712.86	1,572,188.12	
	860107 FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-21 A 0.59125% 20291025	55,346.10	52,722.67	

特殊債券	860108	FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-62 1A1 1.832% 20441025	584,661.29	559,903.98	
	860110	連邦住宅貸付抵当公社 (FHLMC) 4.704% 20350901	2,064,465.86	2,147,557.51	
	870124	連邦抵当金庫 (FNMA) 2000-13 F 0.88125% 20230925	45,138.54	45,101.40	
	870276	FHLMC STRUCTURED PASS THROUGH SECURITIES T-61 1A1 2.032% 20440725	212,263.47	202,919.99	
	計		22,332,681.76	23,599,111.51	
	510E05	Morgan Stanley 2.3725% 20100514	2,600,000.00	2,619,094.40	
	511A03	Kinder Morgan Finance Co ULC 5.35% 20110105	1,300,000.00	1,340,625.00	
	511E13	Hewlett-Packard Company 1.30563% 20110527	3,700,000.00	3,751,074.80	
	511E14	Cellco Partnership / Verizon Wireless Capital LLC 3.75% 20110520	10,000,000.00	10,338,840.00	
	512C08	Citigroup Inc. 0.37875% 20120316	2,600,000.00	2,525,510.00	
社債券	512F05	American Express Centurion Bank 0.38406% 20120612	3,000,000.00	2,945,097.00	
	512H04	SLM Corporation 5.125% 20120827	300,000.00	293,872.80	
	513D05	Citigroup Inc. 5.5% 20130411	1,600,000.00	1,679,457.60	
	513E03	General Electric Capital Corporation 1.16658% 20130522	2,500,000.00	2,486,442.50	
	513I01	Pricoa Global Funding 0.45063% 20130927	3,600,000.00	3,423,441.60	
	514A01	SLM Corporation 0.58219% 20140127	2,700,000.00	2,196,396.00	
	516F00	Barclays Bank Plc 0.45063% 20160627	2,900,000.00	2,674,899.10	
	516K00	OAO Gazprom 6.212% 20161122	5,000,000.00	5,030,500.00	
	518C01	Pemex Project Funding Master Trust 5.75% 20180301	1,800,000.00	1,822,500.00	
	518E01	HBOS plc 6.75% 20180521	2,500,000.00	2,393,037.50	
	519A01	Electricite de France (EDF) 6.5% 20190126	3,200,000.00	3,633,817.60	
	519J00	Temasek Financial l Ltd 4.3% 20191025	5,300,000.00	5,220,680.20	
	870204	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-AR1 1A2 0.58313% 20340319	81,974.87	73,759.90	
	870212	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2004-AR3 1A2 0.52313% 20340719	20,520.85	16,818.86	
	870216	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 5 A 0.58313% 20261019	73,080.39	54,586.08	
	870237	WASHINGTON MUTUAL 2003-R1 A1 0.77125% 20271225	2,220,769.20	1,653,303.81	
	870254	WASHINGTON MUTUAL 2005-AR1 A1A 0.55125% 20450125	132,715.99	98,138.81	
	870255	WASHINGTON MUTUAL 2005-AR2 2A1A 0.54125% 20450125	135,124.04	102,861.77	
	870256	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2005-2 2A1 0.55125% 20350325	148,039.12	95,301.23	
	870258	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-3 2A1 0.52125% 20350425	107,708.66	61,304.74	

