【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成22年2月19日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 石橋 俊朗
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】	長谷川 英男 連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】	03-5695-2111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル７５
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成22年2月20日から平成23年2月21日まで） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル７５

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。格付けは、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（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

(5) 【申込手数料】

① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

② 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

平成22年2月20日から平成23年2月21日まで（継続申込期間）

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

① 受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

② 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

③ 当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

④ 「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

⑤ 取得申込金額に利息は付きません。

⑥ 振替受益権について

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

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第１ 【ファンドの状況】

１ 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	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）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし
	対象インデックス	その他の指数（合成インデックス）

（注1）商品分類の定義

- 「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
- 「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）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
- 「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- 「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、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
- 「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「ファミリーファンド」…目論見書等において、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

・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、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

・「その他の指数」…日経225、ＴＯＰＩＸにあてはまらないすべてのもの

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス http://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億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、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1. トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

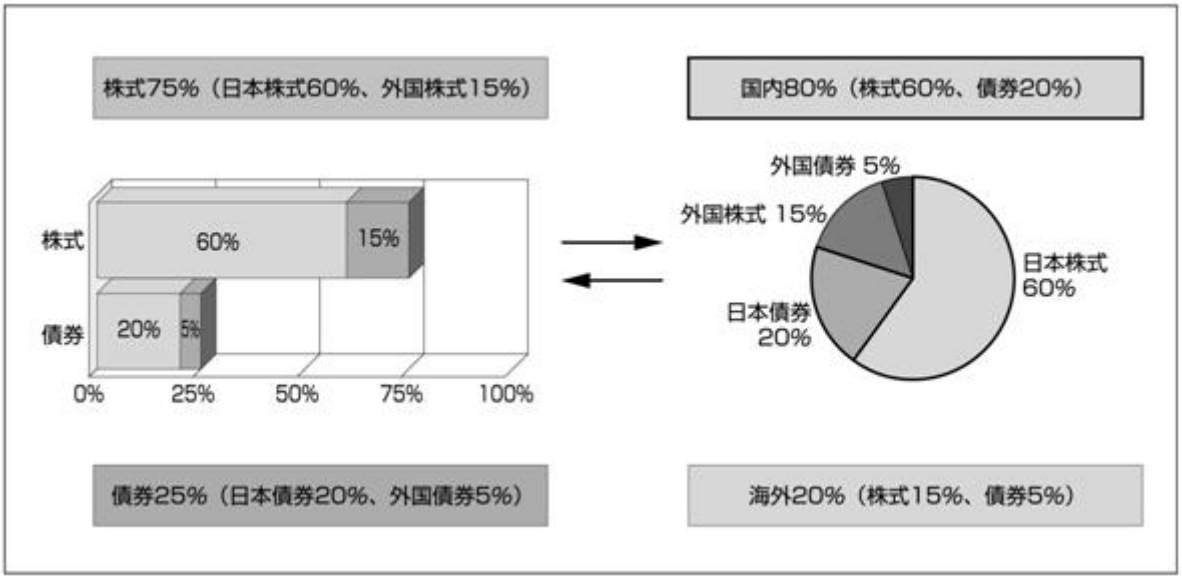
	当ファンドの主要投資対象	各マザーファンドのベンチマーク
日本株式	トピックス・インデックス・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）
日本債券	日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数
外国株式	外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数（円ベース）
外国債券	外国債券インデックスマザーファンド	シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

（注）当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。マザーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンド（トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド）の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しくみです。ただし、市況動向等によっては、ベビーファンドから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。

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

3. 各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、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。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

4. 運用の特色、関連説明

(a) 合成ベンチマークについて

各マザーファンド毎のベンチマークを上記の標準組入比率に準拠して指数化したものを合成ベンチマークとし、各マザーファンドを標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

(b) 各マザーファンドの運用プロセス

ⅰ．トピックス・インデックス・マザーファンド

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル（注）を用いてポートフォリオを構築します。TOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

（注）ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

ⅱ．日本債券インデックスマザーファンド

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル（注）の使用により効率的なDBI総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またDBI総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行ないます。

（注）マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。このモデルを用いることにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ないポート

フォリオを効率的に構築および管理することができます。

iii．外国株式インデックスマザーファンド

MSCIコクサイ指数に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル（注）を用いてポートフォリオを構築します。MSCIコクサイ指数への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

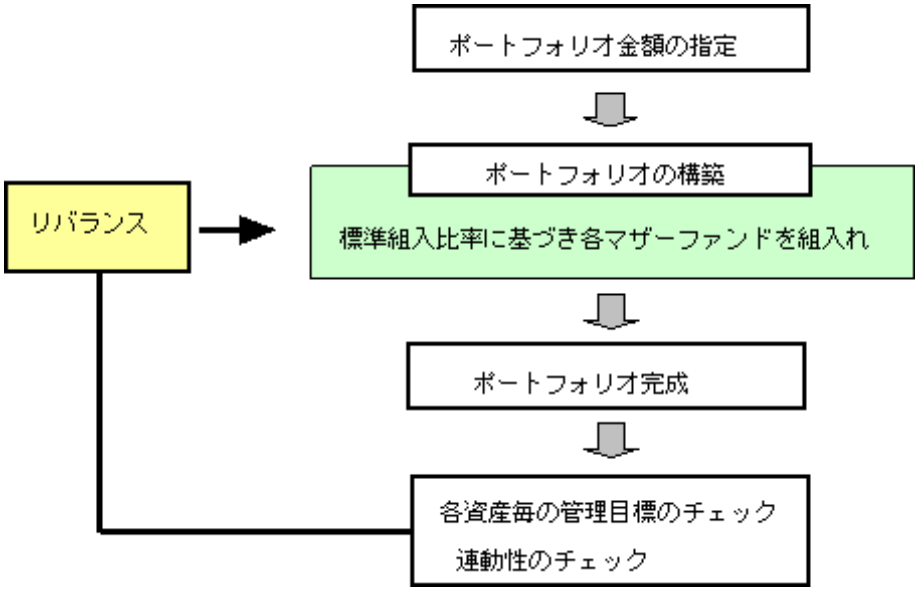
（注）ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

iv．外国債券インデックスマザーファンド

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）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、各通貨別にリスクモデル（注）を用いて、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようポートフォリオを構築します。また、リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とマザーファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行ないます。

（注）リスクモデルでは、個別債券をキャッシュフロー（利金と償還金）ごとに分解し、ポートフォリオをキャッシュフローの集合体として分析するなどの手法を採用することで、イールドカーブの変化などの債券価格変動要因がポートフォリオの価値に与える影響の測定・管理やポートフォリオの効率的な複製を行なうことなどができます。

(c) 運用プロセス



・標準組入比率に従って、各資産のマザーファンド受益証券へ投資し、ポートフォリオを構築します。

・合成ベンチマークに連動する投資成果をめざすため、各資産毎のウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。

・各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。

5．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことがで

きるものとします。

6. 保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

7. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

8. 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

9. 年1回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。なお、当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。

10. 原則としていつでもお買付け・ご換金をお申込みいただけます。

(2) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など
↓運用指図　↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など
	損益↑↓投資	
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、外国の公社債 など （マザーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

＜委託会社の概況（平成21年12月末日現在）＞

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

・大株主の状況

名 称	住 所	所有株式数	比率
		株	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンドおよび外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、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。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の60%

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

ハ．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ニ．保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。

ホ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

へ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

① 委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（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．トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券

2．日本債券インデックスマザーファンド受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンド受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンド受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

9．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。）

10．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

11．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

12．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

13．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

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、前5.から前15.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ます。）

18．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

19．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

20．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。）

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

22．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

23．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

24．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書、前16.ならびに前20.の証券または証書のうち前5.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、前6.から前10.までの証券および前16.ならびに前20.の証券または証書のうち前6.から前10.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前17.の証券および前18.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

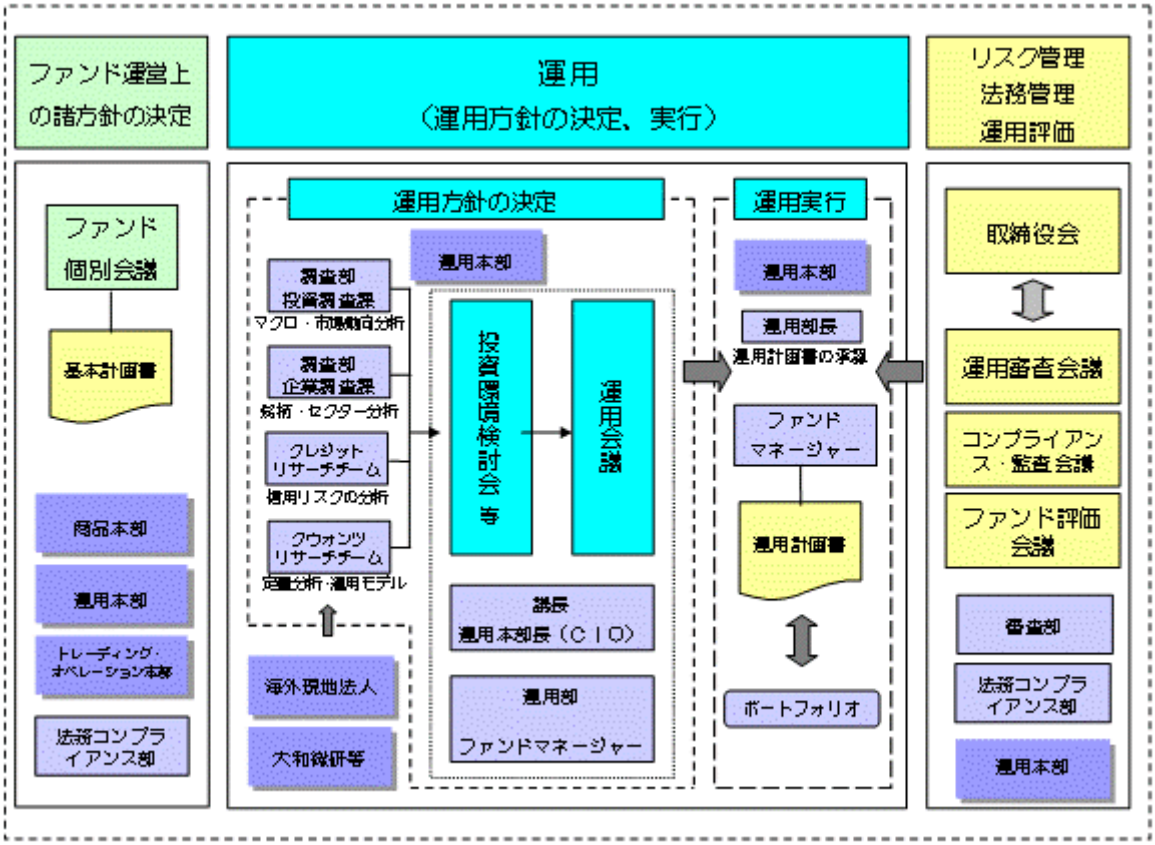
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（ＣＩＯ）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

ＣＩＯが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③ 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．運用本部長（ＣＩＯ）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営

・ファンドマネージャーの任命・変更

・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定

・各ファンドの分配政策の決定

・代表取締役に対する随時の的確な状況報告

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受けています。

※ 上記の運用体制は平成21年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

② 原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

② 新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③ 投資信託証券（信託約款）

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

ロ．前イ.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投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（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のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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。

ロ．前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、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または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ.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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買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。

ロ．信用取引の指図は、次の1.から6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦ 先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行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て取扱うものとします（以下同じ。）。

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ハ．委託会社は、わが国の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取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)②の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額（以下本2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑧ スワップ取引（信託約款）

イ．委託会社は、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、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ヘ．委託会社は、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。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

イ．委託会社は、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。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総

額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ヘ．前ホ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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の割合を乗じて得た額をいいます。

ト．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

チ．委託会社は、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。

⑩ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ.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転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.および2.の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

ロ．前イ.の1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみ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。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付け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。

⑫ 外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産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、信託財産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ.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。

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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。

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産と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（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。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参 考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。

ロ．ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、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。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

4．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

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の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取引所におけ

るわが国の金利にかか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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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。

(注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年（昭和43年）1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969年（昭和44年）7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。株式会社東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

２．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券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。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．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。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

18．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

20．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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資は、行ないません。

(注）ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは

ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が開発した日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定する指数であり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

対 象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期 間：残存期間1年以上
種 類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、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．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券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。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．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。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

18．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

20．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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは

ＭＳＣＩコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。

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、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果を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）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、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．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券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。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．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。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

18．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

20．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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）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）とは

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）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社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。

投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入実質外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

なお、当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。このため、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

④ その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

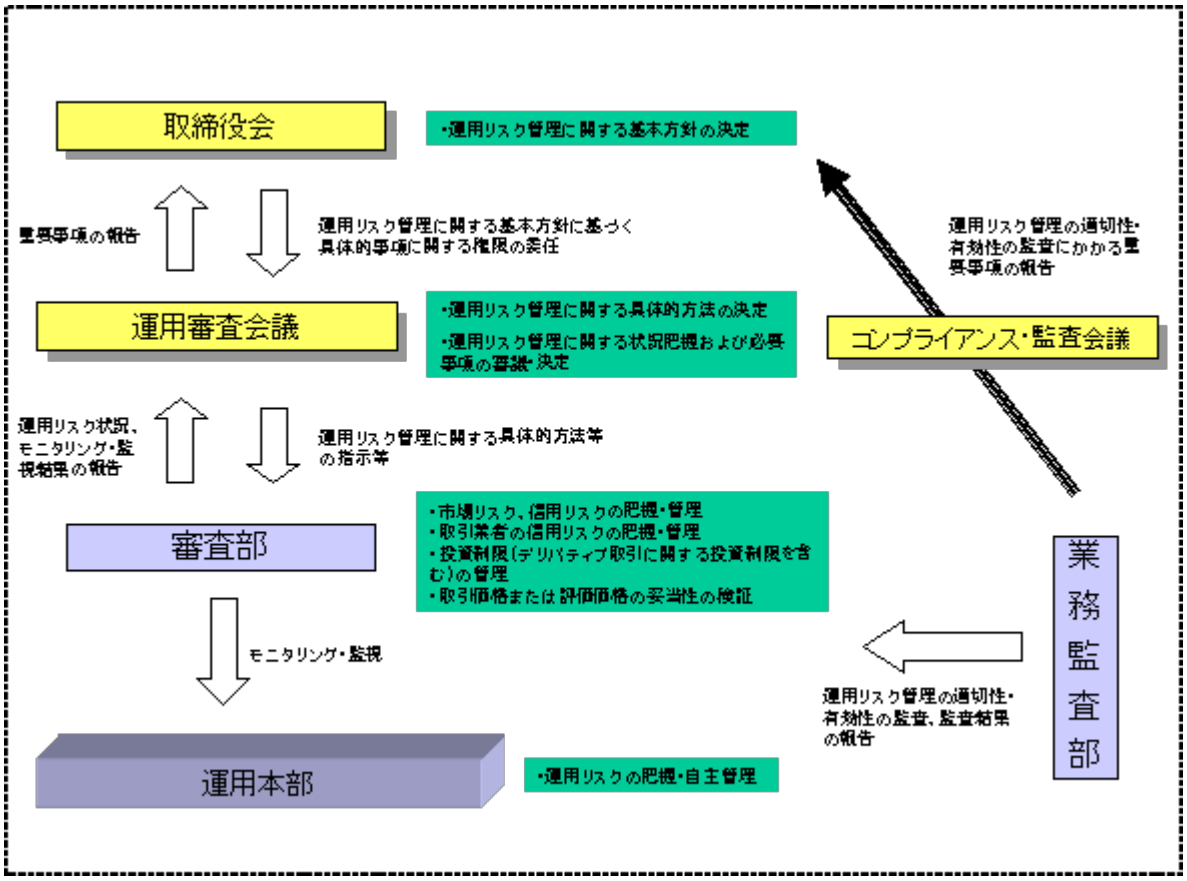
ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込み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ご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.945%（税抜0.90%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合に

は、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.3675% （税抜0.35%）	年0.4935% （税抜0.47%）	年0.084% （税抜0.08%）

④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

(4) 【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

各マザーファンドの投資対象等に応じて、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

① 個人の受益者に対する課税

イ．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、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用されます。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日から15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。

なお、益金不算入制度（当ファンドの場合、対象金額は四分の一となります。）および税額控除制度が適用されます。

③ 確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、前②にかかわらず所得税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

＜注1＞個別元本について

① 受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

② 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行なうつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、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、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、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」（受益者ごとの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取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

（※）税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成21年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		295,338,949	99.71
	内 日本	295,338,949	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		870,024	0.29
純資産総額		296,208,973	100.00

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
株式		94,001,560,310	98.84
	内 日本	94,001,560,310	98.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,100,809,340	1.16
純資産総額		95,102,369,650	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引 （買建）		1,094,445,000	1.15
	内 日本	1,094,445,000	1.15

（参考）日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
国債証券		33,832,000,060	66.39
	内 日本	33,832,000,060	66.39
地方債証券		4,312,824,145	8.46
	内 日本	4,312,824,145	8.46
特殊債券		5,878,923,902	11.54
	内 日本	5,878,923,902	11.54
社債券		6,603,471,840	12.96
	内 日本	6,603,471,840	12.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		334,020,655	0.66
純資産総額		50,961,240,602	100.00

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
株式		46,712,159,951	97.27
	内 オーストラリア	1,958,583,536	4.08
	内 カナダ	2,562,756,008	5.34
	内 スイス	1,940,575,891	4.04

	内 デンマーク	211,948,321	0.44
	内 ユーロ	8,268,602,530	17.22
	内 英国	5,248,635,258	10.93
	内 香港	558,219,791	1.16
	内 ノルウェー	206,079,568	0.43
	内 ニュージーランド	18,636,633	0.04
	内 スウェーデン	630,897,861	1.31
	内 シンガポール	350,446,489	0.73
	内 米国	24,756,778,065	51.55
投資証券		668,262,189	1.39
	内 オーストラリア	133,727,339	0.28
	内 ユーロ	80,052,522	0.17
	内 英国	68,317,143	0.14
	内 香港	17,021,664	0.04
	内 シンガポール	9,322,632	0.02
	内 米国	359,820,889	0.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		640,334,179	1.33
純資産総額		48,020,756,319	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引 （買建）		619,851,420	1.29
	内 米国	619,851,420	1.29

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類		時価（円）	投資比率（%）
国債証券		102,068,635,064	96.26
	内 オーストラリア	781,568,006	0.74
	内 カナダ	2,837,724,572	2.68
	内 スイス	641,612,454	0.61
	内 デンマーク	932,361,527	0.88
	内 ユーロ	52,381,826,339	49.40
	内 英国	7,768,143,208	7.33
	内 マレーシア	563,809,856	0.53
	内 ノルウェー	327,557,784	0.31
	内 ポーランド	916,550,774	0.86
	内 スウェーデン	729,145,042	0.69
	内 シンガポール	405,089,624	0.38
	内 米国	33,783,245,876	31.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,965,812,412	3.74
純資産総額		106,034,447,476	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（%）

為替予約取引　（買建）		2,024,852,267	1.91
	内 日本	2,024,852,267	1.91
為替予約取引　（売建）		14,312,151	△0.01
	内 日本	14,312,151	△0.01

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
（注3）株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっとも近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
（注4）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】(平成21年12月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細　（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トピックス・インデックス・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券 ―	369,663,615	0.44118 163,091,196	0.4769 176,292,577	― ―	59.52%
2	日本債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 ―	50,026,210	1.18402 59,232,119	1.1855 59,306,071	― ―	20.02%
3	外国株式インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 ―	49,380,790	0.84080 41,519,370	0.9125 45,059,970	― ―	15.21%
4	外国債券インデックスマザーファンド 日本	親投資信託受益証券 ―	7,637,255	1.88850 14,422,966	1.9222 14,680,331	― ―	4.96%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.71%
合計	99.71%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

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）トピックス・インデックス・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細　（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,075,200	3,792 4,078,168,441	3,880 4,171,776,000	－ －	4.39%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	5,813,800	515 2,994,977,398	452 2,627,837,600	－ －	2.76%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	667,400	2,874 1,918,634,814	3,110 2,075,614,000	－ －	2.18%
4	キヤノン 日本	株式 電気機器	485,000	3,706 1,797,607,820	3,910 1,896,350,000	－ －	1.99%
5	三菱商事 日本	株式 卸売業	616,400	1,963 1,210,116,540	2,305 1,420,802,000	－ －	1.49%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	325,000	4,281 1,391,624,612	3,650 1,186,250,000	－ －	1.25%
7	武田薬品 日本	株式 医薬品	307,200	3,918 1,203,830,751	3,830 1,176,576,000	－ －	1.24%
8	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	492,100	2,414 1,188,083,087	2,335 1,149,053,500	－ －	1.21%
9	三井住友フィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	423,700	3,290 1,394,392,920	2,645 1,120,686,500	－ －	1.18%
10	みずほフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	6,735,200	183 1,232,887,610	166 1,118,043,200	－ －	1.18%
11	ソ　ニ　ー 日本	株式 電気機器	418,000	2,664 1,113,750,813	2,670 1,116,060,000	－ －	1.17%
12	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先物取引業	1,538,900	674 1,037,798,840	681 1,047,990,900	－ －	1.10%
13	パナソニック 日本	株式 電気機器	764,700	1,412 1,080,375,680	1,325 1,013,227,500	－ －	1.07%
14	任　天　堂 日本	株式 その他製品	44,200	24,448 1,080,640,624	22,040 974,168,000	－ －	1.02%
15	東　芝 日本	株式 電気機器	1,765,000	497 878,255,280	511 901,915,000	－ －	0.95%
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	6,852	148,158 1,015,182,343	129,600 888,019,200	－ －	0.93%
17	三井物産 日本	株式 卸売業	664,100	1,282 851,691,449	1,311 870,635,100	－ －	0.92%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	146,800	6,431 944,196,490	5,870 861,716,000	－ －	0.91%
19	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	2,295,000	351 807,507,100	375 860,625,000	－ －	0.90%
20	三菱地所 日本	株式 不動産業	543,000	1,515 823,101,160	1,478 802,554,000	－ －	0.84%
21	東京海上ＨＤ 日本	株式 保険業	312,100	2,700 842,905,850	2,530 789,613,000	－ －	0.83%
22	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	939,700	617 580,187,714	810 761,157,000	－ －	0.80%
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	338,200	2,019 682,897,864	2,170 733,894,000	－ －	0.77%
24	信越化学 日本	株式 化学	134,500	5,955 801,022,060	5,230 703,435,000	－ －	0.74%
25	小松製作所 日本	株式 機械	363,100	1,783 647,526,460	1,934 702,235,400	－ －	0.74%
26	ファナック 日本	株式 電気機器	80,700	8,177 659,912,130	8,630 696,441,000	－ －	0.73%

27	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	322,600	2,156 695,569,305	2,100 677,460,000	－ －	0.71%
28	ＪＦＥホールディングス 日本	株式 鉄鋼	175,300	3,416 598,839,320	3,650 639,845,000	－ －	0.67%
29	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,287	558,633 718,961,339	493,000 634,491,000	－ －	0.67%
30	セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ 日本	株式 小売業	329,700	2,165 713,813,446	1,897 625,440,900	－ －	0.66%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.84%
合計	98.84%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.40%
建設業	1.92%
食料品	3.41%
繊維製品	0.88%
パルプ・紙	0.38%
化学	5.86%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.63%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	1.23%
鉄鋼	2.72%
非鉄金属	1.22%
金属製品	0.66%
機械	4.64%
電気機器	14.62%
輸送用機器	10.52%
精密機器	1.64%
その他製品	2.13%
電気・ガス業	4.99%
陸運業	3.84%
海運業	0.47%
空運業	0.31%
倉庫・運輸関連業	0.24%
情報・通信業	5.32%
卸売業	4.98%
小売業	3.41%
銀行業	8.92%
証券・商品先物取引業	1.88%

保険業	2.13%
その他金融業	0.66%
不動産業	2.32%
サービス業	1.55%
合計	98.84%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2010年3月	買建	121	1,093,092,030	1,094,445,000	1.15%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（参考）日本債券インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細　（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率
1	２８８　１０年国債 日本	国債証券 ―	709,000,000	105.66 749,132,340	105.76 749,859,670	1.700000 17/09/20	1.47%
2	３０３　１０年国債 日本	国債証券 ―	645,000,000	101.26 653,159,250	101.25 653,088,300	1.400000 19/09/20	1.28%
3	２７８　２年国債 日本	国債証券 ―	593,000,000	100.28 594,694,570	100.31 594,891,670	0.400000 11/03/15	1.17%
4	８５　５年国債 日本	国債証券 ―	577,000,000	100.78 581,531,920	101.15 583,641,270	0.700000 14/09/20	1.15%
5	３０１　１０年国債 日本	国債証券 ―	566,000,000	102.35 579,322,580	102.45 579,917,940	1.500000 19/06/20	1.14%
6	８１　５年国債 日本	国債証券 ―	532,000,000	101.41 539,550,880	101.69 541,012,080	0.800000 14/03/20	1.06%
7	２９６　１０年国債 日本	国債証券 ―	495,000,000	103.16 510,676,650	103.25 511,132,050	1.500000 18/09/20	1.00%
8	２６９　１０年国債 日本	国債証券 ―	491,000,000	103.62 508,799,970	104.05 510,905,140	1.300000 15/03/20	1.00%
9	６９　５年国債 日本	国債証券 ―	475,000,000	101.86 483,838,000	101.99 484,476,250	0.900000 12/12/20	0.95%
10	２８５　２年国債 日本	国債証券 ―	475,000,000	99.97 474,867,000	100.13 475,627,000	0.200000 11/10/15	0.93%
11	２８１　２年国債 日本	国債証券 ―	465,000,000	100.31 466,479,770	100.38 466,799,550	0.400000 11/06/15	0.92%
12	２８４　２年国債 日本	国債証券 ―	401,000,000	100.15 401,637,590	100.28 402,146,860	0.300000 11/09/15	0.79%
13	２８５　１０年国債 日本	国債証券 ―	347,000,000	105.91 367,507,700	106.09 368,132,300	1.700000 17/03/20	0.72%

14	１１３　２０年国債 日本	国債証券 ―	365,000,000	101.11 369,077,030	100.20 365,762,850	2.100000 29/09/20	0.72%
15	２８９　１０年国債 日本	国債証券 ―	350,000,000	103.93 363,773,020	104.06 364,234,500	1.500000 17/12/20	0.71%
16	８４　５年国債 日本	国債証券 ―	345,000,000	100.88 348,067,800	101.20 349,143,450	0.700000 14/06/20	0.69%
17	２８４　１０年国債 日本	国債証券 ―	318,000,000	105.88 336,700,160	106.17 337,630,140	1.700000 16/12/20	0.66%
18	２８６　１０年国債 日本	国債証券 ―	310,000,000	106.52 330,222,300	106.69 330,754,500	1.800000 17/06/20	0.65%
19	２９９　１０年国債 日本	国債証券 ―	323,000,000	100.87 325,835,940	100.99 326,213,850	1.300000 19/03/20	0.64%
20	２７９　２年国債 日本	国債証券 ―	322,000,000	100.30 322,973,670	100.34 323,101,240	0.400000 11/04/15	0.63%
21	２８２　１０年国債 日本	国債証券 ―	300,000,000	105.87 317,610,000	106.19 318,597,000	1.700000 16/09/20	0.63%
22	６６　５年国債 日本	国債証券 ―	305,000,000	102.29 311,984,500	102.43 312,423,700	1.100000 12/09/20	0.61%
23	７７　５年国債 日本	国債証券 ―	292,000,000	102.30 298,744,820	102.48 299,267,880	1.000000 13/09/20	0.59%
24	２７０　１０年国債 日本	国債証券 ―	285,000,000	103.65 295,406,450	104.05 296,548,200	1.300000 15/06/20	0.58%
25	２９７　１０年国債 日本	国債証券 ―	289,000,000	102.04 294,918,720	102.15 295,222,170	1.400000 18/12/20	0.58%
26	２８３　２年国債 日本	国債証券 ―	287,000,000	100.16 287,459,200	100.27 287,780,640	0.300000 11/08/15	0.56%
27	６４　５年国債 日本	国債証券 ―	277,000,000	103.14 285,708,090	103.24 285,994,190	1.500000 12/06/20	0.56%
28	２９３　１０年国債 日本	国債証券 ―	265,000,000	105.90 280,655,260	105.98 280,862,900	1.800000 18/06/20	0.55%
29	２９８　１０年国債 日本	国債証券 ―	277,000,000	101.18 280,287,290	101.29 280,598,230	1.300000 18/12/20	0.55%
30	２８３　１０年国債 日本	国債証券 ―	260,000,000	106.54 277,027,400	106.87 277,867,200	1.800000 16/09/20	0.55%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	66.39%
地方債証券	8.46%
特殊債券	11.54%
社債券	12.96%
合計	99.34%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

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）外国株式インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細　　（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	EXXON MOBIL CORP 米国	株式 石油・石炭製品	123,500	6,895 851,597,585	6,340 783,010,254	－ －	1.63%
2	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	202,900	2,691 546,036,770	2,889 586,214,013	－ －	1.22%
3	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	458,500	1,034 474,520,627	1,045 479,492,244	－ －	1.00%
4	APPLE INC 米国	株式 電気機器	22,800	18,474 421,214,929	19,258 439,084,908	－ －	0.91%
5	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製品	492,300	855 421,134,166	886 436,427,150	－ －	0.91%
6	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	96,350	4,281 412,558,589	4,500 433,575,241	－ －	0.90%
7	JOHNSON & JOHNSON 米国	株式 医薬品	70,700	5,792 409,506,348	5,980 422,854,862	－ －	0.88%
8	PROCTER & GAMBLE CO 米国	株式 化学	74,037	5,754 426,039,105	5,671 419,902,178	－ －	0.87%
9	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	33,900	11,576 392,459,283	12,143 411,660,752	－ －	0.86%
10	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	150,095	2,485 373,102,999	2,610 391,765,061	－ －	0.82%
11	GENERAL ELECTRIC CO 米国	株式 電気機器	273,700	1,468 401,811,854	1,422 389,207,969	－ －	0.81%
12	JPMORGAN CHASE & CO 米国	株式 銀行業	99,720	3,806 379,583,482	3,821 381,052,956	－ －	0.79%
13	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製品	51,018	7,199 367,301,897	7,111 362,791,090	－ －	0.76%
14	GOOGLE INC-CL A 米国	株式 サービス業	6,200	53,395 331,054,555	57,046 353,689,788	－ －	0.74%
15	PFIZER INC 米国	株式 医薬品	204,563	1,681 343,915,321	1,709 349,675,083	－ －	0.73%
16	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製品	55,150	5,526 304,768,827	5,994 330,575,718	－ －	0.69%
17	BANCO SANTANDER SA ユーロ	株式 銀行業	213,550	1,528 326,423,988	1,537 328,397,190	－ －	0.68%
18	CISCO SYSTEMS 米国	株式 電気機器	146,400	2,153 315,242,827	2,219 324,950,904	－ －	0.68%
19	BANK OF AMERICA CORP 米国	株式 銀行業	223,501	1,424 318,441,319	1,392 311,236,765	－ －	0.65%
20	WELLS FARGO & CO 米国	株式 銀行業	123,972	2,496 309,519,556	2,457 304,627,470	－ －	0.63%
21	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	86,200	3,323 286,467,529	3,531 304,411,645	－ －	0.63%
22	WAL-MART STORES 米国	株式 小売業	59,300	5,031 298,363,384	4,983 295,523,388	－ －	0.62%
23	HEWLETT-PACKARD CO 米国	株式 電気機器	60,400	4,519 272,968,559	4,841 292,438,499	－ －	0.61%

24	ROCHE HOLDING AG-GENUS スイス	株式 医薬品	18,500	14,772 273,289,807	15,774 291,826,271	— —	0.61%
25	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	1,365,237	202 276,866,677	210 287,669,279	— —	0.60%
26	COCA COLA CO 米国	株式 食料品	54,000	5,266 284,379,012	5,317 287,164,116	— —	0.60%
27	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	108,027	2,548 275,352,181	2,603 281,269,899	— —	0.59%
28	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	54,900	4,934 270,903,254	5,045 276,988,233	— —	0.58%
29	MERCK & CO INC 米国	株式 医薬品	78,321	3,342 261,772,983	3,416 267,615,808	— —	0.56%
30	GLAXOSMITHKLINE PLC 英国	株式 医薬品	135,202	1,874 253,384,596	1,954 264,280,728	— —	0.55%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.27%
投資証券	1.39%
合計	98.67%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.24%
鉱業	3.45%
建設業	0.78%
食料品	6.32%
繊維製品	0.19%
パルプ・紙	0.25%
化学	3.99%
医薬品	7.19%
石油・石炭製品	8.13%
ゴム製品	0.11%
ガラス・土石製品	0.30%
鉄鋼	0.64%
非鉄金属	0.10%
金属製品	0.33%
機械	2.28%
電気機器	8.34%
輸送用機器	1.67%
精密機器	0.42%
その他製品	0.79%
電気・ガス業	2.87%
陸運業	0.88%
海運業	0.21%
空運業	0.12%

倉庫・運輸関連業	0.00%
情報・通信業	4.89%
卸売業	0.34%
小売業	4.61%
銀行業	11.98%
証券・商品先物取引業	0.79%
保険業	3.96%
その他金融業	1.91%
不動産業	0.52%
サービス業	10.30%
消費材	0.30%
石油他	2.68%
建設資材	0.39%
水道	0.17%
持株会社	0.26%
コング゛ロマリット	1.03%
電力	1.50%
プ゜ランテーション	0.04%
その他製造	1.67%
新聞・出版	0.32%
合計	97.27%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	米国	S&P500 2010年3月	買建	24	613,621,316	619,851,420	1.29%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該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または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細　（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率
1	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	644,607,900	104.78 675,478,172	100.25 646,264,542	3.750000 18/11/15	0.61%
2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	639,818,700	96.60 618,071,262	92.25 590,277,538	2.750000 19/02/15	0.56%
3	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	523,116,000	103.22 539,991,722	103.46 541,215,814	3.750000 16/08/01	0.51%

