【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23年2月21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 ダイワライフスタイル75

国投資信託受益証券に係る

ファンドの名称】

【届出の対象とした募集内 継続申込期間(平成23年2月22日から平成24年2月22日まで)

国投資信託受益証券の金 5,000億円を上限とします。

額】

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、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】

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)

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。 「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23年2月22日から平成24年2月22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】

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。

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。

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。

「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。)。

取得申込金額に利息は付きません。

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。

<b>*</b> • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	単位型投信・追加型 投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
商品分類	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
	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
  属性区分	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。

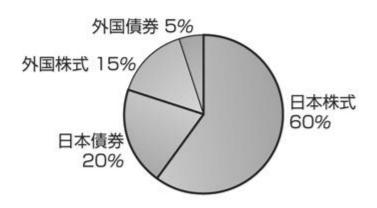
#### <信託金の限度額>

- ・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 内外の株式および債券に投資します。

●各資産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。

## 標準組入比率(基準ポートフォリオ)について



	国内	海 外	合 計
株式	60%	15%	75%
債 券	20%	5%	25%
合 計	80%	20%	100%

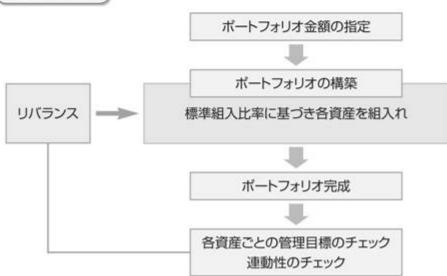
※資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

- 2 各資産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。
- ●合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を標準組入比率に乗じて指数化したものです。

### 各資産ごとのベンチマーク

日本株式	東証株価指数(TOPIX)
日本債券	ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数
外国株式	MSCIコクサイ指数(円ベース)
外国債券	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)

### 運用プロセス



- 標準組入比率にしたがって、各資産へ投資し、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、各資産ごと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。

## ファンドの仕組み

### ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資家のみなさまからお預かりした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仕組みです。



- 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。
- 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。
- 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1.および2.の運用が行なわれないことがあります。
- 毎年11月30日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、 収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### 〈分配方針〉

- 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。

## 各マザーファンドの運用プロセス

### 1. 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。ボ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。

#### 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

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。ボ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 (章) 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ボ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ボ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。

### 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

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。

#### MSCIコクサイ指数とは

MSCIコクサイ指数は、MSCIInc.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、MSCIInc.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、MSCIInc.に帰属します。また、MSCIInc.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

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。

### 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。

#### (2) 【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」)

### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者		お申込者		
	収益分配金(注)、	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。 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 など		

収益分配金、償還金など お申込金( 3)

委託会社

1

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。

受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算

運用報告書の作成 など

運用指図

2

損益 信託金( 3)

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。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処

信託財産の計算

など

損益 投資

投資対象

受託会社

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 (ファミリ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22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。

(金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第352号)

### ・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
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	株 2,608,525	% 100.00

#### 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 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。

#### 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%

- 八.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へ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。
- 二.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】

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.の証券または証書ならびに前16.および前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.までの証券ならびに前18.の証券のうち投資法人債券ならびに前16.および前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(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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。

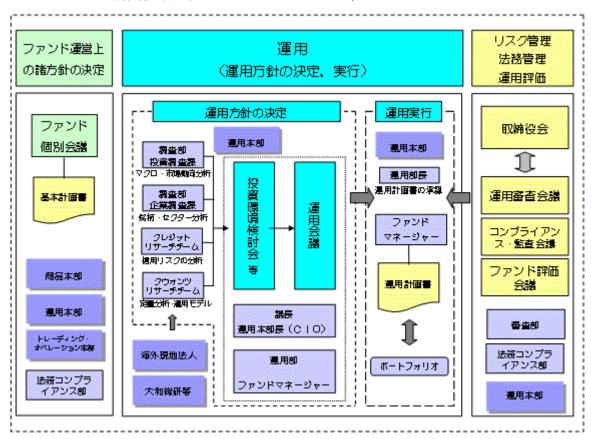
- 1. 預金
- 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3. コール・ローン
- 4. 手形割引市場において売買される手形
- 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

前 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 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】

#### 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。



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。

#### 口.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。

#### 八.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。

#### 二.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。

#### 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
- 口.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。

八.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。

### 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20~30名程度です。

### 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22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。

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。

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。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

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。

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。
- 口.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。

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。
- 口.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。

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号口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。

口.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。

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。
- 口.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。

### 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。
- 口.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

### 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号口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号八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. 先物取引の売建ておよびコール・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、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) 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. 先物取引の売建ておよびコール・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、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。
- 八.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. 先物取引の売建ておよびコール・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) 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) 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。

### 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。

- 二.前八.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。
- へ.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。

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。
- 口.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。
- 八.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(以下本八.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(以下本八.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。
- 二.前八.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。
- へ.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。

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。
- 口.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。

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。

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。
- 口.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。

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。

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。

### 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。
- 口.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。
- 二.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

### 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。

#### 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。
- 八、株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

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

委託会社は、信託金を、前 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

EDINET提出書類 大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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号口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号八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

主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- 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

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。) および新株子約権証券
- 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

委託会社は、信託金を、前 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

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。

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。

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。

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

### 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。

#### 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へ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。
- 八.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

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

委託会社は、信託金を、前 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

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

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### 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。
- 口.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

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

委託会社は、信託金を、前 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

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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

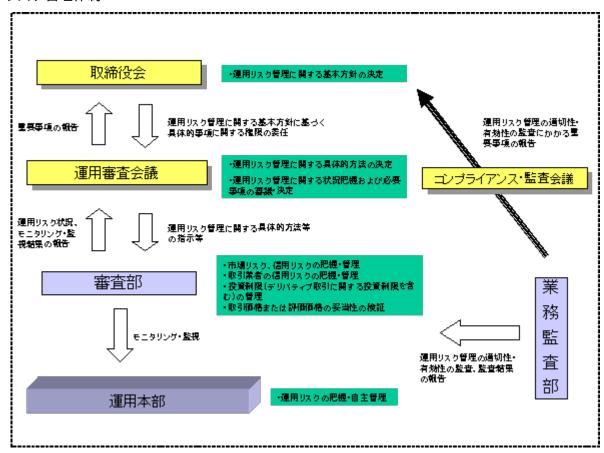
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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) その他の留意点

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

#### (4) リスク管理体制



#### 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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)

申込手数料には、消費税等が課されます。

「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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.945%(税抜0.90%)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。

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。

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
年率0.3675%	年率0.4935%	年率0.084%
(税抜0.35%)	(税抜0.47%)	(税抜0.08%)

前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】

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。

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。

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。 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。

( )「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示す ことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

#### <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】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

#### 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。

#### 口,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。

#### 八.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。

#### 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。

受益者が、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

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。

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。

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

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。

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、口. 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。

- ( )上記は、平成22年12月末現在のものですので、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22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	332,108,514	99.70
内 日本	332,108,514	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	997,366	0.30
純資産総額	333,105,880	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	95,095,541,450	98.36
内 日本	95,095,541,450	98.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,586,761,726	1.64
純資産総額	96,682,303,176	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)	1,541,120,000	1.59
内 日本	1,541,120,000	1.59

## (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		32,415,827,530	63.65
	内 日本	32,415,827,530	63.65
地方債証券	4	4,869,882,687	9.56
	内 日本	4,869,882,687	9.56
特殊債券		6,577,924,307	12.92
	内 日本	6,577,924,307	12.92
社債券		6,749,804,571	13.25
	内 日本	6,749,804,571	13.25
コール・ロ	1ーン、その他の資産(負債控除後)	311,794,645	0.61
純資産総額		50,925,233,740	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	45,325,080,780	97.16
内 オーストラリア	1,960,029,494	4.20
内 カナダ	2,749,774,240	5.89
内 スイス	1,903,668,879	4.08

	内 デンマーク	234,551,999	0.50
	内 ユーロ	6,827,673,495	14.64
	内 英国	5,012,697,545	10.75
	内 香港	642,248,202	1.38
	内 イスラエル	182,849,531	0.39
	内 ノルウェー	194,773,113	0.42
	内 ニュージーランド	16,140,465	0.03
	内 スウェーデン	768,094,759	1.65
	内 シンガポール	394,310,652	0.85
	内 米国	24,438,268,407	52.38
投資証券		696,896,934	1.49
	内 オーストラリア	127,866,980	0.27
	内 ユーロ	71,855,358	0.15
	内 英国	59,151,806	0.13
	内 香港	18,318,312	0.04
	内 シンガポール	9,697,448	0.02
	内 米国	410,007,031	0.88
コール・ロ	コーン、その他の資産(負債控除後)	629,366,696	1.35
純資産総額	Ą	46,651,344,410	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)	613,961,958	1.32	
内 米国	613,961,958	1.32	

## (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	98,615,129,168	98.17	
内 オーストラリア	1,109,337,265	1.10	
内 カナダ	2,871,913,988	2.86	
内 スイス	533,502,862	0.53	
内 デンマーク	835,218,778	0.83	
内 ユーロ	41,787,856,975	41.60	
内 英国	7,667,913,961	7.63	
内 メキシコ	863,398,540	0.86	
内 マレーシア	533,369,553	0.53	
内 ノルウェー	257,645,922	0.26	
内 ポーランド	922,633,934	0.92	
内 スウェーデン	662,205,864	0.66	
内 シンガポール	378,006,378	0.38	
内 米国	40,192,125,149	40.01	
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,838,826,980	1.83	
純資産総額	100,453,956,148	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)	2,680,206,332	2.67	
内 日本	2,680,206,332	2.67	

- (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。
- (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22年12月30日現在)

### 【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	415,374,774	0.46130 191,612,384	0.4821 200,252,178		60.12%
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	54,461,574	1.20717 65,744,464	1.2147 66,154,473	-	19.86%
	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 -	54,788,258	0.87220 47,786,435	0.9002 49,320,389	-	14.81%
	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 -	9,684,012	1.75502 16,995,699	1.6916 16,381,474	-	4.92%

(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。

### 口.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	99.70%	
合計	99.70%	

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】 該当事項はありません。

(参考)トピックス・インデックス・マザーファンド

## 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	1,016,800	3,070 3,121,576,000	3,220 3,274,096,000	-	3.39%
2	三菱UF J フィナンシャル G 日本	株式 銀行業	5,913,600	408 2,416,607,100	439 2,596,070,400	-	2.69%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	667,600	2,999 2,002,200,600	3,215 2,146,334,000	-	2.22%
4	キヤノン 日本	株式 電気機器	492,000	3,905 1,921,260,000	4,210 2,071,320,000	-	2.14%
5	三井住友フィナンシャル G 日本	株式 銀行業	591,200	2,625 1,552,231,800	2,892 1,709,750,400	-	1.77%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	9,522,000	130 1,244,283,800	153 1,456,866,000	-	1.51%
7	三菱商事日本	株式 卸売業	625,300	1,952 1,220,668,900	2,198 1,374,409,400	-	1.42%
8	ソ ニ ー 日本	株式 電気機器	444,900	2,642 1,175,755,600	2,927 1,302,222,300	-	1.35%
9	武田薬品 日本	株式 医薬品	309,900	4,016 1,244,834,000	3,995 1,238,050,500	-	1.28%
10	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	582,900	2,309 1,346,068,300	1,983 1,155,890,700	-	1.20%
11	任 天 堂 日本	株式 その他製品	45,300	23,582 1,068,273,100	23,830 1,079,499,000	-	1.12%
12	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	293,200	3,809 1,116,988,800	3,675 1,077,510,000	-	1.11%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	82,500	10,620 876,191,000	12,470 1,028,775,000	-	1.06%
14	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	346,300	2,685 930,091,000	·	-	1.01%
15	小松製作所 日本	株式 機械	392,700	1,924 755,571,600	2,457 964,863,900	-	1.00%
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	6,456	146,000 942,576,000	141,800 915,460,800	-	0.95%
17	三井物産日本	株式 卸売業	674,600	1,196 807,278,000	1,341 904,638,600	-	0.94%
18	パナソニック 日本	株式 電気機器	783,900	1,113 872,813,500	1,153 903,836,700	-	0.93%
19	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	1,646,200	426 701,821,700	515 847,793,000	-	0.88%
20	三菱地所日本	株式 不動産業	547,000	1,321 723,013,000	1,506 823,782,000	-	0.85%
21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	999,000	714 713,497,300	773 772,227,000	-	0.80%
22	日 立 日本	株式 電気機器	1,777,000	376 668,152,000	433 769,441,000		0.80%
23	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	137,400	5,230 718,602,000	5,280 725,472,000		0.75%
24	東京海上H D 日本	株式 保険業	296,000	2,417 715,432,000	2,427 718,392,000	-	0.74%
25	セプン&アイ・H L D G S 日本	株式 小売業	326,000	1,970 642,220,000	2,170 707,420,000	-	0.73%
26	東 芝 日本	株式 電気機器	1,562,000	408 637,296,000	442 690,404,000	-	0.71%

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

_							
27	三菱電機	株式	791,000	712	852	-	0.70%
	日本	電気機器	,	563,801,000	673,932,000	-	011070
20	関西電力	株式	222 222	2,160	2,004	-	0 070/
28	日本	電気・ガス業	322,300	696,261,300	645,889,200	-	0.67%
20	新日本製鐵	株式	2,168,000	293	292	-	0.65%
29	日本	鉄鋼	2,100,000	635,224,000	633,056,000	-	0.05%
20	信越化学	株式	137,900	4,370	4,400	-	0.63%
30	日本	化学	137,900	602,719,700	606,760,000	-	0.63%

(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。

# 口.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	98.36%
合計	98.36%

(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。

# 八.投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.52%
建設業	1.98%
食料品	2.90%
繊維製品	0.90%
パルプ・紙	0.37%
化学	5.80%
医薬品	4.08%
石油・石炭製品	0.87%
ゴム製品	0.59%
ガラス・土石製品	1.24%
鉄鋼	2.35%
非鉄金属	1.32%
金属製品	0.65%
機械	4.91%
電気機器	14.92%
輸送用機器	9.74%
精密機器	1.40%
その他製品	2.15%
電気・ガス業	4.65%
陸運業	3.47%
海運業	0.60%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	5.35%
卸売業	5.18%
小売業	3.47%
銀行業	9.40%
証券・商品先物取引業	1.58%

保険業	2.51%
その他金融業	0.72%
不動産業	2.44%
サービス業	1.66%
合計	98.36%

(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。

投資不動産物件 該当事項はありません。

# その他投資資産の主要なもの

(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 2011年3月	買建	172	1,526,843,742	1,541,120,000	1.59%

- (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

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	3 0 5 1 0 年国債 日本	国債証券	757,000,000	101.81 770,724,410	102.54 776,295,930	1.300000 19/12/20	1.52%
2	288 10年国債 日本	国債証券	652,000,000	106.55 694,751,640	106.88 696,870,640	1.700000 17/09/20	1.37%
3	88 5年国債 日本	国債証券	673,000,000	100.40 675,692,000	100.66 677,455,260	0.500000 15/03/20	1.33%
4	2 9 0 2 年国債 日本	国債証券	600,000,000	100.03 600,232,000	100.05 600,354,000	0.200000 12/03/15	1.18%
5	9 2 5 年国債 日本	国債証券	570,000,000	99.33 566,224,100	99.65 568,022,100	0.300000 15/09/20	1.12%
6	3 1 0 1 0 年国債 日本	国債証券	546,000,000	98.36 537,097,860	99.16 541,446,360	1.000000 20/09/20	1.06%
7	309 10年国債 日本	国債証券	517,000,000	99.52 514,554,590	100.29 518,551,000	1.100000 20/06/20	1.02%
8	3 0 3 1 0 年国債 日本	国債証券	467,000,000	102.98 480,935,280	103.65 484,087,530	1.400000 19/09/20	0.95%
9	296 10年国債 日本	国債証券	428,000,000	104.71 448,175,920	105.11 449,900,760	1.500000 18/09/20	0.88%
10	90 5年国債 日本	国債証券	435,000,000	99.49 432,798,400	99.73 433,855,950	0.300000 15/06/20	0.85%
11	301 10年国債 日本	国債証券	406,000,000	104.05 422,469,640	104.67 424,964,260	1.500000 19/06/20	0.83%
12	85 5年国債 日本	国債証券	377,000,000	101.31 381,942,470	101.50 382,662,540	0.700000 14/09/20	0.75%
13	306 10年国債 日本	国債証券	357,000,000	102.39 365,564,430	103.23 368,563,230	1.400000 20/03/20	0.72%

# 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

						有価証	券届出書 (内国	<u>国投資信託</u>
14	307 103	年国債 日本	国債証券	340,000,000	101.55 345,293,800	102.35 348,007,000	1.300000 20/03/20	0.68%
15	298 2年	国債 日本	国債証券	340,000,000	99.83 339,422,000	99.88 339,619,200	0.100000 12/11/15	0.67%
16	299 104	年国債 日本	国債証券	323,000,000	102.69 331,688,700	103.25 333,500,730	1.300000 19/03/20	0.65%
17	284 103	年国債 日本	国債証券	311,000,000	106.57 331,442,030	106.84 332,284,840	1.700000 16/12/20	0.65%
18	113 204	年国債 日本	国債証券	306,000,000	102.55 313,824,420	103.97 318,175,740	2.100000 29/09/20	0.62%
19	269 103	年国債 日本	国債証券	298,000,000	103.79 309,318,040	103.99 309,908,080	1.300000 15/03/20	0.61%
20	292 2年	国債 日本	国債証券	290,000,000	100.03 290,104,400	100.06 290,194,300	0.200000 12/05/15	0.57%
21	87 5年国(	責 日本	国債証券	285,000,000	100.47 286,362,300	100.72 287,057,700	0.500000 14/12/20	0.56%
22	292 103	年国債 日本	国債証券	247,000,000	106.53 263,134,040	106.89 264,020,770	1.700000 18/03/20	0.52%
23	295 2年	国債 日本	国債証券	250,000,000	100.03 250,082,500	100.07 250,180,000	0.200000 12/08/15	0.49%
24	121 203	年国債 日本	国債証券	246,000,000	98.84 243,155,720	100.35 246,883,140	1.900000 30/09/20	0.48%
25	117 203	年国債 日本	国債証券	236,000,000	102.17 241,130,640	103.68 244,703,680	2.100000 30/03/20	0.48%
26	297 103	年国債 日本	国債証券	231,000,000	103.71 239,574,720	104.21 240,732,030	1.400000 18/12/20	0.47%
27	280 103	年国債 日本	国債証券	222,000,000	107.52 238,703,280	107.74 239,191,680	1.900000 16/06/20	0.47%
28	89 5年国(	責 日本	国債証券	238,000,000	99.91 237,787,700	100.17 238,416,500	0.400000 15/06/20	0.47%
29	285 104	年国債 日本	国債証券	220,000,000	106.60 234,531,000	106.89 235,166,800	1.700000 17/03/20	0.46%
30	264 104	年国債 日本	国債証券	223,000,000	104.32 232,653,670	104.45 232,930,190	1.500000 14/09/20	0.46%

(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。

# 口.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	63.65%
地方債証券	9.56%
特殊債券	12.92%
社債券	13.25%
合計	99.39%

(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。

投資不動産物件 該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの該当事項はありません。

# (参考)外国株式インデックスマザーファンド

# 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	128,855	5,659 729,252,360	5,978 770,413,904	-	1.65%
	APPLE INC	米国	株式 電気機器	23,200	25,821 599,064,282	26,507 614,982,865	-	1.32%
3	MICROSOFT CORP	米国	株式 サービス業	197,200	2,062 406,727,347	2,279 449,473,089	-	0.96%
4	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	株式 食料品	90,050	4,814 433,552,029	4,857 437,440,388		0.94%
5	GENERAL ELECTRIC CO	米国	株式 電気機器	271,400	1,301 353,198,684	1,488 404,066,372	-	0.87%
6	HSBC HOLDINGS PLC	英国	株式 銀行業	458,800	823 378,001,062	838 384,790,458	-	0.82%
7	CHEVRON CORP	米国	株式 石油・石炭製 品	51,318	6,656 341,619,723	7,445 382,100,552	-	0.82%
8	INT'L BUSINESS MACHINES	S 米国	株式 電気機器	32,000	11,644 372,611,395	11,939 382,077,274	-	0.82%
9	PROCTER & GAMBLE CO	米国	株式 化学	71,737	5,062 363,202,544	5,247 376,472,620	-	0.81%
	AT&T INC	米国	株式 情報・通信業	151,195	2,257 341,288,391	2,388 361,125,009	-	0.77%
	JOHNSON & JOHNSON	米国	株式 医薬品	70,200	5,045 354,162,222	5,062 355,420,754	-	0.76%
	JPMORGAN CHASE & CO	米国	株式 銀行業	101,520	3,089 313,624,305	3,451 350,438,553		0.75%
	BHP BILLITON LTD オーストラ	ラリア	株式 鉱業	87,400	3,594 314,162,901	3,778 330,219,793		0.71%
	WELLS FARGO & CO	米国	株式 銀行業	126,072	2,216 279,442,118	2,527 318,687,298	-	0.68%
15	GOOGLE INC-CL A	米国	株式 サービス業	6,300	47,436 298,847,707	48,975 308,545,587	-	0.66%
16	PFIZER INC	米国	株式 医薬品	204,563	1,349 276,052,532	1,434 293,389,164	-	0.63%
17	VODAFONE GROUP PLC	英国	株式 情報・通信業	1,365,237	201 275,071,555	213 291,475,696	-	0.62%
18	BP PLC	英国	株式 石油・石炭製 品	486,600	541 263,536,409	598 291,293,280	-	0.62%
19	COCA COLA CO	米国	株式 食料品	52,600	5,165 271,713,248	5,333 280,543,178	-	0.60%
20	BANK OF AMERICA CORP	米国	株式 銀行業	254,301	921 234,377,000	1,084 275,822,977	-	0.59%
21	CITIGROUP INC	米国	株式 銀行業	697,833	344 240,147,483	388 271,252,781	-	0.58%
22	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	株式 医薬品	55,550	4,667 259,293,957	4,862 270,087,877	-	0.58%
23	ORACLE CORPORATION	米国	株式 サービス業	101,583	2,218 225,327,124	2,566 260,756,958	-	0.56%

						131144111		110 70 IUU
24	ROYAL DUTCH SHELL PI	LC-A S 英国	株式 石油・石炭製 品	91,500	2,460 225,151,159		-	0.53%
25	INTEL CORP	米国	株式 電気機器	142,000	1,738 246,821,801	1,706 242,308,885		0.52%
26		ユーロ	株式 石油・石炭製 品	55,050	4,003 220,370,105	4,374 240,803,343	-	0.52%
27	CISCO SYSTEMS	米国	株式 電気機器	145,600	1,584 230,654,511	1,650 240,265,116	-	0.52%
28		米国	株式 サービス業	34,667	6,274 217,526,065	6,815 236,255,907	-	0.51%
	MERCK & CO INC	米国	株式 医薬品	78,121	2,826 220,839,325	2,950 230,515,767	-	0.49%
30	WAL-MART STORES	米国	株式 小売業	51,900	4,388 227,749,474	4,406 228,722,220	-	0.49%

(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。

# 口.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	97.16%
投資証券	1.49%
合計	98.65%

(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。

# 八.投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.20%
鉱業	4.25%
建設業	0.73%
食料品	6.31%
繊維製品	0.21%
パルプ・紙	0.29%
化学	4.19%
医薬品	6.67%
石油・石炭製品	7.63%
ゴム製品	0.12%
ガラス・土石製品	0.27%
鉄鋼	0.55%
非鉄金属	0.15%
金属製品	0.37%
機械	2.68%
電気機器	8.65%
輸送用機器	1.99%
精密機器	0.42%
その他製品	0.77%
電気・ガス業	2.44%
陸運業	0.82%
海運業	0.28%