870278	MASTR SEASONED SECURITIES TRUST 2005-1 2A1 6.21658% 20170925	271,232.84	288,647.66	
870279	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2005-3 2A2A 4.64051% 20350825	1,509,235.88	1,239,470.52	
870283	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2003-11 1A11 4.75% 20181025	874,938.99	870,555.54	
870286	BANC OF AMERICA MORTGAGE SECURITIES 2004-4 1A9 5% 20340525	1,542,550.88	1,519,668.98	
870287	GMAC MORTGAGE CORPORATION LOAN TRUST 2004-J4 A1 5.5% 20340925	810,174.11	801,831.01	
870294	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 2005-4 2A1 3.06823% 20350420	171,162.96	156,638.66	
870299	FIRST HORIZON ALTERNATIVE MORTGAGE SECURITIES 2004-AA1 A1 2.59565% 20340625	24,127.18	19,538.12	
870301	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 3A2A 5.25% 20360220	860,673.89	581,757.53	
870302	COUNTRYWIDE HOME LOANS 2005-HYB 5A1 5.25% 20360220	788,642.41	409,462.58	
870305	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENT INC 2005-AR8 A1 0.51125% 20350225	1,081,262.81	612,126.23	
870314	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-0A1 2A1 0.44313% 20460401	1,976,314.41	1,061,865.62	
870315	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR2 2A1 4.95% 20360325	1,215,772.58	1,031,845.03	
870318	RESIDENTIAL ACCREDIT LOANS INC 2006-Q03 A1 0.44125% 20460425	2,357,642.67	988,284.43	
870328	MASTR ADJUSTABLE RATE MORTGAGES TRUST 2004-4 4A1 3.18601% 20340525	1,370,425.65	1,217,051.72	
870329	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS INC 2006-AR3 12A1 0.45125% 20350925	2,827,087.56	1,505,536.36	
870330	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2006-AR8 1A1 3.21245% 20360420	738,881.61	626,891.82	
870346	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-HY12 A1 6.10985% 20360625	2,160,662.18	2,086,797.78	
870348	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2006-HYB5 2A1 5.74049% 20360820	9,644,348.73	5,673,777.10	
870353	THORNBERG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-5 A1 0.35125% 20360625	2,991,909.03	2,935,324.84	
870354	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A2 0.28125% 20360825	68,180.80	67,735.25	
870356	BEAR STEARNS ALT-A TRUST 2006-6 32A1 5.61827% 20361025	3,250,500.90	1,922,343.30	
870357	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-15 A1 0.34125% 20361025	533,693.16	520,261.17	
870359	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A11A 0.46125% 20351025	562,383.59	544,176.97	
870368	RESIDENTIAL ACCREDIT LOANS INC 2005-Q01 A1 0.53125% 20350825	2,854,208.55	1,588,703.56	
870376	ASSET BACKED FUNDING CERTIFICATES 2004-OPTS A1 0.58125% 20340625	591,162.56	419,762.54	

870407	GSAMP TRUST 2006-HE7 A2A 0.27125% 20461125	78,701.78	78,472.14	
870409	INDYMAC INDEX MORTGAGE LOAN TRUST 2006-AR1A 1A1A 0.32125% 20461125	965,200.20	910,941.85	
870410	STRUCTURED ASSET SEC CORP 2006-11 A1 3.71607% 20351025	886,415.34	740,752.92	
870411	ACE SECURITIES CORP 2006-HE4 A2A 0.29125% 20361025	41,230.41	25,810.87	
870417	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-CH1 A2 0.28125% 20281125	419,428.45	410,790.15	
870418	THORNBERG MORTGAGE SECURITIES TRUST 2006-6 A1 0.34125% 20111125	2,808,740.61	2,754,827.39	
870429	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2005-14 2A1 0.44125% 20350525	170,380.46	101,241.21	
870430	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE 0.61125% 20340925	10,642.06	6,726.02	
870434	SOUNDVIEW HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-NLCL A1 0.29125% 20361125	137,618.58	73,932.96	
870438	WELLS FARGO MORTGAGE BACKED SECURITIES TRUST 2004-EE 2A1 3.10778% 20341225	76,804.73	71,752.76	
870439	SAXON ASSET SECURITIES TRUST 2006- 3 A1 0.29125% 20361125	7.56	7.56	
870440	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORP 2006-BC3 A2 0.28125% 20361025	103,483.30	98,613.03	
870441	COUNTRYWIDE HOME LOAN MORTGAGE PASS THROUGH TRUST 2004-12 12A1 3.98279% 20340825	222,408.29	180,803.92	
870442	HARBORVIEW MORTGAGE LOAN TRUST 2004-11 3A1A 0.58313% 20350119	161,514.13	88,197.53	
870445	AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT TRUST 2004-3 5A 2.69813% 20341025	70,708.59	54,095.91	
870446	FREMONT HOME LOAN TRUST 2006-C 2A1 0.28125% 20361025	94,199.45	91,297.04	
870448	WELLS FARGO HOME EQUITY TRUST 2005-2 A112 0.47125% 20351025	169,799.18	165,871.38	
870451	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-25 2A1 0.30125% 20460125	1,324,072.16	1,259,058.23	
870452	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2006-WFH3 A2 0.33125% 20361025	34,950.77	33,396.70	
870453	GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR8 1A1A 0.31125% 20470125	2,489,841.20	2,176,299.25	
870454	JP MORGAN MORTGAGE ACQUISITION CORP 2006-WMC3 A3 0.34125% 20360825	100,000.00	43,533.05	
870456	ACE SECURITIES CORP 2006-FH2 A2A 0.28125% 20360825	46,754.47	41,529.16	
870468	GREENPOINT MORTGAGE FUNDING TRUST 2006-AR6 A1A 0.31125% 20461025	826,539.91	748,704.81	
870469	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-0A22 A1 0.39125% 20470225	1,285,314.57	729,941.84	
870480	BANC OF AMERICA LARGE LOAN INC 2007-BM8X A1 0.74313% 20290815	674,984.27	576,078.21	
870484	SLC STUDENT LOAN TRUST 2008-2 A2 0.70363% 20170615	2,000,000.00	1,996,413.40	
870485	COUNTRYWIDE ALTERNATIVE LOAN TRUST 2007-16CB 5A1 6.25% 20370825	245,280.04	124,139.02	