4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	538,048,200	103.39 556,331,078	98.55 530,268,023	3.625000 19/08/15	0.50%
5	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	488,677,550	108.92 532,267,587	108.05 528,016,093	5.250000 12/06/07	0.50%
6	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	495,264,000	101.64 503,416,045	101.13 500,895,152	3.000000 15/10/25	0.47%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	485,090,700	103.45 501,860,285	101.02 490,053,178	2.625000 14/06/30	0.46%
8	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	482,143,500	100.72 485,624,576	100.01 482,215,822	1.000000 11/09/30	0.45%
9	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	464,772,000	104.02 483,479,073	103.63 481,652,519	4.250000 19/02/01	0.45%
10	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	483,248,700	100.87 487,477,126	99.63 481,470,345	1.375000 12/10/15	0.45%
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	411,576,000	116.19 478,218,386	116.81 480,770,157	6.000000 31/05/01	0.45%
12	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	452,760,000	107.22 485,453,800	106.15 480,627,378	4.250000 19/04/25	0.45%
13	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	478,827,900	100.60 481,743,962	100.28 480,173,406	0.875000 11/02/28	0.45%
14	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	439,032,000	107.56 472,240,380	107.19 470,633,523	5.000000 12/01/04	0.44%
15	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	378,576,000	122.36 463,229,379	122.60 464,168,248	6.500000 27/11/01	0.44%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	452,118,900	100.76 455,559,525	100.12 452,697,612	1.000000 11/08/31	0.43%
17	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	454,053,000	101.91 462,757,196	99.58 452,186,842	2.250000 14/05/31	0.43%
18	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	424,116,000	105.90 449,138,844	105.50 447,442,380	4.500000 19/03/01	0.42%
19	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	438,856,500	101.48 445,351,576	100.28 440,107,241	1.500000 12/07/15	0.42%
20	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	429,792,000	103.18 443,485,173	101.49 436,225,986	3.500000 19/07/04	0.41%
21	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	386,100,000	112.91 435,968,676	112.02 432,547,830	5.000000 16/10/25	0.41%
22	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	412,335,420	110.71 456,496,543	104.38 430,395,711	4.750000 38/12/07	0.41%
23	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	397,584,000	106.82 424,711,156	106.67 424,106,829	5.000000 12/02/01	0.40%
24	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	387,420,000	108.71 421,168,156	108.36 419,816,060	5.000000 12/07/04	0.40%
25	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	430,848,000	98.29 423,510,659	96.67 416,517,996	4.000000 38/10/25	0.39%
26	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	411,963,300	100.58 414,389,764	100.38 413,553,478	0.875000 10/12/31	0.39%
27	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	393,888,000	103.06 405,952,789	104.12 410,131,941	5.000000 39/08/01	0.39%
28	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	379,632,000	107.78 409,186,351	107.48 408,062,640	4.750000 13/02/01	0.38%

29	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 ―	366,168,000	108.21 396,256,025	107.89 395,073,302	4.500000 13/01/04	0.37%
30	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 ―	389,136,000	100.52 391,186,747	100.51 391,132,268	1.500000 11/09/12	0.37%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.26%
合計	96.26%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2010年2月	買建	2,019,000	185,178,642	185,869,140	0.18%
		米ドル買/円売 2010年1月	買建	5,943,000	517,214,992	547,290,870	0.52%
		スウェーデンクローナ売/円買 2010年1月	売建	277,500	3,535,350	3,540,900	△0.00%
		スウェーデンクローナ買/円売 2010年2月	買建	1,100,000	14,005,199	14,036,000	0.01%
		ポーランドズロチ買/円売 2010年2月	買建	320,000	10,156,200	10,208,000	0.01%
		英ポンド買/円売 2010年2月	買建	630,000	92,317,731	92,257,199	0.09%
		ユーロ買/円売 2010年2月	買建	3,910,000	515,206,090	515,885,400	0.49%
		ユーロ買/円売 2010年1月	買建	4,524,000	593,004,153	597,122,759	0.56%
		デンマーククローネ買/円売 2010年2月	買建	513,000	9,084,628	9,090,360	0.01%
		デンマーククローネ買/円売 2010年1月	買建	1,252,136	22,072,340	22,200,379	0.02%
		スイスフラン売/円買 2010年1月	売建	121,489	10,772,466	10,771,251	△0.01%
		スイスフラン買/円売 2010年2月	買建	71,000	6,291,542	6,294,150	0.01%
		カナダドル買/円売 2010年2月	買建	177,000	15,559,893	15,581,310	0.01%
		オーストラリアドル買/円売 2010年2月	買建	110,000	8,970,300	9,016,700	0.01%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
（注3）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	1口当たりの純資産額（分配落）（円）	1口当たりの純資産額（分配付）（円）
設定時（平成12年4月28日）	10,000,000	－	1.0000	－
第1計算期間末（平成12年11月30日）	34,986,791	34,986,791	0.8845	0.8845
第2計算期間末（平成13年11月30日）	34,897,571	34,897,571	0.7663	0.7663
第3計算期間末（平成14年12月2日）	53,496,322	53,496,322	0.6894	0.6894
第4計算期間末（平成15年12月1日）	81,148,495	81,148,495	0.7591	0.7591
第5計算期間末（平成16年11月30日）	113,936,928	113,936,928	0.8103	0.8103
第6計算期間末（平成17年11月30日）	191,331,527	191,331,527	1.0374	1.0374
第7計算期間末（平成18年11月30日）	238,864,496	238,864,496	1.0952	1.0952
第8計算期間末（平成19年11月30日）	283,009,107	283,009,107	1.0876	1.0876
第9計算期間末（平成20年12月1日）	219,693,052	219,693,052	0.6871	0.6871
平成20年12月末日	227,494,912	－	0.7014	－
平成21年1月末日	217,206,581	－	0.6583	－
2月末日	210,324,870	－	0.6416	－
3月末日	218,693,267	－	0.6591	－
4月末日	236,544,510	－	0.7030	－
5月末日	254,750,190	－	0.7392	－
6月末日	268,458,598	－	0.7579	－
7月末日	282,172,749	－	0.7753	－
8月末日	287,905,311	－	0.7855	－
9月末日	286,387,395	－	0.7626	－
10月末日	287,085,085	－	0.7569	－
第10計算期間末（平成21年11月30日）	275,496,805	275,496,805	0.7254	0.7254
12月末日	296,208,973	－	0.7699	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000

③　【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△11.6
第2計算期間	△13.4
第3計算期間	△10.0
第4計算期間	10.1
第5計算期間	6.7
第6計算期間	28.0
第7計算期間	5.6
第8計算期間	△0.7
第9計算期間	△36.8
第10計算期間	5.6

６ 【手続等の概要】

(1) 申込（販売）手続等

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンド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かかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

(2) 換金（解約）手続等

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

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その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当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、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて計算される価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

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かかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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。

7 【管理及び運営の概要】

(1) 資産の評価

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・外国の株式：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

(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。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 計算期間

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

上記にかかわらず、上記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。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) その他

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは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、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.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信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.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会社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3.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2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、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、前3.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なうことが困難な場合

には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 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、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、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出ます。

2. 委託会社は、前1.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信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.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会社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3.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2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して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取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

   http://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、

自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

(6) 受益者の権利等

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、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。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払います。

上記にかかわらず、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ついては、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再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、原則として信託終了日から起算して5営業日までに、受益者に支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「6 手続等の概要」をご参照下さい。

第２ 【財務ハイライト情報】

本項の記載事項は、「ファンドの詳細情報」に記載の「財務諸表」（当該「財務諸表」については、あずさ監査法人により監査証明を受けており、当該監査証明にかかる監査報告書は、当該「財務諸表」の箇所に添付しております。）から抜粋して記載したものです。

ダイワライフスタイル７５

１ 【貸借対照表】

	第9期 平成20年12月1日現在	第10期 平成21年11月30日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,038,381	2,238,900
親投資信託受益証券	219,052,623	274,688,866
未収入金	101,000	―
流動資産合計	221,192,004	276,927,766
資産合計	221,192,004	276,927,766
負債の部		
流動負債		
未払解約金	211,430	113,559
未払受託者報酬	113,456	116,104
未払委託者報酬	1,163,386	1,190,502
その他未払費用	10,680	10,796
流動負債合計	1,498,952	1,430,961
負債合計	1,498,952	1,430,961
純資産の部		
元本等		
元本	319,733,910	379,779,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△100,040,858	△104,282,287
（分配準備積立金）	35,833,635	33,432,585
元本等合計	219,693,052	275,496,805
純資産合計	219,693,052	275,496,805
負債純資産合計	221,192,004	276,927,766

２ 【損益及び剰余金計算書】

	第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月 2日 至 平成21年11月30日

	金 額（円）	金 額（円）
営業収益		
受取利息	8,176	1,605
有価証券売買等損益	△118,232,298	14,439,243
営業収益合計	△118,224,122	14,440,848
営業費用		
受託者報酬	232,327	210,359
委託者報酬	2,382,212	2,156,953
その他費用	21,601	19,542
営業費用合計	2,636,140	2,386,854
営業利益又は営業損失（△）	△120,860,262	12,053,994
経常利益又は経常損失（△）	△120,860,262	12,053,994
当期純利益又は当期純損失（△）	△120,860,262	12,053,994
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（△）	△4,013,218	161,843
期首剰余金又は期首欠損金（△）	22,806,712	△100,040,858
剰余金増加額又は欠損金減少額	―	7,379,100
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	―	7,379,100
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,000,526	23,512,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,395,280	―
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,605,246	23,512,680
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△100,040,858	△104,282,287

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月 2日 至 平成21年11月30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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成20年11月30日が休日のため、当計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	計算期間末日の取扱い 平成20年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

第３ 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 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等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

① 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かかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①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 上記①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かかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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。

(6) 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。

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

(9) 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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第４ 【ファンドの詳細情報の項目】

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 平成 年 月 日
Ⅰ 資産総額
Ⅱ 負債総額
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）
Ⅳ 発行済数量
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）
第５ 設定及び解約の実績

第三部 【ファンドの詳細情報】

第１ 【ファンドの沿革】

平成12年 4月28日　　信託契約締結、当初設定、運用開始
平成12年12月 1日　　ファンドの名称の変更（従来は「ライフスタイル７５」）

第２ 【手続等】

１ 【申込（販売）手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

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

２ 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、販売会社が定める単位（別に定める契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

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その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当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、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて計算される価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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かかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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。

第３ 【管理及び運営】

１ 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいい

ます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・外国の株式：海外取引所に上場されている株式は原則として海外取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場、海外の店頭市場に登録されている株式は原則として当該海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3.価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

(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。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

上記にかかわらず、上記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。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは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、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.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信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.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会社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3.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2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、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、前3.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なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 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、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、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出ます。

2. 委託会社は、前1.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信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.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会社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3.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2分の1を超えると

きは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をし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知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して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取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

http://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

2 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、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。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日後1か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、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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

上記にかかわらず、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、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分

配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、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みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から起算して5営業日まで）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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。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会社が当ファンドの償還をするのと引換えに、当該償還にかか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。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受託会社は、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、償還金については受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に収益分配金および償還金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

受益者が、収益分配金については支払開始日から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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「第２　手続等」の「２　換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第４ 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成19年12月1日から平成20年12月1日まで）及び第10期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

ダイワライフスタイル７５

ダイワライフスタイル７５

(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 平成20年12月1日現在	第10期 平成21年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,038,381	2,238,900
親投資信託受益証券	219,052,623	274,688,866
未収入金	101,000	―
流動資産合計	221,192,004	276,927,766
資産合計	221,192,004	276,927,766
負債の部		
流動負債		
未払解約金	211,430	113,559
未払受託者報酬	113,456	116,104
未払委託者報酬	1,163,386	1,190,502
その他未払費用	10,680	10,796
流動負債合計	1,498,952	1,430,961
負債合計	1,498,952	1,430,961
純資産の部		
元本等		
元本	※1 319,733,910	※1 379,779,092
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △100,040,858	※2 △104,282,287
（分配準備積立金）	35,833,635	33,432,585
元本等合計	219,693,052	275,496,805
純資産合計	219,693,052	275,496,805
負債純資産合計	221,192,004	276,927,766

(2) 【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
営業収益		
受取利息	8,176	1,605
有価証券売買等損益	△118,232,298	14,439,243
営業収益合計	△118,224,122	14,440,848
営業費用		
受託者報酬	232,327	210,359
委託者報酬	2,382,212	2,156,953
その他費用	21,601	19,542
営業費用合計	2,636,140	2,386,854
営業利益又は営業損失（△）	△120,860,262	12,053,994
経常利益又は経常損失（△）	△120,860,262	12,053,994
当期純利益又は当期純損失（△）	△120,860,262	12,053,994
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（△）	△4,013,218	161,843
期首剰余金又は期首欠損金（△）	22,806,712	△100,040,858
剰余金増加額又は欠損金減少額	―	7,379,100
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	―	7,379,100
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,000,526	23,512,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,395,280	―
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,605,246	23,512,680
分配金	― ※1	― ※1
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△100,040,858	△104,282,287

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成20年11月30日が休日のため、当計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	計算期間末日の取扱い 平成20年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第9期 平成20年12月1日現在	第10期 平成21年11月30日現在
1. ※1 期首元本額	260,202,395円	319,733,910円
期中追加設定元本額	79,284,787円	83,697,312円
期中一部解約元本額	19,753,272円	23,652,130円
2. 計算期間末日における受益権の総数	319,733,910口	379,779,092口
3. ※2 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100,040,858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104,282,287円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（45,085,776円）及び分配準備積立金（35,833,635円）より分配対象額は80,919,411円（1万口当たり2,530.84円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,366円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（62,684,528円）及び分配準備積立金（33,431,219円）より分配対象額は96,117,113円（1万口当たり2,530.87円）でありますが、分配を行っておりません。

（有価証券関係に関する注記）
売買目的有価証券

種 類	第9期 平成20年12月1日現在		第10期 平成21年11月30日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	219,052,623	△118,184,143	274,688,866	13,946,085
合計	219,052,623	△118,184,143	274,688,866	13,946,085

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第9期 自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	第9期 平成20年12月1日現在	第10期 平成21年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6871円 (6,871円)	0.7254円 (7,254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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	364,827,526	160,852,456	
	日本債券インデックスマザーファンド	48,487,347	57,409,018	
	外国株式インデックスマザーファンド	50,670,108	42,603,426	
	外国債券インデックスマザーファンド	7,325,120	13,823,966	
親投資信託受益証券 合計		471,310,101	274,688,866	
合計		471,310,101	274,688,866	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券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。

次へ

（参考）

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

次へ

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		平成20年12月1日現在 金 額（円）	平成21年11月30日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,683,227,210	1,698,124,245
株式	※3	67,436,943,546	85,334,744,080
新株予約権証券		―	1,150,000
派生商品評価勘定		82,740,650	2,446,077
未収配当金		283,274,714	427,340,176
前払金		―	178,765,000
差入委託証拠金		252,535,000	49,590,000
流動資産合計		71,738,721,120	87,692,159,578
資産合計		71,738,721,120	87,692,159,578
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,700,069	105,037,520
前受金		91,480,000	―
未払金		1,513,617,819	43,680,000
未払解約金		100,000	23,100,000
流動負債合計		1,614,897,888	171,817,520
負債合計		1,614,897,888	171,817,520
純資産の部			
元本等			
元本	※1	164,435,605,491	198,496,539,943
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△94,311,782,259	△110,976,197,885
元本等合計		70,123,823,232	87,520,342,058
純資産合計		70,123,823,232	87,520,342,058
負債純資産合計		71,738,721,120	87,692,159,578

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	先物取引 同左
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
1．※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	120,270,950,664円	164,435,605,491円
同期中における追加設定元本額	57,187,221,127円	44,844,778,480円
同期中における一部解約元本額	13,022,566,300円	10,783,844,028円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信１号	1,801,760,523円	1,865,599,483円
トピックス・インデックスファンド	12,514,811,465円	12,114,450,876円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	34,927,888,508円	39,228,078,906円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	1,154,238,593円	1,122,437,137円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	403,763,245円	396,469,094円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	6,923,021,379円	6,785,644,364円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	425,837,019円	434,024,202円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	8,981,557,005円	9,047,353,050円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	44,231,742,592円	50,336,517,999円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,726,533,172円	1,815,398,970円
ダイワ・ライフ・バランス５０	12,698,043円	109,223,884円
ダイワ・ライフ・バランス７０	22,622,323円	80,039,516円
年金ダイワ日本株式インデックス	405,512,158円	820,031,920円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,186,645円	13,399,559円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	3,780,050円	6,247,286円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	725,197円	1,141,095円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	548,870,842円	501,523,853円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	3,890,420,271円	3,555,428,274円

ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	2,137,601,673円	1,997,968,426円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	118,307,032円	113,355,088円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	672,574,719円	765,792,706円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	372,661,933円	363,504,608円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	4,354,438,935円	4,311,225,285円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	579,817,702円	603,930,494円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	22,032,367,710円	37,306,738,546円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	1,652,791,261円	2,590,086,746円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	3,502,844,882円	6,235,966,966円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	2,752,784,244円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	56,722円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	68,052円
ダイワライフスタイル２５	127,077,609円	148,914,351円
ダイワライフスタイル５０	356,171,358円	417,210,659円
ダイワライフスタイル７５	305,174,282円	364,827,526円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	10,243,807,365円	12,291,100,056円
計	164,435,605,491円	198,496,539,943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	164,435,605,491口	198,496,539,943口
3．※2 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94,311,782,259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110,976,197,885円であります。
4．※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　63,955,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　56,500,000円

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月1日現在		平成21年11月30日現在	
	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	67,436,943,546	△23,728,766,477	85,334,744,080	△10,733,060,054
新株予約権証券	－	－	1,150,000	1,150,000
合計	67,436,943,546	△23,728,766,477	85,335,894,080	△10,731,910,054

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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（平成20年9月20日から平成20年12月1日まで、及び平成21年9月25日から平成21年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

Ⅰ 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ 取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	平成20年12月1日 現在				平成21年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 株価指数先物取引 買 建	3,006,165,000	－	3,080,160,000	73,995,000	2,881,985,000	－	2,780,400,000	△101,585,000
合計	3,006,165,000	－	3,080,160,000	73,995,000	2,881,985,000	－	2,780,400,000	△101,585,000

（注） 1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4265円 (4,265円)	0.4409円 (4,409円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備考
		単 価	金 額	
極　洋	49,000	173	8,477,000	
日本水産	98,000	246	24,108,000	
マルハニチロホールディングス	195,000	126	24,570,000	
サカタのタネ	17,200	1,372	23,598,400	
ホクト	9,600	1,886	18,105,600	
ショーボンドＨＤ	9,100	1,603	14,587,300	
日鉄鉱業	26,000	380	9,880,000	
三井松島	46,000	157	7,222,000	
国際石油開発帝石	424	674,000	285,776,000	
関東天然瓦斯	12,000	467	5,604,000	
石油資源開発	14,700	3,930	57,771,000	
間組	55,400	80	4,432,000	
東急建設	35,180	232	8,161,760	
コムシスホールディングス	39,500	842	33,259,000	
ミサワホーム	15,600	270	4,212,000	
高松コンストラクションＧＰ	7,700	1,260	9,702,000	
東建コーポレーション	3,920	2,645	10,368,400	
大成建設	397,000	151	59,947,000	
大　林　組	242,000	288	69,696,000	
清水建設	245,000	299	73,255,000	
長谷工コーポレーシヨン	461,000	64	29,504,000	
鹿島建設	384,000	167	64,128,000	
不動テトラ	83,000	51	4,233,000	
鉄建建設	68,000	80	5,440,000	
安藤建設	47,000	101	4,747,000	
太平工業	16,000	308	4,928,000	
西松建設	116,000	108	12,528,000	
大豊建設	40,000	58	2,320,000	
前田建設	65,000	224	14,560,000	
奥　村　組	84,000	298	25,032,000	
東鉄工業	14,000	482	6,748,000	
淺沼組	43,000	65	2,795,000	
戸田建設	101,000	259	26,159,000	
熊　谷　組	87,000	53	4,611,000	
青木あすなろ建設	9,500	454	4,313,000	

北野建設	32,000	224	7,168,000	
三井ホーム	14,000	435	6,090,000	
矢作建設	15,000	614	9,210,000	
大東建託	37,100	4,110	152,481,000	
ＮＩＰＰＯ	20,000	636	12,720,000	
前田道路	26,000	685	17,810,000	
日本道路	34,000	176	5,984,000	
東亜建設	87,000	94	8,178,000	
五洋建設	105,500	86	9,073,000	
住友林業	64,700	647	41,860,900	
日本基礎技術	24,100	181	4,362,100	
パナホーム	32,000	574	18,368,000	
大和ハウス	217,000	869	188,573,000	
ライト工業	30,400	180	5,472,000	
積水ハウス	262,000	762	199,644,000	
コミューチュア	11,000	573	6,303,000	
ユアテック	18,000	501	9,018,000	
西部電気工業	16,000	343	5,488,000	
中電工	12,500	1,224	15,300,000	
関　電　工	39,000	587	22,893,000	
大明	12,800	657	8,409,600	
きんでん	55,000	776	42,680,000	
東京エネシス	12,000	593	7,116,000	
トーエネック	17,000	506	8,602,000	
日本電設工業	18,000	672	12,096,000	
協和エクシオ	31,400	745	23,393,000	
日本工営	35,000	300	10,500,000	
東電通	31,000	168	5,208,000	
九電工	20,000	514	10,280,000	
三機工業	22,000	629	13,838,000	
日　揮	87,000	1,617	140,679,000	
中外炉工業	34,000	220	7,480,000	
太平電業	12,000	857	10,284,000	
高砂熱学	25,500	740	18,870,000	
三晃金属	17,000	197	3,349,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	7,700	1,067	8,215,900	
大　氣　社	13,000	1,260	16,380,000	
ダイダン	16,000	448	7,168,000	
日比谷総合設	14,100	805	11,350,500	
東芝プラントシステム	13,000	1,114	14,482,000	
日本製粉	55,000	468	25,740,000	
日清製粉Ｇ本社	84,500	1,170	98,865,000	
昭和産業	44,000	296	13,024,000	
協同飼料	50,000	114	5,700,000	
中部飼料	11,000	745	8,195,000	
日本配合飼料	45,000	99	4,455,000	
ユニ・チャーム　ペットケア	5,500	3,150	17,325,000	
日本甜菜糖	54,000	220	11,880,000	
三井製糖	35,000	300	10,500,000	
日本Ｍ＆Ａセンター	18	338,000	6,084,000	
アコーディア・ゴルフ	225	87,400	19,665,000	
パソナグループ	101	68,700	6,938,700	
テンプホールディングス	13,700	829	11,357,300	
森永製菓	98,000	196	19,208,000	
中　村　屋	26,000	469	12,194,000	

江崎グリコ	33,000	1,003	33,099,000	
名糖産業	5,000	1,230	6,150,000	
山崎製パン	67,000	1,067	71,489,000	
森永乳業	80,000	396	31,680,000	
ヤクルト	49,500	2,695	133,402,500	
明治ホールディングス	27,600	3,440	94,944,000	
雪印メグミルク	18,500	1,545	28,582,500	
プリマハム	61,000	91	5,551,000	
日本ハム	65,000	1,070	69,550,000	
伊藤ハム	58,000	325	18,850,000	
丸大食品	40,000	292	11,680,000	
米　久	8,500	813	6,910,500	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,500	810	6,075,000	
スタジオアリス	5,200	825	4,290,000	
ＮＥＣフィールディング	8,600	1,161	9,984,600	
新日鉄ソリューションズ	7,800	1,494	11,653,200	
綜合警備保障	29,700	993	29,492,100	
日本駐車場開発	1,250	4,190	5,237,500	
カカクコム	54	317,000	17,118,000	
新日本科学	5,400	482	2,602,800	
ソネット・エムスリー	36	286,600	10,317,600	
ディー・エヌ・エー	101	473,000	47,773,000	
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	11,060	4,220	46,673,200	
ぐるなび	49	187,500	9,187,500	
パシフィックゴルフＧＲＰ	199	59,900	11,920,100	
サッポロホールディングス	134,000	418	56,012,000	
アサヒビール	161,100	1,536	247,449,600	
キリンＨＤ	380,000	1,412	536,560,000	
宝ホールディングス	75,000	489	36,675,000	
オエノンホールディングス	34,000	172	5,848,000	
メルシャン	34,000	200	6,800,000	
養　命　酒	9,000	835	7,515,000	
三国コカ・コーラ	12,600	716	9,021,600	
コカ・コーラウエスト	22,400	1,600	35,840,000	
コカコーラセントラルジャパン	11,100	1,164	12,920,400	
ダイドードリンコ	4,200	2,840	11,928,000	
伊　藤　園	25,700	1,395	35,851,500	
キーコーヒー	8,500	1,590	13,515,000	
日清オイリオグループ	36,000	452	16,272,000	
不二製油	22,600	1,458	32,950,800	
Ｊ－オイルミルズ	36,000	280	10,080,000	
ローソン	22,600	4,280	96,728,000	
サンエー	3,200	3,330	10,656,000	
カワチ薬品	5,600	1,678	9,396,800	
エービーシー・マート	8,500	2,695	22,907,500	
アスクル	7,200	1,607	11,570,400	
ゲオ	142	96,600	13,717,200	
ポイント	7,410	4,800	35,568,000	
伊藤忠食品	2,400	2,990	7,176,000	
くらコーポレーション	24	285,500	6,852,000	
エレマテック	6,400	922	5,900,800	
ＪＡＬＵＸ	4,500	878	3,951,000	
エディオン	33,000	704	23,232,000	
サーラコーポレーション	14,000	552	7,728,000	
バルス	51	65,000	3,315,000	

双日	540,000	151	81,540,000	
アルフレッサホールディングス	19,300	3,760	72,568,000	
ハニーズ	7,260	503	3,651,780	
キッコーマン	71,000	1,005	71,355,000	
味　の　素	234,000	811	189,774,000	
キユーピー	46,800	997	46,659,600	
ハウス食品	33,600	1,370	46,032,000	
カ　ゴ　メ	33,200	1,686	55,975,200	
焼津水産化工	6,400	1,110	7,104,000	
アリアケジャパン	8,100	1,420	11,502,000	
ニチレイ	100,000	323	32,300,000	
横浜冷凍	20,000	600	12,000,000	
東洋水産	40,000	2,355	94,200,000	
日清食品ＨＤ	32,500	3,170	103,025,000	
永　谷　園	10,000	864	8,640,000	
フジッコ	10,000	1,044	10,440,000	
ロックフィールド	6,400	1,162	7,436,800	
日本たばこ産業	1,928	255,800	493,182,400	
わらべや日洋	5,900	1,055	6,224,500	
片倉工業	11,100	815	9,046,500	
グ　ン　ゼ	60,000	316	18,960,000	
昭　栄	15,700	718	11,272,600	
神　栄	25,000	116	2,900,000	
アルペン	6,200	1,454	9,014,800	
ビックカメラ	215	30,950	6,654,250	
ＤＣＭ　ＪＡＰＡＮ　ＨＬＤＧＳ	41,200	539	22,206,800	
あい　ホールディングス	24,100	287	6,916,700	
Ｊ．　フロント　リテイリング	195,000	363	70,785,000	
ドトール・日レスＨＤ	13,200	1,242	16,394,400	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	14,000	2,220	31,080,000	
ココカラファイン　ＨＤ	6,800	1,809	12,301,200	
三越伊勢丹ＨＤ	142,900	742	106,031,800	
東洋紡績	299,000	131	39,169,000	
ユニチカ	204,000	63	12,852,000	
富士紡ホールディングス	44,000	135	5,940,000	
日清紡ホールディングス	58,000	707	41,006,000	
倉敷紡績	87,000	133	11,571,000	
ダイワボウＨＤ	60,000	195	11,700,000	
シキボウ	56,000	145	8,120,000	
日東紡績	81,000	142	11,502,000	
トヨタ紡織	24,300	1,700	41,310,000	
クリエイトＳＤＨ	3,600	1,980	7,128,000	
バイタルＫＳＫＨＤ	13,200	550	7,260,000	
ＵＫＣホールディングス	5,300	1,107	5,867,100	
日本毛織	31,000	507	15,717,000	
ダイドーリミテツド	13,100	593	7,768,300	
野村不動産ＨＬＤＧＳ	39,200	1,342	52,606,400	
ヒューリック	24,400	584	14,249,600	
日本コークス工業	76,500	99	7,573,500	
ＪＦＥ商事ＨＬＤＧＳ	55,000	286	15,730,000	
あさひ	4,000	1,490	5,960,000	
サークルＫサンクス	15,500	1,139	17,654,500	
コスモス薬品	3,600	2,155	7,758,000	
シップヘルスケアＨＤ	108	53,100	5,734,800	
セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	326,000	1,933	630,158,000	

ツルハホールディングス	6,400	3,400	21,760,000	
サンマルクホールディングス	2,700	2,710	7,317,000	
トリドール	25	188,500	4,712,500	
帝　人	305,000	270	82,350,000	
東　レ	541,000	459	248,319,000	
三菱レイヨン	202,000	370	74,740,000	
ク　ラ　レ	118,500	1,039	123,121,500	
旭　化　成	469,000	420	196,980,000	
サカイ　オーベックス	43,000	85	3,655,000	
稲葉製作所	7,600	885	6,726,000	
宮地エンジニアリングＧ	60,000	77	4,620,000	
三協・立山ＨＬＤＧＳ	122,000	96	11,712,000	
トーカロ	5,000	1,269	6,345,000	
ＳＵＭＣＯ	46,600	1,477	68,828,200	
川田テクノロジーズ	3,100	1,665	5,161,500	
住江織物	38,000	105	3,990,000	
日本バイリーン	13,000	418	5,434,000	
アツギ	94,000	106	9,964,000	
セーレン	21,600	585	12,636,000	
小松精練	20,000	345	6,900,000	
ワコールホールディングス	47,000	995	46,765,000	
ホギメディカル	3,700	4,680	17,316,000	
サンエー・インターナショナル	4,900	805	3,944,500	
レナウン	20,600	125	2,575,000	
ＩＴホールディングス	24,900	1,018	25,348,200	
コーエーテクモＨＤ	17,000	709	12,053,000	
特種東海ＨＬＤＧＳ	57,000	222	12,654,000	
ドワンゴ	49	159,200	7,800,800	
マクロミル	56	134,700	7,543,200	
ティーガイア	71	158,800	11,274,800	
ザッパラス	30	134,700	4,041,000	
インターネットイニシアティブ	54	174,300	9,412,200	
ソネットエンタテインメント	42	188,000	7,896,000	
王子製紙	353,000	368	129,904,000	
三菱製紙	127,000	104	13,208,000	
北越紀州製紙	61,500	435	26,752,500	
中越パルプ	41,000	152	6,232,000	
大王製紙	37,000	714	26,418,000	
日本製紙Ｇ本社	35,800	2,355	84,309,000	
レンゴー	60,000	558	33,480,000	
トーモク	41,000	201	8,241,000	
ザ・パック	6,300	1,350	8,505,000	
昭和電工	522,000	153	79,866,000	
住友化学	553,000	340	188,020,000	
日本化成	24,000	175	4,200,000	
住友精化	20,000	327	6,540,000	
日産化学	55,000	1,143	62,865,000	
ラサ工業	52,000	79	4,108,000	
クレハ	52,000	426	22,152,000	
テイカ	20,000	234	4,680,000	
石原産業	152,000	62	9,424,000	
日本曹達	55,000	294	16,170,000	
東ソー	203,000	206	41,818,000	
トクヤマ	134,000	497	66,598,000	
セントラル硝子	84,000	324	27,216,000	

東亜合成	97,000	324	31,428,000	
ダイソー	39,000	206	8,034,000	
関東電化	20,000	583	11,660,000	
電気化学	171,000	363	62,073,000	
イビデン	54,300	2,920	158,556,000	
信越化学	133,200	4,690	624,708,000	
日本カーバイド	34,000	100	3,400,000	
堺　化　学	32,000	359	11,488,000	
エア・ウォーター	62,000	1,079	66,898,000	
大陽日酸	114,000	975	111,150,000	
日本化学工業	36,000	175	6,300,000	
日本パーカライジング	19,000	1,004	19,076,000	
高圧ガス	16,000	519	8,304,000	
四国化成	15,000	549	8,235,000	
戸田工業	15,000	726	10,890,000	
ステラ　ケミファ	4,300	4,430	19,049,000	
保土谷化学	27,000	213	5,751,000	
日本触媒	48,000	782	37,536,000	
大日精化	34,000	305	10,370,000	
カネカ	107,000	573	61,311,000	
協和発酵キリン	104,000	931	96,824,000	
三菱瓦斯化学	136,000	393	53,448,000	
三井化学	245,000	217	53,165,000	
ＪＳＲ	78,600	1,659	130,397,400	
東京応化工業	14,400	1,505	21,672,000	
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	463,500	314	145,539,000	
日本合成化学	22,000	604	13,288,000	
ダイセル化学	103,000	514	52,942,000	
住友ベークライト	74,000	392	29,008,000	
積水化学	165,000	514	84,810,000	
日本ゼオン	76,000	352	26,752,000	
アイカ工業	22,500	891	20,047,500	
宇部興産	367,000	213	78,171,000	
積水樹脂	14,000	730	10,220,000	
タキロン	27,000	239	6,453,000	
旭有機材	36,000	198	7,128,000	
日立化成	37,300	1,693	63,148,900	
ニチバン	18,000	288	5,184,000	
大倉工業	27,000	250	6,750,000	
積水化成品	27,000	400	10,800,000	
群栄化学	31,000	207	6,417,000	
日本化薬	63,000	711	44,793,000	
イーピーエス	27	328,000	8,856,000	
フェイス	392	9,770	3,829,840	
野村総合研究所	46,300	1,822	84,358,600	
ドリームインキュベータ	47	61,700	2,899,900	
サイバネットシステム	178	37,300	6,639,400	
電通	79,200	1,858	147,153,600	
シンプレクス・テクノロジー	138	33,700	4,650,600	
ＡＤＥＫＡ	35,200	793	27,913,600	
日油	71,000	348	24,708,000	
ミヨシ油脂	50,000	132	6,600,000	
ハリマ化成	11,000	475	5,225,000	
花　王	221,600	2,120	469,792,000	
三洋化成	25,000	472	11,800,000	