空運業0.14%倉庫・運輸関連業0.03%情報・通信業4.65%卸売業0.40%小売業4.50%銀行業11.26%証券・商品先物取引業0.75%保険業4.03%その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%新聞・出版0.31%		
情報・通信業4.65%卸売業0.40%小売業4.50%銀行業11.26%証券・商品先物取引業0.75%保険業4.03%その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	空運業	0.14%
卸売業0.40%小売業4.50%銀行業11.26%証券・商品先物取引業0.75%保険業4.03%その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	倉庫・運輸関連業	0.03%
小売業4.50%銀行業11.26%証券・商品先物取引業0.75%保険業4.03%その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	情報・通信業	4.65%
銀行業 11.26% 証券・商品先物取引業 0.75% 保険業 4.03% その他金融業 2.02% 不動産業 0.59% サービス業 10.53% 消費材 0.34% 石油他 2.77% 建設資材 0.34% 水道 0.15% 持株会社 0.26% コンク゛ロマリット 1.10% 電力 1.33% エンシ゛ニアリンク゛ 0.02% プ゜ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	卸売業	0.40%
証券・商品先物取引業 0.75% 保険業 4.03% その他金融業 2.02% 不動産業 0.59% サービス業 10.53% 消費材 0.34% 石油他 2.77% 建設資材 0.34% 水道 0.15% 持株会社 0.26% コンク゛ロマリット 1.10% 電力 1.33% エンシ゛ニアリンク゛ 0.02% フ゜ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	小売業	4.50%
保険業4.03%その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	銀行業	11.26%
その他金融業2.02%不動産業0.59%サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	証券・商品先物取引業	0.75%
不動産業 0.59% サービス業 10.53% 消費材 0.34% 石油他 2.77% 建設資材 0.34% 水道 0.15% 持株会社 0.26% コンク゛ロマリット 1.10% 電力 1.33% エンシ゛ニアリンク゛ 0.02% フ゜ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	保険業	4.03%
サービス業10.53%消費材0.34%石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	その他金融業	2.02%
消費材 0.34% 石油他 2.77% 建設資材 0.34% 水道 0.15% 持株会社 0.26% コンク゛ロマリット 1.10% 電力 1.33% エンシ゛ニアリンク゛ 0.02% フ゜ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	不動産業	0.59%
石油他2.77%建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	サービス業	10.53%
建設資材0.34%水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	消費材	0.34%
水道0.15%持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	石油他	2.77%
持株会社0.26%コンク゛ロマリット1.10%電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	建設資材	0.34%
コンク゛ロマリット 1.10% 電力 1.33% エンシ゛ニアリンク゛ 0.02% フ゜ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	水道	0.15%
電力1.33%エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	持株会社	0.26%
エンシ゛ニアリンク゛0.02%プ゜ランテーション0.06%その他製造1.61%	コンク゛ロマリット	1.10%
フ <sup>°</sup> ランテーション 0.06% その他製造 1.61%	電力	1.33%
その他製造 1.61%	エンシ゛ニアリンク゛	0.02%
	プ <sup>®</sup> ランテーション	0.06%
新聞・出版 0.31%	その他製造	1.61%
	新聞・出版	0.31%
合計 97.16%	合計	97.16%

(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。

投資不動産物件 該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(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 2011年3月	買建	24	605,157,371	613,961,958	1.32%

(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

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	国債証券 -	605,959,640	106.03 642,505,066	101.86 617,272,906	3.375000 19/11/15	0.61%
2	U.S. TREASURY NOTE 米	国債証券	570,348,510	110.11 628,050,669	106.08 605,054,217	3.750000 18/11/15	0.60%

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

					1 有個証	<u> </u>	<u> 国投貨信託</u>
3	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	566,111,030	102.16 578,361,673	98.42 557,217,426	2.750000 19/02/15	0.55%
4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	500,674,560	104.65 523,985,968	100.78 504,624,882	3.125000 19/05/15	0.50%
5	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	476,064,580	108.33 515,744,563	104.20 496,073,574	3.625000 19/08/15	0.49%
6	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	458,788,700	107.86 494,881,607	103.49 474,809,601	3.625000 20/02/15	0.47%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	429,207,830	105.89 454,522,508	104.50 448,535,059	2.625000 14/06/30	0.45%
•	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券	421,810,800	106.79 450,451,753	106.17 447,836,526	5.250000 12/06/07	0.45%
	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	428,555,910	106.55 456,643,464	102.17 437,859,859	3.500000 20/05/15	0.44%
10	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	427,578,030	101.64 434,607,413	101.42 433,688,120	1.375000 12/10/15	0.43%
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	427,607,700	99.65 426,132,453	99.26 424,460,507	3.750000 16/08/01	0.42%
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	404,840,800	104.02 421,131,594	103.20 417,828,093	3.000000 15/10/25	0.42%
	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	401,745,700	104.60 420,230,020	103.26 414,878,767	2.250000 14/05/31	0.41%
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	370,097,000	109.42 404,986,044	107.67 398,498,244	4.250000 19/04/25	0.40%
15	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	388,299,850	101.75 395,095,097	101.64 394,667,968	1.500000 12/07/15	0.39%
16		国債証券	377,706,150	107.71 406,857,511	104.35 394,140,145	3.250000 17/03/31	0.39%
	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	381,943,630	106.21 405,662,329	103.05 393,608,188	3.000000 17/02/28	0.39%
	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	378,439,560	101.75 385,088,743	101.46 383,964,778	1.375000 13/01/15	0.38%
19	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	379,580,420	102.36 388,549,905	100.37 381,003,847	1.875000 15/06/30	0.38%
20	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券	355,914,720	107.53 382,715,098	106.99 380,793,159	4.750000 38/12/07	0.38%
21	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	401,664,210	96.07 385,901,795	94.52 379,665,061	2.625000 20/08/15	0.38%
22	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	375,505,920	100.83 378,641,394	100.76 378,378,540	1.000000 12/03/31	0.38%
23	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	375,831,880	100.65 378,297,337	100.57 377,974,122	0.875000 12/02/29	0.38%
24	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	361,571,130	105.94 383,052,071	104.16 376,626,952	2.625000 14/12/31	0.37%
25	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	374,854,000	100.29 375,948,574	100.27 375,892,346	0.625000 12/06/30	0.37%
26	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	373,468,670	100.49 375,336,013	100.48 375,291,197	0.750000 12/05/31	0.37%
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	358,875,400	104.70 375,764,076	104.54 375,182,698	5.000000 12/01/04	0.37%
28	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	379,915,900	99.58 378,335,450	98.42 373,943,622	4.250000 19/02/01	0.37%
29	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券	368,253,310	100.86 371,431,336	100.84 371,372,416	1.000000 12/04/30	0.37%
30	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券	371,105,460	103.99 385,919,990	99.51 369,305,599	4.375000 39/11/15	0.37%
			1 - 11455451				

(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。

# 口.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	98.17%
合計	98.17%

(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。

投資不動産物件 該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(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 2011年1月	買建	5,922,000	497,904,978	482,465,338	0.48%
		米ドル買/円売 2011年2月	買建	8,315,000	680,238,042	676,924,150	0.67%
		カナタ゛ト゛ル買/円売 2011 年1月	買建	407,791	33,898,531	33,210,459	0.03%
		カナタ゛ト゛ル買/円売 2011 年2月	買建	696,209	56,809,212	56,629,679	0.06%
		オーストラリアト゛ル買/円売 2011年1月	買建	458,925	37,850,730	38,113,692	0.04%
		オーストラリアト゛ル買/円売 2011年2月	買建	224,000	18,536,258	18,524,800	0.02%
		英ポンド買/円売 2011年1月	買建	425,000	55,498,134	53,741,249	0.05%
		英ポンド買/円売 2011年2月	買建	1,332,000	168,653,831	168,271,560	0.17%
		スイスフラン買/円売 2011年1 月	買建	17,388	1,461,313	1,501,464	0.00%
		スイスフラン買/円売 2011年2 月	買建	106,612	9,201,532	9,204,869	0.01%
		テ゛ンマーククローネ買/円売 2011年1月	買建	2,101,205	30,751,732	30,404,442	0.03%
		テ゛ンマーククローネ買/円売 2011年2月	買建	965,000	13,995,959	13,953,900	0.01%
		スウェーデ ンクローナ買/円 売 2011年1月	買建	1,740,499	20,923,247	20,833,771	0.02%
		スウェーテ゛ンクローナ買/円 売 2011年2月	買建	936,000	11,236,892	11,185,200	0.01%
		メキシコへ <sup>°</sup> ソ買/円売 2011 年2月	買建	2,631,000	17,355,647	17,285,670	0.02%
		ホ゜ーラント゛ス゛ロチ買/円 売 2011年1月	買建	1,163,264	31,525,443	31,501,189	0.03%
		ホ゜ーラント゛ス゛ロチ買/円 売 2011年2月	買建	574,000	15,595,744	15,515,220	0.02%
		ユーロ買/円売 2011年1月	買建	4,251,000	466,719,754	458,597,880	0.46%
		ユーロ買/円売 2011年2月	買建	5,031,000	544,592,177	542,341,800	0.54%

- (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】

# 【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
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
平成21年12月末日	296,208,973	-	0.7699	-
平成22年1月末日	288,114,553	-	0.7568	-
2月末日	287,688,396	-	0.7526	-
3月末日	316,018,035	-	0.8126	-
4月末日	322,705,251	-	0.8207	-
5月末日	294,676,384	-	0.7490	-
6月末日	295,923,818	-	0.7231	-
7月末日	302,466,329	-	0.7343	-
8月末日	291,841,692	-	0.7042	-
9月末日	308,832,508	-	0.7307	-
10月末日	304,617,318	-	0.7189	-
第11計算期間末 (平成22年11月30日)	317,352,187	317,352,187	0.7453	0.7453
12月末日	333,105,880	-	0.7681	-

# 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第11計算期間	0.0000

# 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第11計算期間	2.7



#### (参考情報)

2010年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

#### 基準価額・純資産の推移 2001年1月4日~2010年12月30日 13,000 8.0 基準価額 7,681円 12,000 分配金再投資基準価額(左軸) 7.0 基準価額(左軸) 3.3億円 純資産総額 11,000 6.0 資 基準価額の騰落率 10,000 5.0 焦 期間 ファンド 額 9,000 4.0 額 m 1カ月間 3.1% 億 8,000 3.0 3カ月間 5.1% 6カ月間 6.2% 2.0 7,000 1年間 -0.2% 3年間 -28.3% 6,000 1.0 5年間 -29.1% 5,000 0.0 設定来 -23.2%

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。 ※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

2006/12

2008/12

#### 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

		直近1年	間分配金	合計額:	0円	設定来	分配金合	計額:	0円			
決算期	第1期											
DC-94-701	00年11月	01年11月	02年12月	03年12月	04年11月	05年11月	06年11月	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	
分配金	0円											

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

2002/12

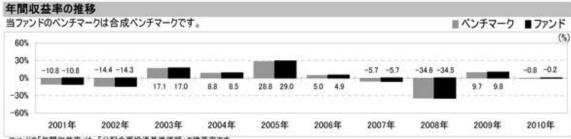
#### 主要な資産の状況

AND ALL MEDIA	4-H-100 WHI BAN WICH	make the second
※比準は、	爬真连移翻	こ対するものです。

2010/12

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ボートフォリオ	特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国·地域名	比率
国内株式·先物	1,299	60.1%	日本円	80.3%	直接利回り(%)	1.9	トヨタ自動車	日本	2.0%
国内债券	418	19.7%	米ドル	10.0%	最終利回り(%)	1.2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.6%
外国株式·先物	1,198	14.6%	ユーロ	4.3%	修正デュレーション	6.6	本田技研	日本	1.3%
外国債券	601	4.8%	英ポンド	2.0%	残存年数	7.8	キヤノン	日本	1.3%
外国リート	42	0.2%	カナダ・ドル	1.0%	债券格付別構成	比率	三井住友フィナンシャルG	日本	1.1%
			豪ドル	0.7%	AAA	75.3%	TOPIX先物 2303月	日本	1.0%
			スイス・フラン	0.6%	AA	15.3%	みずほフィナンシャルG	日本	0.9%
			スウェーデン・クローネ	0.3%	A	5.3%	三菱商事	日本	0.9%
			香港ドル	0.2%	BBB	0.3%	ソニー	日本	0.8%
コール・ローン、	その他	1.7%	その他	0.5%	BB以下·無格付	3.8%	武田薬品	日本	0.8%
合計	3,558	-	合計	100.0%	合計	100.0%	승화		11.6%

2001/01



<sup>・</sup>ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の機落率です。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

<sup>※</sup>上記の「基準価額の機落率」とは、 「分配金再投資基準価額」の練落率です。

<sup>※</sup>債券格付別構成の比率は、債券ボートフォリオに対するものです。無格付債券を3.8%保有しております。 ※債券格付別構成について、日系発行体はR&L, JCR, Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。 ※先物の建五がある場合は、資産別構成の比率合計機を表示していません。

<sup>-2010</sup>年は12月30日までの機落率を表しています。

<sup>・</sup>当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

# (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第11計算期間	81,429,409	35,405,267

#### 第2【管理及び運営】

#### 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。

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。

### 3 【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) 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】

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、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。

#### 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。

## 反対者の買取請求権

前 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 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 の3.または前 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。

#### 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。

公告

- 4. 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。

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。

#### 4 【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。

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、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行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、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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、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、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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。

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。

#### 換金請求権

EDINET提出書類 大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

#### 第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)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。以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

ただし、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)については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、第11期計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則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は、あずさ監査法人により監査を受け、第11期計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法 人となりました。

1【財務諸表】

<u>ダイワライフスタイル75</u>

# ダイワライフスタイル75 (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第10期 平成21年11月30日現在	第11期 平成22年11月30日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,238,900	2,456,033
親投資信託受益証券		274,688,866	316,417,410
流動資産合計		276,927,766	318,873,443
資産合計		276,927,766	318,873,443
負債の部			
流動負債			
未払解約金		113,559	71,227
未払受託者報酬		116,104	127,800
未払委託者報酬		1,190,502	1,310,338
その他未払費用		10,796	11,891
流動負債合計		1,430,961	1,521,256
負債合計		1,430,961	1,521,256
純資産の部			
元本等			
元本		379,779,092	425,803,234
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金(	)	104,282,287	108,451,047
(分配準備積立金)		33,432,585	30,575,444
元本等合計		275,496,805	317,352,187
純資産合計		275,496,805	317,352,187
負債純資産合計		276,927,766	318,873,443

# (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

		(1=113)
	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
営業収益		
受取利息	1,605	1,593
有価証券売買等損益	14,439,243	10,160,544
営業収益合計	14,440,848	10,162,137
営業費用		
受託者報酬	210,359	253,573
委託者報酬	2,156,953	2,600,080
その他費用	19,542	23,590
営業費用合計	2,386,854	2,877,243
営業利益	12,053,994	7,284,894
経常利益	12,053,994	7,284,894
当期純利益	12,053,994	7,284,894
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	161,843	1,089,835
期首剰余金又は期首欠損金()	100,040,858	104,282,287
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,379,100	9,605,011
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	9,605,011
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,512,680	19,968,830
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増 加額	23,512,680	19,968,830
分配金	<b>-</b> 1	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	104,282,287	108,451,047
•		

# (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

=	(主女は云川7)町にかる子塚に関する江山 <i>)</i>			
	区分	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22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	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。	同左	
2.		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10期	第11期		
		平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在		
1.	1 期首元本額	319,733,910円	379,779,092円		
	期中追加設定元本額	83,697,312円	81,429,409円		
	期中一部解約元本額	23,652,130円	35,405,267円		
2.	計算期間末日における受益権の 総数	379,779,092□	425,803,234□		
3.			貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額 は108,451,047円であります。		

# (損益及び剰余金計算書に関する注記)

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 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	(		
至 平成21年11月30日 至 平成22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 (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 ありますが、分配を行っており	E ()		1
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 (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 整金(77,190,967円)及び分配 準備積立金(33,431,219円)よ リ分配対象額は96,117,113円 (1万口当たり2,530.90円)でありますが、分配を行っており ありますが、分配を行っており		日 平成20年12月2日	目 半放21年12月1日
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、分配を行っておりありますが、分配を行っておりありますが、分配を行っており		至 平成21年11月30日	至 平成22年11月30日
	1 分配金の計算過程	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、繰りで損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(62,684,528円)及び分配整金(62,684,528円)及び分配対象額は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	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(1,018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、繰返を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(77,190,967円)及び分配準備積立金(30,574,426円)より分配対象額は107,766,411円(1万口当たり2,530.90円)でありますが、分配を行っており

# (追加情報)

第11期計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」 (企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計 基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

# 金融商品の状況に関する事項

	正版回印の小川に関する事点	
	区 分	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1.	金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」第2条 第4項に定める証券投資信託で あり、投資信託約款に規定する 「運用の基本方針」に従ってお ります。
2.	金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投証信託受益証券を通じて有価資金を通じてするります。 一次であります。 では、市場リスク(価格変動、急利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3.	金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する 組織的な体制によりリスク管理 を行っております。信託財産全 体としてのリスク管理を金融商 品、リスクの種類毎に行ってお ります。
4.	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

# 金融商品の時価等に関する事項

	区 分	第11期 平成22年11月30日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表計上 額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関 する注記に記載しております。

(2)コールローン等の金銭債権 及び金銭債務

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

## (有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

20. 具白的有侧征分				
	第10期 平成21年11月30日現在		第11期 平成22年11月30日現在	
種 類	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)	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	274,688,866	13,946,085	9,053,551	
合計	274,688,866	13,946,085	9,053,551	

# (デリバティブ取引に関する注記)

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)

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。

第11期計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期 平成22年11月30日現在

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

( 国建当事首との取引に関する注心 )	
第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22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10期 平成21年11月30日現在	第11期 平成22年11月30日現在
1口当たり純資産額	0.7254円	0.7453円
(1万口当たり純資産額)	(7,254円)	(7,453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
-----	-----	------	---------	----

大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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	416,798,965	192,269,362	
	日本債券インデックスマザーファンド	51,009,498	61,568,464	
	外国株式インデックスマザーファンド	53,975,786	47,066,885	
	外国債券インデックスマザーファンド	8,824,563	15,512,699	
親投資信託受益語	证券 合計	530,608,812	316,417,410	
合計		530,608,812	316,417,410	

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。

## (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

貝旧刈炽衣		亚代04年44日00日田左	亚世20年44日20日日去
		平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
\\ \tau \rightarrow \rightarr		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,698,124,245	1,818,834,278
株式	3	85,334,744,080	91,225,627,750
新株予約権証券		1,150,000	-
派生商品評価勘定		2,446,077	61,166,178
未収入金		-	443,587
未収配当金 未収配当金		427,340,176	504,038,275
——————————————————— 前払金		178,765,000	-
差入委託証拠金		49,590,000	-
流動資産合計		87,692,159,578	93,610,110,068
資産合計		87,692,159,578	93,610,110,068
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		105,037,520	2,494,511
前受金		-	91,911,000
未払金		43,680,000	-
未払解約金		23,100,000	387,775,000
流動負債合計		171,817,520	482,180,511
		171,817,520	482,180,511
純資産の部			
元本等			
元本	1	198,496,539,943	201,865,410,927
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	2	110,976,197,885	108,737,481,370
元本等合計		87,520,342,058	93,127,929,557
純資産合計		87,520,342,058	93,127,929,557
負債純資産合計		87,692,159,578	93,610,110,068

# 注記表

# (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

_		<u> </u>	
	区 分	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1.	有価証券の評価基準及び評価方 法	株式及び新株予約権証券	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。	同左
2.	デリバティブ取引の評価基準及 び評価方法	先物取引 	先物取引

			日叫此为田山首(以巴汉县后心
		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。	同左
3.	収益及び費用の計上基準		受取配当金 同左

#### (貸借対照表に関する注記)

(貸借対照表に関する注記)				
区 分	平成21年11月30日現在	平成22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	164,435,605,491円	198,496,539,943円		
同期中における追加設定元本額	44,844,778,480円	18,482,977,114円		
同期中における一部解約元本額	10,783,844,028円	15,114,106,130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	1,865,599,483円	1,827,977,064円		
トピックス・インデックスファン ド	12,114,450,876円	11,355,152,914円		
ダイワ・トピックス・インデック スファンドVA	39,228,078,906円	37,540,919,907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V A 2	1,122,437,137円	1,053,248,340円		
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	396,469,094円	408,819,017円		
ダイワ国内重視バランスファンド 5 0 V A (一般投資家私募)	6,785,644,364円	6,624,272,198円		
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	434,024,202円	406,311,668円		
ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A (一般投資家私募)	9,047,353,050円	8,944,337,173円		
DCダイワ日本株式インデックス	50,336,517,999円	55,387,545,369円		
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	1,815,398,970円	1,870,711,058円		
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	109,223,884円	217,055,087円		
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	80,039,516円	181,688,938円		
年金ダイワ日本株式インデックス	820,031,920円	1,265,555,828円		
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	13,399,559円	16,553,954円		
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	6,247,286円	14,675,588円		
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,141,095円	919,041円		
ダイワ世界分散バランスファンド 15VA	501,523,853円	500,282,197円		
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	3,555,428,274円	3,473,643,223円		
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A(国内株式型)	1,997,968,426円	2,075,331,030円		
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	113,355,088円	115,778,941円		

			有価証券届出書(内国投資信託
	ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A	765,792,706円	
	ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A (国内株式型)	363,504,608円	373,445,348円
	ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	4,311,225,285円	4,062,250,479円
	ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	603,930,494円	596,105,462円
	ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	37,306,738,546円	35,877,519,420円
	ゲイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	2,590,086,746円	2,410,471,798円
	ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 7 5 V A	6,235,966,966円	5,582,048,617円
	ダイワ・バランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家専用)	2,752,784,244円	3,033,655,709円
	ダイワ国内バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	56,722円	533,316,921円
	ダイワ国内バランスファンド30 VA(適格機関投資家専用)	68,052円	460,974,143円
	ダイワライフスタイル 2 5	148,914,351円	177,432,821円
	ダイワライフスタイル50	417,210,659円	
	ダイワライフスタイル75	364,827,526円	1 1
	D C ・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)	12,291,100,056円	
	計	198,496,539,943円	201,865,410,927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	198,496,539,943□	201,865,410,927□
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108,737,481,370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。	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	株式 434,700,000円

# (金融商品に関する注記)

# (追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」第2条 第4項に定める証券投資信託で あり、投資信託約款に規定する 「運用の基本方針」に従って おります。

2. 金融商品の内容及びリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。

これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、 金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項につい ての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることも、ブロスト

デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

五**犬**00年44日00日日士

### 金融商品の時価等に関する事項

	区 分	平成22年11月30日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に 関する注記に記載しておりま す。
		(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注 記に記載しております。

(3) コールローン等の金銭債権 及び金銭債務 これらは短期間で決済される ため、時価は帳簿価額にほぼ等 しいことから、当該帳簿価額を 時価としております。

# (有価証券に関する注記)

# 売買目的有価証券

	平成21年11	1月30日現在 平成22年11月30日現在			
種 類	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)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)		
株式	85,334,744,080	10,733,060,054	1,314,435,928		
新株予約権証券	1,150,000	1,150,000	-		
合計	85,335,894,080	10,731,910,054	1,314,435,928		

(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21年9月25日から平成21年11月30日まで、及び平成22年9月22日から平成22年11月30日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成20年12月2日から平成21年11月30日まで)

取引の状況に関する事項

	区分	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。
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、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。
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。
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。

#### 株式関連

ハナハギン						
		平成21年11月30日 現在				
種 類	契約額等	契約額等		評価損益		
	(円)	うち	(円)	(円)		
		1 年超				
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	2,881,985,000	-	2,780,400,000	101,585,000		
合計	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。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 (平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

#### 株式関連

TATAL TOTAL						
	平成22年11月30日 現在					
種 類	契約額等		時価	評価損益		
	(円)	うち	(円)	(円)		
		1 年超				
市場取引						
株価指数先物取引						
買建	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000		
合計	1,768,509,000	-	1,827,540,000	59,031,000		