	870486	SMALL BUSINESS ADMINISTRATION PARTICIPATION CERTIFICATES 2008- 20G 1 5.87% 20280701	1,791,313.63	1,949,348.51
	870487	SMALL BUSINESS ADMINISTRATION PARTICIPATION CERTIFICATES 2008- 20H 1 6.02% 20280801	1,881,166.35	2,067,082.77
	870490	MERRILL LYNCH/COUNTRYWIDE COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2006-4 A3 5.172% 20491212	700,000.00	627,022.41
	社債券 計		118,424,609.54	103,428,097.62
アメリカドル 計			200,857,291.30	185,755,010.91
(邦貨換算額)			(18,539,127.987)	(17,145,187.507)

外貨建債券 (カナダドル)					(単位：カナダドル)	
種 類		銘 柄	券面総額	評価額	備 考	
国債証券	312C00	カナダ国債 1.5% 20120301	40,400,000.00	40,436,360.00		
国債証券 計			40,400,000.00	40,436,360.00		
特殊債券	814C00	Canada Housing Trust 2.2% 20140315	1,800,000.00	1,771,560.00		
特殊債券 計			1,800,000.00	1,771,560.00		
社債券	511L00	Rogers Cable Inc 7.25% 20111215	300,000.00	331,032.00		
社債券 計			300,000.00	331,032.00		
カナダドル 計			42,500,000.00	42,538,952.00		
(邦貨換算額)			(3,793,975,000)	(3,797,452,245)		

外貨建債券 (オーストラリアドル)					(単位：オーストラリアドル)	
種 類		銘 柄	券面総額	評価額	備 考	
社債券	870475	PUMA FINANCE LTD P10 BA 4.2467% 20360712	549,950.00	526,577.12		
	870476	PUMA FINANCE LTD P11 BA 4.1683% 20370822	1,416,592.00	1,367,719.57		
社債券 計			1,966,542.00	1,894,296.69		
オーストラリアドル 計			1,966,542.00	1,894,296.69		
(邦貨換算額)			(168,473.653)	(162,284.397)		

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	314C00	イギリス国債 2.25% 20140307	9,600,000.00	9,449,308.80		
国債証券 計			9,600,000.00	9,449,308.80		
特殊債券	814D00	欧州投資銀行 (EIB) 6.25% 20140415	10,000,000.00	11,323,960.00		
	815L00	ドイツ復興金融公庫 (KfW) 5.5% 20151207	10,000,000.00	11,103,650.00		
特殊債券 計			20,000,000.00	22,427,610.00		
社債券	518H00	GE Capital UK Funding 6.75% 20180806	600,000.00	660,381.60		
社債券 計			600,000.00	660,381.60		
イギリスポンド 計			30,200,000.00	32,537,300.40		
(邦貨換算額)			(4,487,418,000)	(4,834,717,466)		

外貨建債券 (デンマーククローネ)					(単位：デンマーククローネ)	
種 類		銘 柄	券面総額	評価額	備 考	
国債証券	319K00	デンマーク国債 4% 20191115	24,700,000.00	25,436,825.70		
国債証券 計			24,700,000.00	25,436,825.70		
デンマーククローネ 計			24,700,000.00	25,436,825.70		
(邦貨換算額)			(444,106,000)	(457,354,126)		