武田薬品	303,800	3,600	1,093,680,000	
アステラス製薬	171,000	3,190	545,490,000	
大日本住友製薬	62,200	886	55,109,200	
塩野義製薬	117,600	1,862	218,971,200	
田辺三菱製薬	71,000	1,140	80,940,000	
わかもと製薬	18,000	313	5,634,000	
あすか製薬	12,000	617	7,404,000	
日本新薬	20,000	1,022	20,440,000	
中外製薬	86,200	1,640	141,368,000	
科研製薬	37,000	759	28,083,000	
エーザイ	99,100	3,170	314,147,000	
ロート製薬	37,000	1,114	41,218,000	
小野薬品	40,000	3,990	159,600,000	
久光製薬	24,300	3,050	74,115,000	
持田製薬	33,000	831	27,423,000	
大正製薬	68,000	1,582	107,576,000	
参天製薬	24,500	2,925	71,662,500	
エスエス製薬	20,000	498	9,960,000	
扶桑薬品	34,000	267	9,078,000	
日本ケミファ	18,000	243	4,374,000	
ツムラ	23,700	2,875	68,137,500	
テ　ル　モ	59,600	4,890	291,444,000	
みらかホールディングス	16,700	2,760	46,092,000	
キッセイ薬品工業	16,000	1,922	30,752,000	
生化学工業	15,900	970	15,423,000	
栄研化学	7,200	819	5,896,800	
鳥居薬品	6,100	1,719	10,485,900	
東和薬品	4,200	4,310	18,102,000	
沢井製薬	5,400	4,950	26,730,000	
ゼリア新薬工業	14,000	848	11,872,000	
第一三共	254,600	1,693	431,037,800	
キョーリン	22,000	1,350	29,700,000	
大日本塗料	65,000	87	5,655,000	
日本ペイント	76,000	525	39,900,000	
関西ペイント	98,000	747	73,206,000	
中国塗料	24,000	646	15,504,000	
日本特殊塗料	15,100	347	5,239,700	
藤倉化成	12,200	410	5,002,000	
太陽インキ製造	6,900	2,290	15,801,000	
ＤＩＣ	266,000	138	36,708,000	
サカタインクス	23,000	340	7,820,000	
東洋インキ	79,000	315	24,885,000	
オリエンタルランド	20,700	6,150	127,305,000	
ダスキン	24,700	1,615	39,890,500	
パーク２４	46,900	941	44,132,900	
フジ・メディア・ＨＤ	846	129,200	109,303,200	
秀英予備校	4,600	458	2,106,800	
ラウンドワン	12,600	510	6,426,000	
リゾートトラスト	13,100	1,021	13,375,100	
オービック	2,620	14,380	37,675,600	
ヤフー	4,470	25,830	115,460,100	
ビー・エム・エル	5,100	2,800	14,280,000	
ワタベウェディング	3,900	990	3,861,000	
トレンドマイクロ	32,900	3,090	101,661,000	
もしもしホットライン	6,000	1,618	9,708,000	

東急コミュニティー	3,000	2,015	6,045,000	
リソー教育	1,107	5,500	6,088,500	
日本オラクル	12,900	3,930	50,697,000	
アルファシステムズ	3,300	1,800	5,940,000	
フューチャーアーキテクト	141	37,800	5,329,800	
シーエーシー	9,800	626	6,134,800	
ユー・エス・エス	10,970	5,370	58,908,900	
オービックビジネスＣ	2,400	3,830	9,192,000	
伊藤忠テクノソリュー	11,900	2,380	28,322,000	
東京個別指導学院	12,300	140	1,722,000	
カルチュア・コンビニエンス	29,900	533	15,936,700	
大塚商会	6,600	4,130	27,258,000	
総合メディカル	2,500	2,180	5,450,000	
セントラルスポーツ	6,000	824	4,944,000	
電通国際情報Ｓ	8,500	541	4,598,500	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	171,800	2,355	404,589,000	
コニカミノルタＨＬＤＧＳ	178,000	796	141,688,000	
資　生　堂	147,000	1,707	250,929,000	
ライオン	97,000	448	43,456,000	
高砂香料	27,000	429	11,583,000	
マンダム	8,300	2,320	19,256,000	
ミルボン	4,400	2,085	9,174,000	
ファンケル	17,100	1,740	29,754,000	
コーセー	12,100	1,880	22,748,000	
ドクターシーラボ	64	177,700	11,372,800	
エステー	7,100	1,031	7,320,100	
コ　ニ　シ	9,000	839	7,551,000	
長谷川香料	11,300	1,234	13,944,200	
小林製薬	12,000	3,860	46,320,000	
荒川化学工業	7,800	1,067	8,322,600	
日本高純度化学	27	270,000	7,290,000	
アース製薬	6,500	2,880	18,720,000	
イハラケミカル	21,000	253	5,313,000	
大成ラミック	4,200	2,120	8,904,000	
クミアイ化学	20,000	241	4,820,000	
日本農薬	19,000	474	9,006,000	
新日本石油	490,000	368	180,320,000	
昭和シエル石油	78,100	731	57,091,100	
コスモ石油	218,000	186	40,548,000	
東燃ゼネラル石油	112,000	754	84,448,000	
ユシロ化学	5,100	1,133	5,778,300	
新日鉱ホールディングス	311,500	339	105,598,500	
ＡＯＣホールディングス	21,000	505	10,605,000	
出光興産	9,200	5,300	48,760,000	
横浜ゴム	91,000	324	29,484,000	
東洋ゴム	81,000	136	11,016,000	
ブリヂストン	250,500	1,375	344,437,500	
住友ゴム	60,700	679	41,215,300	
オカモト	39,000	350	13,650,000	
アキレス	79,000	124	9,796,000	
ニッタ	8,700	1,192	10,370,400	
東海ゴム	14,000	908	12,712,000	
三ツ星ベルト	27,000	337	9,099,000	
バンドー化学	36,000	232	8,352,000	
鬼怒川ゴム	24,000	170	4,080,000	

旭　硝　子	397,000	755	299,735,000	
日本板硝子	242,000	219	52,998,000	
有沢製作所	12,900	409	5,276,100	
日本山村硝子	39,000	290	11,310,000	
日本電気硝子	141,000	1,028	144,948,000	
オハラ	4,000	1,284	5,136,000	
住友大阪セメント	148,000	130	19,240,000	
太平洋セメント	323,000	96	31,008,000	
東海カーボン	83,000	390	32,370,000	
日本カーボン	45,000	249	11,205,000	
東洋炭素	3,900	3,990	15,561,000	
ノリタケ	48,000	224	10,752,000	
ＴＯＴＯ	126,000	466	58,716,000	
日本碍子	96,000	1,897	182,112,000	
日本特殊陶業	71,000	931	66,101,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,700	2,020	5,454,000	
品川リフラクトリーズ	30,000	158	4,740,000	
黒崎播磨	28,000	137	3,836,000	
フジミインコーポレーテッド	8,400	1,379	11,583,600	
ニチアス	45,000	307	13,815,000	
新日本製鐵	2,274,000	321	729,954,000	
住友金属工業	1,480,000	219	324,120,000	
神戸製鋼所	1,123,000	147	165,081,000	
日新製鋼	305,000	129	39,345,000	
中山製鋼所	44,000	108	4,752,000	
合同製鐵	45,000	190	8,550,000	
ＪＦＥホールディングス	173,700	2,840	493,308,000	
東京製鐵	39,600	976	38,649,600	
共英製鋼	8,400	1,640	13,776,000	
大和工業	20,300	2,710	55,013,000	
東京鐵鋼	21,000	250	5,250,000	
大阪製鐵	5,900	1,482	8,743,800	
淀川製鋼所	61,000	341	20,801,000	
東洋鋼鈑	20,000	409	8,180,000	
丸一鋼管	23,600	1,643	38,774,800	
モリ工業	24,000	212	5,088,000	
大同特殊鋼	134,000	284	38,056,000	
日本高周波	52,000	86	4,472,000	
日本金属工業	64,000	133	8,512,000	
日本冶金工	49,000	345	16,905,000	
山陽特殊鋼	44,000	344	15,136,000	
愛知製鋼	47,000	382	17,954,000	
日立金属	47,000	754	35,438,000	
日本金属	32,000	137	4,384,000	
大平洋金属	61,000	561	34,221,000	
日本電工	38,000	512	19,456,000	
栗本鉄工所	57,000	78	4,446,000	
日本製鋼所	125,000	1,052	131,500,000	
三菱製鋼	56,000	141	7,896,000	
日本軽金属	206,000	74	15,244,000	
三井金属	239,000	213	50,907,000	
東邦亜鉛	44,000	405	17,820,000	
三菱マテリアル	461,000	206	94,966,000	
住友鉱山	209,000	1,418	296,362,000	
ＤＯＷＡホールディングス	95,000	462	43,890,000	

古河機金	159,000	97	15,423,000	
大阪チタニウム	8,700	2,080	18,096,000	
東邦チタニウム	14,400	1,044	15,033,600	
住友軽金属	131,000	70	9,170,000	
古河スカイ	41,000	121	4,961,000	
古河電工	256,000	320	81,920,000	
住友電工	265,700	1,022	271,545,400	
フジクラ	123,000	405	49,815,000	
昭和電線ＨＬＤＧＳ	112,000	70	7,840,000	
タツタ電線	28,000	210	5,880,000	
日立電線	70,000	214	14,980,000	
リョービ	52,000	175	9,100,000	
アサヒＨＤ	12,500	1,450	18,125,000	
東洋製罐	61,700	1,294	79,839,800	
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	18,000	754	13,572,000	
三和ホールディングス	83,000	226	18,758,000	
文化シヤツター	29,000	276	8,004,000	
住生活グループ	104,200	1,412	147,130,400	
日本フイルコン	10,200	490	4,998,000	
ノーリツ	13,800	1,052	14,517,600	
長府製作所	9,800	1,855	18,179,000	
リンナイ	14,000	4,280	59,920,000	
ユニプレス	12,200	1,221	14,896,200	
日東精工	21,000	210	4,410,000	
三洋工業	36,000	113	4,068,000	
岡　部	22,600	300	6,780,000	
日立ツール	6,900	829	5,720,100	
東　プ　レ	17,600	721	12,689,600	
高周波熱錬	14,700	528	7,761,600	
東京製綱	58,000	209	12,122,000	
日本発条	57,000	772	44,004,000	
三浦工業	12,100	2,300	27,830,000	
タ　ク　マ	34,000	217	7,378,000	
ツ　ガ　ミ	33,000	156	5,148,000	
オークマ	59,000	376	22,184,000	
東芝機械	45,000	304	13,680,000	
ア　マ　ダ	132,000	500	66,000,000	
アイダエンジニア	24,500	230	5,635,000	
牧野フライス	42,000	303	12,726,000	
オーエスジー	36,500	789	28,798,500	
旭ダイヤモンド	23,000	589	13,547,000	
森精機製作所	32,500	795	25,837,500	
ディスコ	7,900	4,980	39,342,000	
日東工器	5,800	1,926	11,170,800	
豊田自動織機	66,500	2,370	157,605,000	
大阪機工	51,000	63	3,213,000	
オーエム製作所	12,000	238	2,856,000	
津田駒工業	31,000	105	3,255,000	
島精機製作所	10,600	1,649	17,479,400	
日阪製作所	10,000	828	8,280,000	
やまびこ	4,600	966	4,443,600	
ナブテスコ	33,000	955	31,515,000	
三井海洋開発	5,900	1,654	9,758,600	
ＳＭＣ	25,700	9,720	249,804,000	
新川	7,200	1,203	8,661,600	

ホソカワミクロン	18,000	290	5,220,000	
ユニオンツール	5,800	2,285	13,253,000	
オイレス工業	10,700	1,170	12,519,000	
サトー	9,700	923	8,953,100	
日精樹脂工業	11,900	226	2,689,400	
小松製作所	359,800	1,698	610,940,400	
住友重機械	173,000	387	66,951,000	
日立建機	33,400	2,020	67,468,000	
井関農機	84,000	260	21,840,000	
ＴＯＷＡ	10,100	779	7,867,900	
丸山製作所	28,000	135	3,780,000	
北川鉄工所	54,000	80	4,320,000	
クボタ	331,000	761	251,891,000	
東洋エンジニア	55,000	266	14,630,000	
三菱化工機	31,000	199	6,169,000	
月島機械	15,000	517	7,755,000	
帝国電機製作所	3,600	1,675	6,030,000	
東京機械	39,000	92	3,588,000	
新東工業	17,300	596	10,310,800	
アイチ　コーポレーション	17,100	319	5,454,900	
小森コーポレーション	22,900	920	21,068,000	
住友精密	19,000	242	4,598,000	
酒井重工業	30,000	123	3,690,000	
荏原製作所	165,000	330	54,450,000	
西島製作所	8,200	1,728	14,169,600	
千代田化工建	67,000	664	44,488,000	
ダイキン工業	90,300	3,070	277,221,000	
オルガノ	16,000	569	9,104,000	
トーヨーカネツ	51,000	179	9,129,000	
栗田工業	44,300	2,730	120,939,000	
椿本チエイン	47,000	332	15,604,000	
日　機　装	23,000	442	10,166,000	
木村化工機	8,300	812	6,739,600	
新興プランテック	16,100	877	14,119,700	
アネスト岩田	23,000	254	5,842,000	
ダイフク	33,000	510	16,830,000	
加藤製作所	26,000	132	3,432,000	
油研工業	28,000	116	3,248,000	
タダノ	38,000	386	14,668,000	
フジテック	25,000	483	12,075,000	
シーケーディ	22,700	542	12,303,400	
平和	16,600	898	14,906,800	
理想科学工業	7,600	678	5,152,800	
ＳＡＮＫＹＯ	22,500	4,860	109,350,000	
日本金銭機械	9,500	793	7,533,500	
マースエンジニアリング	3,900	2,215	8,638,500	
キヤノンファインテック	7,300	1,013	7,394,900	
ダイコク電機	3,400	1,686	5,732,400	
ア　マ　ノ	23,800	733	17,445,400	
ＪＵＫＩ	59,000	79	4,661,000	
サンデン	50,000	189	9,450,000	
ブラザー工業	107,400	946	101,600,400	
マックス	16,000	847	13,552,000	
グローリー	23,500	1,846	43,381,000	
大和冷機工業	13,000	413	5,369,000	

セガサミーホールディングス	87,700	1,094	95,943,800	
日本ピストンリング	50,000	85	4,250,000	
リ　ケ　ン	36,000	257	9,252,000	
帝国ピストン	13,000	339	4,407,000	
ホシザキ電機	16,900	1,162	19,637,800	
大豊工業	8,100	528	4,276,800	
日本精工	158,000	534	84,372,000	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	180,000	326	58,680,000	
ジェイテクト	75,100	847	63,609,700	
不　二　越	89,000	172	15,308,000	
ミネベア	115,000	432	49,680,000	
日本トムソン	28,000	413	11,564,000	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	51,700	1,421	73,465,700	
ユーシン精機	4,300	1,220	5,246,000	
イーグル工業	12,000	414	4,968,000	
キッツ	39,000	412	16,068,000	
日　立	1,297,000	234	303,498,000	
東　芝	1,745,000	458	799,210,000	
三菱電機	718,000	610	437,980,000	
富士電機ＨＬＤＧＳ	213,000	130	27,690,000	
東洋電機製造	17,000	638	10,846,000	
安川電機	91,000	647	58,877,000	
シンフォニア　テクノロジー	49,000	183	8,967,000	
明　電　舎	78,000	381	29,718,000	
オリジン電気	16,000	208	3,328,000	
デンヨー	9,500	657	6,241,500	
日立工機	22,700	920	20,884,000	
三桜工業	12,400	520	6,448,000	
マキタ	50,400	2,920	147,168,000	
東芝テック	54,000	303	16,362,000	
芝浦メカトロニクス	15,000	276	4,140,000	
マブチモーター	10,900	4,240	46,216,000	
日本電産	37,200	7,590	282,348,000	
高岳製作所	36,000	236	8,496,000	
ダイヘン	43,000	270	11,610,000	
ＪＶＣケンウッドＨＤ	313,500	35	10,972,500	
日新電機	15,000	433	6,495,000	
大崎電気	13,000	719	9,347,000	
オムロン	91,700	1,446	132,598,200	
日東工業	12,900	883	11,390,700	
ＩＤＥＣ	13,300	537	7,142,100	
エルピーダメモリ	81,100	1,065	86,371,500	
ジーエス・ユアサ　コーポ	150,000	608	91,200,000	
サクサホールディングス	27,000	174	4,698,000	
メルコホールディングス	4,300	1,532	6,587,600	
日本電気	989,000	218	215,602,000	
富　士　通	799,000	514	410,686,000	
沖　電　気	273,000	72	19,656,000	
岩崎通信機	51,000	74	3,774,000	
電気興業	24,000	370	8,880,000	
サンケン電気	45,000	239	10,755,000	
アイホン	6,200	1,486	9,213,200	
ＮＥＣエレクトロニクス	19,000	543	10,317,000	
セイコーエプソン	61,300	1,339	82,080,700	
ワコム	154	183,800	28,305,200	

アルバック	13,400	1,900	25,460,000	
ナナオ	6,600	2,045	13,497,000	
日本信号	20,100	735	14,773,500	
京三製作所	20,000	405	8,100,000	
能美防災	10,000	509	5,090,000	
ホーチキ	10,000	500	5,000,000	
マスプロ電工	7,700	740	5,698,000	
日本無線	32,000	143	4,576,000	
パナソニック	756,700	1,111	840,693,700	
シャープ	371,000	988	366,548,000	
アンリツ	42,000	302	12,684,000	
富士通ゼネラル	23,000	259	5,957,000	
日立国際電気	19,000	610	11,590,000	
ソ　ニ　ー	413,700	2,325	961,852,500	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	39,900	4,510	179,949,000	
帝国通信工業	25,000	189	4,725,000	
三洋電機	816,000	155	126,480,000	
ミツミ電機	25,200	1,346	33,919,200	
タムラ製作所	23,000	228	5,244,000	
アルプス電気	66,100	495	32,719,500	
池上通信機	44,000	68	2,992,000	
パイオニア	66,600	233	15,517,800	
日本電波工業	5,600	1,382	7,739,200	
日本トリム	2,550	1,735	4,424,250	
ローランド　ディー．ジー．	3,800	1,021	3,879,800	
フオスター電機	7,000	2,285	15,995,000	
クラリオン	56,000	77	4,312,000	
Ｓ　Ｍ　Ｋ	26,000	468	12,168,000	
ヨコオ	9,800	495	4,851,000	
ホシデン	20,500	922	18,901,000	
ヒロセ電機	13,300	9,140	121,562,000	
日本航空電子	17,000	608	10,336,000	
Ｔ　Ｏ　Ａ	12,000	498	5,976,000	
ユニデン	26,000	163	4,238,000	
アルパイン	16,600	868	14,408,800	
スミダコーポレーション	8,000	566	4,528,000	
アイコム	4,500	1,830	8,235,000	
船井電機	6,600	4,790	31,614,000	
横河電機	83,700	615	51,475,500	
新電元工業	30,000	220	6,600,000	
山武	21,000	1,817	38,157,000	
日本光電工業	14,100	1,527	21,530,700	
チ　ノ　ー	22,000	201	4,422,000	
堀場製作所	13,200	1,932	25,502,400	
アドバンテスト	56,500	1,922	108,593,000	
小野測器	15,000	416	6,240,000	
エスペック	9,200	425	3,910,000	
サンクス	12,700	279	3,543,300	
キーエンス	15,500	17,370	269,235,000	
日置電機	4,700	1,738	8,168,600	
シスメックス	14,500	4,670	67,715,000	
メガチップス	6,600	1,240	8,184,000	
ＯＢＡＲＡ	7,100	716	5,083,600	
東京電波	4,700	468	2,199,600	
デンソー	181,800	2,415	439,047,000	

コーセル	11,700	962	11,255,400	
日立メディコ	6,000	743	4,458,000	
新日本無線	13,000	168	2,184,000	
オプテックス	6,700	826	5,534,200	
千代田インテグレ	4,900	887	4,346,300	
スタンレー電気	53,200	1,712	91,078,400	
岩崎電気	35,000	135	4,725,000	
ウシオ電機	46,100	1,458	67,213,800	
日本セラミック	6,100	1,122	6,844,200	
新神戸電機	7,000	897	6,279,000	
日本デジタル研究所	8,400	978	8,215,200	
古河電池	6,000	654	3,924,000	
双信電機	7,800	313	2,441,400	
図　研	7,300	620	4,526,000	
日本電子	32,000	331	10,592,000	
カ　シ　オ	86,900	628	54,573,200	
ファナック	80,000	7,140	571,200,000	
日本シイエムケイ	16,800	497	8,349,600	
エンプラス	4,900	1,602	7,849,800	
ロ　ー　ム	38,200	5,680	216,976,000	
浜松ホトニクス	30,000	1,986	59,580,000	
三井ハイテック	11,700	812	9,500,400	
新光電気工業	21,000	1,217	25,557,000	
京　セ　ラ	63,800	6,880	438,944,000	
太陽誘電	31,000	887	27,497,000	
村田製作所	86,400	4,110	355,104,000	
ユーシン	11,800	423	4,991,400	
双葉電子工業	14,000	1,419	19,866,000	
日東電工	66,600	2,770	184,482,000	
北陸電気工業	37,000	140	5,180,000	
パナソニック電工	136,000	989	134,504,000	
東海理化電機	19,700	1,781	35,085,700	
ニチコン	26,400	768	20,275,200	
日本ケミコン	40,000	250	10,000,000	
Ｋ　Ｏ　Ａ	11,400	614	6,999,600	
三井造船	326,000	213	69,438,000	
日立造船	358,500	121	43,378,500	
佐世保重工業	59,000	198	11,682,000	
三菱重工業	1,299,000	282	366,318,000	
川崎重工業	602,000	210	126,420,000	
ＩＨＩ	571,000	139	79,369,000	
日本車輌	32,000	477	15,264,000	
近畿車輌	14,000	659	9,226,000	
日産自動車	930,400	626	582,430,400	
いすゞ自動車	526,000	148	77,848,000	
トヨタ自動車	1,064,600	3,440	3,662,224,000	※
日野自動車	106,000	258	27,348,000	
三菱自動車工業	1,712,000	117	200,304,000	
武蔵精密工業	8,400	1,796	15,086,400	
トヨタ車体	15,100	1,576	23,797,600	
日産車体	33,000	732	24,156,000	
関東自動車	13,100	717	9,392,700	
新明和工業	38,000	268	10,184,000	
極東開発工業	17,700	316	5,593,200	
日信工業	14,000	1,292	18,088,000	

トピー工業	72,000	145	10,440,000	
ティラド	30,000	188	5,640,000	
曙ブレーキ	26,700	508	13,563,600	
タチエス	12,500	730	9,125,000	
Ｎ　Ｏ　Ｋ	40,000	1,004	40,160,000	
カヤバ工業	54,000	230	12,420,000	
大同メタル工業	17,000	185	3,145,000	
プレス工業	41,000	138	5,658,000	
カルソニックカンセイ	57,000	203	11,571,000	
太平洋工業	20,000	386	7,720,000	
ケーヒン	15,600	1,233	19,234,800	
アイシン精機	68,100	2,090	142,329,000	
マ　ツ　ダ	492,000	184	90,528,000	
ダイハツ	77,000	812	62,524,000	
愛知機械	22,000	266	5,852,000	
今仙電機製作所	7,000	1,177	8,239,000	
本田技研	660,900	2,700	1,784,430,000	
スズキ	153,700	2,050	315,085,000	
富士重工業	263,000	343	90,209,000	
ヤマハ発動機	95,100	1,011	96,146,100	
ショーワ	18,800	416	7,820,800	
小糸製作所	37,000	1,285	47,545,000	
エクセディ	10,300	1,624	16,727,200	
ミツバ	17,000	370	6,290,000	
豊田合成	23,500	2,375	55,812,500	
愛三工業	10,100	753	7,605,300	
ヨ　ロ　ズ	6,300	1,115	7,024,500	
エフ・シー・シー	11,200	1,448	16,217,600	
シマノ	32,200	3,610	116,242,000	
タカタ	13,100	1,673	21,916,300	
テイ・エス　テック	16,200	1,585	25,677,000	
小　野　建	7,700	618	4,758,600	
はるやま商事	7,800	327	2,550,600	
佐鳥電機	8,300	508	4,216,400	
カッパクリエイト	5,700	1,912	10,898,400	
伯東	6,100	719	4,385,900	
ライトオン	7,300	679	4,956,700	
ナガイレーベン	5,600	1,924	10,774,400	
ジーンズメイト	7,400	470	3,478,000	
菱食	8,200	2,530	20,746,000	
良品計画	8,600	3,540	30,444,000	
三城ホールディングス	11,100	698	7,747,800	
松田産業	5,700	1,504	8,572,800	
メディパルＨＤ	81,200	1,194	96,952,800	
アドヴァン	8,400	519	4,359,600	
アズワン	5,800	1,650	9,570,000	
シモジマ	6,900	1,239	8,549,100	
ドウシシャ	4,500	1,949	8,770,500	
コナカ	14,500	254	3,683,000	
コ　ジ　マ	13,200	432	5,702,400	
コーナン商事	7,700	1,052	8,100,400	
黒田電気	11,300	1,193	13,480,900	
ネットワンシステムズ	154	103,200	15,892,800	
ワタミ	8,900	1,718	15,290,200	
ドン・キホーテ	15,000	2,185	32,775,000	

丸文	8,700	529	4,602,300	
メガネトップ	7,800	1,044	8,143,200	
西松屋チェーン	18,100	792	14,335,200	
ゼンショー	31,700	621	19,685,700	
ハピネット	4,200	1,200	5,040,000	
幸楽苑	6,900	1,170	8,073,000	
トーメンエレクトロニクス	3,700	860	3,182,000	
ユニマットライフ	5,800	908	5,266,400	
サイゼリヤ	12,100	1,463	17,702,300	
エクセル	4,700	1,028	4,831,600	
ガリバーインターナショナル	2,060	5,950	12,257,000	
日本エム・ディ・エム	12,100	194	2,347,400	
ユナイテッドアローズ	9,700	762	7,391,400	
シークス	6,000	874	5,244,000	
京都きもの友禅	6,600	863	5,695,800	
コロワイド	20,000	555	11,100,000	
壱番屋	3,500	2,195	7,682,500	
マクニカ	4,100	1,378	5,649,800	
スギホールディングス	11,500	1,916	22,034,000	
島津製作所	90,000	542	48,780,000	
Ｊ　Ｍ　Ｓ	17,000	354	6,018,000	
アロカ	5,400	617	3,331,800	
モリテックス	6,100	215	1,311,500	
長野計器	6,400	472	3,020,800	
スター精密	16,200	622	10,076,400	
東京計器	37,000	104	3,848,000	
東京精密	15,800	947	14,962,600	
ニコン	144,600	1,560	225,576,000	
トプコン	17,600	476	8,377,600	
オリンパス	90,900	2,625	238,612,500	
大日本スクリーン	85,000	308	26,180,000	
キヤノン電子	7,800	1,836	14,320,800	
タムロン	7,900	822	6,493,800	
ＨＯＹＡ	178,400	2,205	393,372,000	
ノーリツ鋼機	7,700	598	4,604,600	
エー・アンド・デイ	8,300	312	2,589,600	
キヤノン	480,200	3,330	1,599,066,000	
リ　コ　ー	230,000	1,151	264,730,000	
日本電産コパル	8,500	1,248	10,608,000	
日本電産サンキョー	20,000	656	13,120,000	
シチズンホールディングス	99,100	477	47,270,700	
リズム時計	50,000	115	5,750,000	
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	89,700	862	77,321,400	
フランスベッドＨＬＤＧＳ	67,000	132	8,844,000	
パイロットコーポレーション	79	102,200	8,073,800	
エイベックス・グループＨＤ	13,600	747	10,159,200	
トッパン・フォームズ	15,700	943	14,805,100	
フジシールインターナショナル	8,100	1,947	15,770,700	
タカラトミー	25,700	743	19,095,100	
廣済堂	13,900	196	2,724,400	
レック	4,000	1,920	7,680,000	
タカノ	6,500	477	3,100,500	
プロネクサス	12,300	527	6,482,100	
大建工業	41,000	193	7,913,000	
き　も　と	8,000	1,006	8,048,000	

凸版印刷	234,000	701	164,034,000	
大日本印刷	234,000	1,067	249,678,000	
共同印刷	32,000	237	7,584,000	
日本写真印刷	12,800	4,490	57,472,000	
光村印刷	20,000	281	5,620,000	
藤森工業	6,600	1,243	8,203,800	
宝印刷	8,200	685	5,617,000	
前澤化成工業	8,300	911	7,561,300	
アシックス	73,000	768	56,064,000	
ツ　ツ　ミ	4,400	1,820	8,008,000	
ニ　チ　ハ	11,600	455	5,278,000	
ローランド	7,100	805	5,715,500	
エフピコ	4,000	4,450	17,800,000	
ヤマハ	57,000	878	50,046,000	
河合楽器	47,000	98	4,606,000	
クリナップ	10,400	660	6,864,000	
ピジョン	4,800	3,760	18,048,000	
天馬	7,500	962	7,215,000	
パラマウントベッド	8,700	1,917	16,677,900	
兼松日産農林	25,000	84	2,100,000	
リンテック	17,900	1,645	29,445,500	
信越ポリマー	16,200	525	8,505,000	
東　リ	37,000	150	5,550,000	
イトーキ	27,300	164	4,477,200	
任　天　堂	43,700	21,210	926,877,000	
三菱鉛筆	8,000	1,070	8,560,000	
タカラスタンダード	40,000	478	19,120,000	
コ　ク　ヨ	43,700	754	32,949,800	
ナカバヤシ	33,000	173	5,709,000	
ニ　フ　コ	18,300	1,554	28,438,200	
グローブライド	68,000	102	6,936,000	
岡村製作所	34,000	391	13,294,000	
日本バルカー	44,000	150	6,600,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	19,000	137	2,603,000	
伊　藤　忠	529,000	593	313,697,000	
丸　紅	624,000	456	284,544,000	
高　島	27,000	114	3,078,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	8,200	995	8,159,000	
三陽商会	40,000	279	11,160,000	
長瀬産業	42,000	1,047	43,974,000	
豊田通商	73,200	1,156	84,619,200	
オンワードホールディングス	52,000	546	28,392,000	
三共生興	22,500	235	5,287,500	
兼　松	182,000	66	12,012,000	
美　津　濃	45,000	413	18,585,000	
ファミリーマート	24,500	2,845	69,702,500	
ルック	29,000	75	2,175,000	
三井物産	657,900	1,144	752,637,600	
日本紙パルプ	44,000	308	13,552,000	
東京エレクトロン	65,000	4,720	306,800,000	
日立ハイテクノロジーズ	24,700	1,412	34,876,400	
東都水産	21,000	134	2,814,000	
セイコーＨＤ	34,000	162	5,508,000	
山　善	34,500	268	9,246,000	
住友商事	415,900	850	353,515,000	

日本ユニシス	20,400	673	13,729,200	
内田洋行	23,000	222	5,106,000	
三菱商事	610,500	1,950	1,190,475,000	
第一実業	24,000	221	5,304,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	27,100	1,268	34,362,800	
西華産業	38,000	193	7,334,000	
菱洋エレクトロ	10,300	685	7,055,500	
ユアサ商事	99,000	69	6,831,000	
神鋼商事	29,000	142	4,118,000	
阪和興業	83,000	282	23,406,000	
菱電商事	15,000	427	6,405,000	
ニプロ	16,400	1,846	30,274,400	
岩谷産業	87,000	249	21,663,000	
すてきナイスグループ	43,000	190	8,170,000	
昭光通商	55,000	104	5,720,000	
ニチモウ	31,000	134	4,154,000	
兼松エレクトロニクス	6,800	779	5,297,200	
三愛石油	23,000	343	7,889,000	
稲畑産業	23,600	285	6,726,000	
ＧＳＩクレオス	35,000	90	3,150,000	
明和産業	20,400	143	2,917,200	
東京スタイル	29,000	688	19,952,000	
ユニ・チヤーム	15,700	8,820	138,474,000	
デサント	26,000	455	11,830,000	
東邦ホールディングス	21,400	1,197	25,615,800	
サンゲツ	14,100	1,965	27,706,500	
ミツウロコ	15,800	618	9,764,400	
シナネン	25,000	381	9,525,000	
伊藤忠エネクス	20,500	389	7,974,500	
ザ・トーカイ	23,000	445	10,235,000	
サンリオ	24,400	703	17,153,200	
リョーサン	12,500	2,105	26,312,500	
新光商事	9,000	651	5,859,000	
三信電気	9,400	628	5,903,200	
東陽テクニカ	13,400	738	9,889,200	
モスフード　サービス	11,400	1,451	16,541,400	
加賀電子	8,500	830	7,055,000	
三益半導体	6,800	1,065	7,242,000	
木曽路	9,100	1,999	18,190,900	
千　趣　会	16,200	545	8,829,000	
ケーヨー	18,100	433	7,837,300	
アデランスホールディングス	10,100	927	9,362,700	
上新電機	19,000	677	12,863,000	
日本瓦斯	10,400	1,534	15,953,600	
ベスト電器	27,500	311	8,552,500	
マルエツ	20,000	409	8,180,000	
ロイヤルホールディングス	13,500	976	13,176,000	
いなげや	11,000	944	10,384,000	
島　忠	18,400	1,865	34,316,000	
チヨダ	11,200	1,043	11,681,600	
ライフコーポレーション	5,800	1,620	9,396,000	
カ　ス　ミ	21,400	437	9,351,800	
リンガーハツト	7,000	1,161	8,127,000	
ＡＯＫＩホールディングス	8,400	874	7,341,600	
オークワ	11,000	831	9,141,000	