### (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21年11月30日現在	平成22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	0.4409円	0.4613円
(1万口当たり純資産額)	(4,409円)	(4,613円)

# 附属明細表

# 第1 有価証券明細表

# (1) 株式

(1) 株式 銘 柄	株式数		額(円)	備考
		単 価	金 額	
極洋	42,000	173	7,266,000	
日本水産	105,900	247	26,157,300	
マルハニチロホールディングス	182,000	133	24,206,000	
サカタのタネ	12,600	1,055	13,293,000	
ホクト	9,200	1,876	17,259,200	
ショーボンドHD	8,300	1,672	13,877,600	
ミライト・ホールディングス	21,600	575	12,420,000	
日鉄鉱業	26,000	308	8,008,000	1
三井松島	59,000	148	8,732,000	
国際石油開発帝石	900	430,500	387,450,000	
日本海洋掘削	2,500	2,475	6,187,500	
関東天然瓦斯	12,000	422	5,064,000	
石油資源開発	14,100	2,926	41,256,600	
東急建設	33,970	244	8,288,680	
コムシスホールディングス	44,500	801	35,644,500	
ミサワホーム	12,700	398	5,054,600	
高松コンストラクション G P	7,500	1,090	8,175,000	
東建コーポレーション	3,410	2,630	8,968,300	
大成建設	423,000	189	79,947,000	
大 林 組	269,000	348	93,612,000	
清水建設	254,000	336	85,344,000	
長谷エコーポレーション	563,500	75	42,262,500	
鹿島建設	394,000	209	82,346,000	
不動テトラ	84,400	52	4,388,800	
鉄建建設	68,000	76	5,168,000	
安藤建設	44,000	103	4,532,000	
太平工業	19,000	365	6,935,000	
西松建設	130,000	104	13,520,000	
前田建設	58,000	251	14,558,000	
奥村組	86,000	303	26,058,000	
東鉄工業	13,000	528	6,864,000	
戸田建設	97,000	294	28,518,000	
熊谷組	86,000	64	5,504,000	
北野建設	28,000	206	5,768,000	
三井ホーム	13,000	375	4,875,000	
矢作建設	13,000	459	5,967,000	
大東建託	34,600	5,180	179,228,000	-
NIPPO	21,000	545	11,445,000	
前田道路	27,000	616	16,632,000	
日本道路	32,000	189	6,048,000	
東亜建設	88,000	94	8,272,000	
東洋建設	141,000	44	6,204,000	
五洋建設	102,000	129	13,158,000	
住友林業	61,900	655	40,544,500	
日本基礎技術	22,900	174	3,984,600	
巴コーポレーション	16,500	263	4,339,500	
パナホーム	31,000	488	15,128,000	
大和ハウス	221,000	945	208,845,000	
ライト工業	26,100	183	4,776,300	
ノコー上未	20,100	103	4,770,300	

1			有価証券届出書(内国投資信
積水ハウス	267,000	795	212,265,000
ユアテック	17,000	287	4,879,000
四電工	13,000	320	4,160,000
中電工	14,100	897	12,647,700
関 電 工	41,000	506	20,746,000
きんでん	59,000	720	42,480,000
東京エネシス	11,000	491	5,401,000
トーエネック	15,000	423	6,345,000
日本電設工業	17,000	778	13,226,000
協和エクシオ	32,300	745	24,063,500
新日本空調	10,000	474	4,740,000
日本工営	34,000	229	7,786,000
日本電話施設	20,000	254	5,080,000
九電工	18,000	491	8,838,000
三機工業	22,000	520	11,440,000
日揮	89,000	1,621	144,269,000
中外炉工業	30,000	280	8,400,000
太平電業	13,000	632	8,216,000
高砂熱学	26,400	633	16,711,200
NECネッツエスアイ	8,100	987	7,994,700
朝日工業社	15,000	335	5,025,000
大 氣 社	14,000	1,354	18,956,000
ダイダン	15,000	384	5,760,000
日比谷総合設	12,900	706	9,107,400
東芝プラントシステム	14,000	1,042	14,588,000
日本製粉	50,000	384	19,200,000
日清製粉G本社	80,500	1,014	81,627,000
昭和産業	39,000	221	8,619,000
鳥越製粉	9,800	732	7,173,600
協同飼料	46,000	98	4,508,000
中部飼料	9,600	507	4,867,200
日本配合飼料	40,000	98	3,920,000
日本甜菜糖	53,000	200	10,600,000
三井製糖	37,000	306	11,322,000
日本M&Aセンター	22	307,500	6,765,000
アコーディア・ゴルフ	238	74,000	17,612,000
パソナグループ	68	60,100	4,086,800
テンプホールディングス	12,300	725	8,917,500
森永製菓	88,000	187	16,456,000
中 村 屋	23,000	405	9,315,000
江崎グリコ	31,000	958	29,698,000
名糖産業	5,000	1,089	5,445,000
不 二 家	57,000	157	8,949,000
山崎製パン	64,000	979	62,656,000
モロゾフ	24,000	268	6,432,000
森永乳業	75,000	325	24,375,000
ヤクルト	47,100	2,375	111,862,500
明治ホールディングス	26,200	3,640	95,368,000
雪印メグミルク	17,200	1,421	24,441,200
プリマハム	59,000	92	5,428,000
日本八ム	62,000	1,001	62,062,000
伊藤八ム	50,000	270	13,500,000
丸大食品	41,000	247	10,127,000
米 久	9,500	620	5,890,000
S Foods	7,000	660	4,620,000

スタジオアリス				有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
マステナ   94	スタジオアリス	5,300	766	4,059	,800
NECフィールディング 7,700 957 7,368,900 新日鉄ソリューションズ 7,000 1,632 11,424,000 46合警備保障 30,800 881 27,134,4000 日本駐車場開発 1,276 3,735 4,765,860 カカクコム 58 409,000 23,722,000 エムスリー 34 422,000 14,348,000 ディー・エヌ・エー 32,400 2,444 79,185,600 信略型 DYHLDGS 11,590 4,200 48,678,000 でるなび 50 119,600 5,880,000 アグー・エア・イングス 179 53,900 9,648,100 サッボロホールディングス 128,000 339 43,3392,000 アサヒビール 165,400 1,630 269,602,000 キリンHD 362,000 1,166 422,092,000 まホールディングス 77,000 490 37,730,000 オエノンホールディングス 31,000 163 5,705,000 オエノンホールディングス 31,000 163 5,705,000 カントンキン 35,000 163 5,705,000 カントンキン 35,000 163 5,705,000 カントンキントラルジャバン 10,600 1,031 4,431 11,458,600 イント・ドリンコ 3,800 2,840 10,732,000 伊藤 園 22,500 1,349 30,352,500 日清オイリオグルーブ 40,000 369 14,760,000 イント・ドリンコ 3,000 2,840 10,732,000 日オインドル・パンケーク 40,000 369 14,760,000 インインドル・パンケーク 40,000 369 14,760,000 インイント・ドリンコ 3,000 1,331 1,336 24,196,800 リンエー 2,800 1,337 26,100,000 インケーク 40,000 3,700 3,25,500 日清オイリオグルーブ 40,000 369 14,760,000 インケーク 40,000 37,730 3,252,500 日ガラ手楽品 5,700 1,577 8,888,900 エービーシ・マート 9,200 2,837 26,100,400 インケーク 5,800 1,665 9,57,700 インケーク 5,800 1,665 9,57,700 イント 6,670 1,653 7,055,100 イント 6,670 1,653 7,055,100 イント 6,670 1,653 9,57,700 1,577 7,000 1,577 7,000 3,592,000 イント 6,670 1,655 7,57,700 1,653 7,055,100 1,577 1,600 1,653 7,055,100 1,577 2,400 1,530 4,530 3,555,000 1,530 4,530 3,555,000 1,530 4,530 3,555,000 1,530 4,530 3,555,000 1,577 2,400 4,500	シミック	190	22,850	4,341	,500
#日齢ソリューションズ 7,000 1,632 11,424,000 会合管備保障 30,800 881 27,134,800 7カクコム 58 409,000 23,722,000 1五ムスリー 34 422,000 14,348,000 1882 PYHLDGS 11,590 4,200 48,678,000 7 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5 5	システナ	94	78,300	7,360	, 200
综合警備保障 30,800 881 27,134,800 日本駐車場開発 1,276 3,735 4,765,860 カカクコム 58 409,000 23,722,000 エムスリー 34 422,000 14,348,000 子・イー・エヌ・エー 32,400 2,444 79,185,600 169 19 H L D G S 11,590 4,200 49,678,000 (2 & & 2 & 4 & 4 & 4 & 4 & 4 & 4 & 4 & 4	NECフィールディング	7,700	957	7,368	,900
日本駐車場開発 1,276 3,735 4,765,866 カカクコム 58 409,000 23,722,000 14,348,000 アイト・エヌ・エー 32,400 2,444 79,185,600 情報堂 D Y H L D G S 111,590 4,200 48,678,000 79,000 79,000 79,000 70,000 7	新日鉄ソリューションズ	7,000	1,632	11,424	,000
カカクコム   58   409,000   23,722,000   エムスリー   34   422,000   14,348,000   世報堂DYHLDGS   11,590   4,200   48,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,678,000   49,077,730,000   49,077,730,000   47,779,000   49,077,730,000   47,779,000   49,077,730,000   47,779,000   49,077,730,000   47,779,000   49,077,730,000   47,779,000   49,077,730,000   47,779,000   48,077,730,000   48	綜合警備保障	30,800	881	27,134	,800
エムスリー ディー・エヌ・エー 32,400 2,444 79,185,600	日本駐車場開発	1,276	3,735	4,765	, 860
ディー・エヌ・エー 32,400 2,444 79,185,600 情報堂 D Y H L D G S 11,590 4,200 48,678,000 5,980,000 P G Mホールディングス 179 53,900 9,648,100 サッポロホールディングス 179 53,900 339 43,392,000 190,700 1,166 422,092,000 まホールディングス 77,000 490 37,730,000 オエノンホールディングス 77,000 490 37,730,000 対エノンホールディングス 77,000 490 37,730,000 教エノンホールディングス 77,000 194 6,0114,000 表	カカクコム	58	409,000	23,722	,000
博報堂 D Y H L D G S	エムスリー	34	422,000	14,348	,000
マンス (できなび できるなび できる (できるなび) できるなび できなび できるなび できなび できなび できなび できなび できなび できなび できなび でき	ディー・エヌ・エー	32,400	2,444	79,185	,600
PGMホールディングス 128,000 339 43,382,000 キリンHD 365,400 1,630 269,602,000 キリンHD 365,400 1,630 269,602,000 キリンHD 362,000 1,166 422,092,000 宝ホールディングス 77,000 490 37,730,000 オエノンホールディングス 31,000 194 6,014,000 メルシャン 35,000 163 5,705,000 管命 酒 9,000 779 7,011,000 三国コカ・コ・ラ 11,700 730 8,541,000 カコーラウエスト 27,300 1,394 38,056,200 カカコーラセントラルジャパン 10,600 1,081 11,458,600 ダイド・ドリンコ 3,800 2,840 10,792,000 伊藤 園 22,500 1,349 30,352,500 1后清オイリオグルーブ 40,000 369 14,760,000 不三製油 21,300 1,136 24,196,800 リ・オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 ローソン 26,400 3,710 97,944,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,657 8,988,900 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 グイオ 128 88,800 11,366,400 アスクル 5,800 16,365 24,512,250 伊藤忠育品 5,700 1,657 8,988,900 グイオ 128 88,800 11,366,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 グイオ 128 88,800 11,366,400 アスクル 5,800 657 18,790,200 (551-ボレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 (551-ボレーション 4,300 1,339 5,757,700 オーンドゥ 52 71,000 3,692,000 (551-ボレーション 4,300 1,339 5,757,700 オーンドゥ 52 71,000 3,692,000 (551-ボレーション 13,500 433 5,845,500 (577,700 カーブ・アルフレッサホールディングス 7,240 1,186 8,586,640 キューエービー 44,200 1,019 45,039,800 (577,3000 901 65,773,000 901 65,7	博報堂DYHLDGS	11,590	4,200	48,678	,000
サッポロホールディングス         128,000         339         43,392,000           アサヒビール         165,400         1,630         269,602,000           オリンドD         362,000         1,166         422,092,000           宝ホールディングス         77,000         490         37,730,000           オエノンホールディングス         31,000         194         6,014,000           メルシャン         35,000         163         5,705,000           養 命 酒         9,000         779         7,011,000           三国コカ・コ・ラ         11,700         730         8,541,000           コカコラウエスト         27,300         1,394         38,056,200           グイドードリンコ         3,800         2,840         10,792,000           伊藤 園         22,500         1,349         30,352,500           日清オイリオグループ         40,000         369         14,760,000           不二製油         21,300         1,136         24,196,800           メイルミルズ         37,000         225         8,325,000           サンエー         2,800         3,030         8,484,000           カウチ薬品         5,700         1,577         8,988,900           サンエー         2,800         3,030         8,484,000           カクチ薬品         5,7	ぐるなび	50	119,600	5,980	,000
アサヒビール       165,400       1,630       269,602,000         キリンHD       362,000       1,166       422,092,000         宝ホールディングス       77,000       490       37,730,000         オエノンホールディングス       31,000       194       6,014,000         メルシャン       35,000       163       5,705,000         国国コカ・コ・ラ       11,700       730       8,541,000         コカ・コーラウエスト       27,300       1,394       38,056,200         コカコーラセントラルジャパン       10,600       1,081       11,458,600         ダイド・ドリンコ       3,800       2,840       10,792,000         伊藤 園       22,500       1,349       30,352,500         キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         オーコトン       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カクチ薬配品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオオ       128	P G Mホールディングス	179	53,900	9,648	,100
アサヒビール       165,400       1,630       269,602,000         キリンHD       362,000       1,166       422,092,000         宝ホールディングス       77,000       490       37,730,000         オエノンホールディングス       31,000       194       6,014,000         メルシャン       35,000       163       5,705,000         国国コカ・コ・ラ       11,700       730       8,541,000         コカ・コーラウエスト       27,300       1,394       38,056,200         コカコーラセントラルジャパン       10,600       1,081       11,458,600         ダイド・ドリンコ       3,800       2,840       10,792,000         伊藤 園       22,500       1,349       30,352,500         キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         オーコトン       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カクチ薬配品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオオ       128	サッポロホールディングス	128,000	339	43,392	,000
宝ホールディングス 77,000 490 37,730,000 オエノンホールディングス 31,000 194 6,014,000 大アルシャン 35,000 163 5,705,000 養 命 酒 9,000 779 7,011,000 コカ・コーラウエスト 27,300 1,394 38,056,200 コカ・コーラウエスト 27,300 1,394 38,056,200 コカ・コーラウエスト 27,300 2,840 10,792,000 伊 藤 園 22,500 1,349 30,352,500 井ーコーヒー 8,700 1,431 12,449,700 日清オリオグループ 40,000 369 14,760,000 アニ製油 21,300 1,136 24,196,800 リ・オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 コープン 26,400 3,710 97,944,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスグル 5,800 1,665 9,657,000 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 ズラーボレーション 4,300 1,339 5,757,700 オャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 エディオン 28,600 657 18,790,200 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 パルス 42 85,500 3,591,000 カカやき亭 16 233,900 3,742,400 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 パニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 小ラス会品 98,261,000 八コーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 小ラ会品 9,200 八コーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 八コーズ 42,200 1,019 45,039,800 八カス食品		165,400	1,630	269,602	,000
オエノンホールディングス 31,000 194 6,014,000 メルシャン 35,000 163 5,705,000	キリンHD	362,000	1,166	422,092	,000
オエノンホールディングス 31,000 194 6,014,000 メルシャン 35,000 163 5,705,000	宝ホールディングス	77,000	490	37,730	,000
メルシャン       35,000       163       5,705,000         養命酒       9,000       779       7,011,000         三国コカ・コ・ラ       11,700       730       8,541,000         コカ・コーラウエスト       27,300       1,394       38,056,200         コカコーラセントラルジャパン       10,600       1,081       11,458,600         ダイドードリンコ       3,800       2,840       10,792,000         伊藤園       22,500       1,349       30,352,500         キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         不二製油       21,300       1,136       24,196,800         J・オイルミルズ       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カフチ薬品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ベイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤徳会品       2,200       2,			194		
養命 酒       9,000       779       7,011,000         三国コカ・コ・ラ       11,700       730       8,541,000         コカ・コーラウエスト       27,300       1,394       38,056,200         コカコーラセントラルジャパン       10,600       1,081       11,458,600         ダイドードリンコ       3,800       2,840       10,792,000         伊藤園       22,500       1,349       30,352,500      キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         不二製油       21,300       1,136       24,196,800         J・オイルミルズ       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カフチ薬品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         アスクル       6,670       3,675       24,512,250         伊藤志白品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       <			163		
三国コカ・コ・ラ					
コカ・コーラウエスト 27,300 1,394 38,056,200 コカコーラセントラルジャパン 10,600 1,081 11,458,600 ダイドードリンコ 3,800 2,840 10,792,000 キーコーヒー 8,700 1,349 30,352,500 キーコーヒー 8,700 1,431 12,449,700 日清オイリオグループ 40,000 369 14,760,000 不二製油 21,300 1,136 24,196,800 1ーメイルミルズ 37,000 225 8,325,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 オャンドゥ 52 71,000 3,692,000 パル 2,400 2,966 7,118,400 エーディオン 28,600 657 18,790,200 サラコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 オーマデック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 スカヤき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 所よ 24,000 ステルフレッサホールディングス 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 トニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 所よ 24,000 系素 240,000 826 198,240,000 キュービー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品	三国コカ・コ - ラ		730		
コカコーラセントラルジャパン 10,600 1,081 11,458,600 ダイドードリンコ 3,800 2,840 10,792,000 伊藤 園 22,500 1,349 30,352,500 日ーレー 8,700 1,431 12,449,700 日清オイリオグループ 40,000 369 14,760,000 不二製油 21,300 1,136 24,196,800 月・オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 ローソン 26,400 3,710 97,944,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 がオ 128 88,800 11,366,400 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 よらーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 ルフルーグェーグ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ・カーブ			1,394		
ダイドードリンコ       3,800       2,840       10,792,000         伊藤園       22,500       1,349       30,352,500         キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         不二製油       21,300       1,136       24,196,800         J・オイルミルズ       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カワチ薬品       5,700       1,577       8,988,900         エーピーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ガオ       128       88,800       11,366,400         ボイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エディオン       28,600       657       18,790,200         ガルラー       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       42       85,500					
伊藤 園 22,500 1,349 30,352,500 キーコーヒー 8,700 1,431 12,449,700 日清オイリオグループ 40,000 369 14,760,000 不二製油 21,300 1,136 24,196,800 J・オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 がオ 128 88,800 11,366,400 ま2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 がルフチューポレーション 13,500 433 5,845,500 カルラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 カルラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 カルラコーポレーション 73,000 901 65,773,000 ホーコーマン 73,000 901 65,773,000 ホーコーマン 73,000 901 65,773,000 ホーニビー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
キーコーヒー       8,700       1,431       12,449,700         日清オイリオグループ       40,000       369       14,760,000         不二製油       21,300       1,136       24,196,800         J・オイルミルズ       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         エーピーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ボイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         ボルーション       4,300       1,053       7,055,100         ボル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーボレーション       13,500       433       5,845,500         ボルス       42       85,500 <td< td=""><td></td><td></td><td>·</td><td></td><td></td></td<>			·		
日清オイリオグループ 40,000 369 14,760,000 不二製油 21,300 1,136 24,196,800 J・オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 ローソン 26,400 3,710 97,944,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エーピーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 ゲオ 128 88,800 11,366,400 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーボレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 パルス 42 85,500 3,591,000 カみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 パニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キャコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400	17 1331				
不二製油 21,300 1,136 24,196,800 J - オイルミルズ 37,000 225 8,325,000 ローソン 26,400 3,710 97,944,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワ手薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 ゲオ 128 88,800 11,366,400 がオイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーボレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーボレーション 13,500 433 5,845,500 パルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 カーマルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キュービー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400		1			
J・オイルミルズ       37,000       225       8,325,000         ローソン       26,400       3,710       97,944,000         サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カワ手薬品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ポイント       6,670       3,675       24,512,250          2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       70,788,000       901       65,773,000					
ローソン 26,400 3,710 97,944,000 サンエー 2,800 3,030 8,484,000 カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キュービー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
サンエー       2,800       3,030       8,484,000         カワチ薬品       5,700       1,577       8,988,900         エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ポイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000					
カワチ薬品 5,700 1,577 8,988,900 エービーシー・マート 9,200 2,837 26,100,400 アスクル 5,800 1,665 9,657,000 がオ 128 88,800 11,366,400 ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 アルフレッサホールディングス 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 トコーピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
エービーシー・マート       9,200       2,837       26,100,400         アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ポイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       20,400       3,470       70,788,000         ハニーズ       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000         キューピー       44,200       1,019       45,039,800<					
アスクル       5,800       1,665       9,657,000         ゲオ       128       88,800       11,366,400         ポイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       20,400       3,470       70,788,000         ハニーズ       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000         キューピー       44,200       1,019       45,039,800         ハウス食品       32,300       1,318       42,571,400					
ゲオ       128       88,800       11,366,400         ポイント       6,670       3,675       24,512,250         伊藤忠食品       2,200       2,640       5,808,000         くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         パルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       20,400       3,470       70,788,000         ハニーズ       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000         キューピー       44,200       1,019       45,039,800         ハウス食品       32,300       1,318       42,571,400					
ポイント 6,670 3,675 24,512,250 伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 パニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
伊藤忠食品 2,200 2,640 5,808,000 くらコーポレーション 4,300 1,339 5,757,700 キャンドゥ 52 71,000 3,692,000 エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 パルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400		+			
くらコーポレーション       4,300       1,339       5,757,700         キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       20,400       3,470       70,788,000         ハニーズ       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000         キューピー       44,200       1,019       45,039,800         ハウス食品       32,300       1,318       42,571,400					
キャンドゥ       52       71,000       3,692,000         エレマテック       6,700       1,053       7,055,100         パル       2,400       2,966       7,118,400         エディオン       28,600       657       18,790,200         サーラコーポレーション       13,500       433       5,845,500         バルス       42       85,500       3,591,000         あみやき亭       16       233,900       3,742,400         双日       530,500       162       85,941,000         アルフレッサホールディングス       20,400       3,470       70,788,000         ハニーズ       7,240       1,186       8,586,640         キッコーマン       73,000       901       65,773,000         味の素       240,000       826       198,240,000         キューピー       44,200       1,019       45,039,800         ハウス食品       32,300       1,318       42,571,400					
エレマテック 6,700 1,053 7,055,100 パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
パル 2,400 2,966 7,118,400 エディオン 28,600 657 18,790,200 サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 トユーピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400			,		
エディオン28,60065718,790,200サーラコーポレーション13,5004335,845,500バルス4285,5003,591,000あみやき亭16233,9003,742,400双日530,50016285,941,000アルフレッサホールディングス20,4003,47070,788,000ハニーズ7,2401,1868,586,640キッコーマン73,00090165,773,000味の素240,000826198,240,000キューピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400					
サーラコーポレーション 13,500 433 5,845,500 バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400			•		
バルス 42 85,500 3,591,000 あみやき亭 16 233,900 3,742,400 双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
あみやき亨16233,9003,742,400双日530,50016285,941,000アルフレッサホールディングス20,4003,47070,788,000ハニーズ7,2401,1868,586,640キッコーマン73,00090165,773,000味の素240,000826198,240,000キューピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400					
双日 530,500 162 85,941,000 アルフレッサホールディングス 20,400 3,470 70,788,000 ハニーズ 7,240 1,186 8,586,640 キッコーマン 73,000 901 65,773,000 味 の 素 240,000 826 198,240,000 キューピー 44,200 1,019 45,039,800 ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
アルフレッサホールディングス20,4003,47070,788,000ハニーズ7,2401,1868,586,640キッコーマン73,00090165,773,000味の素240,000826198,240,000キューピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400					
ハニーズ7,2401,1868,586,640キッコーマン73,00090165,773,000味 の 素240,000826198,240,000キューピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400		1			
キッコーマン73,00090165,773,000味の素240,000826198,240,000キューピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400					
味 の 素240,000826198,240,000キユーピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400		· ·	•		
キユーピー44,2001,01945,039,800ハウス食品32,3001,31842,571,400					
ハウス食品 32,300 1,318 42,571,400					
			•		
カ ゴ メ	カゴメ				
<u> </u>					
大学 大学 10		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
ニチレイ	101,000	357	36,057,	000
横浜冷凍	18,800	531	9,982,	800
東洋水産	38,000	1,766	67,108,	000
日清食品 H D	31,400	2,886	90,620,	400
永 谷 園	9,000	831	7,479,	000
フジッコ	10,000	977	9,770,	000
ロックフィールド	5,300	1,223	6,481,	900
日本たばこ産業	1,839	285,400	524,850,	600
わらべや日洋	5,800	962	5,579,	600
片倉工業	11,000	764	8,404,	000
グ ン ゼ	63,000	294	18,522,	000
昭 栄	15,600	645	10,062,	000
アルペン	5,900	1,393	8,218,	700
ビックカメラ	181	33,600	6,081,	600
D C Mホールディングス	39,500	439	17,340,	500
あい ホールディングス	21,600	299	6,458,	400
J. フロント リテイリング	186,000	466	86,676,	000
ドトール・日レスHD	13,800	1,065	14,697,	000
マツモトキヨシHLDGS	14,800	1,688	24,982,	
ココカラファイン	7,800	1,651	12,877,	
三越伊勢丹HD	155,800	959	149,412,	
東洋紡績	310,000	141	43,710,	
ユニチカ	214,000	71	15,194,	
富士紡ホールディングス	48,000	128	6,144,	
日清紡ホールディングス	54,000	862	46,548,	
<b>倉敷紡績</b>	91,000	144	13,104,	
ダイワボウHD	77,000	231	17,787,	
シキボウ	64,000	118	7,552,	
日東紡績	73,000	202	14,746,	
トヨタ紡織	27,900	1,466	40,901,	
クリエイトSDH	3,000	1,701	5,103,	
バイタルKSKHD	15,700	586	9,200,	
UKCホールディングス	5,300	880	4,664,	
日本毛織	31,000	636	19,716,	
ダイドーリミテツド	14,600	680	9,928,	
野村不動産HLDGS	33,100	1,227	40,613,	
ヒューリック	22,700	622	14,119,	
帝国繊維	13,000	507	6,591,	
ブックオフコーポレーション	5,800	671	3,891,	
日本コークス工業	71,500	145	10,367,	
JFE商事HLDGS	54,000	341	18,414,	
あさひ	3,700	1,075	3,977,	
サークルドサンクス	17,200	1,161	19,969,	
日本調剤	1,170	2,875	3,363,	
コスモス薬品	3,600	2,628	9,460,	
シップヘルスケア H D	10,800	961	10,378,	
セプン&アイ・H L D G S	326,000	2,045	666,670,	
ツルハホールディングス	5,800	3,625	21,025,	
サンマルクホールディングス	2,600	3,025	8,047,	
トリドール	32	112,800	3,609,	
帝 人	321,000	338	108,498,	
東レ	643,000	467	300,281,	
<del>** レ</del> ク ラ レ	122,700	1,155	141,718,	
旭 化 成	481,000	498	239,538,	
サカイ オーベックス	44,000	124	5,456,	UUU