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	320A00	ドイツ国債 3.25% 20200104	93,500,000.00	92,865,602.50		
	328010	ドイツ国債 5.625% 20280104	64,215.00	76,524.56		
国債証券 計			93,564,215.00	92,942,127.06		
特殊債券	310040	フランス鉄道線路公社 (RFF) 5.25% 20100414	1,500,000.00	1,517,212.50		
	810101	フランス貯蓄共済金庫全国金庫 (CDEE) 5.25% 20100917	13,000,000.00	13,366,821.00		
特殊債券 計			14,500,000.00	14,884,033.50		
社債券	510105	Banco Santander Central Hispano SA 4% 20100910	2,000,000.00	2,033,722.00		
	512K00	Banco Santander Central Hispano SA 4.5% 20121114	8,000,000.00	8,430,616.00		
社債券 計			2,200,000.00	2,361,330.40		
ユーロ 計			120,264,215.00	120,651,828.96		
(邦貨換算額)			(16,086,541,398)	(16,138,388,642)		

総合計					(単位：円)	
			(43,519,642,038)	(42,535,384,383)		
(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。			43,519,642,038	42,535,384,383		

外貨建有価証券の内訳

通貨	国債証券	銘柄数	組入債券時価比率 (%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	国債証券 7銘柄		28.4	11.4
アメリカドル	地方債証券 2銘柄		3.2	1.3
アメリカドル	特殊債券 19銘柄		12.7	5.1
アメリカドル	社債券 80銘柄		55.7	22.4
カナダドル	国債証券 1銘柄		95.0	8.5
カナダドル	特殊債券 1銘柄		4.2	0.4
カナダドル	社債券 1銘柄		0.8	0.1
オーストラリアドル	社債券 2銘柄		100.0	0.4
イギリスポンド	国債証券 1銘柄		29.0	3.3
イギリスポンド	特殊債券 2銘柄		69.0	7.8
イギリスポンド	社債券 1銘柄		2.0	0.2
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄		100.0	1.1
ユーロ	国債証券 2銘柄		77.1	29.3
ユーロ	特殊債券 2銘柄		12.3	4.7
ユーロ	社債券 3銘柄		10.6	4.0

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2 ファンドの現況

以下のファンドの現況は平成 22 年 1 月 29 日現在です。

純資産額計算書

資産総額	238,604,089,638	円
負債総額	873,304,237	円
純資産総額 (-)	237,730,785,401	円
発行済数量	323,339,101,452	口
1 単位当たり純資産額 (/)	0.7352	円

(参考) 日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	85,357,011,272	円
負債総額	739,066,264	円
純資産総額 (-)	84,617,945,008	円
発行済数量	84,178,964,037	口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0052	円

(参考) 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,775,146,019	円
負債総額	141,235,697	円
純資産総額 (-)	31,633,910,322	円
発行済数量	20,564,121,242	口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.5383	円

(参考) 日本債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	54,906,783,205	円
負債総額	234,178,037	円
純資産総額 (-)	54,672,605,168	円
発行済数量	48,637,183,454	口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.1241	円

(参考) 北米株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	62,023,197,769	円
負債総額	977,712	円
純資産総額 (-)	62,022,220,057	円
発行済数量	77,812,061,731	口
1 単位当たり純資産額 (/)	0.7971	円

(参考) 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	54,947,779,511	円
負債総額	216,310,619	円
純資産総額 (-)	54,731,468,892	円
発行済数量	40,801,619,989	口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.3414	円

(参考) アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	17,356,485,793	円
負債総額	9,483,348	円
純資産総額 (-)	17,347,002,445	円
発行済数量	6,014,638,774	口
1 単位当たり純資産額 (/)	2.8841	円

(参考) 海外債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	43,987,270,064	円
負債総額	550,778,587	円
純資産総額 (-)	43,436,491,477	円
発行済数量	26,681,886,424	口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.6279	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計算期間 (2008年1月11日 ~ 2009年1月13日)	6,547,417,251	110,726,620,676
第7計算期間 (2009年1月14日 ~ 2010年1月12日)	4,726,664,478	87,049,479,782

(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。



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。