コメリ	9,800	2,405	23,569,000	
青山商事	19,200	1,137	21,830,400	
しまむら	8,500	8,090	68,765,000	
ＣＦＳコーポレーション	11,500	466	5,359,000	
高　島　屋	103,000	555	57,165,000	
丸　善	56,000	70	3,920,000	
松　屋	15,600	696	10,857,600	
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	516	22,188,000	
丸　栄	30,000	103	3,090,000	
ニッセンＨＤ	19,400	268	5,199,200	
パ　ル　コ	22,600	762	17,221,200	
丸井グループ	91,800	486	44,614,800	
クレディセゾン	57,700	956	55,161,200	
セディナ	65,900	162	10,675,800	
ダイエー	37,150	303	11,256,450	
イズミヤ	29,000	369	10,701,000	
イオン	267,600	696	186,249,600	
ユ　ニ　ー	63,200	625	39,500,000	
イ　ズ　ミ	22,800	1,100	25,080,000	
平　和　堂	15,800	1,060	16,748,000	
フ　ジ	10,200	1,820	18,564,000	
ヤオコー	4,200	2,830	11,886,000	
ゼビオ	8,700	1,774	15,433,800	
ケーズホールディングス	13,200	2,880	38,016,000	
新生銀行	381,000	106	40,386,000	
あおぞら銀行	262,000	108	28,296,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	4,793,000	482	2,310,226,000	
りそなホールディングス	219,600	924	202,910,400	
中央三井トラストＨＤ	431,000	304	131,024,000	
三井住友フィナンシャルＧ	418,800	2,850	1,193,580,000	
第四銀行	105,000	320	33,600,000	
北越銀行	93,000	137	12,741,000	
西日本シティ銀行	265,000	237	62,805,000	
札幌北洋ホール	111,300	322	35,838,600	
千葉銀行	300,000	569	170,700,000	
横浜銀行	524,000	420	220,080,000	
常陽銀行	291,000	399	116,109,000	
群馬銀行	187,000	505	94,435,000	
武蔵野銀行	12,400	2,295	28,458,000	
千葉興業銀行	16,600	672	11,155,200	
関東つくば銀行	27,300	296	8,080,800	
東京都民銀行	14,900	1,185	17,656,500	
七十七銀行	126,000	530	66,780,000	
青森銀行	57,000	207	11,799,000	
秋田銀行	57,000	352	20,064,000	
山形銀行	47,000	428	20,116,000	
岩手銀行	5,500	5,340	29,370,000	
東邦銀行	69,000	293	20,217,000	
東北銀行	68,000	135	9,180,000	
みちのく銀行	46,000	170	7,820,000	
ふくおかフィナンシャルＧ	311,000	314	97,654,000	
静岡銀行	237,000	864	204,768,000	
十六銀行	100,000	338	33,800,000	
スルガ銀行	79,000	849	67,071,000	
八十二銀行	153,000	552	84,456,000	

山梨中央銀行	52,000	382	19,864,000	
大垣共立銀行	106,000	285	30,210,000	
福井銀行	71,000	288	20,448,000	
北國銀行	86,000	348	29,928,000	
清水銀行	3,100	3,730	11,563,000	
滋賀銀行	75,000	536	40,200,000	
南都銀行	77,000	492	37,884,000	
百五銀行	74,000	426	31,524,000	
京都銀行	134,000	791	105,994,000	
三重銀行	37,000	234	8,658,000	
ほくほくフィナンシャルG	534,000	202	107,868,000	
広島銀行	220,000	361	79,420,000	
山陰合同銀行	49,000	776	38,024,000	
中国銀行	66,000	1,187	78,342,000	
鳥取銀行	36,000	259	9,324,000	
伊予銀行	92,000	793	72,956,000	
百十四銀行	88,000	340	29,920,000	
四国銀行	61,000	293	17,873,000	
阿波銀行	67,000	466	31,222,000	
鹿児島銀行	53,000	671	35,563,000	
大分銀行	53,000	356	18,868,000	
宮崎銀行	45,000	309	13,905,000	
肥後銀行	64,000	539	34,496,000	
佐賀銀行	50,000	277	13,850,000	
十八銀行	55,000	224	12,320,000	
沖縄銀行	6,600	3,400	22,440,000	
琉球銀行	17,100	1,096	18,741,600	
住友信託	691,000	463	319,933,000	
みずほ信託銀行	673,000	79	53,167,000	
八千代銀行	4,600	2,010	9,246,000	
みずほフィナンシャルG	6,624,300	162	1,073,136,600	
紀陽ホールディングス	303,000	111	33,633,000	
山口フィナンシャルG	76,000	905	68,780,000	
芙蓉総合リース	7,600	1,935	14,706,000	
興銀リース	11,900	1,580	18,802,000	
東京センチュリーリース	20,000	889	17,780,000	
ＳＢＩホールディングス	7,350	14,580	107,163,000	
日本証券金融	35,000	601	21,035,000	
大阪証券金融	19,000	189	3,591,000	
アイフル	64,100	100	6,410,000	
ポケットカード	15,600	241	3,759,600	
長野銀行	38,000	187	7,106,000	
名古屋銀行	73,000	337	24,601,000	
愛知銀行	3,100	6,950	21,545,000	
第三銀行	54,000	226	12,204,000	
中京銀行	36,000	252	9,072,000	
東日本銀行	47,000	168	7,896,000	
愛媛銀行	54,000	247	13,338,000	
トマト銀行	44,000	189	8,316,000	
みなと銀行	91,000	102	9,282,000	
京葉銀行	68,000	446	30,328,000	
関西アーバン銀行	85,000	118	10,030,000	
栃木銀行	42,000	411	17,262,000	
北日本銀行	3,000	2,390	7,170,000	
香川銀行	31,000	270	8,370,000	

東和銀行	98,000	59	5,782,000	
徳島銀行	26,000	278	7,228,000	
武富士	48,560	418	20,298,080	
リコーリース	6,200	1,794	11,122,800	
イオン　クレジットサービス	36,600	878	32,134,800	
ア　コ　ム	20,340	1,153	23,452,020	
プロミス	34,550	578	19,969,900	
ジャックス	53,000	203	10,759,000	
日立キャピタル	19,900	1,139	22,666,100	
オリックス	39,660	5,980	237,166,800	
三菱ＵＦＪリース	20,840	2,595	54,079,800	
ジャフコ	11,400	2,075	23,655,000	
大和証券Ｇ本社	717,000	465	333,405,000	
野村ホールディングス	1,479,600	622	920,311,200	
みずほ証券	209,000	282	58,938,000	
みずほインベスタズ証	190,000	83	15,770,000	
岡三証券グループ	70,000	434	30,380,000	
丸三証券	27,200	512	13,926,400	
東洋証券	38,000	156	5,928,000	
東海東京ＨＤ	89,000	306	27,234,000	
光世証券	45,000	95	4,275,000	
水戸証券	28,000	173	4,844,000	
いちよし証券	18,700	593	11,089,100	
松井証券	49,600	585	29,016,000	
マネックスＧ	494	31,750	15,684,500	
カブドットコム証券	129	83,900	10,823,100	
極東証券	11,700	652	7,628,400	
岩井証券	8,700	580	5,046,000	
フィデアホール	44,600	164	7,314,400	
池田泉州ＨＤ	261,500	309	80,803,500	
三井住友海上ＨＤ	173,400	2,270	393,618,000	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	253	260,100	65,805,300	
日本興亜損害保険	271,000	514	139,294,000	
損害保険ジャパン	357,000	542	193,494,000	
ニッセイ同和損害保険	94,000	429	40,326,000	
あいおい損害保険	196,000	426	83,496,000	
富士火災	107,000	92	9,844,000	
東京海上ＨＤ	309,500	2,485	769,107,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	112,500	2,000	225,000,000	
三井不動産	340,000	1,490	506,600,000	
三菱地所	537,000	1,345	722,265,000	
平和不動産	65,500	268	17,554,000	
東京建物	116,000	286	33,176,000	
ダイビル	23,000	669	15,387,000	
サンケイビル	16,100	643	10,352,300	
東急不動産	155,000	308	47,740,000	
京阪神不動産	17,300	384	6,643,200	
住友不動産	184,000	1,495	275,080,000	
大京	92,000	180	16,560,000	
テーオーシー	35,100	331	11,618,100	
東京楽天地	21,000	367	7,707,000	
レオパレス２１	54,200	332	17,994,400	
空港施設	13,600	467	6,351,200	
住友不動産販売	3,280	3,530	11,578,400	
ゴールドクレスト	5,960	2,370	14,125,200	

日本エスリード	4,500	666	2,997,000	
東急リバブル	8,900	776	6,906,400	
飯田産業	4,700	1,372	6,448,400	
日神不動産	7,100	372	2,641,200	
アーネストワン	14,200	1,020	14,484,000	
イオンモール	37,500	1,585	59,437,500	
リサ・パートナーズ	122	60,200	7,344,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	514	62,100	31,919,400	
東武鉄道	335,000	480	160,800,000	
相鉄ホールディングス	119,000	387	46,053,000	
東京急行	426,000	379	161,454,000	
京浜急行	212,000	702	148,824,000	
小田急電鉄	249,000	710	176,790,000	
京王電鉄	218,000	547	119,246,000	
京成電鉄	120,000	488	58,560,000	
富士急行	28,000	468	13,104,000	
東日本旅客鉄道	143,900	6,100	877,790,000	
西日本旅客鉄道	669	321,000	214,749,000	
東海旅客鉄道	658	625,000	411,250,000	
西日本鉄道	110,000	352	38,720,000	
ハマキョウレックス	3,000	2,020	6,060,000	
近畿鉄道	702,000	333	233,766,000	
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	522,000	401	209,322,000	
南海電鉄	165,000	375	61,875,000	
京阪電鉄	174,000	373	64,902,000	
名古屋鉄道	271,000	278	75,338,000	
日本通運	328,000	384	125,952,000	
ヤマトホールディングス	156,600	1,198	187,606,800	
山　九	93,000	416	38,688,000	
日　新	38,000	220	8,360,000	
丸全昭和運輸	30,000	300	9,000,000	
センコー	30,000	315	9,450,000	
トナミホールディングス	25,000	186	4,650,000	
日本梱包運輸	24,000	921	22,104,000	
福山通運	58,000	437	25,346,000	
セイノーホールディングス	59,000	630	37,170,000	
神奈川中央交通	18,000	529	9,522,000	
日立物流	14,400	1,208	17,395,200	
日本郵船	411,000	269	110,559,000	
商船三井	371,000	483	179,193,000	
川崎汽船	198,000	251	49,698,000	
新和海運	32,000	237	7,584,000	
乾　汽　船	10,300	640	6,592,000	
明治海運	10,100	394	3,979,400	
飯野海運	39,500	393	15,523,500	
太平洋海運	37,000	67	2,479,000	
第一中央汽船	56,000	196	10,976,000	
全日本空輸	1,103,000	227	250,381,000	
パスコ	23,000	169	3,887,000	
三菱倉庫	56,000	912	51,072,000	
三井倉庫	36,000	305	10,980,000	
住友倉庫	57,000	388	22,116,000	
渋沢倉庫	25,000	250	6,250,000	
ヤマタネ	48,000	113	5,424,000	
東陽倉庫	34,000	174	5,916,000	

日本トランスシティ	22,000	251	5,522,000	
東洋埠頭	41,000	178	7,298,000	
上　組	91,000	682	62,062,000	
郵船航空サービス	7,300	1,234	9,008,200	
近鉄エクスプレス	6,900	2,295	15,835,500	
バンテック	45	115,000	5,175,000	
東京放送ＨＤ	43,900	1,344	59,001,600	
日本テレビ放送網	7,130	12,540	89,410,200	
テレビ朝日	207	131,000	27,117,000	
テレビ東京	3,300	1,940	6,402,000	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	647	38,950	25,200,650	
イー・アクセス	420	61,100	25,662,000	
ＮＥＣモバイリング	3,300	2,430	8,019,000	
日本電信電話	322,200	3,750	1,208,250,000	
ＫＤＤＩ	1,273	467,000	594,491,000	
光通信	10,700	1,486	15,900,200	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,786	131,000	888,966,000	※
ＧＭＯインターネット	25,600	369	9,446,400	
学研ホールディングス	38,000	230	8,740,000	
ゼンリン	11,700	1,055	12,343,500	
昭文社	7,700	550	4,235,000	
角川グループＨＬＤＧＳ	7,300	2,340	17,082,000	
東京電力	486,400	2,330	1,133,312,000	
中部電力	260,200	2,210	575,042,000	
関西電力	319,100	2,150	686,065,000	
中国電力	113,400	1,750	198,450,000	
北陸電力	79,200	1,968	155,865,600	
東北電力	192,700	1,827	352,062,900	
四国電力	85,400	2,585	220,759,000	
九州電力	169,400	1,899	321,690,600	
北海道電力	71,600	1,724	123,438,400	
沖縄電力	5,700	5,290	30,153,000	
電源開発	51,400	2,685	138,009,000	
東京瓦斯	979,000	356	348,524,000	
大阪瓦斯	837,000	315	263,655,000	
東邦瓦斯	217,000	485	105,245,000	
西部瓦斯	107,000	254	27,178,000	
静岡瓦斯	26,000	603	15,678,000	
松　竹	47,000	809	38,023,000	
東　宝	58,900	1,384	81,517,600	
エイチ・アイ・エス	8,400	1,694	14,229,600	
東　映	33,000	449	14,817,000	
ＮＴＴデータ	507	244,900	124,164,300	
共立メンテナンス	5,200	1,373	7,139,600	
東京テアトル	44,000	143	6,292,000	
よみうりランド	23,000	284	6,532,000	
東京都競馬	68,000	128	8,704,000	
常磐興産	47,000	143	6,721,000	
カナモト	16,000	319	5,104,000	
東京ドーム	65,000	254	16,510,000	
ＤＴＳ	9,800	760	7,448,000	
スクウェア・エニックス・ＨＤ	20,700	1,881	38,936,700	
シーイーシー	8,800	465	4,092,000	
カプコン	17,400	1,392	24,220,800	
日本空港ビルデング	20,000	1,108	22,160,000	

トランス・コスモス	11,000	701	7,711,000	
乃村工藝社	27,000	244	6,588,000	
住商情報システム	9,500	1,257	11,941,500	
藤田観光	25,000	370	9,250,000	
近畿日本ツーリスト	46,000	73	3,358,000	
日本管財	4,100	1,550	6,355,000	
セコム	78,200	4,040	315,928,000	
ＣＳＫホールディングス	32,700	348	11,379,600	
アイネス	12,300	725	8,917,500	
メイテツク	12,100	1,263	15,282,300	
ＴＫＣ	8,900	1,727	15,370,300	
アサツー　ディ・ケイ	15,400	1,687	25,979,800	
富士ソフト	10,600	1,498	15,878,800	
ソラン	13,000	786	10,218,000	
応用地質	10,200	748	7,629,600	
日システム	19,200	929	17,836,800	
コナミ	33,700	1,442	48,595,400	
ベネッセホールディングス	27,200	3,860	104,992,000	
イオンディライト	7,000	1,142	7,994,000	
ニチイ学館	18,100	794	14,371,400	
ダイセキ	14,300	1,938	27,713,400	
トラスコ中山	9,900	1,254	12,414,600	
ヤマダ電機	37,150	5,190	192,808,500	
オートバックスセブン	9,700	2,605	25,268,500	
アークランドサカモト	6,100	1,030	6,283,000	
ニ　ト　リ	14,600	7,240	105,704,000	
愛　眼	9,000	495	4,455,000	
吉野家ホールディングス	223	101,500	22,634,500	
加藤産業	12,500	1,712	21,400,000	
イエローハット	8,800	726	6,388,800	
富士エレクトロニクス	7,000	730	5,110,000	
松屋フーズ	5,200	1,300	6,760,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,700	590	6,903,000	
ＪＫホールディングス	10,900	379	4,131,100	
サガミチェーン	11,000	791	8,701,000	
日　伝	4,100	2,075	8,507,500	
因幡電機産業	8,500	2,100	17,850,000	
住金物産	42,000	169	7,098,000	
プレナス	9,500	1,165	11,067,500	
ミニストップ	7,100	1,117	7,930,700	
アークス	10,700	1,231	13,171,700	
バ　ロ　ー	17,200	685	11,782,000	
ミスミグループ本社	27,700	1,576	43,655,200	
大　庄	6,100	1,204	7,344,400	
タキヒヨー	16,000	474	7,584,000	
ファーストリテイリング	16,400	15,680	257,152,000	
ソフトバンク	334,900	2,070	693,243,000	
スズケン	28,900	3,160	91,324,000	
サンドラッグ	15,900	2,230	35,457,000	
ベルーナ	13,350	338	4,512,300	
合計	113,894,173		85,334,744,080	

次へ

（注） ※先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車　5,000株　エヌ・ティ・ティ・ドコモ　300株

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額（円）	備考
新株予約権証券	ＤＯＷＡホールディングス	50,000	1,150,000	
新株予約権証券 合計		50,000	1,150,000	
合計		50,000	1,150,000	

新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券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

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

次へ

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成20年12月1日現在 金 額（円）	平成21年11月30日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	474,076,224	330,404,393
国債証券	20,141,204,360	33,365,251,460
地方債証券	2,633,838,891	4,097,875,571
特殊債券	4,026,519,442	5,765,306,059
社債券	2,881,276,815	6,280,247,172
未収入金	656,387,080	―
未収利息	107,554,887	184,512,325
前払費用	12,229,503	22,969,289
流動資産合計	30,933,087,202	50,046,566,269
資産合計	30,933,087,202	50,046,566,269
負債の部		
流動負債		
未払金	970,987,320	167,750,740
未払解約金	620,000	3,582,022
流動負債合計	971,607,320	171,332,762
負債合計	971,607,320	171,332,762
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	26,046,441,947	42,125,615,868
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,915,037,935	7,749,617,639
元本等合計	29,961,479,882	49,875,233,507
純資産合計	29,961,479,882	49,875,233,507
負債純資産合計	30,933,087,202	50,046,566,269

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,886,820,847円	26,046,441,947円
同期中における追加設定元本額	17,204,819,334円	17,021,304,185円
同期中における一部解約元本額	5,045,198,234円	942,130,264円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	394,547,894円	395,753,572円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	2,840,285,759円	2,779,471,808円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	373,016,093円	389,440,841円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	3,447,906,306円	3,540,347,140円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	1,989,684,054円	2,189,587,022円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	14,099,729,574円	26,082,660,375円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	3,328,015,683円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	63,438円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	59,213円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	2,569,728,244円	3,022,483,477円
ダイワライフスタイル２５	153,561,922円	183,525,749円
ダイワライフスタイル５０	139,212,657円	165,720,203円
ダイワライフスタイル７５	38,769,444円	48,487,347円
計	26,046,441,947円	42,125,615,868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	26,046,441,947口	42,125,615,868口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月1日現在		平成21年11月30日現在	
	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	20,141,204,360	165,623,100	33,365,251,460	330,256,070
地方債証券	2,633,838,891	13,482,427	4,097,875,571	50,774,429
特殊債券	4,026,519,442	21,225,523	5,765,306,059	71,310,297
社債券	2,881,276,815	△22,552,977	6,280,247,172	81,388,437
合計	29,682,839,508	177,778,073	49,508,680,262	533,729,233

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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（平成19年12月1日から平成20年12月1日まで、及び平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日

該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1503円 (11,503円)	1.1840円 (11,840円)

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

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	１　４０年国債	85,000,000	89,745,550	
	１　３０年国債	16,000,000	18,045,600	
	２　４０年国債	69,000,000	69,000,000	
	２　３０年国債	24,000,000	25,473,600	
	３　３０年国債	30,000,000	31,329,300	
	４　３０年国債	30,000,000	34,394,400	
	５　３０年国債	28,000,000	28,689,920	
	６　３０年国債	24,000,000	25,387,440	
	７　３０年国債	37,000,000	38,451,880	
	８　３０年国債	19,000,000	17,991,290	
	９　３０年国債	37,000,000	32,275,840	
	１０　３０年国債	39,000,000	31,756,920	
	１１　３０年国債	44,000,000	40,650,280	
	１２　３０年国債	35,000,000	34,916,700	
	１３　３０年国債	36,000,000	35,227,440	
	１４　３０年国債	52,000,000	54,773,680	
	１５　３０年国債	39,000,000	41,797,080	
	１６　３０年国債	41,000,000	43,960,610	
	１７　３０年国債	45,000,000	47,331,900	
	１８　３０年国債	45,000,000	46,448,100	
	１９　３０年国債	45,000,000	46,418,850	
	２０　３０年国債	52,000,000	55,713,320	
	２１　３０年国債	48,000,000	49,491,360	
	２２　３０年国債	48,000,000	51,426,240	
	２２　利付国債２０年	3,000,000	3,484,590	
	２３　３０年国債	65,000,000	69,668,300	
	２３　利付国債２０年	2,000,000	2,379,740	
	２４　３０年国債	54,000,000	57,902,040	
	２４　利付国債２０年	4,000,000	4,716,960	
	２５　３０年国債	65,000,000	67,011,100	
	２６　３０年国債	116,000,000	121,931,080	
	２６　利付国債２０年	4,000,000	4,750,400	
	２７　３０年国債	130,000,000	139,370,400	
	２８　３０年国債	111,000,000	119,090,790	
	２８　利付国債２０年	6,000,000	7,371,360	
	２９　３０年国債	173,000,000	181,985,620	
	２９　利付国債２０年	7,000,000	8,412,390	

	３０　３０年国債	159,000,000	163,727,070	
	３０　利付国債２０年	30,000,000	35,172,900	
	３１　３０年国債	64,000,000	64,522,240	
	３１　利付国債２０年	18,000,000	21,070,800	
	３２　利付国債２０年	16,000,000	18,922,880	
	３３　利付国債２０年	22,000,000	26,305,620	
	３４　利付国債２０年	9,000,000	10,663,470	
	３５　利付国債２０年	22,000,000	25,754,520	
	３６　利付国債２０年	21,000,000	24,186,540	
	３７利付国債２０年	23,000,000	26,667,120	
	３８利付国債２０年	60,000,000	67,810,800	
	３９　２０年国債	90,000,000	100,911,600	
	４０　２０年国債	57,000,000	62,436,090	
	４１　２０年国債	151,000,000	154,916,940	
	４２　２０年国債	87,000,000	97,591,380	
	４３　２０年国債	105,000,000	120,860,250	
	４４　２０年国債	65,000,000	72,310,550	
	４５　２０年国債	78,000,000	86,062,080	
	４６　２０年国債	73,000,000	78,985,270	
	４７　２０年国債	89,000,000	96,175,180	
	４８　２０年国債	54,000,000	59,941,620	
	４９　２０年国債	64,000,000	68,270,080	
	５０　２０年国債	107,000,000	111,890,970	
	５１　２０年国債	57,000,000	60,130,440	
	５２　５年国債	130,000,000	130,841,100	
	５２　２０年国債	52,000,000	55,349,840	
	５３　５年国債	61,000,000	61,522,160	
	５３　２０年国債	66,000,000	70,147,440	
	５４　５年国債	10,000,000	10,117,300	
	５４　２０年国債	50,000,000	53,680,500	
	５５　５年国債	110,000,000	111,716,000	
	５５　２０年国債	79,000,000	82,927,880	
	５６　５年国債	100,000,000	101,689,000	
	５６　２０年国債	71,000,000	74,433,560	
	５７　５年国債	115,000,000	117,116,000	
	５７　２０年国債	70,000,000	72,573,200	
	５８　５年国債	56,000,000	57,116,640	
	５８　２０年国債	81,000,000	83,847,960	
	５９　５年国債	78,000,000	79,315,080	
	５９　２０年国債	62,000,000	62,601,400	
	６０　５年国債	83,000,000	84,463,290	
	６０　２０年国債	72,000,000	70,029,360	
	６１　５年国債	232,000,000	236,607,520	
	６１　２０年国債	74,000,000	68,124,400	
	６２　５年国債	230,000,000	235,034,700	
	６２　２０年国債	75,000,000	66,978,000	
	６３　５年国債	319,000,000	325,944,630	
	６３　２０年国債	78,000,000	79,251,120	
	６４　５年国債	241,000,000	248,555,350	
	６４　２０年国債	99,000,000	101,609,640	
	６５　５年国債	120,000,000	123,458,400	
	６５　２０年国債	103,000,000	105,515,260	
	６６　５年国債	305,000,000	311,984,500	
	６６　２０年国債	42,000,000	42,500,220	
	６７　５年国債	197,000,000	202,632,230	
	６７　２０年国債	46,000,000	47,030,860	
	６８　５年国債	203,000,000	207,965,380	

	６８　２０年国債	51,000,000	54,087,540	
	６９　５年国債	425,000,000	432,828,500	
	６９　２０年国債	101,000,000	105,827,800	
	７０　５年国債	248,000,000	251,836,560	
	７０　２０年国債	93,000,000	100,885,470	
	７１　５年国債	195,000,000	201,193,200	
	７１　２０年国債	72,000,000	76,286,880	
	７２　５年国債	228,000,000	237,097,200	
	７２　２０年国債	170,000,000	177,514,000	
	７３　５年国債	91,000,000	93,993,900	
	７３　２０年国債	80,000,000	82,332,800	
	７４　５年国債	120,000,000	122,666,400	
	７４　２０年国債	80,000,000	83,384,000	
	７５　５年国債	143,000,000	146,770,910	
	７５　２０年国債	63,000,000	65,501,730	
	７６　５年国債	223,000,000	229,714,530	
	７６　２０年国債	71,000,000	71,937,200	
	７７　５年国債	228,000,000	233,159,640	
	７７　２０年国債	65,000,000	66,678,300	
	７８　５年国債	52,000,000	52,971,880	
	７８　２０年国債	71,000,000	71,731,300	
	７９　５年国債	49,000,000	49,525,770	
	７９　２０年国債	54,000,000	55,311,660	
	８０　５年国債	211,000,000	214,103,810	
	８０　２０年国債	70,000,000	72,683,100	
	８１　５年国債	508,000,000	515,162,800	
	８１　２０年国債	79,000,000	80,744,320	
	８２　５年国債	230,000,000	234,209,000	
	８２　２０年国債	125,000,000	129,532,500	
	８３　５年国債	270,000,000	274,797,900	
	８３　２０年国債	88,000,000	91,003,440	
	８４　５年国債	315,000,000	317,727,900	
	８４　２０年国債	101,000,000	103,001,820	
	８５　５年国債	325,000,000	327,505,750	
	８５　２０年国債	95,000,000	98,034,300	
	８６　５年国債	220,000,000	220,719,400	
	８６　２０年国債	70,000,000	74,222,400	
	８７　２０年国債	72,000,000	75,296,160	
	８８　２０年国債	130,000,000	137,671,300	
	８９　２０年国債	88,000,000	91,901,040	
	９０　２０年国債	146,000,000	152,254,640	
	９１　２０年国債	83,000,000	87,785,780	
	９２　２０年国債	214,000,000	219,651,740	
	９３　２０年国債	86,000,000	86,892,680	
	９４　２０年国債	132,000,000	135,259,080	
	９５　２０年国債	112,000,000	117,971,840	
	９６　２０年国債	123,000,000	125,905,260	
	９７　２０年国債	132,000,000	136,811,400	
	９８　２０年国債	101,000,000	103,137,160	
	９９　２０年国債	228,000,000	232,564,560	
	１００　２０年国債	160,000,000	165,392,000	
	１０１　２０年国債	66,000,000	70,288,680	
	１０２　２０年国債	101,000,000	107,482,180	
	１０３　２０年国債	71,000,000	74,434,980	
	１０４　２０年国債	85,000,000	86,441,600	
	１０５　２０年国債	176,000,000	178,770,240	
	１０６　２０年国債	108,000,000	111,483,000	

	１０７　２０年国債	86,000,000	87,246,140	
	１０８　２０年国債	195,000,000	191,647,950	
	１０９　２０年国債	83,000,000	81,447,070	
	１１０　２０年国債	163,000,000	165,268,960	
	１１１　２０年国債	101,000,000	103,910,820	
	１１２　２０年国債	207,000,000	209,612,340	
	１１３　２０年国債	223,000,000	225,522,130	
	２２５　利付国債	18,000,000	18,323,280	
	２２６　利付国債	60,000,000	61,018,200	
	２２７　利付国債	22,000,000	22,399,520	
	２２８　利付国債	21,000,000	21,354,060	
	２２９　１０年国債	42,000,000	42,651,420	
	２３０　１０年国債	17,000,000	17,198,730	
	２３１　１０年国債	46,000,000	46,775,560	
	２３２　１０年国債	29,000,000	29,444,280	
	２３３　１０年国債	88,000,000	89,619,200	
	２３４　１０年国債	183,000,000	186,881,430	
	２３５　１０年国債	78,000,000	79,858,740	
	２３６　１０年国債	68,000,000	69,765,960	
	２３７　１０年国債	43,000,000	44,235,390	
	２３８　１０年国債	88,000,000	90,327,600	
	２３９　１０年国債	35,000,000	36,008,700	
	２４０　１０年国債	3,000,000	3,078,870	
	２４１　１０年国債	48,000,000	49,365,600	
	２４２　１０年国債	19,000,000	19,490,390	
	２４３　１０年国債	36,000,000	36,829,440	
	２４４　１０年国債	60,000,000	61,276,800	
	２４５　１０年国債	62,000,000	63,132,120	
	２４６　１０年国債	25,000,000	25,381,000	
	２４７　１０年国債	148,000,000	150,289,560	
	２４８　１０年国債	6,000,000	6,073,260	
	２４９　１０年国債	25,000,000	25,219,750	
	２５０　１０年国債	58,000,000	58,273,760	
	２５１　１０年国債	30,000,000	30,567,000	
	２５２　１０年国債	55,000,000	56,232,000	
	２５３　１０年国債	30,000,000	31,352,400	
	２５４　１０年国債	85,000,000	88,212,150	
	２５５　１０年国債	72,000,000	74,975,760	
	２５６　１０年国債	129,000,000	134,002,620	
	２５７　１０年国債	50,000,000	51,740,000	
	２５８　１０年国債	138,000,000	142,849,320	
	２５９　１０年国債	255,000,000	266,163,900	
	２６０　１０年国債	49,000,000	51,406,390	
	２６１　１０年国債	124,000,000	131,221,760	
	２６２　１０年国債	76,000,000	80,764,440	
	２６３　１０年国債	145,000,000	152,328,300	
	２６４　１０年国債	223,000,000	233,173,260	
	２６５　１０年国債	139,000,000	145,448,210	
	２６６　１０年国債	78,000,000	81,235,440	
	２６７　１０年国債	117,000,000	121,248,270	
	２６８　１０年国債	172,000,000	180,032,400	
	２６９　１０年国債	481,000,000	498,397,770	
	２７０　１０年国債	230,000,000	238,254,700	
	２７１　１０年国債	72,000,000	74,178,720	
	２７２　１０年国債	58,000,000	60,412,800	
	２７３　１０年国債	161,000,000	168,597,590	
	２７４　１０年国債	172,000,000	180,137,320	

	２７５　２年国債	65,000,000	65,284,700	
	２７５　１０年国債	125,000,000	130,151,250	
	２７６　２年国債	367,000,000	368,306,520	
	２７６　１０年国債	150,000,000	157,968,000	
	２７７　２年国債	505,000,000	506,302,900	
	２７７　１０年国債	113,000,000	118,985,610	
	２７８　２年国債	523,000,000	524,464,400	
	２７８　１０年国債	104,000,000	110,795,360	
	２７９　２年国債	246,000,000	246,718,320	
	２７９　１０年国債	251,000,000	270,502,700	
	２８０　１０年国債	306,000,000	327,952,440	
	２８１　２年国債	427,000,000	428,336,510	
	２８１　１０年国債	108,000,000	116,458,560	
	２８２　２年国債	250,000,000	250,400,000	
	２８２　１０年国債	250,000,000	264,675,000	
	２８３　２年国債	287,000,000	287,459,200	
	２８３　１０年国債	260,000,000	277,027,400	
	２８４　２年国債	401,000,000	401,637,590	
	２８４　１０年国債	293,000,000	310,175,660	
	２８５　２年国債	475,000,000	474,867,000	
	２８５　１０年国債	347,000,000	367,507,700	
	２８６　１０年国債	302,000,000	321,657,180	
	２８７　１０年国債	200,000,000	214,584,000	
	２８８　１０年国債	779,000,000	822,904,440	
	２８９　１０年国債	312,000,000	324,221,040	
	２９０　１０年国債	255,000,000	262,407,750	
	２９１　１０年国債	204,000,000	208,286,040	
	２９２　１０年国債	232,000,000	244,249,600	
	２９３　１０年国債	242,000,000	256,232,020	
	２９４　１０年国債	161,000,000	169,206,170	
	２９５　１０年国債	225,000,000	232,755,750	
	２９６　１０年国債	460,000,000	474,568,200	
	２９７　１０年国債	289,000,000	294,918,720	
	２９８　１０年国債	377,000,000	381,474,990	
	２９９　１０年国債	323,000,000	325,835,940	
	３００　１０年国債	245,000,000	251,458,200	
	３０１　１０年国債	540,000,000	552,690,000	
	３０２　１０年国債	206,000,000	208,991,120	
	３０３　１０年国債	340,000,000	344,301,000	
	３０４　１０年国債	245,000,000	245,852,600	
国債証券　合計		32,350,000,000	33,365,251,460	
地方債証券	６　共同発行地方債	110,100,000	114,693,261	
	８　共同発行地方債	111,000,000	115,733,706	
	１２　共同発行地方	120,000,000	124,269,960	
	１４　共同発行地方	100,000,000	104,038,800	
	１５　共同発行地方	100,000,000	104,507,500	
	２７　共同発行地方	100,000,000	103,101,100	
	３０　共同発行地方	100,000,000	103,044,200	
	５１　共同発行地方	100,000,000	106,581,000	
	５７　共同発行地方	100,000,000	104,317,100	
	６１　共同発行地方	100,000,000	103,262,500	
	７６　川崎市公債	100,000,000	101,237,400	
	１１５　神奈川県公債	156,000,000	158,271,048	
	１３９　神奈川県公債	100,000,000	106,810,700	
	３０８　大阪府公債	100,000,000	104,201,900	
	５７６　東京都公債	110,000,000	112,093,300	