稲葉製作所6,1007154,361,5三協・立山HLDGS103,0009810,094,0トーカロ4,8001,4076,753,6SUMCO51,3001,32668,023,8住江織物26,0001533,978,0日本バイリ・ン12,0004004,800,0芦森工業34,0001184,012,0アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5サンエー・インターナショナル5,7009605,472,0	00 00 00 00 00 00 00 00 00 00
トーカロ4,8001,4076,753,6S U M C O51,3001,32668,023,8住江織物26,0001533,978,0日本バイリ・ン12,0004004,800,0芦森工業34,0001184,012,0アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00 00 00 00 00 00
SUMCO51,3001,32668,023,8住江織物26,0001533,978,0日本バイリ・ン12,0004004,800,0芦森工業34,0001184,012,0アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00 00 00 00 00
住江織物 26,000 153 3,978,00 日本バイリ・ン 12,000 400 4,800,00 芦森工業 34,000 118 4,012,00 アツギ 94,000 104 9,776,00 セーレン 22,600 555 12,543,00 小松精練 28,000 330 9,240,00 ワコールホールディングス 52,000 1,133 58,916,00 ホギメディカル 4,500 3,705 16,672,5	00 00 00 00 00 00 00 00
日本バイリ・ン12,0004004,800,0芦森工業34,0001184,012,0アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00 00 00 00
芦森工業34,0001184,012,0アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00 00 00
アツギ94,0001049,776,0セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00 00
セーレン22,60055512,543,0小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00 00
小松精練28,0003309,240,0ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00 00 00
ワコールホールディングス52,0001,13358,916,0ホギメディカル4,5003,70516,672,5	00
ホギメディカル 4,500 3,705 16,672,5	00
サンエー・インターナショナル     5,700     960	വ
レナウン 23,400 215 5,031,0	00
I Tホールディングス     26,500     987     26,155,5	00
グリー 12,900 1,020 13,158,0	00
コーエーテクモHD 16,800 533 8,954,4	00
三菱総合研究所 3,600 1,870 6,732,0	00
特種東海製紙 57,000 165 9,405,0	00
ドワンゴ 44 157,200 6,916,8	00
マクロミル 46 155,500 7,153,0	00
ティーガイア     64     127,300     8,147,2	00
GMOペイメントゲートウェイ 23 167,500 3,852,5	00
ザッパラス 52 121,700 6,328,4	00
インターネットイニシアティブ 50 192,800 9,640,0	00
ソネットエンタテインメント     46     233,500     10,741,0	00
SRAホールディングス 6,100 801 4,886,1	00
JBISホールディングス 11,400 294 3,351,6	00
王子製紙 364,000 382 139,048,0	00
三菱製紙 137,000 92 12,604,0	00
北越紀州製紙 54,500 443 24,143,5	00
中越パルプ     40,000     138     5,520,0	00
大王製紙 36,000 522 18,792,0	00
日本製紙G本社 39,900 1,988 79,321,2	00
レンゴー 65,000 524 34,060,0	00
トーモク 30,000 210 6,300,0	00
ザ・パック 6,200 1,470 9,114,0	00
昭和電工 552,000 171 94,392,0	00
住友化学 567,000 359 203,553,0	00
住友精化 17,000 334 5,678,0	00
日産化学 60,300 1,004 60,541,2	00
クレハ 52,000 472 24,544,0	00
テイカ 16,000 270 4,320,0	00
石原産業 146,000 67 9,782,0	00
日本曹達 51,000 334 17,034,0	00
東ソー 206,000 235 48,410,0	00
トクヤマ 129,000 414 53,406,0	00
セントラル硝子 81,000 353 28,593,0	00
東亞合成 83,000 361 29,963,0	00
ダイソー 34,000 231 7,854,0	00
関東電化 19,000 608 11,552,0	00
電気化学 174,000 372 64,728,0	
イビデン 48,400 2,300 111,320,0	00
信越化学 137,900 4,090 564,011,0	00
日本カ・バイド 23,000 227 5,221,0	00

			有価証券届出書(内	国投資信託
堺 化 学	26,000	348		
エア・ウォーター	66,000	991	65,406,000	
大陽日酸	108,000	657	70,956,000	
日本化学工業	35,000	186	6,510,000	
日本パ - カライジング	20,000	1,098	21,960,000	)
高圧ガス	12,000	455	5,460,000	
四国化成	12,000	451	5,412,000	)
戸田工業	12,000	706	8,472,000	
ステラ ケミファ	3,800	3,350	12,730,000	
保土谷化学	21,000	297	6,237,000	)
日本触媒	67,000	789	52,863,000	)
大日精化	29,000	367	10,643,000	)
カネカ	101,000	499	50,399,000	
協和発酵キリン	99,000	842	83,358,000	
三菱瓦斯化学	129,000	513	66,177,000	
三井化学	377,000	256	96,512,000	
J S R	69,100	1,421	98,191,100	
東京応化工業	15,200	1,548	23,529,600	
三菱ケミカルHLDGS	478,500	481	230,158,500	
日本合成化学	20,000	486	9,720,000	
ダイセル化学	107,000	570		
住友べ - クライト	77,000	434		
積水化学	171,000	575		
日本ゼオン	78,000	674		
アイカ工業	23,800	935		
宇部興産	350,000	213		
積水樹脂	13,000	785		
タキロン	23,000	268		
日立化成	35,400	1,551	54,905,400	
リケンテクノス	17,000	243		
大倉工業	24,000	211	5,064,000	
積水化成品	20,000	327		
群栄化学	24,000	216		
日本化薬	58,000	794		
イーピーエス	49	186,800		
パナソニック電工IS	2,100	2,234		
野村総合研究所	44,200	1,688		
ケネディクス	981	19,820		
電通	75,400	2,258		
インテージ	3,100	1,588		
シンプレクスホールディング	147	40,100		
日本精化	8,500	482		
ADEKA	32,200	839		
日油	71,000	364	, ,	
ミヨシ油脂	39,000	129	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
ハリマ化成	8,000	471	3,768,000	
花王	225,200	2,102		+
第一工業製薬	17,000	221	3,757,000	
三洋化成	23,000	600		
武田薬品	309,900	3,890	· · · · ·	
アステラス製薬	183,800	3,000		
大日本住友製薬	60,000	725		
<u> </u>	121,200	1,530	, ,	
田辺三菱製薬	68,000	1,318		
わかもと製薬	16,000	244		
[1///)'ひC 表栄	16,000	244	3,904,000	ין

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
あすか製薬	13,000	545	7,085,	000
日本新薬	20,000	1,091	21,820,	000
中外製薬	82,500	1,511	124,657,	500
科研製薬	36,000	917	33,012,	000
エーザイ	101,900	2,879	293,370,	100
ロート製薬	38,000	917	34,846,	000
小野薬品	41,200	3,700	152,440,	000
久光製薬	23,300	3,330	77,589,	000
持田製薬	34,000	855	29,070,	000
大正製薬	65,000	1,741	113,165,	000
参天製薬	25,600	2,879	73,702,	400
扶桑薬品	34,000	231	7,854,	000
日本ケミファ	17,000	257	4,369,	000
ツムラ	22,700	2,570	58,339,	000
テ ル モ	62,200	4,455	277,101,	
みらかホールディングス	20,200	2,972	60,034,	
キッセイ薬品工業	17,200	1,520	26,144,	
生化学工業	17,400	865	15,051,	
<b>栄研化学</b>	7,800	906	7,066,	
日水製薬	7,100	670	4,757,	
鳥居薬品	6,300	1,640	10,332,	
東和薬品	4,300	4,685	20,145,	
沢井製薬	5,500	7,150	39,325,	
ゼリア新薬工業	13,000	990	12,870,	
第一三共	278,300	1,811	504,001,	
キョーリン製薬HD	23,000	1,335	30,705,	
大幸薬品	3,600	1,275	4,590,	
大日本塗料	57,000	90	5,130,	
日本ペイント	70,000	623	43,610,	
関西ペイント	92,000	765	70,380,	
中国塗料	22,000	620	13,640,	
藤倉化成	11,200	504	5,644,	
太陽ホールディングス	5,900	2,425	14,307,	
DIC	310,000	166	51,460,	
サカタインクス	17,000	368	6,256,	
東洋インキ	73,000	375	27,375,	
アルプス技研	7,100	728	5,168,	
オリエンタルランド	22,200	7,580	168,276,	
ダスキン	23,100	1,481	34,211,	
パーク24	37,100	800	29,680,	
<u>パープとす</u> 明光ネットワークジャパン	8,200	686	5,625,	
フジ・メディア・H D	814	117,100	95,319,	i
ラウンドワン	23,500	425	9,987,	
リゾートトラスト	13,100	1,307	17,121,	
オービック	2,680	15,120	40,521,	
ヤフー	5,711	30,000	171,330,	
ビー・エム・エル	5,300	2,140	11,342,	
ワタベウェディング	4,000	867	3,468,	
トレンドマイクロ	34,800	2,585	89,958,	
<u> </u>	5,500		10,527,	
		1,914		
東急コミュニティー	2,500	2,318	5,795,	
リソー教育	1,092	3,915	4,275,	
日本オラクル	12,200	3,695	45,079,	
アルファシステムズ	2,700	1,454	3,925,	
フューチャーアーキテクト	137	34,400	4,712,	800

			有価証券届出書(内	$\overline{}$
ユー・エス・エス	10,710	6,060	64,902,600	
オービックビジネスC	2,100	3,925	8,242,500	
伊藤忠テクノソリュー	11,200	3,015	33,768,000	
カルチュア・コンビニエンス	44,000	418		
大塚商会	6,300	5,430	34,209,000	
総合メディカル	1,900	2,113	4,014,700	
セントラルスポーツ	4,900	865	4,238,500	
電通国際情報S	7,200	503	3,621,600	
ウェザーニューズ	2,600	1,311	3,408,600	
富士フイルムHLDGS	177,000	2,812	497,724,000	
コニカミノルタHLDGS	210,000	862	181,020,000	
資 生 堂	137,200	1,749	239,962,800	
ライオン	95,000	444	42,180,000	
高砂香料	27,000	483	13,041,000	
マンダム	8,800	2,153	18,946,400	
ミルボン	4,600	2,393	11,007,800	
ファンケル	16,500	1,152	19,008,000	
コーセー	15,100	1,912	28,871,200	
ドクターシーラボ	58	299,000	17,342,000	
エステー	6,800	925	6,290,000	
コニシ	6,800	936	6,364,800	
長谷川香料	10,300	1,285	13,235,500	
小林製薬	11,400	3,660	41,724,000	
荒川化学工業	6,500	825	5,362,500	
日本高純度化学	26	240,800	6,260,800	
アース製薬	6,200	2,790	17,298,000	
イハラケミカル	18,000	238	4,284,000	
大成ラミック	3,300	2,124	7,009,200	
クミアイ化学	19,000	270	5,130,000	
日本農薬	18,000	401	7,218,000	
昭和シエル石油	74,700	696	51,991,200	
コスモ石油	228,000	237	54,036,000	
ニチレキ	14,000	312	4,368,000	
東燃ゼネラル石油	120,000	825	99,000,000	
ユシロ化学	5,400	1,064	5,745,600	
AOCホールディングス	23,500	412	9,682,000	
出光興産	9,700	7,790	75,563,000	
JXホールディングス	919,300	518	476,197,400	
横浜ゴム	94,000	420	39,480,000	
東洋ゴム	71,000	181	12,851,000	
ブリヂストン	259,000	1,542	399,378,000	
住友ゴム	57,800	849	49,072,200	
オカモト	33,000	350	11,550,000	
アキレス	84,000	114	9,576,000	
フコク	4,100	730	2,993,000	
ニッタ	7,900	1,436	11,344,400	
東海ゴム工業	13,100	982	12,864,200	
三ツ星ベルト	22,000	457	10,054,000	
バンドー化学	31,000	298	9,238,000	
鬼怒川ゴム	22,000	361	7,942,000	
旭硝子	408,000	933	380,664,000	
日本板硝子	363,000	196	71,148,000	
有沢製作所	14,700	440	6,468,000	
日本山村硝子	41,000	204	8,364,000	
日本電気硝子	172,000	1,175	202,100,000	
ロイボスを	172,000	1,175	202,100,000	Ъ

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
オハラ	4,000	1,061	4,244,	000
住友大阪セメント	166,000	185	30,710,	000
太平洋セメント	363,000	103	37,389,	000
東海カーボン	80,000	463	37,040,	000
日本カーボン	45,000	242	10,890,	000
東洋炭素	4,200	4,565	19,173,	000
ノリタケ	45,000	262	11,790,	000
ТОТО	121,000	558	67,518,	000
日本碍子	100,000	1,245	124,500,	000
日本特殊陶業	73,000	1,204	87,892,	000
MARUWA	2,300	2,072	4,765,	
品川リフラクトリーズ	26,000	217	5,642,	000
黒崎播磨	21,000	323	6,783,	000
フジミインコーポレーテッド	8,400	1,245	10,458,	000
ニチアス	42,000	401	16,842,	
新日本製鐵	2,168,000	277	600,536,	
住友金属工業	1,529,000	203	310,387,	
神戸製鋼所	1,145,000	190	217,550,	
日新製鋼	320,000	153	48,960,	
中山製鋼所	46,000	105	4,830,	
合同製鐵	48,000	168	8,064,	
J F E ホールディングス	196,000	2,661	521,556,	
東京製鐵	45,300	847	38,369,	
共英製鋼	9,200	1,147	10,552,	
大和工業	18,900	2,405	45,454,	
東京鐵鋼	20,000	182	3,640,	
大阪製鐵	5,300	1,242	6,582,	
定川製鋼所	63,000	323	20,349,	
東洋鋼鈑	20,000	438	8,760,	
住友鋼管	7,000	527	3,689,	
丸一鋼管	26,900	1,603	43,120,	
モリ工業	15,000	310	4,650,	
大同特殊鋼	137,000	449	61,513,	
日本高周波	42,000	95	3,990,	
日本金属工業	67,000	107	7,169,	
日本冶金工	45,000	234	10,530,	
山陽特殊鋼	41,000	432	17,712,	
愛知製鋼	43,000	507	21,801,	
日立金属	53,000	961	50,933,	
		146		
日本金属	26,000		3,796,	
大平洋金属	58,000	634	36,772,	
日本電工	33,000	618	20,394,	
栗本鉄工所	51,000	108	5,508,	
日本製鋼所	128,000	822	105,216,	
三菱製鋼	53,000	216	11,448,	
日本精線	8,000	429	3,432,	
日本軽金属	191,000	150	28,650,	
大紀アルミニウム	17,000	246	4,182,	
三井金属	239,000	254	60,706,	
東邦亜鉛	49,000	381	18,669,	
三菱マテリアル	517,000	259	133,903,	
住友鉱山	229,000	1,301	297,929,	
DOWAホールディングス	100,000	496	49,600,	
古河機金	155,000	93	14,415,	
大阪チタニウム	9,100	3,845	34,989,	500

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
東邦チタニウム	13,500	2,135	28,822,	,500
住友軽金属	138,000	91	12,558,	,000
古河スカイ	35,000	218	7,630,	,000
古河電工	262,000	357	93,534,	,000
住友電工	292,700	1,095	320,506,	,500
フジクラ	126,000	370	46,620,	,000
昭和電線HLDGS	120,000	84	10,080,	,000
タツタ電線	23,000	189	4,347,	,000
日立電線	68,000	221	15,028,	,000
リョービ	48,000	341	16,368,	,000
アサヒHD	11,700	1,650	19,305,	,000
東洋製罐	58,600	1,506	88,251,	,600
ホッカンホールディングス	23,000	224	5,152,	,000
コロナ	4,900	737	3,611,	,300
横河ブリッジHLDGS	17,000	510	8,670,	
駒井ハルテック	24,000	164	3,936,	,000
三和ホールディングス	86,000	249	21,414,	,000
文化シヤツタ -	29,000	183	5,307,	
住生活グループ	99,400	1,545	153,573,	
日本フイルコン	8,400	411	3,452,	
ノーリツ	15,300	1,304	19,951,	
長府製作所	8,400	1,764	14,817,	
リンナイ	13,300	4,860	64,638,	
ユニプレス	10,200	1,470	14,994,	
日東精工	14,000	256	3,584,	
岡 部	20,600	350	7,210,	
日立ツール	5,800	901	5,225,	
東プレ	16,900	583	9,852,	
高周波熱錬	12,400	623	7,725,	
東京製綱	61,000	248	15,128,	
パイオラックス	3,900	1,742	6,793,	
日本発条	60,000	842	50,520,	
中央発條	13,000	302	3,926,	
三浦工業	13,700	2,023	27,715,	
タクマ	34,000	228	7,752,	
ツガミ	25,000	558	13,950,	
オークマ	57,000	560	31,920,	
東芝機械	53,000	383	20,299,	
アマダ	118,000	572	67,496,	
アイダエンジニア	25,500	312	7,956,	
牧野フライス	40,000	616	24,640,	
オーエスジー	37,200	890	33,108,	
<u>/</u> /	18,000	1,452	26,136,	
森精機製作所	45,000	860	38,700,	
ディスコ ロ市工界	8,500 5,200	4,875	41,437,	
日東工器 典中白動総機	5,200	2,055	10,686,	
豊田自動織機	71,300	2,467	175,897,	
大阪機工	38,000	120	4,560,	
オ・エム製作所	12,000	273	3,276,	
津田駒工業	31,000	154	4,774,	
島精機製作所	11,200	1,830	20,496,	
日阪製作所	11,000	963	10,593,	
ナブテスコ	31,400	1,545	48,513,	
三井海洋開発	7,300	1,407	10,271,	
SMC	24,600	13,300	327,180,	,000

1			有価証券届出書(内国	自投資信託
新川	7,200	873	6,285,600	
ホソカワミクロン	19,000	334	6,346,000	
ユニオンツール	5,500	2,080	11,440,000	
オイレス工業	8,900	1,375	12,237,500	
サトー	8,800	1,004	8,835,200	
小松製作所	392,700	2,318	910,278,600	
住友重機械	213,000	514	109,482,000	
日立建機	37,400	1,908	71,359,200	
日工	18,000	276	4,968,000	
巴工業	3,900	1,106	4,313,400	
井関農機	88,000	209	18,392,000	
TOWA	9,700	619	6,004,300	
丸山製作所	28,000	166	4,648,000	
北川鉄工所	47,000	144	6,768,000	
クボタ	347,000	758	263,026,000	
東洋エンジニア	54,000	287	15,498,000	
三菱化工機	31,000	165	5,115,000	
月島機械	14,000	550	7,700,000	
帝国電機製作所	3,500	1,577	5,519,500	
新東工業	18,300	651	11,913,300	
アイチ コーポレーション	16,900	315	5,323,500	
小森コーポレーション	22,700	847	19,226,900	
住友精密	21,000	347	7,287,000	
<b>在原製作所</b>	147,000	357	52,479,000	
酉島製作所	10,200	1,464	14,932,800	
千代田化工建	59,000	727	42,893,000	
ダイキン工業	86,500	3,005	259,932,500	
オルガノ	15,000	581	8,715,000	
ト - ヨ - カネツ	50,000	133	6,650,000	
栗田工業	45,200	2,409	108,886,800	
椿本チエイン	43,000	396	17,028,000	
大同工業	26,000	154	4,004,000	
日機装	29,000	679	19,691,000	
木村化工機	8,900	551	4,903,900	
新興プランテック	17,600	694	12,214,400	
アネスト岩田	21,000	279	5,859,000	
ダイフク	35,500	509	18,069,500	
加藤製作所	29,000	171	4,959,000	
タダノ	37,000	385	14,245,000	
フジテック	25,000	377	9,425,000	
シーケーディ	23,600	633	14,938,800	
平和	17,000	1,177	20,009,000	
理想科学工業	6,900	1,329	9,170,100	
S A N K Y O	23,800	4,430	105,434,000	
日本金銭機械	9,000	598	5,382,000	
マースエンジニアリング	4,400	1,326	5,834,400	
ダイコク電機	4,400	936		
アマノ		733	3,931,200	
JUKI	23,400	733 148	17,152,200	
サンデン	55,000	292	8,140,000	
	46,000		13,432,000	
ブラザー工業	102,700	1,188	122,007,600	
マックス	14,000	873	12,222,000	
モリタホールディングス	15,000	468	7,020,000	
グローリー	22,100	1,990	43,979,000	
大和冷機工業	13,000	388	5,044,000	