	５７７　東京都公債	124,000,000	126,445,528	
	５８３　東京都公債	100,000,000	102,700,300	
	６０４　東京都公債	120,000,000	124,731,120	
	６３５　東京都公債	100,000,000	107,287,200	
	６５４　東京都公債	104,000,000	108,021,368	
	１２－こ　名古屋市債	30,000,000	30,775,290	
	１２－ゆ　名古屋市債	100,000,000	103,560,400	
	１２－ひ　名古屋市債	100,000,000	103,078,400	
	１３－１　静岡県公債	96,510,000	98,154,144	
	１４－１　埼玉県公債	128,500,000	131,749,122	
	１４－１　横浜市公債	116,000,000	119,086,064	
	１４－２　愛知県公債	100,000,000	102,647,400	
	１４－５　横浜市公債	100,000,000	101,237,800	
	１７－４　横浜市公債	100,000,000	104,279,700	
	１７－５　埼玉県公債	100,000,000	103,603,000	
	１７－７　静岡県公債	100,000,000	105,341,400	
	１７－８　兵庫県公債	100,000,000	103,313,000	
	１９－５　札幌市５年	100,000,000	102,478,500	
	２０－３　京都市５年	100,000,000	101,532,900	
	２０－６　愛知県公債	100,000,000	103,949,600	
	１６　川崎市５年	100,000,000	103,168,700	
	１８　川崎市５年	140,000,000	142,577,960	
	２８　大阪府５年	100,000,000	101,993,200	
地方債証券　合計		3,966,110,000	4,097,875,571	
特殊債券	１アフリカ開発銀行ＳＵＢ	170,000,000	196,304,780	
	５　政保中部空港	36,000,000	36,517,644	
	６　政保政策投資ＢＫ	118,000,000	119,696,132	
	７　政保国民生活	38,000,000	39,052,220	
	１４　政保国民生活	179,000,000	186,893,721	
	１０５　政保預金保険	100,000,000	101,316,400	
	１０８　政保預金保険	100,000,000	102,022,200	
	１９０　政保首都高速	10,000,000	10,380,690	
	２０３　信金中金	100,000,000	101,935,700	
	２１０　信金中金	100,000,000	102,195,400	
	２２０　信金中金	100,000,000	101,856,300	
	３１２　政保道路債	100,000,000	101,518,200	
	３１７　政保道路債	72,000,000	72,256,536	
	３１９　政保道路債	147,000,000	149,601,165	
	３２３　政保道路債	119,000,000	123,931,241	
	３２８　政保道路債	112,000,000	116,823,392	
	３３１　政保道路債	49,000,000	51,842,539	
	３３３　政保道路債	115,000,000	120,655,355	
	３３４　政保道路債	100,000,000	104,459,000	
	８００　政保公営企業	133,000,000	135,019,206	
	８０３　政保公営企業	114,000,000	115,874,958	
	８０９　政保公営企業	100,000,000	102,327,800	
	８１６　政保公営企業	116,000,000	119,258,208	
	８１８　政保公営企業	128,000,000	131,462,272	
	８１９　政保公営企業	103,000,000	105,851,967	
	８２８　政保公営企業	100,000,000	100,356,500	
	８２９　政保公営企業	139,000,000	142,460,127	
	８３１　政保公営企業	25,000,000	26,102,375	
	８４２　政保公営企業	11,000,000	11,637,043	
	８６８　政保公営企業	100,000,000	106,301,300	
	２４　政保中日本道	100,000,000	100,738,500	
	い６７７　利付農林債	100,000,000	101,846,900	

	い６８０　みずほコーポ	100,000,000	101,051,700	
	い６８２　利付農林債	100,000,000	101,972,400	
	い６８６　利付農林債	100,000,000	103,111,300	
	い６９２　利付農林債	100,000,000	102,143,600	
	い６９４　利付商工債	100,000,000	102,016,100	
	１００　利付商工債	100,000,000	101,098,300	
	１　公営企業５年	100,000,000	102,199,300	
	２　成田国際空港	100,000,000	104,466,700	
	１５　道路機構	100,000,000	107,287,900	
	２　住宅支援機構	100,000,000	105,595,800	
	１　政保道路機構	24,000,000	25,079,568	
	２３　政保道路機構	100,000,000	105,624,500	
	２７　政保道路機構	100,000,000	106,354,100	
	３０　政保道路機構	12,000,000	12,678,720	
	３３　政保道路機構	100,000,000	105,616,200	
	４７　政保道路機構	100,000,000	103,582,900	
	６６　政保道路機構	100,000,000	102,806,500	
	１　公営企業	100,000,000	102,218,300	
	２　道路債券	100,000,000	102,975,200	
	５　中日本高速道路	100,000,000	104,847,000	
	６　首都高速道路	100,000,000	101,169,100	
	６　国際協力銀行	100,000,000	102,269,400	
	１３　首都高速道路	100,000,000	103,847,400	
	２７　日本政策投資Ｂ	100,000,000	106,894,100	
	２７　国際協力銀行	100,000,000	105,592,800	
	３７　道路債券	100,000,000	104,311,400	
特殊債券　合計		5,570,000,000	5,765,306,059	
社債券	４　ブリヂストン	100,000,000	100,982,700	
	６　トヨタ自動車	200,000,000	204,742,200	
	８　オリエンタルランド	100,000,000	101,150,200	
	８　ＮＴＴドコモ	100,000,000	101,458,600	
	９　トヨタ自動車	100,000,000	101,643,200	
	１０　ホンダフアイナンス	100,000,000	102,569,000	
	１２　三菱ＵＦＪフイナンシヤ	100,000,000	101,041,000	
	１２　みずほコーポレート	100,000,000	102,346,200	
	１３　豊田自動織機	100,000,000	103,153,200	
	１４　日立製作所	100,000,000	101,999,000	
	１６　電源開発	100,000,000	106,859,700	
	１８東日本旅客鉄道	100,000,000	102,979,300	
	１９　ソニー	100,000,000	103,121,600	
	１９　三洋電機	100,000,000	100,729,500	
	２０　三菱重工業	100,000,000	102,610,000	
	２０　トヨタフアイナンス	100,000,000	101,744,200	
	２０　ＮＴＴデータ	100,000,000	102,110,500	
	２３　新日本石油	100,000,000	100,840,400	
	２３　住友商事	100,000,000	101,454,800	
	２６　東レ	100,000,000	101,898,700	
	２６　日本郵船	100,000,000	102,799,500	
	２８　東海旅客鉄道	100,000,000	106,254,200	
	３１　クレデイセゾン	100,000,000	97,140,400	
	３４　石川島播磨	100,000,000	97,491,300	
	３４　トヨタフアイナンス	100,000,000	101,671,000	
	３５東日本旅客鉄道	100,000,000	101,317,300	
	３６　三井化学	100,000,000	101,165,700	
	４９　電信電話債	100,000,000	103,690,100	
	５０　東京急行電鉄	100,000,000	102,828,700	

	５２　アコム	100,000,000	98,710,500	
	５４　新日本製鐵	100,000,000	101,968,900	
	６１　住友不動産	100,000,000	100,643,500	
	６８　丸紅	100,000,000	102,430,300	
	８４　三菱東京ＵＦＪＢＫ	100,000,000	101,813,900	
	１００三菱東京ＵＦＪＢＫ	100,000,000	102,837,300	
	１－Ｂ　日本生命２００９	100,000,000	101,589,600	
	２　三菱信託ＢＫ劣後	100,000,000	103,510,900	
	２６１　北海道電力	6,000,000	6,765,876	
	３０６　中国電力	100,000,000	117,713,000	
	３　ＵＦＪ銀行　ＳＵＢ	100,000,000	101,164,100	
	３２２　東京交通債	100,000,000	115,719,500	
	３２８　中国電力	111,000,000	116,067,372	
	４　日本通運	100,000,000	101,522,400	
	４０２　東北電力	100,000,000	101,488,200	
	４０５　中部電力	100,000,000	118,026,700	
	４４０　関西電力	100,000,000	103,795,700	
	４６４　東京電力	100,000,000	102,778,900	
	４７４　中部電力	100,000,000	105,092,900	
	４８０　東京電力	100,000,000	101,577,800	
	４８２　東京電力	100,000,000	101,654,800	
	４９５　東京電力	112,000,000	114,948,960	
	５　デンソー	100,000,000	102,734,500	
	５１３　東京電力	127,000,000	134,039,102	
	５１６　東京電力	142,000,000	147,085,162	
	５２１　東京電力	100,000,000	106,794,900	
	６　パナソニツク	100,000,000	101,546,200	
	８　三井不動産	100,000,000	108,035,600	
	６　ゴールドマン　サツクス	100,000,000	98,942,300	
	２　ＡＵＳＴ・ＮＺ銀行	100,000,000	100,791,500	
	７　ＧＥキヤピタル	100,000,000	98,664,600	
社債券　合計		6,098,000,000	6,280,247,172	
合計		47,984,110,000	49,508,680,262	

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。

次へ

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		平成20年12月1日現在 金 額（円）	平成21年11月30日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		671,091,224	283,929,513
コール・ローン		842,131,877	114,931,400
株式		29,308,040,867	43,183,357,005
投資証券		340,388,474	574,397,700
派生商品評価勘定		2,206,427	30,062,303
未収入金		15,558,858	39,115,351
未収配当金		86,893,035	99,566,613
差入委託証拠金		287,955,938	181,887,438
流動資産合計		31,554,266,700	44,507,247,323
資産合計		31,554,266,700	44,507,247,323
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		103,781,805	―
未払金		1,349,895,308	73,591,446
未払解約金		―	98,807,000
流動負債合計		1,453,677,113	172,398,446
負債合計		1,453,677,113	172,398,446
純資産の部			
元本等			
元本	※1	43,835,021,720	52,731,230,778
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△13,734,432,133	△8,396,381,901
元本等合計		30,100,589,587	44,334,848,877
純資産合計		30,100,589,587	44,334,848,877
負債純資産合計		31,554,266,700	44,507,247,323

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券	(1)株式 同左 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	同左	
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	(1)先物取引 同左	
	(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。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	(2)為替予約取引 同左	
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金 同左	
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準	

	外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
1. ※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,869,677,806円	43,835,021,720円
同期中における追加設定元本額	25,297,299,569円	15,158,958,941円
同期中における一部解約元本額	5,331,955,655円	6,262,749,883円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	1,722,479,023円	1,987,953,358円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	126,756,640円	109,864,137円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	1,600,387,294円	1,712,103,233円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	267,390,782円	231,531,734円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	5,432,824,988円	5,350,393,621円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	7,674,502,236円	10,512,977,323円
ダイワ・ライフ・バランス３０	542,690,850円	474,924,269円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,458,703円	36,625,859円
ダイワ・ライフ・バランス７０	8,126,950円	22,344,684円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,049,640,167円	1,252,024,659円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	1,546,018円	4,356,044円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	1,384,156円	1,827,810円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	302,512円	419,525円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	159,594,150円	145,940,796円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	2,257,428,321円	2,128,512,519円

ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	46,897,529円	42,781,130円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	415,193,276円	453,192,749円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	8,258,161,514円	6,897,256,021円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	1,833,077,550円	1,615,740,214円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	10,544,243,362円	16,777,951,661円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	593,030,311円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	1,763,208,888円	2,252,382,065円
ダイワライフスタイル２５	19,998,435円	19,314,099円
ダイワライフスタイル５０	55,752,081円	57,112,849円
ダイワライフスタイル７５	47,976,295円	50,670,108円
計	43,835,021,720円	52,731,230,778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	43,835,021,720口	52,731,230,778口
3．※2 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13,734,432,133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8,396,381,901円であります。

（有価証券関係に関する注記）
売買目的有価証券

種 類	平成20年12月1日現在		平成21年11月30日現在	
	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	29,308,040,867	△13,434,452,085	43,183,357,005	8,089,591,757
投資証券	340,388,474	△248,507,374	574,397,700	83,321,877
合計	29,648,429,341	△13,682,959,459	43,757,754,705	8,172,913,634

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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（平成19年12月1日から平成20年12月1日まで、及び平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
Ⅰ 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1．取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。	同左

2．取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4．取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5．取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ 取引の時価等に関する事項

1．株式関連

種 類	平成20年12月1日 現在				平成21年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	526,139,793	－	426,655,215	△99,484,578	537,414,667	－	567,476,970	30,062,303
合計	526,139,793	－	426,655,215	△99,484,578	537,414,667	－	567,476,970	30,062,303

（注） 1．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種 類	平成20年12月1日 現在				平成21年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	216,016,000	－	213,925,200	△2,090,800	－	－	－	－
イギリス・ポンド	49,820,200	－	49,711,400	△108,800	－	－	－	－
カナダ・ドル	74,690,000	－	74,340,800	△349,200	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	5,496,800	－	5,460,000	△36,800	－	－	－	－
ユーロ	86,009,000	－	84,413,000	△1,596,000	－	－	－	－
合計	216,016,000	－	213,925,200	△2,090,800	－	－	－	－

（注） 1．時価の算定方法
(1) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
(2) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6867円 (6,867円)	0.8408円 (8,408円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表
(1) 株式

通 貨	銘 柄	株 式 数	評価額		備考
			単 価	金 額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,300	120.300	156,390.000	

AVON PRODUCTS	10,700	34.690	371,183.000	
ABBOTT LABS	38,500	54.080	2,082,080.000	
ALCOA	24,400	12.660	308,904.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,500	15.790	86,845.000	
AMPHENOL CORP-CL A	5,500	41.350	227,425.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMA	8,929	22.530	201,170.370	
LENDER PROCESSING SERVICE	2,800	41.620	116,536.000	
VALIDUS HOLDINGS LTD	3,400	25.730	87,482.000	
ALLEGHENY ENERGY INC	4,300	21.950	94,385.000	
AFLAC INC	11,900	43.650	519,435.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,500	31.150	109,025.000	
HANSEN NATURAL CORPORATIO	2,200	34.760	76,472.000	
ADOBE SYSTEMS	13,200	35.380	467,016.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,500	83.940	125,910.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	16.370	170,248.000	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	99.460	179,028.000	
GARMIN LTD	3,900	31.010	120,939.000	
AETNA INC	11,600	29.440	341,504.000	
DST SYSTEMS INC	1,500	42.060	63,090.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,300	82.110	435,183.000	
ALTERA CORPORATION	9,400	20.910	196,554.000	
FORTUNE BRANDS INC	4,900	38.420	188,258.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL	17,800	38.480	684,944.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	17.150	72,904.650	
WR BERKLEY CORP	4,700	24.220	113,834.000	
AUTOZONE INC	1,200	150.050	180,060.000	
DOLLAR TREE INC	2,500	50.580	126,450.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,400	34.900	118,660.000	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	3,000	34.190	102,570.000	
CELANESE CORP-SERIES A	5,400	29.630	160,002.000	
D.R.HORTON INC	7,366	10.540	77,637.640	
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	4,600	33.300	153,180.000	
AUTODESK INC	7,100	23.620	167,702.000	
MOODY'S CORP	5,500	22.940	126,170.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	10,700	67.480	722,036.000	
CONSOL ENERGY INC	4,400	45.890	201,916.000	
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	27.250	87,200.000	
CITIGROUP INC	404,533	4.060	1,642,403.980	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,300	43.530	535,419.000	
AMERICAN ELEC POWER	12,400	31.550	391,220.000	
DUN&BRADSTREET CORP	1,700	78.670	133,739.000	
HESS CORP	7,700	57.800	445,060.000	
COVIDIEN LTD	12,425	46.960	583,478.000	
DAVITA INC	2,800	59.330	166,124.000	
DANAHER CORP	6,900	71.170	491,073.000	
AVNET INC	5,200	27.150	141,180.000	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,600	104.820	167,712.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,300	30.650	468,945.000	
PEABODY ENERGY CORP	6,700	44.560	298,552.000	
BUNGE LIMITED	3,400	61.810	210,154.000	
TYCO ELECTRONICS LTD	14,125	23.460	331,372.500	
APPLE INC	22,800	200.590	4,573,452.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	12,800	15.130	193,664.000	
BOEING CO	17,100	52.450	896,895.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	25.200	111,258.000	
MEADWESTVACO CORP	4,800	26.460	127,008.000	
SPECTRA ENERGY CORP	16,196	19.310	312,744.760	

BECTON DICKINSON & CO	6,400	74.720	478,208.000	
SAIC INC	5,100	18.000	91,800.000	
BURLINGTON NORTHERN SANTA	8,900	98.260	874,514.000	
BJ SERVICES CO	9,800	18.550	181,790.000	
NISOURCE INC	9,100	14.210	129,311.000	
JOY GLOBAL INC	3,600	53.520	192,672.000	
BMC SOFTWARE INC	5,800	38.490	223,242.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	55.830	245,652.000	
ALPHA NATURAL RESOURCES I	2,800	37.400	104,720.000	
BARD(C.R.) INC	2,600	81.860	212,836.000	
BLACK & DECKER CORP	1,900	61.060	116,014.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	29,271	26.300	769,827.300	
VERIZON COMMUNICATIONS	71,000	31.630	2,245,730.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	280	3,382.000	946,960.000	
H&R BLOCK INC	8,800	20.390	179,432.000	
BB&T CORPORATION	17,500	24.260	424,550.000	
BECKMAN COULTER INC	2,100	65.330	137,193.000	
HOSPIRA INC	5,220	47.050	245,601.000	
BROADCOM CORP-CL A	10,650	28.970	308,530.500	
BAKER HUGHES INC	7,900	40.360	318,844.000	
BRISTOL MYERS SQUIBB	51,000	25.380	1,294,380.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	56.680	107,692.000	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	13.670	97,576.460	
JPMORGAN CHASE & CO	102,420	41.330	4,233,018.600	
XTO ENERGY INC	14,166	42.150	597,096.900	
LEGG MASON INC	3,550	28.100	99,755.000	
PACTIV CORPORATION	3,300	24.100	79,530.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,400	47.370	303,168.000	
CIGNA CORP	8,800	32.640	287,232.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	3,700	54.260	200,762.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,800	53.240	95,832.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,400	50.390	120,936.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,260	37.050	231,933.000	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE	200	296.250	59,250.000	
CATERPILLAR INC DEL	15,100	57.450	867,495.000	
PETROHAWK ENERGY CORP	7,800	22.590	176,202.000	
FIRST AMERICAN CORPORATIO	2,200	31.740	69,828.000	
CHARLES RIVER LABORATORIE	2,000	32.590	65,180.000	
VIRGIN MEDIA INC	10,200	16.690	170,238.000	
MOSAIC CO/THE	4,500	54.350	244,575.000	
CORNING INC	39,900	16.580	661,542.000	
CISCO SYSTEMS	146,400	23.380	3,422,832.000	
DU PONT	22,000	34.400	756,800.000	
MORGAN STANLEY	30,000	30.510	915,300.000	
DOW CHEMICAL	28,200	27.560	777,192.000	
DELL INC	44,800	14.140	633,472.000	
ENSCO INTERNATIONAL INC	4,400	44.500	195,800.000	
DTE ENERGY COMPANY	5,000	39.830	199,150.000	
DEVRY INC	1,800	54.440	97,992.000	
TELEPHONE AND DATA SYSTEM	1,500	30.770	46,155.000	
AGCO CORP	2,800	30.150	84,420.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,500	36.140	524,030.000	
DENBURY RESOURCES INC	7,100	13.390	95,069.000	
DEERE & CO	11,200	52.360	586,432.000	
AIRGAS INC	1,800	46.120	83,016.000	
QUANTA SERVICES INC	5,300	18.960	100,488.000	
TIME WARNER INC	30,533	30.850	941,943.050	

VMWARE INC-CLASS A	1,200	41.300	49,560.000	
URBAN OUTFITTERS INC	3,000	31.820	95,460.000	
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	18.780	73,242.000	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	4,950	15.030	74,398.500	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,500	42.440	318,300.000	
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,200	31.880	70,136.000	
JEFFERIES GROUP INC(NEW)	2,600	23.460	60,996.000	
NYSE EURONEXT	7,100	25.240	179,204.000	
COLGATE PALMOLIVE CO	12,300	83.630	1,028,649.000	
AMETEK INC	3,100	36.780	114,018.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,000	58.860	117,720.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,300	60.030	678,339.000	
SCANA CORP	3,500	34.940	122,290.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,200	21.360	111,072.000	
CUMMINS INC	4,700	45.340	213,098.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	17,000	11.570	196,690.000	
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	55.760	195,160.000	
LORILLARD INC	4,500	78.910	355,095.000	
PROGRESS ENERGY INC	7,500	38.800	291,000.000	
CABOT OIL & GAS CORP	3,600	38.180	137,448.000	
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	6.320	46,136.000	
DOLBY LABORATORIES-A	1,200	43.770	52,524.000	
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,600	39.970	103,922.000	
COCA COLA CO	54,000	57.180	3,087,720.000	
COCA-COLA ENTERPRISES	7,600	19.930	151,468.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	32.100	182,970.000	
EATON VANCE CORP	2,800	29.430	82,404.000	
COOPER INDUSTRIES LTD-A	5,400	41.610	224,694.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	4,000	53.830	215,320.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,100	108.970	446,777.000	
CSX CORP	10,300	47.530	489,559.000	
FLUOR CORP	4,800	43.070	206,736.000	
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,900	73.290	212,541.000	
EXPEDIA INC	6,950	25.210	175,209.500	
AMAZON.COM INC	8,800	131.740	1,159,312.000	
FLOWSERVE CORP	1,500	100.200	150,300.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,700	82.520	140,284.000	
EXXON MOBIL CORP	127,500	74.870	9,545,925.000	
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	57.160	91,456.000	
FLIR SYSTEMS INC	3,800	28.790	109,402.000	
AES CORP	16,500	12.780	210,870.000	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	3,200	78.450	251,040.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,900	84.850	161,215.000	
EOG RESOURCES INC	6,300	87.230	549,549.000	
EQUITABLE RESOURCES INC	3,400	40.700	138,380.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,700	23.920	136,344.000	
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	40.880	421,064.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,400	24.860	208,824.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,490	28.850	273,786.500	
FORD MOTOR CO	71,323	8.730	622,649.790	
MACY'S INC	10,598	16.970	179,848.060	
ARCH COAL INC	4,300	21.120	90,816.000	
FOSTER WHEELER AG	4,600	30.350	139,610.000	
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,840	31.570	152,798.800	
FOREST LABORATORIES INC	7,400	30.560	226,144.000	
LIBERTY GLOBAL INC	3,135	19.780	62,010.300	
LIBERTY MEDIA-STARZ A	1,248	48.560	60,602.880	

DISCOVERY COMMUNICATION-C	4,240	27.690	117,405.600	
FPL GROUP INC	9,900	51.580	510,642.000	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	10,704	84.140	900,634.560	
US BANCORP	48,300	22.950	1,108,485.000	
FAMILY DOLLAR STORES	4,500	31.020	139,590.000	
FASTENAL CO	4,400	37.020	162,888.000	
FISERV INC	5,200	46.290	240,708.000	
GENERAL ELECTRIC CO	273,700	15.940	4,362,778.000	
GENZYME CORP-GENL DIVISIO	7,100	51.070	362,597.000	
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,900	13.690	108,151.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,500	67.080	570,180.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,300	164.160	2,019,168.000	
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	25.320	124,068.000	
GOODRICH CORP	4,100	60.070	246,287.000	
GOOGLE INC-CL A	6,200	579.760	3,594,512.000	
GENERAL MILLS INC	8,400	68.100	572,040.000	
FIRSTENERGY CORP	8,200	42.610	349,402.000	
GENUINE PARTS CO	4,400	36.130	158,972.000	
FIFTH THIRD BANCORP	19,000	9.570	181,830.000	
HARRIS CORP	4,300	43.840	188,512.000	
HARSCO CORP	3,000	31.710	95,130.000	
HALLIBURTON CO	22,100	29.090	642,889.000	
HOME DEPOT INC	43,300	27.610	1,195,513.000	
ASSURANT INC	3,300	30.260	99,858.000	
HERSHEY CO/THE	4,300	35.600	153,080.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	7,200	28.690	206,568.000	
HUMANA INC	5,200	41.730	216,996.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,100	31.600	192,760.000	
HELMERICH & PAYNE	3,300	37.910	125,103.000	
WINDSTREAM CORP	11,500	10.120	116,380.000	
HENRY SCHEIN INC	2,900	50.370	146,073.000	
HEWLETT-PACKARD CO	60,400	49.070	2,963,828.000	
DIRECTV	25,082	31.600	792,591.200	
HEINZ H J CO	8,500	42.420	360,570.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	33,900	125.700	4,261,230.000	
INTERNATIONAL PAPER	9,700	24.850	241,045.000	
ITT CORP	4,700	51.850	243,695.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,629	35.240	304,085.960	
LEGGETT & PLATT INC	3,600	19.570	70,452.000	
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,435	19.770	67,909.950	
JUNIPER NETWORKS INC	13,100	25.670	336,277.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	58.490	181,319.000	
JOHNSON & JOHNSON	70,700	62.890	4,446,323.000	
HOLOGIC INC	8,800	14.420	126,896.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	65.560	688,380.000	
KROGER CO	15,600	22.870	356,772.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	5,600	31.920	178,752.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,300	77.100	639,930.000	
LIMITED BRANDS	8,000	16.920	135,360.000	
LOWE'S COS INC	35,600	21.960	781,776.000	
ELI LILLY & CO	27,200	36.900	1,003,680.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	46,400	1.200	55,680.000	
LAM RESEARCH CORP	3,200	34.490	110,368.000	
LUBRIZOL CORP	2,200	72.660	159,852.000	
RANGE RESOURCES CORP	3,900	47.930	186,927.000	
LSI CORP	22,500	5.420	121,950.000	
LOEWS CORP	8,500	35.000	297,500.000	

LINCOLN NATIONAL CORP	8,749	22.810	199,564.690	
MCDONALD'S CORP	27,800	63.600	1,768,080.000	
3M CO	18,000	76.750	1,381,500.000	
MANPOWER INC	2,700	48.930	132,111.000	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,800	30.450	237,510.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,100	84.030	92,433.000	
MCAFEE INC	4,200	39.920	167,664.000	
MURPHY OIL CORP	4,500	56.700	255,150.000	
MYRIAD GENETICS INC	2,800	23.950	67,060.000	
MATTEL INC	9,800	19.570	191,786.000	
KBR INC	4,500	18.830	84,735.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,800	35.780	135,964.000	
MYLAN INC	8,200	18.010	147,682.000	
METLIFE INC	20,800	33.280	692,224.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	12,900	15.630	201,627.000	
MOTOROLA INC	56,800	8.200	465,760.000	
MONSANTO CO	13,906	79.500	1,105,527.000	
MCDERMOTT INTL INC	7,400	21.010	155,474.000	
MIRANT CORP	3,800	14.110	53,618.000	
ROCKWELL INTL CORP	3,600	43.510	156,636.000	
MERCK & CO INC	78,321	36.290	2,842,269.090	
MASCO CORP	12,100	13.530	163,713.000	
M & T BANK CORP	2,000	63.850	127,700.000	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	12,536	62.490	783,374.640	
MARSH & MCLENNAN COS	13,100	22.260	291,606.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,982	25.260	201,625.320	
NETAPP INC	8,900	30.830	274,387.000	
NIKE INC -CL B	9,400	65.050	611,470.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	51.190	476,067.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,600	26.050	119,830.000	
NATIONAL SEMICONDUCTOR	7,700	14.470	111,419.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,800	55.000	429,000.000	
NEWMONT MINIG CORP	12,600	53.350	672,210.000	
MCKESSON CORP	7,300	62.750	458,075.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,900	17.790	176,121.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	49,800	49.990	2,489,502.000	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	5,600	12.060	67,536.000	
NUCOR CORP	8,400	41.810	351,204.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	8,900	20.570	183,073.000	
WESTERN UNION CO	18,246	18.500	337,551.000	
NEWELL RUBBERMAID INC	7,500	14.650	109,875.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM	20,200	81.200	1,640,240.000	
OMNICARE INC	3,200	23.170	74,144.000	
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	10.590	81,278.250	
PAYCHEX INC	8,500	31.330	266,305.000	
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	6,700	29.570	198,119.000	
PATTERSON COS INC	2,900	25.860	74,994.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	38.990	148,162.000	
ALTRIA GROUP INC	50,000	19.000	950,000.000	
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	31.870	172,098.000	
PG & E CORPORATION	9,800	42.140	412,972.000	
PFIZER INC	201,463	18.250	3,676,699.750	
XCEL ENERGY INC	11,600	20.190	234,204.000	
STRYKER CORP	7,700	49.690	382,613.000	
AFFILIATED COMPUER SVCS-A	2,400	55.540	133,296.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,900	53.570	208,923.000	
PALL CORP	4,000	32.130	128,520.000	

PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	41.250	132,000.000	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	4,200	15.240	64,008.000	
PROCTER & GAMBLE CO	74,037	62.480	4,625,831.760	
EXELON CORP	16,000	47.660	762,560.000	
CONOCOPHILLIPS	35,000	51.920	1,817,200.000	
PEPSICO INC	40,200	62.300	2,504,460.000	
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	3,600	27.220	97,992.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,700	48.200	563,940.000	
ACCENTURE LTD-CL A	16,300	40.510	660,313.000	
QUESTAR CORP	4,600	39.350	181,010.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,600	28.290	130,134.000	
PENTAIR INC	2,600	30.340	78,884.000	
QUALCOMM INC	42,600	44.990	1,916,574.000	
PARTNERRE LTD	1,700	76.830	130,611.000	
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,900	21.410	62,089.000	
INVESCO LTD	10,550	21.680	228,724.000	
ADVANCE AUTO PARTS	3,250	39.450	128,212.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,300	25.000	207,500.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	5,700	22.000	125,400.000	
ENERGEN CORP	2,000	43.430	86,860.000	
RAYTHEON CO	10,500	51.630	542,115.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	3,100	39.940	123,814.000	
RED HAT INC	5,200	26.800	139,360.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,500	28.030	266,285.000	
PRICELINE.COM INC	1,300	208.210	270,673.000	
ROSS STORES INC	3,700	44.290	163,873.000	
QUEST DIAGNOSTICS	3,900	58.270	227,253.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,200	22.190	71,008.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	4,700	51.320	241,204.000	
POLO RALPH LAUREN CORP	1,400	77.110	107,954.000	
PEPSI BOTTLING GROUP INC	7,000	37.930	265,510.000	
ROWAN COS INC	3,300	24.370	80,421.000	
AUTONATION INC	3,100	17.440	54,064.000	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	42,200	3.800	160,360.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	3,900	53.700	209,430.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,435	5.580	169,827.300	
SUNOCO INC	3,200	25.430	81,376.000	
CHEVRON CORP	51,018	78.170	3,988,077.060	
EDISON INTERNATIONAL	7,800	33.810	263,718.000	
SYMANTEC CORP	20,600	17.690	364,414.000	
STANLEY WORKS/THE	1,800	48.730	87,714.000	
SYNOPSYS INC	3,900	22.430	87,477.000	
TRANSOCEAN LTD	8,122	84.910	689,639.020	
SLM CORP	8,000	10.720	85,760.000	
SANDISK CORP	5,700	19.660	112,062.000	
SOUTHERN CO	20,200	31.610	638,522.000	
SYSCO CORP	14,900	26.830	399,767.000	
SMITH INTERNATIONAL INC	6,000	26.540	159,240.000	
TRAVELERS COS INC	15,323	51.650	791,432.950	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,200	43.860	403,512.000	
SPX CORP	1,400	53.070	74,298.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,400	17.440	59,296.000	
STERICYCLE INC	2,200	54.130	119,086.000	
SCHLUMBERGER LTD	30,000	63.140	1,894,200.000	
SUPERVALU INC	5,173	14.420	74,594.660	
AT&T INC	150,095	26.990	4,051,064.050	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	8.990	53,940.000	

SIGMA-ALDRICH	3,300	53.060	175,098.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,700	61.130	165,051.000	
SEMPRA ENERGY	6,300	52.680	331,884.000	
TIFFANY & CO	3,100	43.210	133,951.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	16,300	15.540	253,302.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	33,400	25.250	843,350.000	
SALESFORCE.COM INC	3,000	63.250	189,750.000	
TIME WARNER CABLE	9,153	42.420	388,270.260	
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,025	36.000	432,900.000	
UNION PACIFIC CORP	12,700	63.190	802,513.000	
MARATHON OIL CORP	18,000	32.630	587,340.000	
UNITED TECHNOLOGIES	23,500	67.200	1,579,200.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	18,300	57.430	1,050,969.000	
SPRINT NEXTEL CORP	72,422	3.750	271,582.500	
UNUM GROUP	8,900	18.900	168,210.000	
AMEREN CORPORATION	5,800	25.580	148,364.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	30,226	29.440	889,853.440	
USX-US STEEL GRP	3,900	43.050	167,895.000	
VERISIGN INC	5,400	22.300	120,420.000	
VALERO ENERGY CORP	14,492	16.000	231,872.000	
WEYERHAEUSER CO	5,400	37.690	203,526.000	
WELLPOINT INC	12,600	54.240	683,424.000	
THE WALT DISNEY CO.	45,500	30.350	1,380,925.000	
WELLS FARGO & CO	112,472	27.140	3,052,490.080	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,500	38.150	95,375.000	
WASTE MANAGEMENT INC	12,200	33.060	403,332.000	
WILLIAMS COMPANY	14,500	19.970	289,565.000	
WHIRLPOOL CORP	1,900	74.600	141,740.000	
WAL-MART STORES	61,000	54.630	3,332,430.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	5,600	58.520	327,712.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	17,700	16.430	290,811.000	
WYNN RESORTS LTD	1,900	62.980	119,662.000	
XEROX CORP	23,700	7.790	184,623.000	
TJX COMPANIES INC	10,400	38.620	401,648.000	
WATERS CORP	2,500	59.020	147,550.000	
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,400	36.960	125,664.000	
WHOLE FOODS MARKET INC	3,300	25.900	85,470.000	
WASHINGTON POST -CL B	240	410.420	98,500.800	
WALGREEN CO	24,800	39.010	967,448.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	4,700	27.060	127,182.000	
WESTERN DIGITAL CORP	5,700	37.500	213,750.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	3,500	45.020	157,570.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,500	30.900	417,150.000	
VISA INC-CLASS A SHS	11,700	80.330	939,861.000	
PPL CORPORATION	10,100	30.460	307,646.000	
PITNEY BOWES INC	6,300	23.270	146,601.000	
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	16.020	102,528.000	
PULTE HOMES INC	7,500	9.110	68,325.000	
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	47.500	194,750.000	
PPG INDUSTRIES INC	4,300	59.330	255,119.000	
NORTHERN TRUST CORP	5,500	47.690	262,295.000	
NSTAR	3,300	32.810	108,273.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	3,400	105.270	357,918.000	
NVIDIA CORP	13,250	12.790	169,467.500	
PNC FINANCIAL SERVICES	11,293	55.380	625,406.340	
LIBERTY MEDIA-INTERACTI A	16,250	10.310	167,537.500	
TERADATA CORP	4,700	28.830	135,501.000	

TYSON FOODS INC-CL A	7,400	12.290	90,946.000	
NII HOLDINGS INC	5,300	30.230	160,219.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	47.480	489,044.000	
NRG ENERGY INC	8,300	23.910	198,453.000	
TORCHMARK CORP	2,100	42.620	89,502.000	
SUNPOWER CORP-CLASS A	700	20.050	14,035.000	
SUNPOWER CORP-CLASS B	1,000	17.600	17,600.000	
TEXTRON INC	7,500	20.080	150,600.000	
NEWS CORP-CL A	46,550	11.540	537,187.000	
NEWS CORP-CLASS B	12,100	13.690	165,649.000	
OMNICOM GROUP	8,400	36.410	305,844.000	
ORACLE CORPORATION	101,583	22.090	2,243,968.470	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,200	235.590	518,298.000	
ONEOK INC	2,900	39.680	115,072.000	
CENTURYTEL INC	8,773	36.310	318,547.630	
ROPER INDUSTRIES INC	2,200	52.240	114,928.000	
CEPHALON INC	1,900	55.230	104,937.000	
YUM! BRANDS INC	12,400	35.400	438,960.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,900	61.710	117,249.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,200	45.010	189,042.000	
NOBLE ENERGY INC	4,400	64.920	285,648.000	
BANK OF AMERICA CORP	223,501	15.470	3,457,560.470	
NORDSTROM INC	4,500	34.020	153,090.000	
AMERICAN EXPRESS CO	27,200	40.840	1,110,848.000	
ANALOG DEVICES	7,800	29.750	232,050.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	20,927	6.850	143,349.950	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	19.340	125,710.000	
AMERICAN INTL GROUP	1,972	33.300	65,667.600	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	60.670	770,509.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,700	24.140	89,318.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	12.950	159,285.000	
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,700	42.420	156,954.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	37.690	113,070.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,300	43.490	317,477.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,200	41.500	796,800.000	
AON CORP	6,100	38.390	234,179.000	
AMGEN	26,500	56.500	1,497,250.000	
ALLERGAN INC	7,900	58.290	460,491.000	
COACH INC	7,900	35.290	278,791.000	
EATON CORP	3,900	64.270	250,653.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,200	36.460	262,512.000	
CELGENE CORP	11,100	54.970	610,167.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	16.990	96,843.000	
APPLIED MATERIALS INC	34,300	12.290	421,547.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,800	46.450	130,060.000	
CME GROUP INC	1,500	322.650	483,975.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	10,644	43.300	460,885.200	
ECOLAB INC	5,900	44.450	262,255.000	
EQUIFAX INC	3,800	28.820	109,516.000	
GAP INC	12,100	22.030	266,563.000	
GILEAD SCIENCES INC	22,700	46.560	1,056,912.000	
MARSHALL & ILSLEY CORP	12,599	5.430	68,412.570	
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	22.850	99,397.500	
ST JUDE MEDICAL INC	9,300	36.410	338,613.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,748	26.270	177,269.960	
HORMEL FOODS CORP	2,200	37.560	82,632.000	
SAFEWAY INC	11,400	22.440	255,816.000	

STATE STREET CORP	12,343	40.200	496,188.600	
STAPLES INC	19,200	23.320	447,744.000	
SUNTRUST BANKS INC	11,548	22.590	260,869.320	
CHARLES SCHWAB	25,100	17.740	445,274.000	
IHS INC-CLASS A	1,400	50.650	70,910.000	
BAXTER INTL INC	15,900	54.830	871,797.000	
CONSTELLATION ENERGY	5,600	32.080	179,648.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	35.160	210,960.000	
CROWN HOLDINGS INC	5,100	25.140	128,214.000	
CHUBB CORP	8,900	49.540	440,906.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,500	32.030	304,285.000	
CAREFUSION CORP	4,750	25.790	122,502.500	
FEDEX CORP	7,700	82.650	636,405.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,154	37.240	452,614.960	
FMC CORP	2,100	55.320	116,172.000	
FLEXTRONICS INTL LTD	24,600	7.140	175,644.000	
CERNER CORP	1,800	75.380	135,684.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,100	40.320	84,672.000	
CITRIX SYSTEMS INC	4,700	37.880	178,036.000	
INTEL CORP	139,300	19.110	2,662,023.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,000	37.240	223,440.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	16,600	6.460	107,236.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	8,700	23.720	206,364.000	
IRON MOUNTAIN INC	5,050	24.520	123,826.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,900	48.660	530,394.000	
ILLUMINA INC	3,400	28.620	97,308.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,800	24.170	381,886.000	
SUN MICROSYSTEMS INC	18,225	8.520	155,277.000	
SEALED AIR CORP	3,800	22.310	84,778.000	
ITT EDUCATIONAL SERVICES	1,000	92.100	92,100.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	900	280.110	252,099.000	
SARA LEE CORP	18,700	12.140	227,018.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	7,500	25.050	187,875.000	
COVANCE INC	1,700	53.300	90,610.000	
CARMAX INC	7,700	19.990	153,923.000	
COMERICA INC	4,900	27.800	136,220.000	
DUKE ENERGY CORP	33,392	16.690	557,312.480	
TARGET CORP	18,700	47.700	891,990.000	
DOVER CORP	5,400	40.580	219,132.000	
RR DONNELLEY & SONS CO	7,200	20.670	148,824.000	
WW GRAINGER INC	2,000	97.460	194,920.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	4,000	35.580	142,320.000	
JOHNSON CONTROLS INC	14,500	26.930	390,485.000	
CINTAS CORP	4,600	28.330	130,318.000	
CA INC	11,005	22.000	242,110.000	
CONAGRA INC	11,000	22.180	243,980.000	
CLOROX COMPANY	3,600	60.050	216,180.000	
ENTERGY CORP	4,900	78.500	384,650.000	
MICROSOFT CORP	207,600	29.220	6,066,072.000	
IMS HEALTH INC	4,500	21.380	96,210.000	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,200	49.950	209,790.000	
CVS CAREMARK CORP	37,974	31.200	1,184,788.800	
MEDTRONIC INC	28,900	42.990	1,242,411.000	
MILLIPORE CORP	1,900	67.850	128,915.000	
MICRON TECH	23,000	7.300	167,900.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	600	221.190	132,714.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	12.960	138,672.000	

	HASBRO INC	3,600	29.340	105,624.000	
	KELLOGG CO	7,200	52.970	381,384.000	
	KEYCORP	20,200	5.570	112,514.000	
	KRAFT FOODS INC-A	36,511	26.640	972,653.040	
	KOHLS CORP	7,300	54.450	397,485.000	
	SEARS HOLDING CORP	1,925	71.940	138,484.500	
	URS CORP	2,100	41.310	86,751.000	
	NEW YORK COMMUNITY BANCOR	9,500	11.440	108,680.000	
	APACHE CORP	8,610	95.750	824,407.500	
	ACE LTD	9,000	48.180	433,620.000	
	ARROW ELECTRONICS INC	3,200	26.490	84,768.000	
	ALLSTATE	13,200	28.270	373,164.000	
	EBAY INC	28,900	23.220	671,058.000	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,900	59.490	113,031.000	
	XILINX INC	7,200	22.630	162,936.000	
	EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	6,600	85.740	565,884.000	
	DISH NETWORK CORP	5,400	20.650	111,510.000	
	YAHOO! INC	34,700	15.000	520,500.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-A	3,100	46.990	145,669.000	
	TOLL BROTHERS INC	3,400	19.280	65,552.000	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,900	26.910	185,679.000	
	NOBLE CORP	7,000	41.210	288,470.000	
	PROGRESSIVE CORP	16,800	16.610	279,048.000	
	PRAXAIR INC	7,900	81.510	643,929.000	
	PACCAR INC	8,837	37.210	328,824.770	
	PETSMART INC	3,700	26.000	96,200.000	
	EL PASO CORPORATION	19,900	9.500	189,050.000	
	EMC CORP/MASS	51,900	16.750	869,325.000	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	5,600	31.080	174,048.000	
	BIOGEN IDEC INC	7,530	46.920	353,307.600	
	INTL GAME TECHNOLOGY	9,300	19.410	180,513.000	
	DEAN FOODS CO	5,100	16.070	81,957.000	
	STARBUCKS CORP	18,700	21.430	400,741.000	
	PERRIGO CO	2,200	40.680	89,496.000	
	NORTHEAST UTILITIES	4,700	24.000	112,800.000	
	INTUIT INC	7,700	29.270	225,379.000	
	BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,900	30.420	118,638.000	
	BEST BUY COMPANY INC	9,200	42.830	394,036.000	
	BALL CORP	3,100	49.850	154,535.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	38,247	8.500	325,099.500	
	BED BATH & BEYOND INC	6,700	36.990	247,833.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,100	17.010	154,791.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,300	48.690	160,677.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	4,500	39.000	175,500.000	
	VF CORP	2,400	72.320	173,568.000	
	CBS CORP-CL B	16,571	13.170	218,240.070	
	VIACOM INC-CLASS B	14,271	30.030	428,558.130	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	41.570	78,983.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,600	14.990	83,944.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,500	46.830	163,905.000	
	CARNIVAL CORP	11,000	32.020	352,220.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	3,700	44.070	163,059.000	
	COMCAST CORP -CL A	47,970	14.880	713,793.600	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	21,700	14.160	307,272.000	
アメリカ・ドル 小計		株		アメリカ・ドル	
		8,084,616		261,558,287.490	

				(22,705,874,937)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	KAZAKHMYS PLC	5,900	12.370	72,983.000	
	BP PLC	492,300	5.838	2,874,047.400	
	UNILEVER PLC	34,860	17.920	624,691.200	
	DRAX GROUP PLC	9,200	4.204	38,676.800	
	BARCLAYS PLC	285,600	2.978	850,516.800	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	49,600	4.764	236,294.400	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C	2,976,000	0.001	2,976.000	
	THOMAS COOK GROUP PLC	22,300	2.162	48,212.600	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	2.437	39,235.700	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	41,900	3.837	160,770.300	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,900	51.650	98,135.000	
	REXAM PLC	32,500	2.822	91,715.000	
	PRUDENTIAL PLC	65,100	6.390	415,989.000	
	LONMIN PLC	3,900	17.830	69,537.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	468,715	0.347	162,644.100	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,400	14.940	95,616.000	
	BAE SYSTEMS PLC	94,100	3.310	311,471.000	
	AVIVA PLC	71,500	3.795	271,342.500	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	8,400	8.455	71,022.000	
	CAIRN ENERGY PLC	4,400	30.400	133,760.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	135,202	12.790	1,729,233.580	
	CABLE & WIRELESS	71,100	1.431	101,744.100	
	REED ELSEVIER PLC	29,046	4.621	134,221.560	
	BG GROUP PLC	90,300	11.260	1,016,778.000	
	DIAGEO PLC	65,800	10.300	677,740.000	
	RIO TINTO PLC-REG	37,800	30.895	1,167,831.000	
	BRITISH AIRWAYS PLC	21,300	1.938	41,279.400	
	STANDARD CHARTERED PLC	51,300	15.200	779,760.000	
	TESCO PLC	209,000	4.290	896,610.000	
	FRESNILLO PLC	5,000	8.455	42,275.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	23,600	5.885	138,886.000	
	SMITHS GROUP PLC	10,333	9.525	98,421.820	
	PEARSON PLC	21,563	8.335	179,727.600	
	SAINSBURY (J) PLC	29,825	3.265	97,378.620	
	NEXT PLC	5,200	19.890	103,428.000	
	WHITBREAD PLC	6,111	13.050	79,748.550	
	TOMKINS PLC	31,700	1.716	54,397.200	
	CADBURY PLC	37,556	8.060	302,701.360	
	BUNZL PLC	11,555	6.255	72,276.520	
	VODAFONE GROUP PLC	1,404,837	1.384	1,944,294.400	
	BALFOUR BEATTY PLC	17,400	2.572	44,752.800	
	KINGFISHER PLC	66,411	2.400	159,386.400	
	WPP PLC	35,600	5.755	204,878.000	
	UNITED UTILITIES GROUP PL	21,727	4.800	104,289.600	
	SEVERN TRENT PLC	7,533	10.400	78,343.200	
	RECKITT BENCKISER PLC	16,200	31.190	505,278.000	
	SCHRODERS PLC	3,900	11.740	45,786.000	
	INTERNATIONAL POWER PLC	47,600	2.798	133,184.800	
	AMEC PLC	11,200	7.930	88,816.000	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	23,800	11.250	267,750.000	
	ASTRAZENECA PLC	38,000	27.330	1,038,540.000	
	WOLSELEY PLC	8,290	11.910	98,733.900	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	178,500	0.809	144,406.500	
	3I GROUP PLC	27,591	2.739	75,571.740	

	BRITISH SKY BROADCASTING	29,600	5.305	157,028.000	
	SAGE GROUP PLC (THE)	38,600	2.176	83,993.600	
	NATIONAL GRID PLC	62,528	6.580	411,434.240	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	426,165	0.586	249,732.690	
	LLOYDS BANKING GROUP-NPR	571,061	0.220	125,633.420	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	88,900	1.186	105,435.400	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP	27,100	17.760	481,296.000	
	CENTRICA PLC	141,760	2.573	364,748.480	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	52,060	18.500	963,110.000	
	ICAP PLC	15,100	4.420	66,742.000	
	SABMILLER PLC	24,700	17.820	440,154.000	
	BHP BILLITON PLC	58,777	18.640	1,095,603.280	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	8.095	80,140.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	458,500	7.063	3,238,385.500	
	SHIRE PLC	14,600	11.870	173,302.000	
	OLD MUTUAL PLC	131,400	1.150	151,110.000	
	ANGLO AMERICAN PLC	34,283	25.880	887,244.040	
	MORRISON SUPERMARKETS	63,100	2.773	174,976.300	
	CARNIVAL PLC	4,461	20.420	91,093.620	
	AUTONOMY CORP PLC	5,900	14.400	84,960.000	
	FIRSTGROUP PLC	12,800	3.995	51,136.000	
	COMPASS GROUP PLC	49,200	4.334	213,232.800	
	BT GROUP PLC	200,800	1.445	290,156.000	
	MAN GROUP PLC	47,925	3.247	155,612.470	
	XSTRATA PLC	48,700	10.720	522,064.000	
	BURBERRY GROUP PLC	15,389	5.725	88,102.020	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	6,700	8.400	56,280.000	
	CAPITA GROUP PLC	19,290	7.225	139,370.250	
	SERCO GROUP PLC	13,500	5.215	70,402.500	
	TULLOW OIL PLC	22,700	12.430	282,161.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,600	23.050	82,980.000	
	PETROFAC LTD	5,400	9.680	52,272.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	7.760	33,748.240	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	91,500	18.310	1,675,365.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	69,381	17.690	1,227,349.890	
	G4S PLC	36,600	2.443	89,413.800	
	COBHAM PLC	38,200	2.274	86,866.800	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,800	10.640	51,072.000	
	INVESTEC PLC	12,500	4.287	53,587.500	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	15,300	1.947	29,789.100	
	ANTOFAGASTA PLC	13,900	9.010	125,239.000	
	STANDARD LIFE PLC	57,900	2.130	123,327.000	
	EXPERIAN PLC	27,154	5.775	156,814.350	
	HOME RETAIL GROUP	29,454	2.984	87,890.730	
イギリス・ポンド 小計		株 10,598,092		イギリス・ポンド 34,488,440.970 (4,943,228,244)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	86,200	40.390	3,481,618.000	
	ASCIANO GROUP	70,000	1.605	112,350.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.540	107,646.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	14,500	48.100	697,450.000	
	OZ MINERALS LTD	97,079	1.180	114,553.220	
	FORTESCUE METALS GROUP	30,900	4.010	123,909.000	
	CSR LIMITED	41,700	1.700	70,890.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	8,700	8.440	73,428.000	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	46,000	27.010	1,242,460.000	
	WESTPAC BANKING	77,298	23.130	1,787,902.740	
	SANTOS LIMITED	24,200	14.330	346,786.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	60,900	21.190	1,290,471.000	
	ARROW ENERGY LTD	17,200	3.860	66,392.000	
	RIO TINTO LTD	10,700	68.550	733,485.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	25,900	15.290	396,011.000	
	AMCOR	24,100	5.760	138,816.000	
	METCASH LTD	23,500	4.560	107,160.000	
	NUFARM LTD	5,400	11.570	62,478.000	
	GOODMAN FIELDER LTD	34,000	1.500	51,000.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	56,500	5.470	309,055.000	
	NEWCREST MINING	13,700	36.930	505,941.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.810	128,136.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	39,800	50.600	2,013,880.000	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	9.160	43,968.000	
	ORICA LIMITED	9,200	24.150	222,180.000	
	QBE INSURANCE	28,300	21.730	614,959.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,000	34.770	139,080.000	
	WOOLWORTHS	32,300	27.890	900,847.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	10.510	167,109.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	7.040	144,320.000	
	CROWN LTD	16,900	7.680	129,792.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	29,700	2.530	75,141.000	
	TELSTRA CORPORATION	124,600	3.390	422,394.000	
	AMP LIMITED	59,600	5.920	352,832.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES N	15,900	7.830	124,497.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	8,800	45.340	398,992.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,100	3.930	43,623.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	1.580	122,766.000	
	CSL LIMITED	17,300	31.000	536,300.000	
	ONESTEEL LIMITED	44,700	2.900	129,630.000	
	WESFARMERS LIMITED	27,400	28.810	789,394.000	
	WESFARMERS LTD-PPS	4,400	28.890	127,116.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,700	61.300	104,210.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,000	2.690	123,740.000	
	SUNCORP-METWAY LIMITED	40,200	8.450	339,690.000	
	BORAL LIMITED	18,100	5.500	99,550.000	
	ASX LTD	5,300	32.700	173,310.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	10.340	143,726.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	4.220	59,080.000	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE	68,000	1.285	87,380.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	52,300	3.770	197,171.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	13.900	140,390.000	
	TRANSURBAN GROUP	33,300	5.410	180,153.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	7.920	148,896.000	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	20.190	109,026.000	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	31,600	5.610	177,276.000	
	WORLEYPARSONS LTD	4,700	25.850	121,495.000	
	PALADIN ENERGY LTD	14,600	3.990	58,254.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.390	88,191.000	
	AGL ENERGY LTD	14,500	13.710	198,795.000	
	BRAMBLES LTD	38,700	6.560	253,872.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 1,944,977		オーストラリア・ドル 22,250,962.960 (1,767,839,007)	

カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	40.630	320,977.000	
	SINO-FOREST CORPORATION	6,300	18.550	116,865.000	
	SILVER WHEATON CORP	8,200	16.750	137,350.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,800	37.400	104,720.000	
	BCE INC	8,330	27.870	232,157.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,600	29.070	104,652.000	
	SUNCOR ENERGY INC	40,780	37.960	1,548,008.800	
	METRO INC-A	3,300	36.010	118,833.000	
	SHERRITT INTERNATIONAL CO	9,500	6.940	65,930.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,800	63.130	303,024.000	
	GROUPE AEROPLAN INC	7,200	9.370	67,464.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	26,300	48.180	1,267,134.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	10,200	68.800	701,760.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	22,300	66.190	1,476,037.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	24.100	195,210.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	37,300	56.700	2,114,910.000	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES	5,700	13.110	74,727.000	
	TRANSCANADA CORP	17,500	33.980	594,650.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	44,500	4.610	205,145.000	
	BARRICK GOLD CORP	24,900	45.250	1,126,725.000	
	CAE INC	9,200	8.650	79,580.000	
	THOMSON REUTERS CORP	11,804	33.150	391,302.600	
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	7,900	118.260	934,254.000	
	INMET MINING CRP	1,600	63.950	102,320.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	32.860	115,010.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	40.460	101,150.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	12,800	32.050	410,240.000	
	AGNICO-EAGLE MINES	4,700	65.880	309,636.000	
	KINROSS GOLD CORP	17,900	20.530	367,487.000	
	BANK OF MONTREAL	14,600	52.930	772,778.000	
	POWER CORP OF CANADA	9,300	26.170	243,381.000	
	CAMECO CORP	10,500	30.360	318,780.000	
	TELUS CORP	900	34.400	30,960.000	
	POWER FINANCIAL CORP	7,400	27.630	204,462.000	
	TECK RESOURECES LIMITED-B	13,300	36.300	482,790.000	
	NEXEN INC	14,000	24.970	349,580.000	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,500	55.250	138,125.000	
	VITERRA INC	7,700	10.620	81,774.000	
	TALISMAN ENERGY INC	26,800	18.370	492,316.000	
	IVANHOE MINES LTD	9,100	12.510	113,841.000	
	AGRIUM INC	4,900	58.280	285,572.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCE	14,100	70.720	997,152.000	
	GERDAU AMERISTEEL CORP	5,200	8.680	45,136.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	500	369.750	184,875.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC-A	3,600	51.660	185,976.000	
	TRANSALTA CORP	6,700	21.700	145,390.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	1,400	61.090	85,526.000	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,200	26.700	58,740.000	
	RESEARCH IN MOTION	13,600	61.450	835,720.000	
	SUN LIFE FINANCIAL SVSC	14,600	29.020	423,692.000	
	ENBRIDGE INC	9,700	45.070	437,179.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	14,300	22.600	323,180.000	
	BROOKFIELD PROPERTIES COR	6,550	11.950	78,272.500	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	42,600	18.490	787,674.000	
	BIOVAIL CORPORATION	5,200	15.040	78,208.000	
	GOLDCORP INC	18,559	45.150	837,938.850	

	ENCANA CORP	20,700	56.730	1,174,311.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,500	51.450	231,525.000	
	IAMGOLD CORPORATION	9,900	19.680	194,832.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	19.920	67,728.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,200	55.640	678,808.000	
	CGI GROUP INC - CL A	8,300	13.210	109,643.000	
	HUSKY ENERGY INC	8,200	27.850	228,370.000	
	ONEX CORPORATION	3,500	23.550	82,425.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,600	20.470	216,982.000	
	TELUS CORPORATION-NON VOT	4,400	33.080	145,552.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	6,100	15.550	94,855.000	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	5,500	43.270	237,985.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	49.000	220,500.000	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	12,400	14.170	175,708.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,900	41.360	161,304.000	
	TMX GROUP INC	2,700	30.140	81,378.000	
	OPEN TEXT CORP	2,000	39.500	79,000.000	
	CI FINANCIAL CORP	5,600	19.490	109,144.000	
	SAPUTO INC	4,800	29.260	140,448.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LT	2,100	81.130	170,373.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	21.530	101,191.000	
	ENSIGN ENERGY SERVICES IN	4,400	14.540	63,976.000	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	4,500	12.550	56,475.000	
	YAMANA GOLD INC	22,600	13.950	315,270.000	
	FORTIS INC	5,800	26.090	151,322.000	
	NIKO RESOURCES LTD	1,200	88.010	105,612.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	25.530	86,802.000	
	CRESCENT POINT ENERGY COR	5,000	39.400	197,000.000	
カナダ・ドル 小計		株 838,123		カナダ・ドル 28,384,795.850 (2,325,282,476)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	33,000	19.020	627,660.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	14.760	708,480.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	13.560	223,333.200	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	3.950	130,350.000	
	KEPPEL CORP	43,000	8.380	360,340.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	3.580	69,452.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	10.140	172,380.000	
	CAPITALAND LIMITED	51,000	4.040	206,040.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.740	183,260.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	24.500	73,500.000	
	O.C.B.C.	75,000	8.410	630,750.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	105,000	1.080	113,400.000	
	SINGAPORE TELECOM	236,450	2.950	697,527.500	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	3.070	147,360.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	3.800	136,800.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	194,400	0.500	97,200.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	7.900	213,300.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	34,000	2.690	91,460.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	20,000	1.100	22,000.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	36,000	6.310	227,160.000	
シンガポール・ドル 小計		株 1,124,720		シンガポール・ドル 5,131,752.700 (322,171,435)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	

	ADECCO SA-REG	3,950	50.850	200,857.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	18,500	166.600	3,082,100.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	27,500.000	110,000.000	
	ABB LTD	57,750	18.650	1,077,037.500	
	ARYZTA AG	2,300	37.150	85,445.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	96,350	48.290	4,652,741.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,700	74.850	127,245.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	29,400	52.900	1,555,260.000	
	GAM HOLDING LTD	5,900	12.250	72,275.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	35.000	206,500.000	
	SGS SA	150	1,284.000	192,600.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	950	258.900	245,955.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	3,832	221.300	848,021.600	
	BALOISE HOLDING -R	1,600	85.250	136,400.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	54,900	55.650	3,055,185.000	
	SWISS RE-REG	8,950	48.740	436,223.000	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	13,450	33.100	445,195.000	
	UBS AG-REGISTERED	93,700	15.690	1,470,153.000	
	SWISSCOM AG-REG	670	391.000	261,970.000	
	GEBERIT AG-REG	1,100	173.100	190,410.000	
	GIVAUDAN REG	190	806.500	153,235.000	
	ACTELION LTD-REG	2,700	59.300	160,110.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	251.000	62,750.000	
	SYNGENTA AG	2,612	267.000	697,404.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,250	118.900	148,625.000	
	LOGITECH INTL-REG	4,650	16.990	79,003.500	
	SYNTHES INC	1,750	132.800	232,400.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,350	80.150	108,202.500	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	48.950	73,425.000	
	HOLCIM LTD-REG	5,550	73.750	409,312.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	127.300	120,935.000	
	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	3,350	29.760	99,696.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,750	97.400	170,450.000	
スイス・フラン 小計		株 428,908		スイス・フラン 20,967,122.600 (1,810,091,694)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ERICSSON LM-B SHS	74,780	68.450	5,118,691.000	
	VOLVO AB-B SHS	32,800	67.100	2,200,880.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,000	531.000	1,062,000.000	
	S.K.F. AB-B SHS	11,400	117.600	1,340,640.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	173.500	1,110,400.000	
	NORDEA AB	85,100	74.900	6,373,990.000	
	SCANIA AB-B SHS	7,700	98.650	759,605.000	
	SWEDISH MATCH AB	7,650	152.500	1,166,625.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	109.100	976,445.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	138.700	859,940.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	24,700	45.740	1,129,778.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	12,050	206.200	2,484,710.000	
	SWEDBANK AB	11,150	65.800	733,670.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	13,700	416.400	5,704,680.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	17,050	98.000	1,670,900.000	
	SKANSKA AB-B	9,000	119.200	1,072,800.000	
	SANDVIK AB	30,500	84.150	2,566,575.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	129.000	1,586,700.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,050	101.000	1,823,050.000	

	VOLVO AB-A SHS	13,900	66.000	917,400.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	66.450	611,340.000	
	TELIASONERA AB	63,100	49.900	3,148,690.000	
	ALFA LAVAL AB	9,000	94.150	847,350.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,700	90.200	1,235,740.000	
	ASSA ABLOY AB-B	7,600	130.800	994,080.000	
	SSAB AB-A SHARES	6,100	113.000	689,300.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,000	58.350	291,750.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	10,650	49.300	525,045.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 529,730		スウェーデン・クローナ 49,002,774.000 (610,084,536)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,500	329.000	3,783,500.000	
	DANSKE BANK A/S	12,300	108.750	1,337,625.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	34,800.000	661,200.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,450	350.000	1,907,500.000	
	CARLSBERG AS-B	3,050	355.000	1,082,750.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,600	492.000	787,200.000	
	COLOPLAST-B	550	468.500	257,675.000	
	DSV A/S	5,600	88.000	492,800.000	
	TOPDANMARK A/S	350	719.000	251,650.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	361.000	297,825.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	25	36,000.000	900,000.000	
デンマーク・クローネ 小計		株 41,269		デンマーク・クローネ 11,759,725.000 (205,795,188)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	TELECOM CORP OF NZ	58,589	2.400	140,613.600	
	FLETCHER BUILDING LTD	16,800	7.730	129,864.000	
ニュージーランド・ドル 小計		株 75,389		ニュージーランド・ドル 270,477.600 (16,796,659)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	21,750	41.080	893,490.000	
	DNB NOR ASA	20,200	65.050	1,314,010.000	
	DNB NOR ASA-RTS	4,488	17.900	80,335.200	
	ORKLA ASA	16,550	53.900	892,045.000	
	TELENOR ASA	26,500	79.000	2,093,500.000	
	STATOIL ASA	30,973	143.000	4,429,139.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,110	238.500	1,218,735.000	
	SEADRILL LTD	9,650	133.300	1,286,345.000	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	3,900	35.110	136,929.000	
ノルウェー・クローネ 小計		株 139,121		ノルウェー・クローネ 12,344,528.200 (189,241,617)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	20,150	51.160	1,030,874.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	15,150	47.940	726,291.000	
	COMMERZBANK AG	21,600	6.235	134,676.000	
	VOLKSWAGEN AG	2,300	86.160	198,168.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	2,850	54.500	155,325.000	
	TUI AG	4,950	5.160	25,542.000	

M.A.N.	2,950	56.710	167,294.500	
SIEMENS AG	21,100	65.720	1,386,692.000	
E.ON AG	50,150	26.790	1,343,518.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,200	32.280	296,976.000	
GEA GROUP AG	5,050	14.170	71,558.500	
BASF SE	26,350	40.590	1,069,546.500	
LINDE	3,900	82.230	320,697.000	
K+S AG	4,200	40.780	171,276.000	
K+S AG-RTS	4,200	2.370	9,954.000	
ALLIANZ SE-REG	11,700	82.590	966,303.000	
THYSSENKRUPP AG	9,550	24.470	233,688.500	
HENKEL AG & CO KGAA	4,850	33.780	163,833.000	
R.W.E. AG	11,800	62.090	732,662.000	
LUFTHANSA	6,750	10.605	71,583.750	
FRAPORT AG	1,100	33.810	37,191.000	
FRESENIUS SE	850	38.720	32,912.000	
HOCHTIEF AG	1,150	52.590	60,478.500	
SAP AG	23,242	32.090	745,835.780	
MUNCHENER RUECK AG-REG	5,500	105.060	577,830.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	2,350	47.160	110,826.000	
BEIERSDORF AG	2,600	43.790	113,854.000	
CELESIO AG	2,800	17.510	49,028.000	
MERCK KGAA	1,750	65.460	114,555.000	
ADIDAS-SALOMON AG	6,020	37.840	227,796.800	
FRESENIUS SE-PFD	2,600	44.680	116,168.000	
PUMA AG	230	231.390	53,219.700	
HENKEL KGAA	3,750	28.380	106,425.000	
METRO AG	3,450	42.660	147,177.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	72,800	9.850	717,080.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,200	35.820	186,264.000	
DAIMLER AG	24,050	34.625	832,731.250	
QIAGEN N.V.	6,800	14.770	100,436.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,700	3.220	98,854.000	
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	32.240	59,644.000	
DEUTSCHE POST AG	23,350	12.620	294,677.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,150	56.600	291,490.000	
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	56.500	64,975.000	
DEUTSCHE POSTBANK AG	2,400	23.450	56,280.000	
SALZGITTER AG	1,050	63.810	67,000.500	
SOLARWORLD AG	2,250	15.210	34,222.500	
WACKER CHEMIE AG	400	108.850	43,540.000	
PHILIPS ELECTRONICS NV	26,426	18.425	486,899.050	
ARCELORMITTAL	22,100	25.990	574,379.000	
UNILEVER NV-CVA	43,050	20.570	885,538.500	
HEINEKEN NV	7,200	31.355	225,756.000	
REED ELSEVIER NV	18,927	7.912	149,750.420	
AEGON NV	39,644	4.830	191,480.520	
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	32,760	8.984	294,315.840	
AKZO NOBEL	6,400	42.950	274,880.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,200	32.900	138,180.000	
WOLTERS KLUWER	8,150	14.595	118,949.250	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	1,250	26.680	33,350.000	
ING GROEP N.V.	52,850	8.530	450,810.500	
KONINKLIJKE KPN NV	44,700	11.790	527,013.000	
ASML HOLDING NV	11,838	20.720	245,283.360	
TNT NV	10,045	19.560	196,480.200	
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	28.135	80,184.750	