			有価証券届出書	(内国投資信託
セガサミーホールディングス	83,100	1,410	117,171	,000
日本ピストンリング	37,000	208	7,696	,000
リケン	33,000	317	10,461	,000
帝国ピストン	10,400	763	7,935	,200
ホシザキ電機	15,800	1,476	23,320	,800
大豊工業	6,600	693	4,573	,800
日本精工	177,000	706	124,962	
NTN	185,000	381	70,485	
ジェイテクト	85,000	927	78,795	
不 二 越	82,000	254	20,828	
ミネベア	119,000	496	59,024	
日本トムソン	28,000	614	17,192	
ТНК	53,000	1,735	91,955	
ユーシン精機	4,600	1,648	7,580	
前澤給装工業	4,700	945	4,441	
イーグル工業	11,000	738	8,118	
日本ピラ・工業	11,000	560	6,160	
キッツ	34,200	362	12,380	
日立	1,777,000	396	703,692	
東芝	1,562,000	436	681,032	
三菱電機	791,000	829	655,739	
富士電機HLDGS	240,000	224	53,760	
東洋電機製造	15,000	404	6,060	
安川電機	88,000	725	63,800	
シンフォニア テクノロジー	52,000	180	9,360	
明電舎	81,000	357	28,917	
オリジン電気	13,000	347	4,511	
デンヨー	9,400	570	5,358	
日立工機	22,100	715	15,801	
三桜工業	9,900	675	6,682	
マキタ	51,600	3,025	156,090	
東芝テック	52,000	352	18,304	
芝浦メカトロニクス	18,000	276	4,968	
マブチモーター	11,200	4,025	45,080	
日本電産	39,100	8,380	327,658	
高岳製作所	34,000	335	11,390	
ダイヘン	44,000	362	15,928	
日新電機	15,000	413	6,195	
大崎電気	12,000	640	7,680	
オムロン	87,900	2,064	181,425	
日東工業	12,800	863	11,046	
IDEC	10,400	682	7,092	
エルピーダメモリ	70,200	997	69,989	
ジーエス・ユアサ コーポ	154,000	561	86,394	
メルコホールディングス	4,600	2,781	12,792	
日本電気	1,026,000	2,781	237,006	
富士通	761,000	537	408,657	
沖電気	302,000	72	21,744	
岩崎通信機	54,000	67	3,618	
電気興業	27,000	350	9,450	
サンケン電気		350		
アイホン	49,000		17,395	
	6,000	1,270	7,620	
ルネサスエレクトロニクス	21,400	814	17,419	
セイコーエプソン	54,300	1,375	74,662	
ワコム	166	116,100	19,272	, 600

			有価証券届出書	(内国投資信託
アルバック	14,900	1,976	29,442	,400
アクセル	3,300	1,952	6,441	,600
ナナオ	7,000	1,701	11,907	,000
日本信号	19,200	586	11,251	,200
京三製作所	19,000	357	6,783	,000
能美防災	12,000	475	5,700	,000
マスプロ電工	8,100	685	5,548	
日本無線	36,000	259	9,324	
パナソニック	783,900	1,204	943,815	
シャープ	355,000	805	285,775	
アンリツ	36,000	580	20,880	
富士通ゼネラル	20,000	445	8,900	
日立国際電気	19,000	766	14,554	
ソニー	444,900	2,971	1,321,797	
T D K	44,600	5,390	240,394	
帝国通信工業	28,000	188	5,264	
三洋電機	608,000	136	82,688	
ミツミ電機	28,700	1,518	43,566	
タムラ製作所	27,000	225	6,075	
アルプス電気	63,300	825	52,222	
パイオニア	115,000	326	37,490	
日本電波工業	6,600	1,422	9,385	
ローランド ディー・ジー・	4,500	1,175	5,287	
フオスタ - 電機	7,800	2,077	16,200	
クラリオン	50,000	145	7,250	
S M K	25,000	391	9,775	
<u>コーポート、</u> ヨコオ	9,200	484	4,452	
<del> </del>	40,000	128	5,120	
ホシデン	20,100	844	16,964	
ヒロセ電機	12,700	8,270	105,029	
日本航空電子	19,000	606	11,514	
T O A	12,000	411	4,932	
ユニデン	29,000	242	7,018	
アルパイン	16,200	1,127	18,257	
スミダコーポレーション	5,800	836	4,848	
アイコム	4,800	2,086	10,012	
ルール・コム  船井電機	7,300	2,844	20,761	
横河電機	80,600	577	46,506	
新電元工業	30,000	375	11,250	
山武	21,900	1,910	41,829	
日本光電工業	14,700	1,624	23,872	
<u>ロ本ルモエ来</u> チ	22,000	194	4,268	
//  堀場製作所	13,900	2,230	30,997	
アドバンテスト	54,600	1,722	94,021	
エスペック		611		
エスペック パナソニック電エSUNX	10,200	457	6,232	
キーエンス	8,900 17,600	21,120	4,067	
十一エンス     日置電機			371,712,	
	4,300	1,625	6,987	
シスメックス	13,900	5,340	74,226	
メガチップス	7,600	1,474	11,202	
OBARA D大家会コパリ電ス	7,000	855	5,985	
日本電産コパル電子	8,900	615	5,473	
デンソー	173,400	2,733	473,902	
コーセル	11,000	1,144	12,584	
日立メディコ	8,000	647	5,176	,000

1			有価証券届出書(内国	国投資信託
オプテックス	6,200	1,125	6,975,000	
千代田インテグレ	3,800	1,021	3,879,800	
東光電気	7,000	433	3,031,000	
スタンレー電気	53,400	1,496	79,886,400	
岩崎電気	36,000	155	5,580,000	
ウシオ電機	47,800	1,442	68,927,600	
日本セラミック	5,500	1,239	6,814,500	
新神戸電機	7,000	900	6,300,000	
日本デジタル研究所	7,600	842	6,399,200	
古河電池	7,000	537	3,759,000	
図 研	8,500	566	4,811,000	
日本電子	33,000	279	9,207,000	
カシオ	77,100	625	48,187,500	
ファナック	82,500	11,990	989,175,000	
日本シイエムケイ	17,300	375	6,487,500	
エンプラス	4,600	1,180	5,428,000	
п – Д	39,400	5,050	198,970,000	
浜松ホトニクス	30,700	2,749	84,394,300	
三井ハイテック	11,600	450	5,220,000	
新光電気工業	20,700	932	19,292,400	
京 セ ラ	65,800	8,540	561,932,000	
太陽誘電	36,000	1,113	40,068,000	
村田製作所	82,900	5,110	423,619,000	
ユーシン	10,200	662	6,752,400	
双葉電子工業	14,000	1,448	20,272,000	
日東電工	68,200	3,475	236,995,000	
北陸電気工業	37,000	156	5,772,000	
パナソニック電工	74,000	1,085	80,290,000	
東海理化電機	18,700	1,514	28,311,800	
ニチコン	25,500	1,009	25,729,500	
日本ケミコン	51,000	359	18,309,000	
K O A	10,500	829	8,704,500	
三井造船	309,000	193	59,637,000	
日立造船	335,500	117	39,253,500	
佐世保重工業	55,000	158	8,690,000	
三菱重工業	1,324,000	301	398,524,000	
川崎重工業	616,000	259	159,544,000	
IHI	542,000	173	93,766,000	
日本車輌	31,000	375	11,625,000	
近畿車輌	14,000	408	5,712,000	
日産自動車	999,000	785	784,215,000	
いすぶ自動車	459,000	373	171,207,000	
トヨタ自動車	1,016,800	3,220	3,274,096,000	
日野自動車	100,000	413	41,300,000	
三菱自動車工業	1,630,000	113	184,190,000	
エフテック	3,100	1,353	4,194,300	
武蔵精密工業	7,800	2,059	16,060,200	
トヨタ車体	14,400	1,483	21,355,200	
日産車体	31,000	661	20,491,000	
関東自動車	12,900	606	7,817,400	
新明和工業	38,000	335	12,730,000	
極東開発工業	19,000	335	6,118,000	
日信工業	16,300	1,423	23,194,900	
		1,423		
トピー工業	68,000		13,056,000	
ティラド	28,000	288	8,064,000	

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
曙ブレーキ	37,700	488	18,397	,600
タチエス	10,600	1,292	13,695	, 200
N O K	38,300	1,580	60,514	,000
フタバ産業	23,700	570	13,509	,000
カヤバ工業	50,000	554	27,700	,000
シロキ工業	19,000	265	5,035	,000
市光工業	22,000	171	3,762	,000
大同メタル工業	14,000	597	8,358	,000
プレス工業	38,000	351	13,338	,000
カルソニックカンセイ	42,000	290	12,180	,000
太平洋工業	18,000	400	7,200	,000
ケーヒン	16,400	1,826	29,946	,400
河西工業	11,000	389	4,279	,000
アイシン精機	64,900	2,713	176,073	,700
マッダ	614,000	233	143,062	,000
ダイハツ	83,000	1,174	97,442	,000
愛知機械	19,000	290	5,510	
今仙電機製作所	5,800	1,123	6,513	
本田技研	667,600	3,010	2,009,476	
スズキ	165,300	2,024	334,567	
富士重工業	250,000	620	155,000	
ヤマハ発動機	120,000	1,200	144,000	
ショーワ	18,000	564	10,152	
小糸製作所	40,000	1,203	48,120	
TBK	10,000	366	3,660	
エクセディ	9,600	2,587	24,835	
ミツバ	15,000	638	9,570	
豊田合成	22,500	1,911	42,997	
愛三工業	10,300	659	6,787	
ョ ロ ズ	5,000	1,365	6,825	
エフ・シー・シー	11,700	1,839	21,516	
新家工業	38,000	136		
シマノ	32,500	4,035	131,137	
タカタ	12,200	2,330	28,426	
テイ・エス テック	15,300	1,525	23,332	
小野建	7,700	673	5,182	
佐鳥電機	6,100	567	3,458	
カッパクリエイト	5,800	1,870	10,846	
伯東	5,400	725	3,915	
ナガイレーベン	6,400	1,949	12,473	
菱食	7,800	1,739	13,564	
良品計画	9,100	3,275	29,802	
三城ホールディングス	10,400	713	7,415	
松田産業	6,400	1,331	8,518	
メディパルHD	71,600	900	64,440	
アズワン	5,600	1,468	8,220	
シモジマ	6,400	1,055	6,752	
ドウシシャ	4,200	1,802	7,568	
コジマ	10,600	493	5,225	
  コーナン商事	7,600	925	7,030	
コープン同事  黒田電気	10,800	1,022	11,037	
ニロ电×リー・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・	198	109,600	21,700	
ワタミ	9,300	1,548	14,396	
ドン・キホーテ	12,200	2,415	29,463	
メガネトップ	8,900	2,415 798	7,102	
<b>ハルヤドツノ</b>	0,900	198	1,102	, 200

T			有価証券届出書(内国	国投資信託
西松屋チェーン	17,400	805		
ゼンショー	29,300	767	22,473,100	
幸楽苑	5,400	1,162	6,274,800	
サイゼリヤ	10,200	1,527	15,575,400	
エクセル	4,900	955	4,679,500	
ガリバーインターナショナル	2,200	3,815	8,393,000	
ユナイテッドアローズ	7,600	1,186		
ハイデイ日高	3,900	1,344	5,241,600	
シークス	5,500	886	4,873,000	
京都きもの友禅	5,900	879	5,186,100	
コロワイド	27,000	417	11,259,000	
壱番屋	2,800	2,239	6,269,200	
マクニカ	3,800	1,900		
スギホールディングス	12,500	1,880		
島津製作所	95,000	620	58,900,000	
J M S	15,000	283	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
スター精密	16,300	827	13,480,100	
東京計器	39,000	115	4,485,000	
日本電産トーソク	5,500	910		
東京精密	16,000	1,214	19,424,000	
ニコン	138,300	1,644	227,365,200	
トプコン	20,200	470	9,494,000	
オリンパス	93,600	2,355		
理研計器	9,100	597	5,432,700	
大日本スクリ・ン	88,000	546		
キヤノン電子	7,400	2,170		
タムロン	8,100	1,630		-
HOYA	181,600	1,974	358,478,400	
ノーリツ鋼機	9,300	487	4,529,100	
エー・アンド・デイ	9,900	331	3,276,900	
キヤノン	492,000	3,945		-
<u> </u>	238,000	1,181	281,078,000	
日本電産コパル	6,600	1,382	9,121,200	
日本電産サンキョー	19,000	654	12,426,000	
シチズンホールディングス	87,900	510	44,829,000	
リズム時計	46,000	134	6,164,000	
SRIスポーツ	59	88,100	5,197,900	
バンダイナムコHLDGS	92,400	807	74,566,800	
フランスベッドHLDGS	61,000	103	6,283,000	
パイロットコーポレーション	81	138,000		
エイベックス・グループHD	15,300	1,205	18,436,500	
トッパン・フォームズ	18,200	797	14,505,400	
フジシールインターナショナル	8,500	1,744	14,824,000	
タカラトミー	24,300	639		
レック	3,600	1,270	4,572,000	
アロン化成	10,000	360	3,600,000	
プロネクサス	11,900	386	4,593,400	
大建工業	37,000	205	7,585,000	
き も と <sup>1</sup>	8,700	682	5,933,400	
一	224,000	700	156,800,000	
大日本印刷	241,000	1,054	254,014,000	
共同印刷 日本写真印刷	33,000	181	5,973,000	
日本写真印刷	14,900	1,837	27,371,300	
藤森工業	6,800	1,050	7,140,000	
前澤化成工業	8,700	684	5,950,800	

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
アシックス	74,000	919	68,006,	,000
ツ ツ ミ	3,800	2,152	8,177,	,600
ジェイ エス ピー	6,000	1,102	6,612,	,000
ニチハ	9,200	646	5,943,	, 200
ローランド	8,300	899	7,461,	,700
エフピコ	4,100	4,375	17,937,	,500
小松ウオール工業	5,600	718	4,020,	,800
ヤマハ	64,000	983	62,912,	,000
河合楽器	39,000	166	6,474,	,000
クリナップ	9,700	494	4,791,	,800
ピジヨン	5,900	2,804	16,543,	,600
天馬	8,400	869	7,299,	,600
パラマウントベツド	6,500	2,155	14,007,	,500
リンテック	16,800	1,955	32,844,	,000
信越ポリマー	17,700	456	8,071,	
東リ	37,000	131	4,847,	,000
イトーキ	22,000	213	4,686,	
任 天 堂	45,300	22,730	1,029,669,	
三菱鉛筆	7,400	1,452	10,744,	
タカラスタンダ・ド	38,000	528	20,064,	
コクヨ	42,000	643	27,006,	
ナカバヤシ	27,000	171	4,617,	
= フ コ	15,900	2,204	35,043,	
グローブライド	53,000	92	4,876,	
岡村製作所	32,000	467	14,944,	
日本バルカー	38,000	240	9,120,	
伊藤忠	544,300	776	422,376,	
丸 紅	682,000	543	370,326,	
スクロール	12,900	313	4,037,	
F & A アクアホールディングス	7,500	649	4,867,	
三陽商会	49,000	338	16,562,	
長瀬産業	43,000	934	40,162,	
蝶理	65,000	96	6,240,	
豊田通商	87,600	1,359	119,048,	
オンワ・ドホールディングス	60,000	713	42,780,	
兼松	196,000	72	14,112,	
美津濃	41,000	365	14,965,	
フアミリーマート	26,100	2,848	74,332,	
三井物産	674,600	1,307	881,702,	
日本紙パルプ	47,000	268	12,596,	
東京エレクトロン	62,200	5,250	326,550,	
日立ハイテクノロジーズ	23,900	1,769	42,279,	
カメイ	12,000	358	4,296,	
スターゼン	31,000	225	6,975,	
セイコーHD	43,000	223	12,771,	
<u> </u>	33,200	374		
<u>山                                    </u>	429,400		12,416,	
日本ユニシス		1,092 554	468,904,	
	23,300		12,908,	
内田洋行	21,000	307	6,447,	
三菱商事	625,300	2,116	1,323,134,	-
第一実業 キャルファケー・シグ・ロ・ロー	24,000	284	6,816,	
キヤノンマーケティングJPN	26,400	1,178	31,099,	
西華産業	34,000	205	6,970,	-
菱洋エレクトロ	11,300	814	9,198,	
ユアサ商事	103,000	77	7,931,	, 000

			有価証券届出書(内閣	国投資信託
神鋼商事	28,000	186	5,208,000	
阪和興業	75,000	318	23,850,000	
カナデン	12,000	471	5,652,000	
菱電商事	17,000	461	7,837,000	
ニプロ	15,700	1,635	25,669,500	
フルサト工業	7,700	447	3,441,900	
岩谷産業	92,000	238	21,896,000	
すてきナイスグループ	40,000	169	6,760,000	
昭光通商	47,000	124	5,828,000	
兼松エレクトロニクス	6,700	796	5,333,200	
三愛石油	20,000	365	7,300,000	
稲畑産業	24,100	425	10,242,500	
ゴ - ルドウイン	25,000	208	5,200,000	
東京スタイル	34,000	605	20,570,000	
ユニ・チヤ・ム	45,400	3,270	148,458,000	
デサント	28,000	417	11,676,000	
東邦ホールディングス	23,900	1,044	24,951,600	
サンゲツ	14,100	1,734	24,449,400	
ミツウロコ	14,900	464	6,913,600	
シナネン	20,000	325	6,500,000	
伊藤忠エネクス	19,500	388	7,566,000	
ザ・トーカイ	22,000	326	7,172,000	
サンリオ	21,900	2,034	44,544,600	
リョーサン	12,500	2,015	25,187,500	
新光商事	7,900	634	5,008,600	
トーホー	21,000	291	6,111,000	
三信電気	10,100	653	6,595,300	
東陽テクニカ	11,500	791	9,096,500	
モスフード サービス	10,200	1,470	14,994,000	
加賀電子	8,200	940	7,708,000	
三益半導体	7,000	820	5,740,000	-
		1,617		
木曽路	9,100	482		
ケーヨー	15,200	410	7,326,400	
コニヘアー	14,400		5,904,000	
	10,200	1,049	10,699,800	
上新電機	17,000	779	13,243,000	
日本瓦斯	8,700	1,075	9,352,500	
マルエツ	18,000	305	5,490,000	
ロイヤルホールディングス	12,800	877	11,225,600	
いなげや	9,000	861	7,749,000	
島の忠	15,100	1,664	25,126,400	
チョダ	10,400	979	10,181,600	
ライフコーポレーション	5,300	1,210	6,413,000	
カスミ	17,600	432	7,603,200	
リンガーハツト	6,900	961	6,630,900	
AOKIホールディングス	7,600	1,322	10,047,200	
オークワ	12,000	826	9,912,000	
コメリ	10,600	1,744	18,486,400	
青山商事	20,000	1,455	29,100,000	
しまむら	8,000	7,640	61,120,000	
CFSコーポレーション	10,000	404	4,040,000	
高島屋	107,000	699	74,793,000	
松屋	16,300	565	9,209,500	
エイチ・ツー・オーリテイリング	46,000	582	26,772,000	
ニッセンHD	16,100	369	5,940,900	

			有価証券届出書(内国投資信託
パルコ	20,900	694	14,504,600
丸井グループ	103,300	678	70,037,400
クレディセゾン	60,100	1,329	79,872,900
原信ナルスHLDGS	5,700	1,080	6,156,000
セディナ	84,100	142	11,942,200
ダイエー	38,600	323	12,467,800
イズミヤ	30,000	314	9,420,000
イオン	274,500	1,021	280,264,500
<u> </u>	64,400	757	48,750,800
イズミ	21,300	1,136	24,196,800
東武ストア	17,000	231	3,927,000
平和堂	16,100	1,008	16,228,800
フ ジ	9,200	1,602	14,738,400
ヤオコー	3,700	2,276	8,421,200
ゼビオ	9,500	1,688	16,036,000
ケーズホールディングス	17,900	2,179	39,004,100
Paltac	5,100	1,564	7,976,400
新生銀行	423,000	73	30,879,000
あおぞら銀行	291,000	143	41,613,000
三菱UFJフィナンシャルG	5,913,600	396	2,341,785,600
りそなホールディングス	240,000	511	122,640,000
中央三井トラストHD	453,000	295	133,635,000
三井住友フィナンシャルG	591,200	2,569	1,518,792,800
第四銀行	101,000	239	24,139,000
北越銀行	89,000	153	13,617,000
西日本シティ銀行	264,000	231	60,984,000
札幌北洋ホール	116,000	347	40,252,000
千葉銀行	307,000	487	149,509,000
横浜銀行	534,000	405	216,270,000
常陽銀行	300,000	353	105,900,000
群馬銀行	178,000	418	74,404,000
武蔵野銀行	12,700	2,364	30,022,800
千葉興業銀行	15,700	429	6,735,300
筑波銀行	37,500	257	9,637,500
東京都民銀行	15,800	860	13,588,000
七十七銀行	130,000	399	51,870,000
青森銀行	66,000	212	13,992,000
秋田銀行	56,000	229	12,824,000
山形銀行	48,000	374	17,952,000
岩手銀行	5,400	3,735	20,169,000
東邦銀行	67,000	246	16,482,000
東北銀行	56,000	134	7,504,000
みちのく銀行	44,000	150	6,600,000
ふくおかフィナンシャルG	316,000	322	101,752,000
静岡銀行	241,000	704	169,664,000
十六銀行	93,000	243	22,599,000
スルガ銀行	82,000	717	58,794,000
八十二銀行	144,000	433	62,352,000
山梨中央銀行	49,000	344	16,856,000
大垣共立銀行	103,000	234	24,102,000
福井銀行	66,000	254	16,764,000
北國銀行	89,000	293	26,077,000
清水銀行	2,800	3,505	9,814,000
滋賀銀行	73,000	427	31,171,000
南都銀行	71,000	403	28,613,000

			有価証券届出書(内国投資信
百五銀行	70,000	326	22,820,000
京都銀行	138,000	739	101,982,000
三重銀行	38,000	210	7,980,000
ほくほくフィナンシャルG	542,000	153	82,926,000
広島銀行	225,000	334	75,150,000
山陰合同銀行	47,000	553	25,991,000
中国銀行	63,000	951	59,913,000
鳥取銀行	31,000	173	5,363,000
伊予銀行	82,000	595	48,790,000
百十四銀行	91,000	303	27,573,000
四国銀行	56,000	241	13,496,000
阿波銀行	64,000	505	32,320,000
鹿児島銀行	50,000	510	25,500,000
大分銀行	52,000	284	14,768,000
宮崎銀行	54,000	202	10,908,000
肥後銀行	60,000	395	23,700,000
佐賀銀行	49,000	210	10,290,000
十八銀行	52,000	221	11,492,000
沖縄銀行	6,000	3,295	19,770,000
琉球銀行	16,600	933	15,487,800
住友信託	702,000	444	311,688,000
みずほ信託銀行	771,000	75	57,825,000
八千代銀行	4,400	1,860	8,184,000
みずほフィナンシャルG	9,522,000	133	1,266,426,000
紀陽ホールディングス	301,000	109	32,809,000
山口フィナンシャルG	77,000	746	57,442,000
芙蓉総合リース	7,600	2,457	18,673,200
興銀リース	11,300	1,944	21,967,200
東京センチュリーリース	18,500	1,236	22,866,000
SBIホールディングス	9,393	11,400	107,080,200
日本証券金融	34,600	553	19,133,800
大阪証券金融	21,600	158	3,412,800
長野銀行	39,000	158	6,162,000
名古屋銀行	73,000	239	17,447,000
愛知銀行	2,700	4,815	13,000,500
第三銀行	50,000	209	10,450,000
中京銀行	33,000	211	6,963,000
東日本銀行	42,000	151	6,342,000
愛媛銀行	50,000	217	10,850,000
トマト銀行	42,000	148	6,216,000
みなと銀行	82,000	133	10,906,000
京葉銀行	62,000	392	24,304,000
関西アーバン銀行	112,000	125	14,000,000
栃木銀行	40,000	403	16,120,000
北日本銀行	3,100	1,910	5,921,000
東和銀行	93,000	75	6,975,000
福島銀行	130,000	46	5,980,000
リコーリース	5,800	2,150	12,470,000
イオン クレジットサービス	35,600	1,080	38,448,000
ア コ ム	16,700	979	16,349,300
プロミス	41,650	471	19,617,150
ジャックス	55,000	186	10,230,000
日立キャピタル	19,000	1,143	21,717,000
オリックス	40,620	7,150	290,433,000
三菱UFJリース	19,860	3,060	60,771,600