SBM OFFSHORE NV	3,807	12.760	48,577.320	
FUGRO NV-CVA	1,550	38.450	59,597.500	
HEINEKEN HOLDING NV	1,800	27.700	49,860.000	
TOTAL SA	56,550	41.865	2,367,465.750	
MICHELIN (CGDE) - B	3,900	52.020	202,878.000	
AIR LIQUIDE	6,338	77.810	493,159.780	
PPR	2,350	81.000	190,350.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	6,350	73.710	468,058.500	
BOUYGUES	5,950	33.480	199,206.000	
LAFARGE SA	5,150	55.710	286,906.500	
BNP PARIBAS	24,700	55.140	1,361,958.000	
PEUGEOT SA	4,900	23.565	115,468.500	
NATIXIS	34,600	3.632	125,667.200	
THALES SA	2,650	32.990	87,423.500	
GROUPE DANONE	14,500	40.280	584,060.000	
CARREFOUR	16,950	32.400	549,180.000	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	6,975	15.060	105,043.500	
VIVENDI SA	29,000	19.385	562,165.000	
L'OREAL	6,500	72.780	473,070.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,000	36.400	364,000.000	
ALCATEL-LUCENT	63,600	2.320	147,552.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,750	57.210	100,117.500	
PERNOD-RICARD	5,467	57.330	313,423.110	
EURAZEO	750	47.300	35,475.000	
SOCIETE GENERALE-A	17,250	46.500	802,125.000	
LVMH	6,650	70.920	471,618.000	
ACCOR SA	4,800	36.150	173,520.000	
CAP GEMINI SA	4,400	31.050	136,620.000	
PUBLICIS GROUPE	4,700	25.890	121,683.000	
VALLOUREC	1,500	113.050	169,575.000	
BUREAU VERITAS SA	1,550	33.900	52,545.000	
EIFFAGE	1,300	36.645	47,638.500	
SODEXO	2,650	37.470	99,295.500	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,450	38.750	211,187.500	
AXA	38,350	16.210	621,653.500	
TELEVISION FRANCAISE	4,200	12.180	51,156.000	
CHRISTIAN DIOR	1,850	67.930	125,670.500	
LAGARDERE S.C.A.	3,800	28.885	109,763.000	
TECHNIP S.A.	3,350	46.485	155,724.750	
RENAULT	4,600	32.165	147,959.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,850	95.910	177,433.500	
ERAMET	200	221.300	44,260.000	
STMICROELECTRONICS NV	21,650	5.449	117,970.850	
ATOS ORIGIN	1,600	30.050	48,080.000	
DASSAULT SYSTEMS SA	2,150	38.675	83,151.250	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	13.960	64,914.000	
FRANCE TELECOM SA	46,650	17.330	808,444.500	
ALSTOM	5,500	47.900	263,450.000	
CNP ASSURANCES	1,000	72.060	72,060.000	
AIR FRANCE-KLM	4,000	10.615	42,460.000	
NEOPOST SA	1,000	59.400	59,400.000	
SANOFI-AVENTIS	27,575	51.200	1,411,840.000	
VINCI	10,800	37.450	404,460.000	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	11,450	11.980	137,171.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10,050	22.800	229,140.000	
CREDIT AGRICOLE SA	23,250	14.035	326,313.750	
GDF SUEZ	32,323	28.545	922,660.030	

IMERYS SA	1,100	39.770	43,747.000	
PAGESJAUNES GROUPE SA	3,550	7.913	28,091.150	
ELECTRICITE DE FRANCE	6,350	38.645	245,395.750	
SES	7,950	14.415	114,599.250	
SAFRAN SA	5,250	11.385	59,771.250	
ILIAD SA	450	81.020	36,459.000	
ADP	950	53.140	50,483.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,800	21.775	60,970.000	
SCOR SE	5,900	16.610	97,999.000	
UCB SA	3,350	29.785	99,779.750	
KBC GROUPE	4,600	30.325	139,495.000	
COLRUYT SA	500	168.900	84,450.000	
DELHAIZE GROUP	2,400	51.000	122,400.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,450	62.120	152,194.000	
SOLVAY SA	1,750	71.500	125,125.000	
UMICORE	4,250	22.990	97,707.500	
DEXIA	17,350	5.001	86,767.350	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	19,500	33.805	659,197.500	
FORTIS	42,400	2.858	121,179.200	
BELGACOM SA	4,900	25.215	123,553.500	
MOBISTAR SA	1,050	46.875	49,218.750	
FONDIARIA-SAI SPA	2,500	11.320	28,300.000	
BANCO POPOLARE SCARL	18,150	5.595	101,549.250	
FIAT SPA	21,950	9.845	216,097.750	
PARMALAT SPA	48,350	1.959	94,717.650	
PRYSMIAN SPA	2,550	11.290	28,789.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,243	17.390	543,315.770	
SAIPEM	8,150	21.800	177,670.000	
MEDIOBANCA SPA	17,115	8.060	137,946.900	
TENARIS SA	13,000	13.380	173,940.000	
UNICREDIT SPA	368,399	2.325	856,527.670	
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO	20,700	0.919	19,023.300	
TELECOM ITALIA SPA	268,382	1.064	285,558.440	
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.751	128,383.450	
ITALCEMENTI SPA	2,200	9.130	20,086.000	
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	2.195	46,863.250	
INTESA SANPAOLO	207,597	2.905	603,069.280	
ATLANTIA SPA	8,300	17.290	143,507.000	
BANCA POPOLARE DI MILANO	13,850	5.230	72,435.500	
ENI SPA	68,350	16.730	1,143,495.500	
MEDIASET SPA	18,200	5.090	92,638.000	
A2A SPA	42,800	1.282	54,869.600	
FINMECCANICA SPA	11,225	11.170	125,383.250	
MONTE DEI PASCHI SIENA	77,300	1.300	100,490.000	
ENEL SPA	161,400	4.030	650,442.000	
SNAM RETE GAS	43,000	3.327	143,061.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	16.890	63,337.500	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	16,100	9.540	153,594.000	
TERNA SPA	39,000	2.790	108,810.000	
PIRELLI & C.	84,100	0.417	35,069.700	
TELEFONICA S.A.	108,027	19.310	2,086,001.370	
BANCO POPULAR ESPANOL	24,072	5.800	139,617.600	
BANCO BILIBAO VIZCAYA	95,512	12.700	1,213,002.400	
ACERINOX SA	4,900	13.925	68,232.500	
IBERDROLA SA	95,900	6.380	611,842.000	
IBERDROLA RENOVABLES SA	23,400	3.250	76,050.000	
BANCO DE SABADELL SA	22,250	4.310	95,897.500	

BANKINTER SA	8,850	7.190	63,631.500	
REPSOL YPF SA	19,200	18.505	355,296.000	
GRIFOLS SA	3,700	11.190	41,403.000	
BANCO SANTANDER SA	213,550	11.580	2,472,909.000	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	7,500	15.245	114,337.500	
GAS NATURAL SDG SA	6,300	13.970	88,011.000	
MAPFRE SA	17,100	3.000	51,300.000	
MAPFRE SA-RTS	17,100	0.010	171.000	
CRITERIA CAIXACORP SA	24,750	3.400	84,150.000	
ZARDOYA OTIS SA	3,700	13.890	51,393.000	
BANCO DE VALENCIA SA	5,800	5.540	32,132.000	
SACYR VALLEHERMOSO SA	1,650	9.480	15,642.000	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	28.340	36,842.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,726	33.700	159,266.200	
ACCIONA SA	750	86.850	65,137.500	
INDRA SISTEMAS SA	2,400	15.825	37,980.000	
GRUPO FERROVIAL	1,400	29.400	41,160.000	
INDITEX	5,700	42.390	241,623.000	
GAMESA CORP TECNOLOGICA	4,950	12.835	63,533.250	
ENAGAS	4,900	14.310	70,119.000	
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	37.120	113,216.000	
GESTEVISION TELECINCO SA	3,500	7.590	26,565.000	
CINTRA CONCESIONES DE INF	5,550	7.320	40,626.000	
UPM-KYMMENE OYJ	15,450	8.620	133,179.000	
NOKIA OYJ	102,250	8.870	906,957.500	
WARTSILA OYJ	2,350	25.300	59,455.000	
RAUTARUUKKI OYJ	2,650	14.090	37,338.500	
STORA ENSO OYJ-R SHS	14,250	5.250	74,812.500	
METSO OYJ	4,450	21.570	95,986.500	
ELISA OYJ-A SHARES	3,550	14.370	51,013.500	
SAMPO OYJ-A SHS	11,800	16.240	191,632.000	
FORTUM OYJ	11,850	17.010	201,568.500	
KESKO OYJ-B SHS	1,950	23.070	44,986.500	
KONE OYJ-B	4,250	27.240	115,770.000	
OUTOKUMPU OYJ	2,700	11.760	31,752.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	17.490	66,462.000	
NESTE OIL OYJ	4,300	11.710	50,353.000	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	1,700	30.500	51,850.000	
OMV AG	5,450	29.460	160,557.000	
ERSTE GROUP BANK AG	5,950	28.110	167,254.500	
TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	11.670	128,370.000	
VOESTALPINE AG	2,450	24.580	60,221.000	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLD	1,900	41.000	77,900.000	
VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	36.130	36,130.000	
MARFIN INVESTMENT GROUP S	17,100	2.110	36,081.000	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA	18,600	8.099	150,641.400	
BRISA	7,950	6.799	54,052.050	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	3.078	166,365.900	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	75,750	0.903	68,402.250	
GALP ENERGIA SGPS SA-B	5,900	12.300	72,570.000	
EDP RENOVAVEIS SA	7,700	6.488	49,957.600	
HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	10.700	81,320.000	
NATIONAL BANK OF GREECE	15,713	20.110	315,988.430	
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO	15,400	4.500	69,300.000	
ELAN CORPORATION PLC	6,500	4.200	27,300.000	
KERRY GROUP PLC-A	4,600	19.755	90,873.000	
CRH PLC	18,400	17.150	315,560.000	

	PUBLIC POWER CORP	3,400	13.300	45,220.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,500	4.748	35,610.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	1,300	19.590	25,467.000	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	14.200	68,160.000	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	9,008	8.600	77,468.800	
	OPAP SA	6,100	16.000	97,600.000	
	PIRAEUS BANK S.A.	6,791	9.590	65,125.690	
	ALPHA BANK A.E.	8,051	8.700	70,043.700	
ユーロ 小計		株 4,641,378		ユーロ 59,723,103.810 (7,776,545,347)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONGKONG ELECTRIC	43,500	41.650	1,811,775.000	
	MTR CORP	42,500	26.150	1,111,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	37,000	110.800	4,099,600.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	24.050	505,050.000	
	SINO LAND	60,000	14.100	846,000.000	
	CHEUNG KONG	36,000	95.200	3,427,200.000	
	WHARF HOLDINGS	36,000	40.100	1,443,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	88.050	1,761,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	52.350	2,748,375.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	12.900	528,900.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	55,300	51.400	2,842,420.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	51.700	1,861,200.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	36.750	918,750.000	
	HK & CHINA GAS	109,960	18.020	1,981,479.200	
	HANG SENG BANK	20,200	111.700	2,256,340.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	24.000	600,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	73,000	15.560	1,135,880.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	59,000	4.500	265,500.000	
	WING HANG BANK LIMITED	4,500	78.500	353,250.000	
	HONG KONG EX & CL	26,900	133.700	3,596,530.000	
	LI & FUNG LTD	65,000	30.350	1,972,750.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	27.600	1,738,800.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	21.600	453,600.000	
	NWS HOLDINGS LTD	23,000	14.880	342,240.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	38.200	859,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	33.200	1,694,528.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	6.490	363,440.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	14.000	588,000.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	100,500	17.660	1,774,830.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	33,400	50.600	1,690,040.000	
香港・ドル 小計		株 1,301,800		香港・ドル 45,571,952.200 (510,405,865)	
合計		株 29,748,123		43,183,357,005 [43,183,357,005]	

次へ

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,947.000	134,576.640	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,541.000	525,833.930	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,400.000	216,886.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,913.000	242,801.650	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,900.000	213,279.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	16,250.000	163,475.000	
		KIMCO REALTY CORP	9,700.000	114,945.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	5,100.000	170,901.000	
		VENTAS INC	4,300.000	176,300.000	
		AMB PROPERTY CORP	4,100.000	93,111.000	
		DUKE REALTY CORP	5,200.000	57,356.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000.000	124,280.000	
		HEALTH CARE REIT INC	3,200.000	136,960.000	
		HCP INC	7,200.000	214,056.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	2,500.000	71,475.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	14,300.000	256,399.000	
		PROLOGIS	11,200.000	141,456.000	
		PUBLIC STORAGE	3,100.000	236,964.000	
		REGENCY CENTERS CORP	2,300.000	72,726.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル	
			114,151.000	3,363,781.220	
				(292,009,848)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		LAND SECURITIES PLC	20,000.000	134,100.000	
		SEGRO PLC	12,650.000	42,681.100	
		HAMMERSON PLC	20,400.000	83,884.800	
		BRITISH LAND CO PLC	24,700.000	113,570.600	
		LIBERTY INTERNATIONAL PLC	13,400.000	64,588.000	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド	
			91,150.000	438,824.500	
				(62,896,716)	
	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
		LEND LEASE	12,900.000	112,101.000	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200.000	97,792.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	143,700.000	113,523.000	
		GPT GROUP	269,800.000	156,484.000	
		MIRVAC GROUP	43,800.000	66,138.000	
		STOCKLAND	70,900.000	277,219.000	
		WESTFIELD GROUP	57,096.000	678,300.480	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル	
			649,396.000	1,501,557.480	
				(119,298,742)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITAMALL TRUST	79,000.000	134,300.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル	
			79,000.000	134,300.000	
				(8,431,354)	
	ユーロ			ユーロ	
		CORIO NV	1,500.000	68,865.000	
		ICADE	600.000	40,008.000	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	2,150.000	325,725.000	
		GECINA SA	450.000	33,768.000	

		KLEPIERRE	2,800.000	77,980.000	
		FONCIERE DES REGIONS	600.000	41,940.000	
	ユーロ 小計		8,100.000	ユーロ 588,286.000 (76,600,720)	
	香港・ドル	LINK REIT	72,000.000	香港・ドル 1,353,600.000	
	香港・ドル 小計		72,000.000	香港・ドル 1,353,600.000 (15,160,320)	
投資証券 合計				574,397,700 [574,397,700]	
合計				574,397,700 [574,397,700]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における［ ］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 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	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 568銘柄 投資証券 19銘柄	98.7%	1.3%	52.6%
イギリス・ポンド	株式 98銘柄 投資証券 5銘柄	98.7%	1.3%	11.4%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄 投資証券 7銘柄	93.7%	6.3%	4.3%
カナダ・ドル	株式 84銘柄	100%	-%	5.3%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資証券 1銘柄	97.4%	2.6%	0.8%
スイス・フラン	株式 33銘柄	100%	-%	4.1%
スウェーデン・クローナ	株式 28銘柄	100%	-%	1.4%
デンマーク・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 242銘柄 投資証券 6銘柄	99.0%	1.0%	17.9%
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 1銘柄	97.1%	2.9%	1.3%

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関係に関する注記）」に記載しております。

次へ

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成20年12月1日現在 金 額（円）	平成21年11月30日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	124,014,884	304,551,148
コール・ローン	1,426,423,025	1,000,433,450
国債証券	74,050,217,221	99,685,281,944
派生商品評価勘定	421,720	153,903
未収入金	710,513,571	607,742,637
未収利息	1,020,333,446	1,312,523,246
前払費用	96,246,015	80,263,602
流動資産合計	77,428,169,882	102,990,949,930
資産合計	77,428,169,882	102,990,949,930
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	53,084,946	34,560,296
未払金	2,022,213,627	564,672,003
未払解約金	20,437,000	83,000
流動負債合計	2,095,735,573	599,315,299
負債合計	2,095,735,573	599,315,299
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	42,371,630,589	54,257,278,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	32,960,803,720	48,134,356,612
元本等合計	75,332,434,309	102,391,634,631
純資産合計	75,332,434,309	102,391,634,631
負債純資産合計	77,428,169,882	102,990,949,930

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	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。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	同左
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
1．※1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	27,910,191,160円	42,371,630,589円
同期中における追加設定元本額	19,172,654,020円	14,735,003,425円
同期中における一部解約元本額	4,711,214,591円	2,849,355,995円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	3,611,062,039円	3,478,207,239円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	101,845,110円	97,143,037円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	777,433,802円	736,271,135円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	234,594,775円	238,430,558円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	2,272,657,902円	2,186,512,902円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	17,426,564,914円	20,597,727,536円
ダイワ・ライフ・バランス３０	320,172,384円	316,096,987円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,052,508円	8,307,664円

ダイワ・ライフ・バランス７０	1,255,084円	4,062,129円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	33,262,188円	56,467,030円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	33,227,824円	45,482,134円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	5,893,021円	9,135,492円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	912,644円	3,102,056円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	260,210円	472,531円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	23,158円	28,978円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	3,624,821,605円	3,633,693,132円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	344,752,912円	363,602,261円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,774,153,161円	13,601,204,072円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	1,561,134,052円	2,531,561,434円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	1,255,208,771円	2,254,587,104円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	－円	629,237,291円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	2,948,063,337円	3,416,283,730円
ダイワライフスタイル２５	15,166,092円	17,225,767円
ダイワライフスタイル５０	21,726,921円	25,110,700円
ダイワライフスタイル７５	6,386,175円	7,325,120円
計	42,371,630,589円	54,257,278,019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	42,371,630,589口	54,257,278,019口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年12月1日現在		平成21年11月30日現在	
	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	74,050,217,221	2,796,517,652	99,685,281,944	913,607,648
合計	74,050,217,221	2,796,517,652	99,685,281,944	913,607,648

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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（平成19年12月1日から平成20年12月1日まで、及び平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

Ⅰ 取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年12月1日 至 平成20年12月1日	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1．取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左

2．取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4．取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5．取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成20年12月1日 現在				平成21年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	12,893,474	－	12,679,536	213,938	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	12,893,474	－	12,679,536	213,938	－	－	－	－
買 建	2,464,802,821	－	2,411,925,657	△52,877,164	1,492,887,041	－	1,458,480,648	△34,406,393
アメリカ・ドル	881,873,831	－	869,326,849	△12,546,982	618,800,930	－	601,513,117	△17,287,813
イギリス・ポンド	361,679,928	－	356,680,233	△4,999,695	97,307,616	－	94,712,190	△2,595,426
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	28,526,902	－	27,732,134	△794,768
カナダ・ドル	95,128,773	－	90,757,260	△4,371,513	32,735,388	－	32,023,030	△712,358
スイス・フラン	8,112,280	－	8,108,160	△4,120	7,651,749	－	7,509,840	△141,909

スウェーデン・クローナ	18,845,165	―	18,393,564	△451,601	8,756,525	―	8,540,700	△215,825
デンマーク・クローネ	8,541,234	―	8,527,480	△13,754	55,219,899	―	54,167,818	△1,052,081
ノルウェー・クローネ	8,391,531	―	8,430,751	39,220	―	―	―	―
ポーランド・ズロチ	9,742,964	―	9,775,920	32,956	11,444,412	―	11,342,020	△102,392
マレーシア・リンギット	13,244,029	―	13,227,212	△16,817	―	―	―	―
ユーロ	1,059,243,086	―	1,028,698,228	△30,544,858	632,443,620	―	620,939,799	△11,503,821
合計	2,477,696,295	―	2,424,605,193	△52,663,226	1,492,887,041	―	1,458,480,648	△34,406,393

（注）　1．時価の算定方法

(1)　本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①　計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②　計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・　計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・　計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)　本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成20年12月1日現在	平成21年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7779円 (17,779円)	1.8872円 (18,872円)

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

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,366,310.730	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,366,113.000	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,022,193.920	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,134,333.710	

		8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,066,550.750	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,315,808.160	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,225,415.220	
		8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,077,112.240	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,042,400.000	
		7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,119,956.250	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,050,990.960	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	974,981.550	
		8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,332,344.500	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,049,280.000	
		7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,172,712.500	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,109,572.500	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,122,231.250	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	985,412.190	
		6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,106,651.010	
		6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,069,613.550	
		6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,528,606.650	
		6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	829,136.700	
		6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	916,326.560	
		6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	996,886.800	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	2,936,191.440	
		5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	968,738.280	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,087,489.060	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,720,045.000	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	848,640.000	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,753,618.890	
		5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,560,453.160	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,390,195.880	
		4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,001,856.550	
		5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	3,260,216.400	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,051,935.040	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	2,904,243.200	
		3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,007,138.960	

		4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	2,726,120.880	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	525,000.000	550,630.500	
		5% U.S. TREASURY NOTE 20110215	2,359,000.000	2,491,505.030	
		5% U.S. TREASURY NOTE 20110815	2,202,000.000	2,371,950.360	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	2,040,030.720	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,437,730.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,880,570.960	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,666,198.350	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,904,789.940	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,901,072.150	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,377,319.540	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,140,230.560	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,083,089.320	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,882,654.860	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,098,930.800	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,906,528.100	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,079,949.480	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,337,915.920	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20101115	1,534,000.000	1,596,663.900	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,048,493.360	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20101215	1,267,000.000	1,320,252.010	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20110115	1,088,000.000	1,135,763.200	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,046,106.040	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110228	2,199,000.000	2,312,204.520	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20110331	1,116,000.000	1,180,728.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	2,212,000.000	2,352,838.040	
		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,248,421.200	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	1,286,000.000	1,371,789.060	
		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	1,392,000.000	1,493,128.800	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110731	1,891,000.000	2,027,719.300	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,285,416.720	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20110831	1,160,000.000	1,242,916.800	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110930	1,261,000.000	1,351,287.600	

		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,238,216.500	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,631,994.560	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,266,587.280	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,124,602.710	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,347,036.800	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,293,875.000	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,492,617.500	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,085,762.720	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,794,688.500	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,002,250.700	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,273,749.540	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,433,077.520	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,207,844.000	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,718,172.100	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,288,868.340	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,149,424.320	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,166,830.600	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,846,035.120	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,067,260.000	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,356,979.830	
		2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,387,878.180	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	3,982,348.260	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,570,950.000	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,965,222.000	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,519,094.240	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,146,361.600	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,570,670.460	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,473,663.500	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,578,895.760	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,393,618.690	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,652,325.000	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,780,487.850	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20101031	5,227,000.000	5,287,633.200	

		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,267,216.000	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,126,930.470	
		3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	7,334,182.110	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20101130	3,334,000.000	3,366,539.840	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,507,108.220	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000	2,496,402.240	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20101231	4,473,000.000	4,499,345.970	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,122,300.520	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20120115	2,825,000.000	2,845,057.500	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110131	3,145,000.000	3,164,027.250	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,457,840.000	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120215	2,353,000.000	2,382,130.140	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	6,710,871.470	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110228	5,199,000.000	5,230,661.910	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,741,974.840	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,218,486.500	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120315	2,326,000.000	2,354,609.800	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110331	2,783,000.000	2,800,282.430	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,341,725.710	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,448,739.230	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120415	2,241,000.000	2,267,959.230	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	2,945,000.000	2,963,288.450	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,398,562.060	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,015,207.100	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120515	2,454,000.000	2,482,466.400	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	3,246,000.000	3,227,465.340	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	3,037,000.000	3,056,072.360	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,024,508.100	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,339,000.000	3,486,617.190	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20120615	2,550,000.000	2,611,633.500	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	3,231,000.000	3,261,274.470	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	5,267,000.000	5,449,080.190	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,214,451.260	

		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20120715	4,765,000.000	4,835,522.000	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20110731	4,102,000.000	4,134,980.080	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,346,246.340	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	1,911,470.730	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20120815	3,247,000.000	3,312,556.930	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,040,511.160	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20110831	4,909,000.000	4,946,357.490	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,040,247.240	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,549,801.920	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120915	3,272,000.000	3,303,051.280	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20110930	5,235,000.000	5,272,796.700	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,048,990.440	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,555,802.270	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20121015	5,247,000.000	5,292,911.250	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 340,808,000.000 (29,585,542,480)	アメリカ・ドル 365,923,934.590 (31,765,856,762)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		9% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110712	440,000.000	496,892.000	
		8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,197,840.000	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	719,161.600	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,000,960.000	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	102,000.000	143,075.400	
		6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,349,196.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	1,854,022.500	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,648,650.400	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,910,000.000	2,113,797.000	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,837,839.600	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,441,360.400	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,191,512.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,115,379.400	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,941,753.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,339,000.000	1,397,916.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	2,476,000.000	2,587,667.600	

		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,618,550.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,132,722.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,379,000.000	1,409,613.800	
		5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	3,335,000.000	3,632,482.000	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	468,000.000	525,096.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,921,737.400	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,498,266.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,181,127.500	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,495,000.000	2,591,806.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	1,956,500.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	1,798,000.000	1,871,718.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	125,000.000	127,625.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	119,000.000	120,582.700	
		2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	1,193,000.000	1,182,740.200	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	343,000.000	361,590.600	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	185,000.000	186,554.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	363,000.000	360,531.600	
		2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	1,426,000.000	1,421,579.400	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 50,055,000.000 (7,174,383,150)	イギリス・ポンド 54,137,847.500 (7,759,577,682)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
		6.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	2,426,000.000	2,555,427.100	
		6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,465,717.800	
		6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	986,000.000	1,037,104.380	
		5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	780,000.000	782,496.000	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,741,000.000	1,786,370.460	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	1,812,551.360	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 9,246,000.000 (734,594,700)	オーストラリア・ドル 9,439,667.100 (749,981,551)	
	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	615,071.360	
		9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	593,168.880	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,357,000.000	2,052,652.480	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,606,114.500	

		6% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	907,000.000	977,609.950	
		5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,168,737.700	
		5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	949,184.280	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,754,211.250	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,576,000.000	2,878,860.320	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,142,749.440	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	1,905,865.200	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,058,346.950	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	735,000.000	770,625.450	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,009,315.600	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	666,657.810	
		4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,599,933.150	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,440,107.160	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20101201	868,000.000	887,799.080	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,675,000.000	1,746,338.250	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	724,000.000	746,842.200	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	623,846.700	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	1,235,000.000	1,243,694.400	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,627,853.370	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,245,000.000	1,246,157.850	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120901	346,000.000	349,809.460	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20111201	1,529,000.000	1,532,914.240	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	695,000.000	701,289.750	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 29,559,000.000 (2,421,473,280)	カナダ・ドル 32,895,756.780 (2,694,820,395)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	508,472.640	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	371,949.300	
		3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20110701	255,000.000	267,510.300	
		3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	573,912.920	
		3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	538,104.060	
		4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	542,080.560	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	424,980.500	

	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20110201	718,000.000	740,107.220	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	334,784.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	223,000.000	233,030.540	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	486,000.000	497,955.600	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	108,865.120	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	346,541.260	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	324,203.840	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	237,404.200	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	179,698.100	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,889,000.000 (369,711,420)	シンガポール・ドル 6,229,600.160 (391,094,298)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	347,000.000	380,339.760	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	589,000.000	662,907.720	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	406,000.000	487,386.760	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	837,000.000	1,028,597.670	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20110610	1,885,000.000	1,987,694.800	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	680,000.000	721,656.800	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,390,000.000	1,513,265.200	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	500,000.000	546,780.000	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 6,634,000.000 (572,713,220)	スイス・フラン 7,328,628.710 (632,680,517)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	6,520,000.000	7,699,076.800	
	5.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20110315	7,005,000.000	7,431,464.400	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	5,435,000.000	5,957,140.450	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	4,550,000.000	4,977,245.000	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,419,518.500	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,276,052.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,415,844.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,010,000.000	10,843,432.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	4,417,826.400	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 53,175,000.000 (662,028,750)	スウェーデン・クローナ 57,437,601.150 (715,098,134)	

デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,323,000.000	3,151,219.190	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	6,171,000.000	6,688,685.190	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,728,000.000	8,449,331.520	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	6,810,000.000	7,188,023.100	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	5,381,000.000	5,633,153.660	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	10,599,920.210	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	4,509,000.000	4,670,332.020	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20121115	5,160,000.000	5,443,077.600	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 47,971,000.000 (839,492,500)	デンマーク・クローネ 51,823,742.490 (906,915,494)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	6% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	5,217,000.000	5,482,336.620	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,232,000.000	5,807,467.680	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,898,000.000	5,254,378.480	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,276,289.440	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 19,479,000.000 (298,613,070)	ノルウェー・クローネ 20,820,472.220 (319,177,839)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,345,872.860	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,287,159.340	
	0% Poland Governmet Bond 20120725	742,000.000	650,986.280	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,218,348.660	
	4.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20110524	2,128,000.000	2,119,275.200	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,713,591.850	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,680,197.690	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	3,317,000.000	3,316,303.430	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	2,400,000.000	2,408,064.000	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,344,415.820	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20110725	1,665,000.000	1,542,855.600	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20120125	2,210,000.000	1,992,867.500	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 28,385,000.000 (890,721,300)	ポーランド・ズロチ 27,619,938.230 (866,713,662)	

	マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
		3.756% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110428	3,090,000.000	3,150,285.900	
		4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,628,112.000	
		3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,301,358.800	
		3.833% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110928	2,582,000.000	2,642,651.180	
		5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,576,000.000	1,673,838.080	
		4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,127,456.840	
		5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,048,627.720	
		3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,385,520.120	
		3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,002,586.550	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	492,688.320	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	576,530.820	
		2.509% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120827	327,000.000	323,491.290	
		4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,103,285.130	
		2.711% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120214	573,000.000	573,418.290	
		3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,054,764.480	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 20,691,000.000 (529,068,870)	マレーシア・リンギット 21,084,615.520 (539,133,619)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		6.5% HELLENIC REPUBLIC 20140111	250,000.000	275,115.000	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,340,385.000	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,593,691.800	
		5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	646,400.370	
		4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,094,646.320	
		5.35% HELLENIC REPUBLIC 20110518	913,000.000	956,668.790	
		5.25% HELLENIC REPUBLIC 20120518	781,000.000	822,377.380	
		8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	482,511.060	
		4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	682,427.450	
		5.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20110223	352,000.000	372,750.400	
		5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	409,750.200	
		8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	931,165.200	
		5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	806,439.250	
		4.6% HELLENIC REPUBLIC 20130520	552,000.000	570,569.280	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110730	2,743,000.000	2,928,289.650	

		6.5% HELLENIC REPUBLIC 20191022	823,000.000	913,776.900	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110928	842,000.000	897,470.960	
		4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	556,063.200	
		5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,367,150.400	
		4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	775,664.000	
		4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	378,301.000	
		5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	1,033,175.890	
		5.9% HELLENIC REPUBLIC 20221022	1,575,000.000	1,676,760.750	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	990,080.000	
		4% IRISH TREASURY 20111111	735,000.000	764,951.250	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,270,794.880	
		5.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110615	580,000.000	613,228.200	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	932,650.200	
		4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,193,156.590	
		3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	410,072.980	
		4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	647,590.680	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,990,065.220	
		3.9% IRISH TREASURY 20120305	1,355,000.000	1,402,425.000	
		4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	597,369.760	
		5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,516,641.570	
		3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	645,811.920	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,335,280.320	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	1,720,000.000	1,856,636.800	
		4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	592,168.500	
		3.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110415	492,000.000	504,978.960	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000	778,543.360	
		3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	199,000.000	205,270.490	
		3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	310,416.800	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	938,237.120	
		5.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20110104	513,000.000	536,382.540	
		4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	1,176,000.000	1,181,092.080	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,893,449.580	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	394,833.040	

		4.5% HELLENIC REPUBLIC 20370920	972,000.000	801,336.240	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	1,006,177.200	
		5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	937,722.120	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,101,585.000	
		4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	660,756.250	
		4.5% HELLENIC REPUBLIC 20140520	639,000.000	654,233.760	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,746,657.300	
		6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	722,754.320	
		4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	597,179.730	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,160,868.660	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,338,642.000	
		4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	466,958.800	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	934,194.860	
		3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,221,086.750	
		4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	709,028.260	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	860,537.040	
		4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,935,974.750	
		4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	1,520,000.000	1,635,109.600	
		3.7% HELLENIC REPUBLIC 20150720	789,000.000	768,959.400	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,098,639.850	
		3.6% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20141015	711,000.000	737,456.310	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,424,235.870	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	649,000.000	698,791.280	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	2,569,457.000	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,849,705.960	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,570,067.950	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,896,160.860	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,914,225.950	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110328	1,390,000.000	1,434,215.900	
		3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	831,000.000	844,487.130	
		3.6% HELLENIC REPUBLIC 20160720	533,000.000	508,492.660	
		6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,622,866.560	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	630,000.000	670,408.200	

		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,050,777.680	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,592,175.410	
		3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,257,588.810	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	993,000.000	1,049,541.420	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,949,126.480	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	688,010.240	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,199,082.250	
		3.9% HELLENIC REPUBLIC 20110820	755,000.000	775,709.650	
		2% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120328	1,080,000.000	1,092,117.600	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	817,008.880	
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110430	1,310,000.000	1,364,129.200	
		4.3% HELLENIC REPUBLIC 20170720	875,000.000	855,977.500	
		4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	962,558.280	
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,554,063.700	
		4.6% HELLENIC REPUBLIC 20400920	811,000.000	668,093.690	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,444,078.880	
		4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	333,000.000	323,103.240	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	708,000.000	751,973.880	
		4.7% HELLENIC REPUBLIC 20240320	1,016,000.000	937,676.560	
		5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20101101	1,859,000.000	1,936,427.350	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	544,630.000	
		4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,866,000.000	2,000,240.040	
		4.1% HELLENIC REPUBLIC 20120820	610,000.000	623,938.500	
		4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	587,000.000	624,127.750	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,554,288.540	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120430	2,036,000.000	2,090,605.520	
		3.8% HELLENIC REPUBLIC 20110320	464,000.000	475,010.720	
		3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,051,000.000	1,087,112.360	
		4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,627,528.620	
		4.6% HELLENIC REPUBLIC 20180720	760,000.000	745,985.600	
		4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,003,691.600	
		4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,854,111.750	
		4% HELLENIC REPUBLIC 20130820	765,000.000	773,958.150	

		6.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110425	1,673,000.000	1,799,361.690	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,223,100.520	
		5.5% HELLENIC REPUBLIC 20140820	1,194,000.000	1,266,989.220	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110801	1,816,000.000	1,927,611.360	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	457,000.000	463,918.980	
		4.3% HELLENIC REPUBLIC 20120320	2,491,000.000	2,564,459.590	
		6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,412,075.800	
		2.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130430	1,704,000.000	1,712,980.080	
		6% HELLENIC REPUBLIC 20190719	1,330,000.000	1,417,593.800	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	2,010,540.840	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,217,508.760	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	964,138.360	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,509,313.480	
		5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	2,129,043.600	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20111025	1,324,000.000	1,416,176.880	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	3,624,000.000	4,092,075.840	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	3,099,896.600	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,143,686.600	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,009,000.000	2,258,578.070	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	2,029,487.120	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,895,985.680	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,662,720.250	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,813,883.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,167,729.200	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,890,194.240	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,145,331.440	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,662,903.910	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,683,138.040	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,903,153.420	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	2,010,249.660	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,677,680.300	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,368,406.430	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,756,835.440	