			有価証券届出書(内国投	<u> 資信託</u>
ジャフコ	11,400	2,006	22,868,400	
トモニホールディングス	62,700	290	18,183,000	
大和証券G本社	772,000	380	293,360,000	
野村ホールディングス	1,646,200	482	793,468,400	
みずほ証券	200,000	196	39,200,000	
みずほインベスタズ証	184,000	78	14,352,000	
岡三証券グループ	70,000	296	20,720,000	
丸三証券	28,200	475	13,395,000	
東洋証券	47,000	129	6,063,000	
東海東京 H D	90,000	307	27,630,000	
水戸証券	32,000	134	4,288,000	
いちよし証券	20,200	548	11,069,600	
松井証券	48,800	522	25,473,600	
NKSJホールディングス	654,000	560	366,240,000	
マネックスG	506	22,320	11,293,920	
カブドットコム証券	35,700	317	11,316,900	
極東証券	11,900	659	7,842,100	
岩井コスモホールディング	9,100	530	4,823,000	
フィデアホール	47,700	182	8,681,400	
池田泉州 H D	223,400	114	25,467,600	
MS&AD	233,600	1,919	448,278,400	
SONY FH	371	302,500	112,227,500	
第一生命	3,127	120,200	375,865,400	
富士火災	77,000	110	8,470,000	
東京海上HD	296,000	2,367	700,632,000	
T&Dホールディングス	143,100	1,901	272,033,100	
三井不動産	369,000	1,482	546,858,000	
三菱地所	547,000	1,412	772,364,000	
平和不動産	66,000	226	14,916,000	
東京建物	162,000	329	53,298,000	
ダイビル	24,200	629	15,221,800	
サンケイビル	17,100	453	7,746,300	
東急不動産	160,000	375	60,000,000	
京阪神不動産	12,700	361	4,584,700	
住友不動産	188,000	1,802	338,776,000	
東宝不動産	9,900	489	4,841,100	
大京	137,000	143	19,591,000	
テーオーシー	32,400	351	11,372,400	
東京楽天地	18,000	297	5,346,000	
レオパレス 2 1	55,000	151	8,305,000	
空港施設	12,200	326	3,977,200	
住友不動産販売	3,040	3,630	11,035,200	
ゴールドクレスト	7,430	1,791	13,307,130	
東栄住宅	6,500	1,009	6,558,500	
東急リバブル	9,200	953	8,767,600	
飯田産業	6,600	799	5,273,400	
アーネストワン	14,900	927	13,812,300	
タカラレーベン	8,800	569	5,007,200	
イオンモール	35,800	1,861	66,623,800	
リサ・パートナーズ	144	35,700	5,140,800	
エヌ・ティ・ティ都市開発	577	73,600	42,467,200	
	338,000	455	153,790,000	
  相鉄ホールディングス	124,000	259	32,116,000	
<u>性鉄がールティングス</u> 東京急行	434,000	370		
	•		160,580,000	
京浜急行	202,000	736	148,672,000	

小田島電鉄 265,000 763 193,039,00 京王電鉄 206,000 566 116,596,00 京王電鉄 206,000 549 71,370,00 富土急行 25,000 416 10,400,00 新京成電鉄 19,000 347 6,593,00 西日本旅客鉄道 137,400 5,000 687,000,00 西日本旅客鉄道 736 293,300 215,868,80 東海旅客鉄道 685 646,000 442,510,00 万一トコーポレーション 2,500 1,232 3,080,00 10 102,000 349 35,598,00 1人でキョウレックス 2,700 2,098 5,664,60 近畿鉄道 709,000 250 177,250,00 172,250,00 380 200,260,00 南海電鉄 164,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 55,312,00 日本通運 315,000 334 105,210,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 105,210,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 1	国投資信託
京成電鉄 130,000 549 71,370,00 富士急行 25,000 416 10,400,00	
富士急行 25,000 416 10,400,00 新京成電鉄 19,000 347 6,593,00 西日本旅客鉄道 137,400 5,000 687,000,00 西日本旅客鉄道 736 293,300 215,868,80 東海旅客鉄道 685 646,000 442,510,00 アートコーボレーション 2,500 1,232 3,080,00 八マキョウレックス 2,700 2,098 5,664,60 近畿鉄道 709,000 250 177,250,00 阪急阪神HLDGS 527,000 380 200,260,000 京海電鉄 164,000 337 59,312,00 名古屋鉄道 275,000 330 375,9312,00 名古屋鉄道 315,000 334 105,210,00 日本通運 315,000 334 105,210,00 日本通運 315,000 334 105,210,00 日本通運 315,000 330 31,680,00 日新 37,000 206 7,622,00 日本通運 35,000 241 8,435,00 日新 37,000 241 8,435,00 日本通運 55,000 340 251 7,530,00 日新 37,000 266 7,622,00 日本通運 35,000 351 7,530,00 日新 37,000 266 7,622,00 日本通運 35,000 341 8,435,00 日本通運 35,000 351 7,530,00 日本通運 35,000 351 7,530,00 日本通運 35,000 351 7,530,00 日本 37,000 266 7,622,00 日本 37,000 266 7,622,00 日本 37,000 27,000 37,000 27,000 37	
新京成電鉄 19,000 347 6,593,00 度日本旅客鉄道 736 293,300 687,000,00 万日本旅客鉄道 736 293,300 215,868,80 東海旅客鉄道 685 646,000 442,510,00 アートコーボレーション 2,500 1,232 3,080,00 西日本鉄道 709,000 349 35,598,000 1人マキョウレックス 2,700 2,998 5,664,60 近畿鉄道 709,000 250 177,250,00 阪急阪神日LDGS 527,000 380 200,260,00 兩海電鉄 164,000 337 55,266,00 20 20 60,500,00 日本通運 315,000 334 105,210,000 日本通運 315,000 334 105,210,000 日本通運 315,000 334 105,210,000 日本通運 315,000 334 105,210,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日新通 320 200,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日新通 320 200,000 日本通運 315,000 330 31,680,000 日新 320 31,680,000 日新 320 31,680,000 251 7,530,000 日本 320 320,000 251 7,530,000 261 7,622,000 320 320,000 251 7,530,000 251 7,540,000 251 7,540,000 251 7,540,000 251 7,540,000 251 7,540,000 251 7,540,000 251 7	
東日本旅客鉄道 736 293,300 215,868,80	
西日本旅客鉄道 736 293,300 215,868,80 東海旅客鉄道 685 646,000 442,510,00 アートコーポレーション 2,500 1,232 3,080,00 西日本鉄道 102,000 349 35,598,00 八マキョウレックス 2,700 2,098 5,664,60 近畿鉄道 709,000 250 177,250,00 阪急阪神HLDGS 527,000 380 200,260,00 扇海電鉄 176,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 59,312,00 名古屋鉄道 275,000 220 60,500,00 日本通運 315,000 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 日 新 37,000 206 7,622,00 丸全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 センコー 35,000 241 8,435,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 福山通運 55,000 410 22,550,00 福山通運 55,000 410 22,550,00 セノノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 相介・川中央交通 14,000 403 5,642,00 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 南船三井 386,000 575 221,950,00 南船三井 386,000 575 221,950,00 南部三井 386,000 575 221,950,00 南部三井 386,000 575 221,950,00 所第四番 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 東澤倫庫 11,880 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 三賽倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三共倉庫 59,000 430 25,370,00 定決倉庫 59,000 430 25,370,00 東陽倉庫 59,000 174 5,046,00 東陽倉庫 59,000 174 5,046,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00	
東海旅客鉄道       685       646,000       442,510,00         アートコーポレーション       2,500       1,232       3,080,00         西日本鉄道       102,000       349       35,598,00         八マキョウレックス       2,700       2,098       5,664,60         近畿鉄道       709,000       250       177,250,00         阪急阪神日LDGS       527,000       380       200,260,00         南海電鉄       164,000       337       55,268,00         名古屋鉄道       275,000       220       60,500,00         日本通運       315,000       334       105,210,00         ヤマトホールディングス       161,600       1,059       171,134,40         山 九       96,000       330       31,680,00         九全昭和運輸       30,000       261       7,530,00         九全昭和運輸       30,000       251       7,530,00         大全田和連輸       24,000       897       21,528,00         大本田包連輸       24,000       897       21,528,00         大中本田連輸       14,000       403       5,642,00         大中大戸市       14,000       403       5,642,00         大本郵船       669,000       365       244,185,00         大田本郵船       669,000       365       244,185,0	1
アートコーポレーション       2,500       1,232       3,080,00         西日本鉄道       102,000       349       35,598,00         八マキョウレックス       2,700       2,098       5,684,60         灰急酸洋申LDGS       527,000       380       200,260,00         腐海電鉄       164,000       337       55,268,00         京阪電鉄       176,000       337       59,312,00         名古屋鉄道       275,000       220       60,500,00         日本通運       315,000       334       105,210,00         ヤマトホールディングス       161,600       1,059       171,134,40         山 九       96,000       330       31,680,00         日新       37,000       206       7,622,00         丸全昭和運輸       30,000       251       7,530,00         日本梱包運輸       24,000       897       21,528,00         桂木ປノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         セノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         セノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         ロカ輸門中央交通       14,000       403       5,642,00         日本郵船       669,000       365       244,185,00         南南川中央交通       14,000       403	1
西日本鉄道 102,000 349 35,598,00	1
八マキョウレックス       2,700       2,098       5,664,60         近畿鉄道       709,000       250       177,250,00         阪急阪神HLDGS       527,000       380       200,260,00         京阪電鉄       164,000       337       55,268,00         京阪電鉄       176,000       337       59,312,00         名古屋鉄道       275,000       220       60,500,00         日本通運       315,000       334       105,210,00         ヤマトホールディングス       161,600       1,059       171,134,40         山 九       96,000       330       31,680,00         日新       37,000       206       7,622,00         丸全昭和運輸       30,000       251       7,530,00         センコー       35,000       241       8,435,00         日本梱包運輸       24,000       897       21,528,00         セイノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         神奈川中央交通       14,000       403       5,642,00         日本郵船       669,000       365       244,185,00         日本郵船       669,000       365       244,185,00         財務       33,000       365       344,195,00         大月       40,300       365       144,709,50     <	1
近畿鉄道 709,000 250 177,250,00	
阪急阪神HLDGS 527,000 380 200,260,00 南海電鉄 164,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 55,268,00 京阪電鉄 176,000 337 59,312,000 名古屋鉄道 275,000 220 60,500,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 日新 37,000 206 7,622,00 九全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 神奈川中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 前時流船 669,000 365 2441,185,00 南部三井 386,000 575 221,950,00 所の高計 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 整 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,300 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 10,056,000 296 312,576,00 至井倉庫 39,000 317 12,363,00 全日本空輸 10,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 使次倉庫 59,000 430 25,370,00 東陽倉庫 24,000 285 6,840,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 中、大 50,46,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,000	
南海電鉄       164,000       337       55,268,00         京阪電鉄       176,000       337       59,312,00         名古屋鉄道       275,000       220       60,500,00         日本通運       315,000       334       105,210,00         レマトホールディングス       161,600       1,059       171,134,40         山 九       96,000       330       31,680,00         日 新       37,000       206       7,622,00         丸全昭和運輸       30,000       251       7,530,00         センコー       35,000       241       8,435,00         日本梱包運輸       24,000       897       21,528,00         福山通運       55,000       410       22,550,00         神奈川中央交通       14,000       403       5,642,00         日立物流       13,700       1,221       16,727,70         日本郵船       669,000       365       244,185,00         南船三井       386,000       575       221,950,00         N S ユナイテッド海運       33,000       208       6,864,00         財産       40,300       365       14,709,50         第一中央汽船       40,300       365       14,709,50         第一中央汽船       56,000       213       11,928,00	-
京阪電鉄 176,000 337 59,312,00 名古屋鉄道 275,000 220 60,500,00 日本通運 315,000 334 105,210,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 日本通軍 37,000 206 7,622,00 九全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 九全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 九全昭和運輸 24,000 897 21,528,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 センコー 35,000 410 22,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 日本郷中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 所Sユナイテッド海運 33,000 365 244,185,00 所第二井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 第 5,888,20 衛野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 第一中汽船 56,000 213 11,928,00 317 12,363,00 第一中汽船 56,000 226 56,840,00	
名古屋鉄道 275,000 220 60,500,00 日本通運 315,000 334 105,210,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 日 新 37,000 206 7,622,00 丸全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 センコー 35,000 410 22,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 中奈川中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 ボミコナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 次沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 103 5,459,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00	
日本通運 315,000 334 105,210,00 ヤマトホールディングス 161,600 1,059 171,134,40 山 九 96,000 330 31,680,00 日 新 37,000 206 7,622,00 丸全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 センコー 35,000 241 8,435,00 日本相包運輸 24,000 897 21,528,00 410 22,550,00 410 32,550,00 410 403 5,642,00 525 32,550,00 410 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 高船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三共倉庫 39,000 317 12,363,00 住友倉庫 59,000 430 225,370,00 渋沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 174 5,046,00 中承陽倉庫 29,000 174 5,046,00 中來月20,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,000	
ヤマトホールディングス       161,600       1,059       171,134,40         山 九       96,000       330       31,680,00         田新       37,000       206       7,622,00         丸全昭和運輸       30,000       251       7,530,00         センコー       35,000       241       8,435,00         日本梱包運輸       24,000       897       21,528,00         福山通運       55,000       410       22,550,00         セイノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         セオノーホールディングス       62,000       525       32,550,00         中奈川中央交通       14,000       403       5,642,00         日立物流       13,700       1,221       16,727,70         日本郵船       669,000       365       244,185,00         商船三井       386,000       575       221,950,00         川崎汽船       247,000       349       86,203,00         N S ユナイテッド海運       33,000       208       6,864,00         乾 汽船       11,800       499       5,888,20         飯野海運       40,300       365       14,709,50         第一中央汽船       56,000       213       11,928,00         全日本空輸       1,056,000       296       312,576,00	
山 九 96,000 330 31,680,00日 新 37,000 206 7,622,00	
日 新 37,000 206 7,622,00 丸全昭和運輸 30,000 251 7,530,00 センコー 35,000 241 8,435,00 日本梱包運輸 24,000 897 21,528,00 福山通運 55,000 410 22,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 神奈川中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 NSユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 全日本空輸 57,000 1,061 60,477,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三菱倉庫 59,000 430 25,370,00 渋沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 103 5,459,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	
丸全昭和運輸30,0002517,530,00センコー35,0002418,435,00日本梱包運輸24,00089721,528,00福山通運55,00041022,550,00セイノーホールディングス62,00052532,550,00神奈川中央交通14,0004035,642,00日立物流13,7001,22116,727,70日本郵船669,000365244,185,00商船三井386,000575221,950,00川崎汽船247,00034986,203,00NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	1
センコー35,0002418,435,00日本梱包運輸24,00089721,528,00福山通運55,00041022,550,00セイノーホールディングス62,00052532,550,00神奈川中央交通14,0004035,642,00日立物流13,7001,22116,727,70日本郵船669,000365244,185,00商船三井386,000575221,950,00川崎汽船247,00034986,203,00NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
日本梱包運輸24,00089721,528,00福山通運55,00041022,550,00セイノーホールディングス62,00052532,550,00神奈川中央交通14,0004035,642,00日立物流13,7001,22116,727,70日本郵船669,000365244,185,00商船三井386,000575221,950,00川崎汽船247,00034986,203,00NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
福山通運 55,000 410 22,550,00 セイノーホールディングス 62,000 525 32,550,00 神奈川中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 住友倉庫 59,000 430 25,370,00 決沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 174 5,046,00 早稼음庫 29,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	
セイノーホールディングス62,00052532,550,00神奈川中央交通14,0004035,642,00日立物流13,7001,22116,727,70日本郵船669,000365244,185,00商船三井386,000575221,950,00川崎汽船247,00034986,203,00NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00性友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
神奈川中央交通 14,000 403 5,642,00 日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 住友倉庫 59,000 430 25,370,00 渋沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 103 5,459,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	
日立物流 13,700 1,221 16,727,70 日本郵船 669,000 365 244,185,00 商船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 NSユナイテッド海運 33,000 208 6,864,000 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 住友倉庫 59,000 430 25,370,00 渋沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 103 5,459,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	
日本郵船669,000365244,185,00商船三井386,000575221,950,00川崎汽船247,00034986,203,00NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
商船三井 386,000 575 221,950,00 川崎汽船 247,000 349 86,203,00 N S ユナイテッド海運 33,000 208 6,864,00 乾 汽 船 11,800 499 5,888,20 飯野海運 40,300 365 14,709,50 第一中央汽船 56,000 213 11,928,00 全日本空輸 1,056,000 296 312,576,00 三菱倉庫 57,000 1,061 60,477,00 三井倉庫 39,000 317 12,363,00 住友倉庫 59,000 430 25,370,00 渋沢倉庫 24,000 285 6,840,00 ヤマタネ 53,000 103 5,459,00 東陽倉庫 29,000 174 5,046,00 日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	
川崎汽船247,00034986,203,00N S ユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
NSユナイテッド海運33,0002086,864,00乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
乾 汽 船11,8004995,888,20飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
飯野海運40,30036514,709,50第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
第一中央汽船56,00021311,928,00全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
全日本空輸1,056,000296312,576,00三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
三菱倉庫57,0001,06160,477,00三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
三井倉庫39,00031712,363,00住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
住友倉庫59,00043025,370,00渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
渋沢倉庫24,0002856,840,00ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	)
ヤマタネ53,0001035,459,00東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
東陽倉庫29,0001745,046,00日本トランスシティ21,0002615,481,00	
日本トランスシティ 21,000 261 5,481,00	)
安田倉庫 10,100 473 4,777,30	
東洋埠頭 38,000 134 5,092,00	
上組 87,000 645 56,115,00	
郵船ロジスティクス 7,200 1,070 7,704,00	
近鉄エクスプレス 7,400 2,139 15,828,60	
バンテック 40 113,500 4,540,00	
東京放送 H D 42,500 1,080 45,900,00	
日本テレビ放送網 6,810 11,010 74,978,10	
テレビ朝日 202 116,400 23,512,80	
スカパー J S A T H D 633 28,190 17,844,27	
テレビ東京 H D 3,700 1,182 4,373,40	
アイ・ティー・シーネットワーク 18,700 415 7,760,50	
イー・アクセス 433 48,000 20,784,00	

			有価証券届出書	<u>(内国投資信託</u>
NECモバイリング	2,800	2,160	6,048,	,000
日本電信電話	333,200	3,790	1,262,828,	,000
KDDI	1,216	478,500	581,856,	,000
光通信	10,400	1,779	18,501,	,600
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,456	135,800	876,724,	,800
GMOインターネット	25,100	335	8,408,	,500
学研ホールディングス	44,000	162	7,128,	,000
ゼンリン	12,300	872	10,725,	,600
昭文社	7,400	577	4,269,	,800
角川グループHLDGS	7,700	2,040	15,708,	,000
東京電力	582,900	1,950	1,136,655,	,000
中部電力	243,300	1,978	481,247,	400
関西電力	322,300	2,013	648,789,	,900
中国電力	109,100	1,667	181,869,	,700
北陸電力	81,100	2,024	164,146,	,400
東北電力	196,700	1,822	358,387,	400
四国電力	80,100	2,435	195,043,	500
九州電力	173,700	1,856	322,387,	200
北海道電力	74,200	1,658	123,023,	
沖縄電力	5,100	3,805	19,405,	
電源開発	49,100	2,554	125,401,	
東京瓦斯	989,000	365	360,985,	
大阪瓦斯	797,000	313	249,461,	
東邦瓦斯	207,000	396	81,972,	
北海道瓦斯	31,000	240	7,440,	
西部瓦斯	97,000	204	19,788,	
静岡瓦斯	24,000	450	10,800,	
松竹	50,000	509	25,450,	
東宝	51,800	1,228	63,610,	
エイチ・アイ・エス	8,800	1,676	14,748,	
東映	35,000	358	12,530,	
NTTデータ	552	271,300	149,757,	
共立メンテナンス	4,700	1,154	5,423,	
建設技術研究所	8,000	445	3,560,	
アインファーマシーズ	2,800	2,842	7,957,	
東京テアトル	52,000	113	5,876,	
よみうりランド	24,000	281	6,744,	
東京都競馬	68,000	122	8,296,	
常磐興産	45,000	118	5,310,	<del></del>
カナモト	13,000	443	5,759,	
東京ドーム	68,000	215	14,620,	
DTS	8,500	940	7,990,	
スクウェア・エニックス・HD	25,700	1,601	41,145,	
カプコン	17,200	1,277	21,964,	
日本空港ビルデング	25,100	1,233	30,948,	
トランス・コスモス	11,900	721	8,579,	
万村工藝社	21,000	251	5,271,	
住商情報システム	8,700	1,220	10,614,	
藤田観光	24,000	382	9,168,	
日本管財	4,000	1,303	5,700,	
セコム	86,000	3,725	320,350,	
C S K	31,500	343	10,804,	
アイネス	12,600	511	6,438,	
メイテツク	12,800	1,879	24,051,	
1/ · 1 / / /	1 / XIII II	i A/ui	// 115 1	

	_		有価証券届出書(内国	国投資信託
アサツー ディ・ケイ	13,700	2,067	28,317,900	
富士ソフト	11,100	1,228	13,630,800	
応用地質	9,300	648	6,026,400	
NSD	16,100	864	13,910,400	
コナミ	35,700	1,563	55,799,100	
ベネッセホールディングス	26,000	3,830	99,580,000	
イオンディライト	9,600	1,505	14,448,000	
ニチイ学館	15,600	700	10,920,000	
ダイセキ	12,900	1,571	20,265,900	
日鐵商事	17,000	239	4,063,000	
元気寿司	5,000	806	4,030,000	
トラスコ中山	11,100	1,303	14,463,300	
ヤマダ電機	35,420	5,320	188,434,400	
オートバックスセブン	10,000	3,020	30,200,000	
アークランドサカモト	5,000	918	4,590,000	
ニトリホールディングス	15,250	7,370	112,392,500	
グルメ杵屋	12,000	416	4,992,000	
愛 眼	9,000	442	3,978,000	
吉野家ホールディングス	212	98,900	20,966,800	
加藤産業	11,600	1,268	14,708,800	
イエローハット	8,400	806	6,770,400	
富士エレクトロニクス	5,100	1,104	5,630,400	
松屋フーズ	4,000	1,280	5,120,000	
JBCCホールディングス	10,100	496	5,009,600	
サガミチェーン	12,000	502	6,024,000	
日伝	3,500	2,355	8,242,500	
因幡電機産業	9,200	2,070	19,044,000	
住金物産	42,000	176	7,392,000	
プレナス	9,600	1,209	11,606,400	
ミニストップ	6,500	1,224	7,956,000	
アークス	10,300	1,148	11,824,400	
バロー	16,300	641	10,448,300	
ミスミグループ本社	26,500	1,894	50,191,000	
ベルク	4,800	866	4,156,800	
大 庄	5,000	957	4,785,000	
タキヒヨー	19,000	376	7,144,000	
ファーストリテイリング	18,200	13,240	240,968,000	
ソフトバンク	346,300	2,900	1,004,270,000	
スズケン	32,200	2,445	78,729,000	
サンドラッグ	14,700	2,275	33,442,500	
ベルーナ	10,650	396	4,217,400	
合計	119,215,496		91,225,627,750	
				_

(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 135,000株

- (2) 株式以外の有価証券 該当事項はありません。
- 第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。
- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



「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

具旧对流仪	平成21年11月30日現在	平成22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	330,404,393	366,843,756
国債証券	33,365,251,460	31,790,733,280
地方債証券	4,097,875,571	4,860,092,226
特殊債券	5,765,306,059	6,570,148,795
社債券	6,280,247,172	6,839,224,693
未収入金	-	207,498,000
未収利息	184,512,325	206,547,506
前払費用	22,969,289	5,110,045
流動資産合計	50,046,566,269	50,846,198,301
資産合計	50,046,566,269	50,846,198,301
負債の部		
流動負債		
未払金	167,750,740	382,462,600
未払解約金	3,582,022	-
流動負債合計	171,332,762	382,462,600
負債合計	171,332,762	382,462,600
純資産の部		
元本等		
元本	1 42,125,615,868	41,807,537,065
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,749,617,639	8,656,198,636
元本等合計	49,875,233,507	50,463,735,701
純資産合計	49,875,233,507	50,463,735,701
負債純資産合計	50,046,566,269	50,846,198,301

# 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20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22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	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。	同左

# (貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在

大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

			有価証券届出書(内国投資信託受
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	26,046,441,947円	
	同期中における追加設定元本額	17,021,304,185円	3,344,297,484円
	同期中における一部解約元本額	942,130,264円	3,662,376,287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 3 0 V A (一般投資家私募)	395,753,572円	376,131,723円
	ダイワ国内重視バランスファンド 5 0 V A ( 一般投資家私募 )	2,779,471,808円	2,601,285,936円
	ダイワ国際分散バランスファンド 3 0 V A ( 一般投資家私募 )	389,440,841円	362,250,200円
	ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A ( 一般投資家私募 )	3,540,347,140円	3,395,456,274円
	D C ダイワ日本債券インデックス	2,189,587,022円	2,510,184,596円
	ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	26,082,660,375円	23,640,373,546円
	ダイワ・バランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家専用 )	3,328,015,683円	3,809,890,838円
	ダイワ国内バランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家専用 )	63,438円	627,229,851円
	ダイワ国内バランスファンド30 VA(適格機関投資家専用)	59,213円	397,790,597円
	ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	3,022,483,477円	3,644,130,813円
	ダイワライフスタイル 2 5	183,525,749円	208,419,388円
	ダイワライフスタイル 5 0	165,720,203円	183,383,805円
	ダイワライフスタイル 7 5	48,487,347円	
	計	42,125,615,868円	41,807,537,065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	42,125,615,868□	41,807,537,065□

# (金融商品に関する注記)

### (追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

# 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 金融商品に対する取組7	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」第2条 第4項に定める証券投資信託で あり、投資信託約款に規定する 「運用の基本方針」に従って おります。

2. 金融商品の内容及びリスク 当ファンドが保有する金融商 品の種類は、有価証券、金銭債 権及び金銭債務であり、その詳 細を附属明細表に記載してお ります。 これらの金融商品に係るリス クは、市場リスク(価格変動、 金利変動等)、信用リスク、流 動性リスクであります。 3. 金融商品に係るリスク管理体制 複数の部署と会議体が連携す る組織的な体制によりリスク 管理を行っております。信託財 産全体としてのリスク管理を 金融商品、リスクの種類毎に 行っております。 金融商品の時価には、市場価格 金融商品の時価等に関する事項につい ての補足説明 に基づく価額のほか、市場価格 がない場合には合理的に算定 された価額が含まれておりま す。当該価額の算定において は、一定の前提条件等を採用し ているため、異なる前提条件等 に拠った場合、当該価額が異な ることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

	世間の日のでは回じに対して子が	
	区 分	平成22年11月30日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に 関する注記に記載しておりま す。
		(2)コールローン等の金銭債権 及び金銭債務
		これらは短期間で決済される ため、時価は帳簿価額にほぼ等 しいことから、当該帳簿価額を 時価としております。

#### (有価証券に関する注記)

売買日的有価証券

	冗具日的行叫证分					
		平成21年11月30日現在		平成22年11月30日現在		
	種 類	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)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)		
	国債証券	33,365,251,460	330,256,070	212,544,060		
	地方債証券	4,097,875,571	50,774,429	2,659,285		
	特殊債券	5,765,306,059	71,310,297	7,642,900		
	社債券	6,280,247,172	81,388,437	10,436,601		

有価証券届出書(内国投資信託受益証券) 合計 49,508,680,262 533,729,233 217,997,046

(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12月2日から平成21年11月30日まで、及び平成21年12月1日から平成22年11 月30日まで)を指しております。

# (デリバティブ取引に関する注記)

(平成20年12月2日から平成21年11月30日まで)

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。

(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで) ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成22年11月30日現在

該当事項はありません。

#### (10当たり情報)

	平成21年11月30日現在	平成22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	1.1840円	1.2070円
(1万口当たり純資産額)	(11,840円)	(12,070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。

## 性式以及の右便証券

種類     銘柄     券面総額 (円)     評価額 (円)       国債証券     288 2年国債     300,000,000     300,117,6	
国債証券 288 2年国債 300,000,000 300,117,	
289 2年国債 700,000,000 700,252,	000
290 2年国債 500,000,000 500,190,	000
292 2年国債 290,000,000 290,104,4	100
2 9 5 2 年国債 250,000,000 250,082,5	500
2 9 6 2 年国債 40,000,000 39,942,	300
2 9 7 2 年国債 20,000,000 19,968,5	200
6 2 5 年国債 420,000,000 425,023,5	200
6 3 5 年国債 129,000,000 130,714,	110
6 4 5 年国債 62,000,000 63,261,	080
6 5 5 年国債 120,000,000 122,254,	300
6 6 5 年国債 205,000,000 208,359,	950
6 7 5 年国債 197,000,000 200,934,	90
6 8 5 年国債 133,000,000 135,467,	50
6 9 5 年国債 130,000,000 131,881,	00
7 0 5 年国債 92,000,000 93,249,3	360
7 1 5 年国債 25,000,000 25,624,	<b>'</b> 50
7 2 5 年国債 14,000,000 14,453,4	160
7 3 5 年国債 91,000,000 93,487,	)30
7 4 5 年国債 20,000,000 20,394,	300
7 5 5 年国債 113,000,000 115,715,3	390
7 6 5 年国債 103,000,000 105,761,4	130
7 7 5 年国債 156,000,000 159,315,	000

1		有価証券届出書(内国投資信託
78 5年国債	40,000,000	40,773,600
7 9 5 年国債	100,000,000	101,329,000
8 0 5 年国債	101,000,000	102,648,320
8 1 5 年国債	132,000,000	134,174,040
8 2 5 年国債	200,000,000	203,978,000
8 3 5 年国債	85,000,000	86,728,050
8 4 5 年国債	133,000,000	134,771,560
8 5 5 年国債	377,000,000	381,942,470
8 6 5 年国債	156,000,000	157,460,160
87 5年国債	285,000,000	286,362,300
88 5年国債	673,000,000	675,692,000
8 9 5 年国債	228,000,000	227,794,800
90 5年国債	400,000,000	397,944,000
9 1 5 年国債	75,000,000	74,859,000
9 2 5 年国債	130,000,000	129,144,600
1 40年国債	85,000,000	91,287,450
2 40年国債	131,000,000	134,064,090
3 40年国債	31,000,000	31,735,630
2 3 5 1 0 年国債	78,000,000	79,010,100
236 10年国債	68,000,000	68,952,000
237 10年国債	43,000,000	43,737,880
238 10年国債	88,000,000	89,396,560
239 10年国債	35,000,000	35,657,650
2 4 0 1 0 年国債	3,000,000	3,051,750
2 4 1 1 0 年国債	48,000,000	48,958,560
2 4 2 1 0 年国債	19,000,000	19,345,420
2 4 3 1 0 年国債	36,000,000	36,590,040
2 4 4 1 0 年国債	60,000,000	60,990,600
2 4 5 1 0 年国債	62,000,000	62,897,140
2 4 6 1 0 年国債	25,000,000	25,310,750
2 4 7 1 0 年国債	48,000,000	48,651,840
2 4 8 1 0 年国債	6,000,000	6,067,740
250 10年国債	34,000,000	34,240,720
251 10年国債	30,000,000	30,516,300
252 10年国債	55,000,000	56,085,700
253 10年国債	30,000,000	31,137,900
254 10年国債	85,000,000	87,751,450
255 10年国債	72,000,000	74,530,800
256 10年国債	105,000,000	108,617,250
257 10年国債	20,000,000	20,628,600
258 10年国債	138,000,000	142,545,720
259 10年国債	155,000,000	161,117,850
260 10年国債	49,000,000	51,189,320
261 10年国債	124,000,000	130,409,560
262 10年国債	76,000,000	80,195,200
263 10年国債	145,000,000	151,819,350
264 10年国債	223,000,000	232,653,670
265 10年国債	152,000,000	158,815,680
266 10年国債	78,000,000	81,186,300
267 10年国債	117,000,000	121,313,790
268 10年国債	172,000,000	179,984,240
269 10年国債	298,000,000	309,318,040
270 10年国債	185,000,000	192,303,800
271 10年国債	72,000,000	74,520,720
272 10年国債	58,000,000	60,644,220
273 10年国債	161,000,000	169,096,690
274 10年国債	107,000,000	112,543,670
2/4   0 十四原	107,000,000	112,043,070

1	1	有価証券届出書(内国投資信託
275 10年国債	25,000,000	26,171,750
276 10年国債	50,000,000	52,837,000
277 10年国債	133,000,000	140,724,640
278 10年国債	104,000,000	111,114,640
279 10年国債	121,000,000	130,527,540
280 10年国債	222,000,000	238,703,280
281 10年国債	68,000,000	73,483,520
282 10年国債	200,000,000	212,980,000
283 10年国債	135,000,000	144,520,200
284 10年国債	311,000,000	331,442,030
285 10年国債	220,000,000	234,531,000
286 10年国債	195,000,000	209,143,350
287 10年国債	190,000,000	204,973,900
288 10年国債	652,000,000	694,751,640
289 10年国債	174,000,000	182,917,500
290 10年国債	121,000,000	126,263,500
291 10年国債	204,000,000	211,464,360
292 10年国債	247,000,000	263,134,040
293 10年国債	138,000,000	147,818,700
294 10年国債	161,000,000	171,249,260
295 10年国債	200,000,000	209,812,000
296 10年国債	428,000,000	
297 10年国債		448,175,920
	231,000,000	239,574,720
298 10年国債	177,000,000	182,175,480
299 10年国債	323,000,000	331,688,700
300 10年国債	230,000,000	239,816,400
3 0 1 1 0 年国債	456,000,000	474,509,040
3 0 2 1 0 年国債	201,000,000	207,492,300
303 10年国債	467,000,000	480,935,280
3 0 4 1 0 年国債	170,000,000	173,631,200
3 0 5 1 0 年国債	757,000,000	770,724,410
3 0 6 1 0 年国債	357,000,000	365,564,430
3 0 7 1 0 年国債	340,000,000	345,293,800
308 10年国債	115,000,000	116,532,950
309 10年国債	517,000,000	514,554,590
3 1 0 1 0 年国債	156,000,000	153,466,560
3 1 1 1 0 年国債	215,000,000	207,642,700
1 30年国債	16,000,000	18,183,360
2 30年国債	24,000,000	25,707,120
3 30年国債	30,000,000	31,659,600
4 30年国債	30,000,000	34,542,000
5 30年国債	28,000,000	29,023,680
6 30年国債	24,000,000	25,626,000
7 30年国債	37,000,000	38,841,490
8 30年国債	19,000,000	18,266,600
9 30年国債	37,000,000	32,898,550
10 30年国債	39,000,000	32,607,510
1 1 3 0 年国債	44,000,000	41,433,480
1 2 3 0 年国債	39,000,000	39,455,910
13 30年国債	36,000,000	35,746,200
14 30年国債	52,000,000	55,348,800
15 30年国債	39,000,000	42,222,570
16 30年国債	55,000,000	59,577,650
17 30年国債	45,000,000	47,922,300
18 30年国債	55,000,000	57,509,100
19 30年国債	55,000,000	57,574,000
20 30年国債	52,000,000	
20 30 十国限	52,000,000	56,450,160

1		有価証券届出書(内国投資信託:
2 1 3 0 年国債	48,000,000	50,277,120
22 30年国債	60,000,000	65,148,000
23 30年国債	60,000,000	65,127,000
2 4 3 0 年国債	54,000,000	58,644,540
25 30年国債	65,000,000	68,047,850
26 30年国債	134,000,000	142,866,780
27 30年国債	126,000,000	136,990,980
28 30年国債	130,000,000	141,350,300
29 30年国債	173,000,000	184,537,370
30 30年国債	168,000,000	175,677,600
3 1 3 0 年国債	189,000,000	193,781,700
3 2 3 0 年国債	198,000,000	207,248,580
3 3 3 0 年国債	68,000,000	66,753,560
2 2 利付国債 2 0 年	3,000,000	3,349,230
23 利付国債20年	2,000,000	2,293,260
2 4 利付国債 2 0 年	4,000,000	4,577,640
2 6 利付国債 2 0 年	4,000,000	4,622,960
28 利付国債20年	6,000,000	7,173,960
29 利付国債20年	7,000,000	8,248,800
3 0 利付国債20年	30,000,000	34,638,000
3 1 利付国債 2 0 年	18,000,000	20,845,080
3 2 利付国債 2 0 年	16,000,000	18,694,560
3 3 利付国債 2 0 年	22,000,000	26,082,760
3 4 利付国債20年	9,000,000	10,608,480
3 5 利付国債 2 0 年	22,000,000	25,672,020
3 6 利付国債 2 0 年	21,000,000	24,180,870
3 7 利付国債 2 0 年	23,000,000	26,633,310
3 8 利付国債 2 0 年	60,000,000	68,090,400
39 20年国債	90,000,000	101,477,700
40 20年国債	57,000,000	63,136,050
41 20年国債	151,000,000	157,444,680
42 20年国債	87,000,000	98,261,280
43 20年国債	105,000,000	121,033,500
4 4 2 0 年国債	85,000,000	95,273,950
45 20年国債	78,000,000	86,768,760
46 20年国債	73,000,000	79,870,760
47 20年国債	89,000,000	97,316,160
48 20年国債	54,000,000	60,566,940
49 20年国債	64,000,000	69,374,720
50 20年国債	107,000,000	113,968,910
51 20年国債	57,000,000	61,154,730
52 20年国債	52,000,000	56,259,320
53 20年国債	66,000,000	71,306,400
54 20年国債	65,000,000	70,890,300
5 5 2 0 年国債 5 6 2 0 年国債	79,000,000 71,000,000	84,405,180 75,760,550
57 20年国債	71,000,000	75,760,550
58 20年国債	81,000,000	73,955,700
		85,446,090
	92,000,000	94,893,400
	72,000,000	71,925,840
	86,000,000	81,749,020
	65,000,000	60,069,100
	90,000,000	93,343,500
6 4 2 0 年国債 6 5 2 0 年国債	99,000,000	103,584,690
1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	103,000,000	107,494,920
	32,000,000	33,029,440
67 20年国債	40,000,000	41,657,600

		有価証券届出書(内国投資信託
68 20年国債	51,000,000	54,956,580
6 9 2 0 年国債	113,000,000	120,446,700
70 20年国債	93,000,000	102,307,440
7 1 2 0 年国債	67,000,000	72,117,460
72 20年国債	163,000,000	173,091,330
7 3 2 0 年国債	72,000,000	75,432,240
7 4 2 0 年国債	80,000,000	84,830,400
7 5 2 0 年国債	63,000,000	66,664,080
7 6 2 0 年国債	71,000,000	73,349,390
77 20年国債	65,000,000	67,945,150
78 20年国債	71,000,000	73,124,320
7 9 2 0 年国債	69,000,000	71,959,410
80 20年国債	60,000,000	63,352,800
8 1 2 0 年国債	73,000,000	75,947,740
82 20年国債	125,000,000	131,767,500
83 20年国債	83,000,000	87,344,220
84 20年国債	111,000,000	115,265,730
85 20年国債	95,000,000	99,672,100
86 20年国債	55,000,000	59,184,950
87 20年国債	72,000,000	76,554,720
88 20年国債	130,000,000	139,590,100
89 20年国債	83,000,000	87,994,110
9020年国債	144,000,000	
		152,396,640
7.1.12.7	75,000,000	80,403,000
9 2 2 0 年国債	209,000,000	217,890,860
9320年国債	81,000,000	83,197,530
9 4 2 0 年国債	137,000,000	142,626,590
9 5 2 0 年国債	128,000,000	136,593,920
9620年国債	97,000,000	100,773,300
97 20年国債	125,000,000	131,363,750
9820年国債	95,000,000	98,484,600
9 9 2 0 年国債	220,000,000	227,717,600
100 20年国債	170,000,000	178,262,000
101 20年国債	43,000,000	46,341,100
102 20年国債	103,000,000	110,944,390
103 20年国債	67,000,000	71,182,140
104 20年国債	85,000,000	87,814,350
105 20年国債	176,000,000	181,647,840
106 20年国債	87,000,000	91,076,820
107 20年国債	66,000,000	68,047,980
108 20年国債	208,000,000	208,139,360
109 20年国債	83,000,000	82,887,120
1 1 0 2 0 年国債	163,000,000	167,766,120
1 1 1 2 0 年国債	89,000,000	92,724,650
1 1 2 2 0 年国債	207,000,000	212,675,940
113 20年国債	306,000,000	313,824,420
114 20年国債	207,000,000	211,899,690
1 1 5 2 0 年国債	97,000,000	100,787,850
116 20年国債	98,000,000	101,719,100
117 20年国債	236,000,000	241,130,640
1 1 8 2 0 年国債	69,000,000	69,340,860
1 1 9 2 0 年国債	68,000,000	66,134,760
120 20年国債	180,000,000	169,286,400
121 20年国債	86,000,000	85,021,320
1 2 2 2 0 年国債	64,000,000	62,184,320
国債証券 合計	30,713,000,000	31,790,733,280
		- , , ,

			有価証券届出書 ( 内国投資信託
地方債証券	583 東京都公債	100,000,000	101,707,300
	595 東京都公債	100,000,000	101,219,800
	604 東京都公債	120,000,000	124,261,920
	608 東京都公債	100,000,000	103,980,300
	635 東京都公債	100,000,000	107,645,500
	6 5 1 東京都公債	100,000,000	105,558,000
	654 東京都公債	104,000,000	109,351,320
	139 神奈川県公債	100,000,000	107,114,900
	163 神奈川県公債	100,000,000	102,575,500
	267 大阪府公債	100,000,000	103,852,100
	308 大阪府公債	112,000,000	118,052,368
	2 8 大阪府 5 年	100,000,000	101,398,400
	17-8 兵庫県公債	100,000,000	103,814,000
	17-7 静岡県公債	100,000,000	105,876,400
	1 4 - 2 愛知県公債	120,000,000	122,360,400
	2 0 - 6 愛知県公債	100,000,000	105,504,200
	17-2 広島県公債	100,000,000	104,716,400
	1 4 - 1 埼玉県公債	128,500,000	130,616,266
	17-5 埼玉県公債	100,000,000	104,188,100
	19-8 福岡県公債	100,000,000	105,243,900
	2 1 - 6 千葉県公債	100,000,000	102,327,600
	16-1 新潟県公債	100,000,000	104,049,300
	6 共同発行地方債	110,100,000	114,034,863
	8 共同発行地方債	111,000,000	115,157,061
	12 共同発行地方	120,000,000	124,043,640
	1 4 共同発行地方	100,000,000	103,803,900
	15 共同発行地方	100,000,000	104,211,900
	2 4 共同発行地方	100,000,000	104,316,900
	27 共同発行地方	100,000,000	103,583,200
	3 0 共同発行地方	100,000,000	103,704,600
	4 1 共同発行地方	100,000,000	107,667,800
	5 1 共同発行地方	100,000,000	107,333,500
	5 7 共同発行地方	100,000,000	105,560,200
	6 1 共同発行地方	100,000,000	104,752,300
	19-2 大阪市公債	100,000,000	106,336,600
	12-ゆ 名古屋市債	100,000,000	103,360,200
	12-ひ 名古屋市債	100,000,000	103,616,700
	20-3 京都市5年	100,000,000	101,688,500
	14-1 横浜市公債	116,000,000	118,108,068
	14-5 横浜市公債	100,000,000	101,161,100
	17-4 横浜市公債	100,000,000	104,875,700
	19-5 札幌市5年	100,000,000	101,939,500
	76 川崎市公債	100,000,000	101,190,200
	16 川崎市5年	100,000,000	102,117,400
	18 川崎市5年	140,000,000	142,114,420
地方債証券 おおおおお かんかん かんかん かんかん かんかん かんかん かんかん かん	<del>.</del>	4,681,600,000	4,860,092,226
特殊債券	6 政保政策投資 B K	118,000,000	119,510,872
	7 日本政策投資CO	100,000,000	101,192,700
	27 日本政策投資 B	100,000,000	107,530,700
	3 1 7 政保道路債	72,000,000	72,456,768
	3 1 9 政保道路債	147,000,000	149,518,257
	323 政保道路債	119,000,000	123,356,233
	328 政保道路債	112,000,000	116,461,408
	331 政保道路債	149,000,000	156,853,939
	333 政保道路債	115,000,000	120,344,510
	334 政保道路債	100,000,000	104,308,400
1		100,000,000	101,000,-100

	i i	有1個証分由工者(内国)	
1 3 道路機構	100,000,000	107,147,800	
1 5 道路機構	100,000,000	107,747,700	
3 2 道路機構	100,000,000	104,941,900	
1 政保道路機構	124,000,000	130,243,524	
2 3 政保道路機構	100,000,000	106,376,800	
2 7 政保道路機構	100,000,000	107,017,600	
3 0 政保道路機構	112,000,000	119,186,704	
3 3 政保道路機構	100,000,000	106,412,300	
47 政保道路機構	100,000,000	104,877,500	
6 6 政保道路機構	100,000,000	104,432,400	
3 7 道路債券	100,000,000	104,279,200	
8 1 6 政保公営企業	116,000,000	118,142,868	
8 1 8 政保公営企業	128,000,000	130,399,616	
8 1 9 政保公営企業	103,000,000	105,015,504	
828 政保公営企業	100,000,000	100,633,200	
829 政保公営企業	139,000,000	142,076,487	
831 政保公営企業	125,000,000	129,653,375	
842 政保公営企業	111,000,000	116,839,155	
	, ,		
8 6 8 政保公営企業 1 公営企業 5 年	100,000,000	106,888,000 101,798,600	
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
2 政保地方公営機	100,000,000	105,075,600	
190 政保首都高速	10,000,000	10,351,950	
6 首都高速道路	100,000,000	101,099,600	
13 首都高速道路	100,000,000	104,017,000	
6 国際協力銀行	100,000,000	101,658,400	
2 7 国際協力銀行	100,000,000	106,461,100	
3 2 2 東京交通債	100,000,000	114,059,900	
3 9 政保関西空港	100,000,000	100,623,100	
2 1 関西空港	100,000,000	100,770,600	
5 政保中部空港	36,000,000	36,464,400	
2 住宅支援機構	100,000,000	106,385,400	
7 政保国民生活	38,000,000	38,743,774	
1 4 政保国民生活	179,000,000	186,498,131	
2 成田国際空港	100,000,000	105,056,300	
い694 利付商工債	100,000,000	101,818,700	
い697 利付商工債	100,000,000	102,882,200	
い682 利付農林債	100,000,000	101,218,100	
い686 利付農林債	100,000,000	102,090,100	
い692 利付農林債	100,000,000	101,714,500	
い694 利付農林債	100,000,000	101,699,300	
2 1 0 信金中金	100,000,000	101,507,400	
2 1 1 信金中金	100,000,000	101,907,500	1
2 2 0 信金中金	100,000,000	101,699,000	
2 3 0 信金中金	100,000,000	102,578,200	
1 1 8 利付商工債	100,000,000	100,510,400	
1アフリカ開発銀行SUB	170,000,000	190,599,920	
1 1 アンデス開発公社	100,000,000	99,967,100	
2 4 政保中日本道	100,000,000	102,592,500	
1 中日本高速道路	100,000,000	102,332,300	
2 中日本高速道路	100,000,000	103,718,800	
5 中日本高速道路	100,000,000	104,339,700	
特殊債券 合計	6,323,000,000	6,570,148,795	1
社債券   7 GEキヤピタル   6 ボールドラン サックス	100,000,000	100,519,600	
6 ゴールドマン サツクス	100,000,000	99,558,800	
6 ドイツ銀行 A Gシドニー	100,000,000	100,219,500	
1 オーストラリアコモンウエルス	100,000,000	101,769,300	