		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,657,830.750	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,813,757.920	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,658,830.590	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	1,752,000.000	1,774,443.120	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,391,162.840	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	3,264,000.000	3,208,414.080	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,312,767.400	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	2,117,000.000	2,206,781.970	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,020,487.040	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,396,275.630	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,473,000.000	1,582,517.550	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,256,990.360	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,710,000.000	1,820,243.700	
		6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	344,843.470	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,354,000.000	2,406,046.940	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,645,800.160	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110112	2,492,000.000	2,551,209.920	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	2,252,000.000	2,188,133.280	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110712	2,680,000.000	2,780,714.400	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110315	1,337,000.000	1,375,599.190	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	4,090,846.380	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,537,980.600	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	1,089,000.000	1,169,422.650	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110915	1,569,000.000	1,628,308.200	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,891,706.490	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,379,795.600	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	861,000.000	933,590.910	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	2,317,000.000	2,431,529.310	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,310,425.040	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110912	2,948,000.000	2,963,535.960	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,105,543.520	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	1,388,000.000	1,424,906.920	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,594,944.360	

		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	3,075,399.920	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110201	1,954,000.000	2,013,421.140	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	2,151,399.550	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,982,998.550	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,799,180.460	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,524,000.000	1,595,277.480	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110408	1,727,000.000	1,785,510.760	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	3,213,000.000	3,402,567.000	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111014	2,029,000.000	2,115,861.490	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	2,615,000.000	2,736,283.700	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,925,079.750	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120301	1,954,000.000	2,009,063.720	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	1,219,000.000	1,309,254.760	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,810,356.020	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	2,019,116.880	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,760,292.540	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,198,938.500	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,341,000.000	1,423,002.150	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,411,545.750	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120701	1,037,000.000	1,050,273.600	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,422,548.620	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,436,000.000	1,476,969.080	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,527,000.000	1,559,708.340	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101210	1,792,000.000	1,818,378.240	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110311	1,512,000.000	1,518,486.480	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110610	1,146,000.000	1,154,640.840	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110916	2,710,000.000	2,715,663.900	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,699,000.000	2,177,982.080	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,410,029.830	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	1,972,658.600	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,060,845.500	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	967,050.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,660,264.060	

		5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110104	2,052,000.000	2,150,331.840	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	740,000.000	874,620.800	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	1,888,093.970	
		5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110704	2,633,000.000	2,794,323.910	
		5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,577,578.640	
		5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110715	1,032,000.000	1,095,179.040	
		5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,190,667.850	
		4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	3,001,939.580	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,029,171.550	
		5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,122,096.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,393,675.580	
		4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,145,823.240	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,374,135.200	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,955,987.320	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,938,937.450	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,226,724.650	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,565,806.940	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,084,040.000	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,643,155.500	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,829,829.500	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,326,172.850	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	862,762.900	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,371,527.210	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	828,187.020	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,298,992.720	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,935,061.540	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	786,591.600	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,026,437.780	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	679,721.600	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	428,000.000	489,289.600	
		4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,064,104.740	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,827,632.600	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110115	1,172,000.000	1,212,398.840	

		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,359,736.160	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,204,138.300	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120115	1,766,000.000	1,805,823.300	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,487,935.020	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,520,638.320	
	ユーロ 小計		ユーロ 377,748,000.000 (49,186,567,080)	ユーロ 401,998,556.110 (52,344,231,991)	
国債証券 合計			93,264,909,820 [93,264,909,820]	99,685,281,944 [99,685,281,944]	
合計			93,264,909,820 [93,264,909,820]	99,685,281,944 [99,685,281,944]	

次へ

（注）1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における［ ］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	150銘柄	100%	31.9%
イギリス・ポンド	国債証券	34銘柄	100%	7.8%
オーストラリア・ドル	国債証券	6銘柄	100%	0.8%
カナダ・ドル	国債証券	27銘柄	100%	2.7%
シンガポール・ドル	国債証券	16銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	8銘柄	100%	0.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券	9銘柄	100%	0.7%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券	4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	12銘柄	100%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券	15銘柄	100%	0.5%
ユーロ	国債証券	251銘柄	100%	52.5%

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関係に関する注記）」に記載しております。

２ 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年12月30日

Ⅰ	資産総額	296,456,094円
Ⅱ	負債総額	247,121円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	296,208,973円
Ⅳ	発行済数量	384,755,706口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7699円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド
純資産額計算書

平成21年12月30日

Ⅰ	資産総額	95,384,926,374円
Ⅱ	負債総額	282,556,724円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	95,102,369,650円
Ⅳ	発行済数量	199,416,778,713口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.4769円

（参考）日本債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年12月30日

Ⅰ	資産総額	51,129,536,322円
Ⅱ	負債総額	168,295,720円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	50,961,240,602円
Ⅳ	発行済数量	42,987,669,060口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1855円

（参考）外国株式インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年12月30日

Ⅰ	資産総額	48,438,455,442円
Ⅱ	負債総額	417,699,123円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,020,756,319円
Ⅳ	発行済数量	52,628,128,754口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9125円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年12月30日

Ⅰ	資産総額	106,761,528,321円
Ⅱ	負債総額	727,080,845円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）　106,034,447,476円
Ⅳ 発行済数量　55,161,854,242口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）　1.9222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	29,555,940	0
第2計算期間	10,582,210	4,598,435
第3計算期間	33,299,556	1,239,054
第4計算期間	39,039,978	9,739,388
第5計算期間	46,544,658	12,830,227
第6計算期間	84,233,648	40,417,878
第7計算期間	59,776,704	26,115,933
第8計算期間	70,748,953	28,638,337
第9計算期間	79,284,787	19,753,272
第10計算期間	83,697,312	23,652,130

（注）当初設定数量は10,000,000口です。

第四部 【特別情報】

第１ 【委託会社等の概況】

１ 【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

平成21年12月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

ｂ．委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境検討会

運用最高責任者である運用本部長（ＣＩＯ）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．運用会議

ＣＩＯが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受

けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成21年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（公募）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	13	44,720
追加型株式投資信託	263	5,758,227
株式投資信託　合計	276	5,802,947
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,016,489
公社債投資信託 合計	17	3,016,489
総合計	293	8,819,436

３ 【委託会社等の経理状況】

１． 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、第49期事業年度（平成19年４月１日から平成20年３月31日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第50期事業年度（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年４月１日から平成20年３月31日まで）の財務諸表及び第50期事業年度（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第51期事業年度に係る中間会計期間（平成21年４月１日から平成21年９月30日まで）の中間財務諸表について、あずさ監査法人により中間監査を受けております。

３．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成20年３月31日現在）		当事業年度 （平成21年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,398,882		3,961,462
有価証券		32,206,041		28,233,112
前払金		3,357		453
前払費用		96,205		84,549
未収入金		75,494		20,722
未収消費税等		―		27,138
未収委託者報酬		8,899,037		5,273,080
未収収益		136,888		25,476
貯蔵品		83,453		38,909
繰延税金資産		779,955		227,536
デリバティブ資産		1,172,830		―
その他		30,104		2,030
流動資産計		46,882,252		37,894,473
固定資産				
有形固定資産	※1	1,618,595	※1	1,252,162
建物（純額）		388,414		349,484
器具備品（純額）		1,229,446		900,893

建設仮勘定		735		1,785
無形固定資産		1,989,254		1,980,730
ソフトウェア		1,976,209		1,967,944
電話加入権		11,850		11,850
その他		1,194		936
投資その他の資産		8,890,810		8,317,769
投資有価証券		7,690,544		7,780,508
関係会社株式		737,012		737,012
出資金		166,719		178,806
従業員に対する長期貸付金		176,298		155,692
差入保証金		633,855		618,264
長期前払費用		10,039		8,394
投資不動産（純額）		593,270		579,162
その他		43		―
貸倒引当金	※3	△1,116,972	※3	△1,740,069
固定資産計		12,498,661		11,550,663
資産合計		59,380,914		49,445,137

（単位:千円）

		前事業年度 （平成20年３月31日現在）		当事業年度 （平成21年３月31日現在）
負債の部				
流動負債				
預り金		50,693		48,999
未払金		10,302,751		5,335,193
未払収益分配金		27,011		32,233
未払償還金		332,721		278,950
未払手数料		4,943,985		2,896,691
その他未払金	※2	4,999,033	※2	2,127,318
未払費用		2,177,782		1,528,570
未払法人税等		1,402,832		442,052
未払消費税等		425,013		―
前受収益		39,700		―
賞与引当金		480,300		223,000
その他		22,096		1,951
流動負債計		14,901,170		7,579,766
固定負債				
退職給付引当金		988,898		1,150,011
役員退職慰労引当金		46,260		62,520
繰延税金負債		2,300,289		1,767,537
固定負債計		3,335,448		2,980,068
負債合計		18,236,618		10,559,835
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174,272		15,174,272
資本剰余金				
資本準備金		11,495,727		11,495,727

資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	11,702,152	9,659,553
利益剰余金合計	14,876,450	12,833,851
株主資本合計	41,546,450	39,503,851
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△402,154	△618,549
評価・換算差額等合計	△402,154	△618,549
純資産合計	41,144,295	38,885,301
負債・純資産合計	59,380,914	49,445,137

(2) 【損益計算書】

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	82,506,998	67,765,880
その他営業収益	572,557	391,449
営業収益計	83,079,556	68,157,330
営業費用		
支払手数料	48,784,763	40,411,927
広告宣伝費	1,542,009	836,270
公告費	9,189	2,131
受益証券発行費	41,501	4,887
調査費	4,197,737	4,089,629
調査費	672,732	752,522
委託調査費	3,525,004	3,337,107
委託計算費	642,326	657,069
営業雑経費	2,103,482	1,828,907
通信費	283,069	264,500
印刷費	918,929	908,407
協会費	40,717	49,882
諸会費	10,258	11,279
その他営業雑経費	850,507	594,837
営業費用計	57,321,011	47,830,823
一般管理費		
給料	4,208,378	3,940,850
役員報酬	185,100	149,400
給料・手当	3,139,424	3,408,724
賞与	403,553	159,726
賞与引当金繰入額	480,300	223,000
福利厚生費	548,953	573,052
交際費	85,291	89,101
寄付金	1,796	630
旅費交通費	231,428	233,872
租税公課	427,247	328,325
不動産賃借料	666,919	730,467
退職給付費用	309,416	310,345
役員退職慰労引当金繰入額	33,405	26,700
固定資産減価償却費	713,538	1,012,489
諸経費	1,349,328	904,760
一般管理費計	8,575,704	8,150,595
営業利益	17,182,840	12,175,911

（単位:千円）

		前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）		当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
営業外収益				
受取配当金		205,108		33,852
有価証券利息		473,605		350,432
受取利息		4,674		4,904
時効成立分配金・償還金		117,919		38,525
有価証券償還益		226,585		26,762
為替差益		—		721,935
デリバティブ評価益		1,150,268		—
その他		27,266		20,641
営業外収益計		2,205,428		1,197,054
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		58,372		127,439
貯蔵品廃棄損		161,462		74,887
為替差損		1,632,650		—
デリバティブ損失		—		885,196
貸倒引当金繰入額		—	※3	621,387
その他		41,095		50,066
営業外費用計		1,893,580		1,758,977
経常利益		17,494,688		11,613,987
特別利益				
投資有価証券売却益	※1	2,241,103		2,157
ゴルフ会員権売却益		13,021		—
特別利益計		2,254,124		2,157
特別損失				
投資有価証券売却損		21,921		2,298
投資有価証券評価損		—		218,872
投資有価証券清算損		—		10,639
固定資産除売却損	※2	44,642	※2	11,886
貸倒引当金繰入額	※3	1,113,972		—
その他	※4	3,737	※4	42,274
特別損失計		1,184,273		285,971
税引前当期純利益		18,564,539		11,330,173
法人税、住民税及び事業税		6,901,995		4,648,684
法人税等調整額		997,192		168,125
法人税等合計		7,899,187		4,816,810
当期純利益		10,665,351		6,513,363

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
特別償却準備金		
前期末残高	2,261	—
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	△2,261	—
当期変動額合計	△2,261	—
当期末残高	—	—
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,834,028	11,702,152
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	2,261	—
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363

当期変動額合計	2,868,123	△2,042,599
当期末残高	11,702,152	9,659,553

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
利益剰余金合計		
前期末残高	12,010,588	14,876,450
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	△2,042,599
当期末残高	14,876,450	12,833,851
株主資本合計		
前期末残高	38,680,588	41,546,450
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	△2,042,599
当期末残高	41,546,450	39,503,851
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	562,216	△402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	△964,370	△216,395
当期末残高	△402,154	△618,549
評価・換算差額等合計		
前期末残高	562,216	△402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	△964,370	△216,395
当期末残高	△402,154	△618,549
純資産合計		
前期末残高	39,242,804	41,144,295
当期変動額		
剰余金の配当	△7,799,489	△8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△964,370	△216,395
当期変動額合計	1,901,491	△2,258,994
当期末残高	41,144,295	38,885,301

重要な会計方針

	前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 (2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法により計上しております。	同左
３．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　７～50年 器具備品　５～10年 （会計方針の変更） 法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年３月30日 法律第６号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年３月30日 政令第83号））に伴い、当事業年度より、平成19年４月１日以降に取得したものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。 当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。 （追加情報） 当事業年度より、平成19年３月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から５年間で均等償却する方法によっております。 当該変更に伴う損益に与える影響は、軽微であります。	(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 同左 ―――――――
	(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年）に基づいております。	(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 同左
	(3) 長期前払費用 定額法によっております。	(3) 長期前払費用 同左

４．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。	(1) 貸倒引当金 同左
	(2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。	(2) 賞与引当金 同左
	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。	(3) 退職給付引当金 同左
	(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。	(4) 役員退職慰労引当金 同左
５．リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	―――――――
６．その他財務諸表作成のための重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、５年間で均等償却を行なっております。	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。
	(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。	(2) 連結納税制度の適用 同左

会計方針の変更

前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

――――――	（リース取引に関する会計基準） 当事業年度より、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成５年６月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年３月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成６年１月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年３月30日改正））を適用しております。 なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 当該変更に伴う損益に与える影響はありません。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成20年３月31日現在）	当事業年度 （平成21年３月31日現在）
※１ 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物 735,161千円 器具備品 1,604,537千円 投資建物 662,012千円 投資器具備品 26,457千円 ※２ 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 4,620,908千円 ※３ 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。 ４ 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。	※１ 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物 776,838千円 器具備品 1,691,069千円 投資建物 675,647千円 投資器具備品 26,929千円 ※２ 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 1,848,998千円 ※３ 同左 ４ 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
※１ 関係会社との取引 投資有価証券売却益 2,067,950千円 ※２ 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除却損 器具備品 44,642千円	―――――― ※２ 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除却損 器具備品 11,886千円

※３ 貸倒引当金繰入額に関する注記 保有している外貨建資産担保債券の１銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。 なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。	※３ 同左
※４ 特別損失の「その他」の主な内訳 会社清算損　3,069千円 保証金の返還に伴う損失　668千円	※４ 特別損失の「その他」の主な内訳 受益証券予備券廃棄損　21,160千円 ゴルフ会員権評価損　19,403千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成19年６月22日定時株主総会	普通株式	7,799	2,990	平成19年３月31日	平成19年６月25日

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

平成20年６月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

①剰余金の配当の総額　8,555百万円

②配当の原資　利益剰余金

③1株当たり配当額　3,280円

④基準日　平成20年３月31日

⑤効力発生日　平成20年６月23日

当事業年度（自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	－	－	2,608
合　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成20年６月20日定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年３月31日	平成20年６月23日

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

平成21年６月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

①剰余金の配当の総額　6,495百万円

②配当の原資　利益剰余金

③1株当たり配当額　2,490円

④基準日　平成21年３月31日

⑤効力発生日　平成21年６月22日

（リース取引関係）

前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）
（借主側） リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 器具備品 取得価額相当額　4,599千円 減価償却累計額相当額　2,299 期末残高相当額　2,299 なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。 (2)未経過リース料期末残高相当額 １年以内　1,314千円 １年超　985 合計　2,299 なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。	（借主側） リース取引開始日が平成20年３月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 器具備品 取得価額相当額　4,599千円 減価償却累計額相当額　3,613 期末残高相当額　985 なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。 (2)未経過リース料期末残高相当額 １年以内　985千円 １年超　- 合計　985 なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料　　1,314千円 減価償却費相当額　1,314千円 (4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料　　1,314千円 減価償却費相当額　1,314千円 (4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

（有価証券関係）

１．その他有価証券で時価のあるもの

種類	前事業年度（平成20年３月31日現在）			当事業年度（平成21年３月31日現在）		
	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの						
(1)株式	55,101	73,804	18,702	55,101	67,520	12,418
(2)債券	50,000	50,105	105	―	―	―
(3)その他						
証券投資信託の受益証券	3,110,512	3,238,991	128,479	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	3,215,614	3,362,900	147,286	1,787,101	1,882,948	95,846
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの						
(1)債券	13,669,870	11,886,801	△1,783,068	―	―	―
(2)その他						
証券投資信託の受益証券	2,816,910	2,591,485	△225,424	3,766,074	2,627,319	△1,138,755
小計	16,486,780	14,478,287	△2,008,493	3,766,074	2,627,319	△1,138,755
合計	19,702,395	17,841,188	△1,861,206	5,553,176	4,510,267	△1,042,909

(注)　その他有価証券で時価のあるものについて、当事業年度において218,872千円の減損処理を行っております。

なお、有価証券の減損にあたって、当事業年度末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。また、時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復可能性を検討し、回復見込みがないと判断されたものについては、減損処理を行っております。

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

	前事業年度（自　平成19年４月１日　至　平成20年３月31日）	当事業年度（自　平成20年４月１日　至　平成21年３月31日）
売却額（千円）	3,892,206	190,340
売却益の合計額（千円）	2,241,103	2,157
売却損の合計額（千円）	21,921	2,298

３．時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

種類	前事業年度 （平成20年３月31日現在） 貸借対照表計上額 （千円）	当事業年度 （平成21年３月31日現在） 貸借対照表計上額 （千円）
子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	737,012	737,012
小計	737,012	737,012
その他有価証券		
非上場株式	1,314,612	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,504,860	2,098,103
ＭＭＦ・中期国債ファンド	18,235,925	28,233,112
小計	22,055,397	31,503,352
合計	22,792,409	32,240,364

４．その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

前事業年度（自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
(1)債券				
社債	150,000	－	－	－
その他	13,569,000	－	－	－
(2)その他				
証券投資信託の受益証券	1,023,578	434,463	1,611,490	86,955
合計	14,742,578	434,463	1,611,490	86,955

当事業年度（自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
その他				
証券投資信託の受益証券	－	376,553	1,729,191	－
合計	－	376,553	1,729,191	－

（デリバティブ取引関係）

１．取引の状況に関する事項

前事業年度 （自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）	当事業年度 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

(1) 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。	(1) 取引の内容及び利用目的 同左
(2) 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。	(2) 取引に対する取組方針 同左
(3) 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。	(3) 取引に係るリスクの内容 同左
(4) 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。 なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。	(4) 取引に係るリスク管理体制 同左

２．取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前事業年度（平成20年３月31日現在）				当事業年度（平成21年３月31日現在）			
		契約額等（千円）	契約額等のうち１年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）	契約額等（千円）	契約額等のうち１年超（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	16,334,748	-	1,150,268	1,150,268	410,852	-	△1,622	△1,622

(注) 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額となっております。

（退職給付関係）

前事業年度（平成20年３月31日現在）	当事業年度（平成21年３月31日現在）
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。	１．採用している退職給付制度の概要 同左
２．退職給付債務に関する事項 退職給付債務　988,898千円 退職給付引当金　988,898千円	２．退職給付債務に関する事項 退職給付債務　1,150,011千円 退職給付引当金　1,150,011千円

3．退職給付費用に関する事項

勤務費用	152,041千円
その他	157,375
退職給付費用	309,416

なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は106,630千円であります。

3．退職給付費用に関する事項

勤務費用	168,703千円
その他	141,642
退職給付費用	310,345

なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度（平成20年３月31日現在）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

	千円
繰延税金資産	
減損損失	887,301
貸倒引当金	454,496
退職給付引当金	402,382
未払事業税	332,390
株式譲渡損繰延	287,965
その他有価証券評価差額金	275,900
投資有価証券評価損	214,784
賞与引当金	168,660
出資金評価損	118,268
器具備品	38,093
役員退職慰労引当金	18,823
未払社会保険料	18,208
前受収益	16,153
一括償却資産	10,048
その他	23,392
繰延税金資産小計	3,266,871
評価性引当額	△1,947,529
繰延税金資産合計	1,319,341
繰延税金負債	
株式譲渡益繰延	2,837,113
その他	2,562
繰延税金負債合計	2,839,675
繰延税金負債の純額	1,520,333

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率	40.69%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.20
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.52
住民税均等割	0.02
評価性引当額	2.45

当事業年度（平成21年３月31日現在）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

	千円
繰延税金資産	
減損損失	886,012
貸倒引当金	708,034
退職給付引当金	467,939
その他有価証券評価差額金	424,359
投資有価証券評価損	303,843
株式譲渡損繰延	287,965
出資金評価損	126,163
未払事業税	108,049
賞与引当金	90,738
器具備品	38,093
役員退職慰労引当金	25,439
未払社会保険料	11,283
その他	31,981
繰延税金資産小計	3,509,905
評価性引当額	△2,210,636
繰延税金資産合計	1,299,269
繰延税金負債	
株式譲渡益繰延	2,837,113
その他	2,156
繰延税金負債合計	2,839,269
繰延税金負債の純額	1,540,000

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率	40.69%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.35
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.13
住民税均等割	0.03
評価性引当額	2.32

その他	△0.29	その他	△0.74
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.55	税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.52

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成19年４月１日 至 平成20年３月31日）

１．親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	 3,153,487 2,067,950	 ― ―	 ― ―

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

有価証券の売却価格は、修正簿価純資産方式により決定しており、支払条件は現金一括払いであります。

２．兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	―	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	31,893,085	未払手数料	3,927,855
親会社の子会社	大和証券エスエムビーシー㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	―	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	1,197,059	未払手数料	82,472
								為替予約	25,434,342	―	―
親会社の子会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	―	なし	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,074,141	その他未払金	321,615

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

（１）上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

（２）証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

（３）為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

（４）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度（自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

（追加情報）

当事業年度より、平成18年10月17日公表の「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号）を適用しております。

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	100.0	経営管理	債務保証	711,260	－	－

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,915,828	未払手数料	2,154,948
同一の親会社をもつ会社	大和証券エスエムビーシー㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	980,553	未払手数料	58,506
							為替予約	17,314,889	－	－
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	544,950	その他未払金	197,190

(注) １．上記（ア）～（イ）の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

（１）証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

（２）為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

（３）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

（４）㈱大和総研との取引金額には、㈱大和総研ホールディングス（旧・㈱大和総研）分社化前の取引金額が含まれております。

２.親会社に関する注記

㈱大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　平成19年４月１日 至　平成20年３月31日）	当事業年度 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）
１株当たり純資産額　　15,773.01円 １株当たり当期純利益　　4,088.65円 なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	１株当たり純資産額　　14,907.00円 １株当たり当期純利益　　2,496.95円 同左

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　平成19年４月１日 至　平成20年３月31日）	当事業年度 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）
当期純利益（千円）	10,665,351	6,513,363
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

前事業年度 （自　平成19年４月１日 至　平成20年３月31日）	当事業年度 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）
該当事項はありません。	同左

次へ

中間財務諸表

（１）中間貸借対照表

（単位：千円）

		当中間会計期間末 （平成21年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,276,319
有価証券		22,256,096
未収委託者報酬		6,213,110
貯蔵品		26,368
繰延税金資産		321,833
その他		424,869
流動資産計		33,518,597
固定資産		
有形固定資産	※１	1,168,979
無形固定資産		1,801,825
投資その他の資産		
投資有価証券		10,148,103
その他	※１	1,503,398
貸倒引当金	※２	△1,538,999
投資その他の資産合計		10,112,502
固定資産計		13,083,307
資産合計		46,601,904

（単位：千円）

		当中間会計期間末 （平成21年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		5,163,439
未払法人税等		722,692
賞与引当金		410,700
その他	※４	1,613,671
流動負債計		7,910,503
固定負債		
繰延税金負債		1,926,552
退職給付引当金		1,163,635
役員退職慰労引当金		43,950
固定負債計		3,134,137
負債合計		11,044,641
純資産の部		

株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
別途積立金	2,800,000
繰越利益剰余金	5,993,148
利益剰余金合計	9,167,446
株主資本合計	35,837,446
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△338,935
繰延ヘッジ損益	58,751
評価・換算差額等合計	△280,183
純資産合計	35,557,263
負債・純資産合計	46,601,904

（２）中間損益計算書

（単位:千円）

		当中間会計期間 （自 平成21年４月１日 至 平成21年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		29,980,874
その他営業収益		212,747
営業収益計		30,193,621
営業費用		
支払手数料		17,787,239
その他営業費用		3,452,353
営業費用計		21,239,592
一般管理費	※１	4,221,719
営業利益		4,732,309
営業外収益	※２	394,870
営業外費用	※１,※３	265,780
経常利益		4,861,399
特別利益	※４	64,666
特別損失		1,221
税引前中間純利益		4,924,844
法人税、住民税及び事業税		2,263,441
法人税等調整額		△167,419
中間純利益		2,828,822

（３）中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自 平成21年４月１日 至 平成21年９月30日）
株主資本	
資本金	
前期末残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
前期末残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	2,800,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,800,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	9,659,553
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404
当中間期末残高	5,993,148
利益剰余金合計	
前期末残高	12,833,851
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404

当中間期末残高	9,167,446

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自 平成21年４月１日 至 平成21年９月30日）
株主資本合計	
前期末残高	39,503,851
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
当中間期変動額合計	△3,666,404
当中間期末残高	35,837,446
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	△618,549
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	279,614
当中間期変動額合計	279,614
当中間期末残高	△338,935
繰延ヘッジ損益	
前期末残高	-
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	58,751
当中間期変動額合計	58,751
当中間期末残高	58,751
評価・換算差額等合計	
前期末残高	△618,549
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	338,366
当中間期変動額合計	338,366
当中間期末残高	△280,183
純資産合計	
前期末残高	38,885,301
当中間期変動額	
剰余金の配当	△6,495,227
中間純利益	2,828,822
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	338,366
当中間期変動額合計	△3,328,038
当中間期末残高	35,557,263

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 （自 平成21年４月１日 至 平成21年９月30日）
１．資産の評価基準及び評価方法	（１）有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。 （２）デリバティブ 時価法により計上しております。
２．固定資産の減価償却の方法	（１）有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　６～47年 器具備品　３～20年 （２）無形固定資産（リース資産を除く） 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年）に基づいております。 （３）長期前払費用 定額法によっております。
３．引当金の計上基準	（１）貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。 （２）賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 （３）退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。 （４）役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．ヘッジ会計の方法	（１）ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 （２）ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券 （３）ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。 （４）ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。
５．リース取引の処理方法	リース取引開始日が平成20年３月31日以前の、リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
６．その他中間財務諸表作成のための重要な事項	（１）消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。 （２）連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

当中間会計期間末 （平成21年９月30日現在）
※１．　減価償却累計額 有形固定資産　2,603,477千円 投資不動産　709,109千円 ※２．　投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。 ３．　債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務573,210千円に対して保証を行っております。 ※４．　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

当中間会計期間 （自　平成21年４月１日 至　平成21年９月30日）
※１．減価償却実施額

有形固定資産	141,608千円
無形固定資産	325,480千円
投資不動産	6,532千円

※２．営業外収益の主要項目

有価証券利息	67,638千円
投資有価証券売却益	188,494千円
デリバティブ利益	29,286千円

※３．営業外費用の主要項目

投資有価証券売却損	161,780千円
有価証券償還損	26,776千円

※４．特別利益の主要項目

貸倒引当金戻入額	64,666千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成21年４月１日 至 平成21年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年６月19日 定時株主総会	普通株式	6,495	2,490	平成21年 ３月31日	平成21年 ６月22日

（リース取引関係）

当中間会計期間
（自 平成21年４月１日
至 平成21年９月30日）

（借主側）

リース取引開始日が平成20年３月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引
（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの）

１．リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

	有形固定資産 (工具、器具 及び備品)	合計
	千円	千円
取得価額相当額	4,599	4,599

減価償却累計額相当額	4,270	4,270
中間期末残高相当額	328	328

（注）取得価額相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

２．未経過リース料中間期末残高相当額

１ 年 内	328千円
１ 年 超	－千円
合　計	328千円

（注）未経過リース料中間期末残高相当額は、未経過リース料中間期末残高が有形固定資産の中間期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

３．支払リース料及び減価償却費相当額

支払リース料	657千円
減価償却費相当額	657千円

４．減価償却費相当額の算定方法
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

（有価証券関係）

当中間会計期間末（平成21年９月30日現在）

１．時価のある有価証券

	取得原価（千円）	中間貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
(１)その他有価証券			
①株　式	55,101	73,537	18,435
②そ の 他 証券投資信託の受益証券	6,900,314	6,310,414	△589,899
計	6,955,416	6,383,952	△571,464

２．時価評価されていない主な有価証券

	中間貸借対照表計上額（千円）
(１)その他有価証券	
①非上場株式	1,172,137
②外貨建資産担保債券	1,855,002
③MMF・FFF・中期国債ファンド	22,256,096
計	25,283,235
(２)子会社株式及び関連会社株式	737,012
計	737,012

（デリバティブ取引関係）

１．取引の状況に関する事項

当中間会計期間
（自 平成21年４月１日
至 平成21年９月30日）

（１）取引の内容
当社が利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引及び株価指数先物取引であります。

（２）取引に対する取組方針
デリバティブ取引については、将来の為替変動リスク及び価格変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

（３）取引の利用目的
当社のデリバティブ取引は、当社が保有する投資有価証券に係る為替変動リスク、及び価格変動リスクを軽減する目的で利用しております。
なお、一部の投資有価証券を対象に、デリバティブ取引を利用してヘッジ会計を行っております。

① ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。

② ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段・・・株価指数先物
ヘッジ対象・・・投資有価証券

③ ヘッジ方針
価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。

④ ヘッジ有効性評価の方法
原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。

（４）取引に係るリスクの内容
為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動によるリスク、株価指数先物取引に係るリスクとして、株式指数先物相場の価格変動によるリスクを有しております。また、為替予約取引は、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。

（５）取引に係るリスク管理体制
デリバティブ取引にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。取引の実行及び管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルール等に従い、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理を行っております。
なお、財務部長はデリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を、執行役員会議及び財務会議で行っております。

２．デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

対象物の種類	取引の種類	当中間会計期間末（平成21年９月30日現在）		
		契約額等（千円）	時価（千円）	評価損益（千円）
通貨	為替予約取引	320,616	△4,055	△4,055

（注）１．時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額となっております。
２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引は除いております。

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自　平成21年４月１日 至　平成21年９月30日）	
1株当たり純資産額	13,631.17円
1株当たり中間純利益金額	1,084.45円

(注) １．潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

２．1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

中間純利益(千円)	2,828,822
普通株式に係る中間純利益(千円)	2,828,822
普通株主に帰属しない金額(千円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４ 【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

５ 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成21年4月2日付で、定款について次の変更をいたしました。

・ 株主名簿管理人の廃止

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２ 【その他の関係法人の概況】

１ 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称 住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 287,537百万円（平成21年3月末日現在）

③ 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 （平成21年 3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
住友信託銀行株式会社	287,537	（注2）
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	（注3）
三井生命保険株式会社	167,280	（注4）
株式会社山口銀行	10,005	（注5）

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（注3）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（注4）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

（注5）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

２ 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３ 【資本関係】

該当ありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成21年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３ 【その他】

(1) 目論見書の表紙および裏表紙の記載等について

① 委託会社の名称、所在地を記載することがあります。

② 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

③ ファンドの形態等を記載することがあります。

④ 図案を採用することがあります。

⑤ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書（請求目論見書）である旨を記載することがあります（請求目論見書の場合）。

⑥ ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 目論見書の表紙裏の記載について

次の事項を記載することがあります。

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。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。

委託会社の情報提供窓口

◆お電話によるお問合わせ先

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

◆委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

本文書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

有価証券届出書第三部の内容を記載した「投資信託説明書（請求目論見書）」は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることもできる旨。

(3) 目論見書の冒頭に、有価証券届出書の第一部および第二部の内容を要約または図表化したものならびに計算例を「目論見書の概要」等として記載することがあります。

(4) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(5) 前(3)の「目論見書の概要」の項または目論見書の巻末に、「用語のご説明」等のタイトルで用語集を掲載することがあります。

(6) 前(3)の「目論見書の概要」の項に、当ファンドの基準価額、純資産総額等の推移をグラフで表示する場合があります。

(7) 当ファンドの投資信託約款の内容を記載した書面を、目論見書と合冊で投資家に交付する場合があります。

(8) 目論見書の別称として、次を用いることがあります。

「投資信託説明書（目論見書）」

「投資信託説明書（交付目論見書）」

「投資信託説明書（請求目論見書）」

独立監査人の監査報告書

平成22年1月15日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　山元 太志　印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　久野 佳樹　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル７５の平成20年12月2日から平成21年11月30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、ダイワライフスタイル７５の平成21年11月30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。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注1） 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 業務執行社員 公認会計士 堀 内 巧 印

指定社員 業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、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、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

委託会社の監査報告書（当期中間）へ

独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士 堀 内 巧 印
業務執行社員

指 定 社
員 公認会計士 小 澤 陽 一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成21年1月16日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	山元 太志 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル７５の平成19年12月1日から平成20年12月1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、ダイワライフスタイル７５の平成20年12月1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。

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注1） 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

委託会社の監査報告書（前期）へ

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社
員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員

指 定 社
員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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