1		有価証券届出書(内国投資信託
2 AUST・NZ銀行	100,000,000	101,065,900
1 三越伊勢丹 H D	100,000,000	100,385,600
3 6 三井化学	100,000,000	101,205,100
3 塩野義製薬	100,000,000	102,263,100
2 3 新日本石油	100,000,000	101,185,900
5 4 新日本製鐵	100,000,000	102,320,000
13 豊田自動織機	100,000,000	103,689,100
15 ダイキン工業	100,000,000	103,834,100
1 4 日立製作所	100,000,000	104,303,400
4 3 日本電気	100,000,000	99,724,200
6 パナソニツク	100,000,000	101,078,400
19 ソニー	100,000,000	102,677,200
5 デンソー	100,000,000	102,899,100
20 三菱重工業	100,000,000	102,005,900
3 4 石川島播磨	100,000,000	103,563,000
6 トヨタ自動車	200,000,000	203,695,400
9 トヨタ自動車	100,000,000	102,153,900
60 丸紅	100,000,000	101,374,900
68 丸紅	100,000,000	103,296,800
1 みずほコーポ劣後	100,000,000	104,480,100
12 みずほコーポレート	100,000,000	102,093,500
100三菱東京UFJBK	100,000,000	102,580,700
3 UFJ銀行 SUB	100,000,000	101,983,200
2 三菱信託BK劣後	100,000,000	101,963,200
	100,000,000	100,972,400
10 ホンダフアイナンス	100,000,000	101,788,300
40 トヨタフアイナンス	100,000,000	103,544,700
48 アコム	100,000,000	97,303,700
131 <b>オリックス</b>	100,000,000	104,088,800
6 三菱UFJリース	100,000,000	101,418,800
1 - B 日本生命 2 0 0 9	100,000,000	103,504,100
8 三井不動産	100,000,000	106,484,500
6 6 三菱地所	100,000,000	101,007,000
14 東急不動産	100,000,000	101,838,900
6 1 住友不動産	100,000,000	103,396,800
7 ジヤパンリアルエステイト	100,000,000	101,561,300
2 日本リテールフアンド	100,000,000	103,191,300
1 オリツクス不動産投	100,000,000	101,892,000
10 相模鉄道	100,000,000	104,099,500
18東日本旅客鉄道	100,000,000	101,814,300
35東日本旅客鉄道	100,000,000	100,919,100
28 東海旅客鉄道	100,000,000	106,972,200
4 日本通運	100,000,000	102,291,600
2 6 日本郵船	100,000,000	102,017,300
49 電信電話債	100,000,000	104,257,100
15 NTTFJE	100,000,000	107,446,000
473 東京電力	100,000,000	102,900,900
4 9 5 東京電力	128,000,000	130,275,328
5 1 3 東京電力	139,000,000	146,054,250
5 1 6 東京電力	142,000,000	147,525,646
5 2 1 東京電力	100,000,000	107,263,600
405 中部電力	100,000,000	115,755,500
474 中部電力	100,000,000	105,685,100
440 関西電力	100,000,000	104,834,200
472 関西電力	100,000,000	105,961,400
306 中国電力	100,000,000	116,838,900
328 中国電力	111,000,000	
」20 中国电力	111,000,000	114,713,949

EDINET提出書類

大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

	261 北海道電力	6,000,000	6,781,920	
	16 電源開発	100,000,000	107,257,000	
	2 4 東京瓦斯	100,000,000	103,106,600	
	20 NTTデータ	100,000,000	101,903,200	
社債券 合計		6,626,000,000	6,839,224,693	
合計		48,343,600,000	50,060,198,994	

- 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。



「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

貝目以無衣	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		` ,
流動資産		
預金	283,929,513	119,178,636
コール・ローン	114,931,400	47,911,852
株式	43,183,357,005	44,215,875,431
投資証券	574,397,700	693,359,317
派生商品評価勘定	30,062,303	36,101,498
未収入金	39,115,351	116,384,318
未収配当金	99,566,613	97,279,344
差入委託証拠金	181,887,438	236,676,383
流動資産合計	44,507,247,323	45,562,766,779
資産合計	44,507,247,323	45,562,766,779
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	820
未払金	73,591,446	59,444,431
未払解約金	98,807,000	49,200,000
流動負債合計	172,398,446	108,645,251
負債合計	172,398,446	108,645,251
純資産の部		
元本等		
元本 1	52,731,230,778	52,126,031,241
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( ) 2	8,396,381,901	6,671,909,713
元本等合計	44,334,848,877	45,454,121,528
純資産合計	44,334,848,877	45,454,121,528
負債純資産合計	44,507,247,323	45,562,766,779

# 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20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1.	有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式	(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。	同左
		(2)投資証券	(2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として 同左 |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. デリバティブ取引の評価基準及|(1)先物取引 (1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価 同左 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。 (2)為替予約取引 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価 同左 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。

受取配当金 受取配当金 原則として、株式及び投資証券の 同左 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。

4. その他財務諸表作成のための基外貨建取引等の処理基準 本となる重要な事項

び評価方法

3. 収益及び費用の計上基準

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21年11月30日現在	平成22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	43,835,021,720円	52,731,230,778円	
同期中における追加設定元本額	15,158,958,941円	7,273,699,166円	
同期中における一部解約元本額	6,262,749,883円	7,878,898,703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	1,987,953,358円	1,949,068,368円	
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	109,864,137円	108,815,688円	
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	1,712,103,233円	1,543,921,087円	
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	231,531,734円	217,611,180円	
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	5,350,393,621円	4,881,089,070円	
DCダイワ外国株式インデックス	10,512,977,323円	13,076,995,518円	
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	474,924,269円	491,350,806円	
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	36,625,859円	76,132,151円	
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	22,344,684円	53,087,790円	
大和 D C 海外株式インデックス ファンド	1,252,024,659円	1,414,979,097円	
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	4,356,044円	5,200,339円	
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	1,827,810円	4,289,919円	
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	419,525円	309,320円	
ダイワ世界分散バランスファンド 1 5 V A	145,940,796円	128,427,020円	
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	2,128,512,519円	1,889,067,515円	
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	42,781,130円	43,329,047円	

	有価証券届出書(内国投資信託
453,192,749円	
6,897,256,021円	6,570,917,361円
1,615,740,214円	1,598,318,957円
16,777,951,661円	14,181,213,813円
593,030,311円	683,438,883円
2,252,382,065円	2,634,664,841円
19,314,099円	22,882,837円
57,112,849円	65,046,051円
50,670,108円	53,975,786円
52,731,230,778円	52,126,031,241円
52,731,230,778□	52,126,031,241□
本総額を下回っており、その差	本総額を下回っており、その差
	453,192,749円 6,897,256,021円 1,615,740,214円 16,777,951,661円 593,030,311円 2,252,382,065円 19,314,099円 57,112,849円 50,670,108円 52,731,230,778円 52,731,230,778口 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。

# (金融商品に関する注記)

# (追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

#### 金融商品の状況に関する事項

2	は既向叩りが近に関する事項	
	区 分	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. :	金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」第2条 第4項に定める証券投資信託で あり、投資信託約款に規定する 「運用の基本方針」に従って おります。
2.	金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項につい ての補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に第立までは、一定の前提条件等を採用は、一定の前提条件等を採用のであた場合、当該価額の算定に関するをは、一定の前提条件等を表しているため、異なる前提条が開発を表します。 デリバティブ取引に関する契約額等についてイブ取引に係るがデリバティすものではありません。

#### 金融商品の時価等に関する事項

	区分	平成22年11月30日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に 関する注記に記載しておりま す。
		(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注 記に記載しております。
		(3)コールローン等の金銭債権 及び金銭債務
		これらは短期間で決済される ため、時価は帳簿価額にほぼ等 しいことから、当該帳簿価額を 時価としております。

#### (有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成21年11月30日現在		平成22年11月30日現在	
種 類	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)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	43,183,357,005	8,089,591,757	2,823,064,120	
投資証券	574,397,700	83,321,877	92,720,905	
合計	43,757,754,705	8,172,913,634	2,915,785,025	

<sup>(</sup>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12月2日から平成21年11月30日まで、及び平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)を指しております。

# (デリバティブ取引に関する注記) (平成20年12月2日から平成21年11月30日まで)

取引の状況に関する事項

	取りの仏流に関する事項	
	区分	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。
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、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。
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。
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。

## 取引の時価等に関する事項

# 1. 株式関連

1. 休式说理						
	平成21年11月30日 現在					
種 類	契約額等		時価	評価損益		
	(円)	うち 1 年超	(円)	(円)		
市場取引						

株価指数先物取引				
買建	537,414,667	-	567,476,970	30,062,303
合計	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

該当事項はありません。

(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

TT PREVIXIE		平成22年11月30日 現在					
種 類	契約額等		時価	評価損益			
	(円)	うち	(円)	(円)			
		1 年超					
市場取引							
株価指数先物取引							
買建	488,827,095	-	524,928,363	36,101,268			
合計	488,827,095	-	524,928,363	36,101,268			

#### (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

		平成22年11月30日 現在				
種 類	契約額等		時価	評価損益		
	(円)	うち	(円)	(円)		
		1 年超				
市場取引以外の取引						
   為替予約取引						

買建	33,233,590	-	33,233,000	590
カナダ・ドル 香港・ドル	8,278,820 24,954,770		8,278,000 24,955,000	
合計	33,233,590	-	33,233,000	590

### (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。

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

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

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

#### (10当たり情報)

	平成21年11月30日現在	平成22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	0.8408円	0.8720円
(1万口当たり純資産額)	(8,408円)	(8,720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		備者
			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	1,500	122.350	183,525.000	
	AVON PRODUCTS	10,700	28.710	307,197.000	)
	ABBOTT LABS	39,800	46.490	1,850,302.000	)
	ALCOA	28,100	13.290	373,449.000	)
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	2,900	30.080	87,232.000	)
	LAS VEGAS SANDS CORP	7,500	50.500	378,750.000	)
	AMPHENOL CORP-CL A	4,300	50.610	217,623.000	)
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,029	27.130	163,566.770	)
	LENDER PROCESSING SERVICE	2,800	31.160	87,248.000	)
	VALIDUS HOLDINGS LTD	2,700	29.350	79,245.000	)
	ALLEGHENY ENERGY INC	4,300	23.070	99,201.000	)
	AFLAC INC	11,900	52.170	620,823.000	)
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,500	49.260	172,410.000	)
	HANSEN NATURAL CORPORATIO	2,200	53.130	116,886.000	)
	ADOBE SYSTEMS	13,200	28.360	374,352.000	)
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,900	122.060	231,914.000	

			有価証券届出書(内国投	資信託
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	12.360	128,544.000	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	66.110	118,998.000	
GARMIN LTD	3,900	29.180	113,802.000	
AETNA INC	11,600	30.160	349,856.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,300	85.820	454,846.000	
ALTERA CORPORATION	8,000	35.470	283,760.000	
FORTUNE BRANDS INC	4,100	59.250	242,925.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL	18,500	49.930	923,705.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	15.190	64,572.690	
WR BERKLEY CORP	4,700	27.030	127,041.000	
AUTOZONE INC	700	257.800	180,460.000	
DOLLAR TREE INC	3,750	55.180	206,925.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,400	40.400	137,360.000	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	3,000	51.550	154,650.000	
CELANESE CORP-SERIES A	5,400	36.360	196,344.000	
D.R.HORTON INC	7,366	9.870	72,702.420	
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	4,600	31.190	143,474.000	
AUTODESK INC	5,600	35.520	198,912.000	
MOODY'S CORP	5,500	26.720	146,960.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	10,700	70.460	753,922.000	
CONSOL ENERGY INC	6,200	42.800	265,360.000	
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	36.360	116,352.000	
CITIGROUP INC	618,933	4.150	2,568,571.950	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,800	45.060	576,768.000	
AMERICAN ELEC POWER	12,900	35.680	460,272.000	
DUN&BRADSTREET CORP	1,700	75.450	128,265.000	
HESS CORP	7,700	70.120	539,924.000	
COVIDIEN PLC	12,425	42.300	525,577.500	
DAVITA INC	2,800	72.280	202,384.000	
DANAHER CORP	13,800	43.330	597,954.000	
AVNET INC	5,200	31.340	162,968.000	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,600	112.920	180,672.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	16,300	28.880	470,744.000	
PEABODY ENERGY CORP	6,700	58.820	394,094.000	
BUNGE LIMITED	3,400	60.780 30.820	206,652.000	
APPLE INC	11,325 23,500		349,036.500	
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	·	316.870 18.420	7,446,445.000	
BOEING CO	14,900	64.360	274,458.000 1,100,556.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,100 4,415	30.120		
MEADWESTVACO CORP	4,800	25.200	132,979.800 120,960.000	
SPECTRA ENERGY CORP	16,196	23.850	386,274.600	
BECTON DICKINSON & CO	5,900	78.050	460,495.000	
SAIC INC	10,200	15.330	156,366.000	
NISOURCE INC	6,500	16.860	109,590.000	
JOY GLOBAL INC	2,500	76.320	190,800.000	
BMC SOFTWARE INC	4,400	44.360	195,184.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	73.520	323,488.000	
ALPHA NATURAL RESOURCES I	3,400	50.030	170,102.000	
BARD(C.R.) INC	2,700	85.040	229,608.000	
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	2,200	89.080	195,976.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	31,171	27.190	847,539.490	
VERIZON COMMUNICATIONS	72,100	31.900	2,299,990.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	21,200	79.510	1,685,612.000	
H&R BLOCK INC	8,800	12.830	112,904.000	
BB&T CORPORATION	17,500	23.700	414,750.000	
BECKMAN COULTER INC	2,100	55.650	116,865.000	
	_,	00.000	,000.000	

			有価証券届出書(内国投資信託
HOSPIRA INC	4,520	56.310	254,521.200
BROADCOM CORP-CL A	11,250	45.070	507,037.500
BAKER HUGHES INC	11,523	50.780	585,137.940
BRISTOL MYERS SQUIBB	43,800	25.420	1,113,396.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	69.350	131,765.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	13.630	97,290.940
JPMORGAN CHASE & CO	101,520	37.910	3,848,623.200
LEGG MASON INC	4,950	32.740	162,063.000
T ROWE PRICE GROUP INC	6,400	58.340	373,376.000
CIGNA CORP	7,600	36.920	280,592.000
COMPUTER SCIENCES CORP	3,700	45.100	166,870.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,800	61.230	110,214.000
FRONTIER COMMUNICATIONS	27,442	9.120	250,271.040
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,400	64.790	155,496.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,960	52.530	365,608.800
WHITE MOUNTAINS INSURANCE	200	321.660	64,332.000
CATERPILLAR INC DEL	16,300	83.670	1,363,821.000
GENWORTH FINANCIAL INC-A	13,700	11.650	159,605.000
PETROHAWK ENERGY CORP	7,800	18.040	140,712.000
CHARLES RIVER LABORATORIE	2,000	32.830	65,660.000
VIRGIN MEDIA INC	7,600	25.730	195,548.000
MOSAIC CO/THE	4,200	68.320	286,944.000
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,100	59.760	304,776.000
CORNING INC	,		
CISCO SYSTEMS	40,100	17.830	714,983.000
	148,300	19.440	2,882,952.000
DU PONT	23,100	46.920	1,083,852.000
MORGAN STANLEY	31,300	24.920	779,996.000
DOW CHEMICAL	29,700	31.280	929,016.000
DELL INC	44,800	13.570	607,936.000
DTE ENERGY COMPANY	4,100	44.810	183,721.000
DEVRY INC	1,800	43.590	78,462.000
TELEPHONE AND DATA SYSTEM	1,500	35.960	53,940.000
AGCO CORP	2,800	44.640	124,992.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,200	41.610	632,472.000
DENBURY RESOURCES INC	11,200	18.330	205,296.000
DEERE & CO	10,900	75.180	819,462.000
AIRGAS INC	1,800	61.750	111,150.000
QUANTA SERVICES INC	5,300	17.840	94,552.000
TIME WARNER INC	29,333	29.900	877,056.700
VMWARE INC-CLASS A	1,800	81.370	146,466.000
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	38.230	141,451.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	21.480	83,772.000
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	4,950	16.730	82,813.500
CONSOLIDATED EDISON INC	7,600	48.020	364,952.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,900	36.780	106,662.000
JEFFERIES GROUP INC(NEW)	3,500	24.280	84,980.000
NYSE EURONEXT	7,100	27.990	198,729.000
COLGATE PALMOLIVE CO	12,300	77.190	949,437.000
AMETEK INC	3,100	58.100	180,110.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,000	65.320	130,640.000
COSTCO WHOLESALE CORP	11,700	66.970	783,549.000
SCANA CORP	3,500	40.800	142,800.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,200	26.250	136,500.000
CUMMINS INC	4,900	97.270	476,623.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,500	11.740	158,490.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	34.300	120,050.000
LORILLARD INC			
LUNILLARU INU	4,000	81.630	326,520.000

			有価証券届出書(内国投資信託
PROGRESS ENERGY INC	7,500	43.830	328,725.000
CABOT OIL & GAS CORP	3,600	34.880	125,568.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	12.170	88,841.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	64.070	96,105.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,600	48.760	126,776.000
COCA COLA CO	52,600	63.390	3,334,314.000
COCA-COLA ENTERPRISES	7,600	24.060	182,856.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	52.720	300,504.000
EATON VANCE CORP	3,700	30.080	111,296.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	4,200	54.320	228,144.000
FMC TECHNOLOGIES INC	3,300	84.540	278,982.000
FRANKLIN RESOURCES INC	4,100	114.510	469,491.000
CSX CORP	9,700	61.780	599,266.000
FLUOR CORP	4,800	57.980	278,304.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,900	81.170	235,393.000
EXPEDIA INC	4,850	26.780	129,883.000
AMAZON.COM INC	9,100	179.490	1,633,359.000
FLOWSERVE CORP	1,500	106.130	159,195.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,700	66.640	179,928.000
EXXON MOBIL CORP	130,255	69.450	9,046,209.750
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	62.870	100,592.000
FLIR SYSTEMS INC	3,800	27.180	103,284.000
AES CORP	19,200	10.860	208,512.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	3,200	70.940	227,008.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,900	84.120	159,828.000
EOG RESOURCES INC	6,300	89.220	562,086.000
EQUITABLE RESOURCES INC	3,400	40.340	137,156.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	4,200	51.850	217,770.000
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	50.820	523,446.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	30.860	219,106.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,590	35.650	341,883.500
FORD MOTOR CO	78,323	16.060	1,257,867.380
MACY'S INC	10,598	25.420	269,401.160
ARCH COAL INC	4,300	29.670	127,581.000
FOSTER WHEELER AG	4,600	29.110	133,906.000
DISCOVERY COMMUNICATION-A		41.440	134,265.600
FOREST LABORATORIES INC	3,240	32.480	243,600.000
LIBERTY GLOBAL INC	7,500 3,735	36.320	135,655.200
DISCOVERY COMMUNICATION-C WARNER CHILCOTT PLC-CL A	4,240	36.060	152,894.400
	3,300	19.620 50.700	64,746.000
NEXTERA ENERGY INC	9,900		501,930.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER	10,704	101.300	1,084,315.200
US BANCORP	48,300	24.100	1,164,030.000
FAMILY DOLLAR STORES	3,100	50.210	155,651.000
F5 NETWORKS INC	2,200	134.180	295,196.000
FASTENAL CO	3,700	53.980	199,726.000
FISERV INC	3,800	56.100	213,180.000
GENERAL ELECTRIC CO	275,200	15.970	4,394,944.000
GENZYME CORP-GENL DIVISIO	6,400	71.150	455,360.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,900	9.640	76,156.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,700	66.310	576,897.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,300	159.280	1,959,144.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	20.120	98,588.000
GOODRICH CORP	3,100	85.360	264,616.000
GOOGLE INC-CL A	6,300	582.110	3,667,293.000
GENERAL MILLS INC	17,100	35.450	606,195.000
FIRSTENERGY CORP	8,300	35.360	293,488.000

			有価証券届出書(内国投	資信託
GENUINE PARTS CO	4,400	48.320	212,608.000	
FIFTH THIRD BANCORP	21,900	12.030	263,457.000	
HARRIS CORP	3,700	45.230	167,351.000	
HARSCO CORP	3,000	24.400	73,200.000	
HALLIBURTON CO	23,900	37.870	905,093.000	
HOME DEPOT INC	43,300	30.690	1,328,877.000	
ASSURANT INC	3,300	35.310	116,523.000	
HERSHEY CO/THE	4,300	46.690	200,767.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	5,800	31.460	182,468.000	
HUMANA INC	4,200	56.400	236,880.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,300	57.190	303,107.000	
HELMERICH & PAYNE	3,300	45.470	150,051.000	
WINDSTREAM CORP	14,500	13.040	189,080.000	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	4,800	24.790	118,992.000	
HENRY SCHEIN INC	2,900	57.430	166,547.000	
HEWLETT-PACKARD CO	59,600	42.600	2,538,960.000	
DIRECTV	22,082	41.530	917,065.460	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,500	90.650	135,975.000	
HEINZ H J CO	7,900	48.410	382,439.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	32,400	142.890	4,629,636.000	
INTERNATIONAL PAPER	10,200	25.290	257,958.000	
ITT CORP	4,900	46.010	225,449.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,429	41.080	346,263.320	
LEGGETT & PLATT INC				
	4,200	20.550	86,310.000	
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,435	34.310	117,854.850	
JUNIPER NETWORKS INC	13,100	33.940	444,614.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	62.850	194,835.000	
JOHNSON & JOHNSON	71,200	61.910	4,407,992.000	
HOLOGIC INC	8,800	16.500	145,200.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	61.530	646,065.000	
KROGER CO	15,600	23.080	360,048.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	4,100	37.270	152,807.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,900	68.200	538,780.000	
LIMITED BRANDS	7,200	33.470	240,984.000	
LOWE'S COS INC	35,600	22.360	796,016.000	
ELI LILLY & CO	26,100	33.890	884,529.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	46,400	1.000	46,400.000	,
LAM RESEARCH CORP	3,200	46.150	147,680.000	
LUBRIZOL CORP	1,700	106.190	180,523.000	
RANGE RESOURCES CORP	3,800	42.560	161,728.000	
LSI CORP	22,500	5.730	128,925.000	
LOEWS CORP	8,500	37.660	320,110.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,349	23.630	197,286.870	
MCDONALD'S CORP	27,100	78.260	2,120,846.000	
3M CO	17,000	84.220	1,431,740.000	
MANPOWER INC	2,700	57.000	153,900.000	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,800	34.390	268,242.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	85.090	110,617.000	
MCAFEE INC	4,200	46.850	196,770.000	
MURPHY OIL CORP	4,500	67.570	304,065.000	
MATTEL INC	9,800	25.680	251,664.000	
KBR INC	4,500	27.680	124,560.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,800	44.150	167,770.000	
MYLAN INC	8,200	20.040	164,328.000	
METLIFE INC	23,100	38.060	879,186.000	
	<del>                                     </del>			
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	19.400	281,300.000	
MOTOROLA INC	56,200	7.770	436,674.000	

			有価証券届出書(内国投資	<b>資信託</b>
MONSANTO CO	13,906	59.360	825,460.160	
ROCKWELL INTL CORP	3,600	66.520	239,472.000	
MERCK & CO INC	79,621	34.690	2,762,052.490	
MASCO CORP	12,100	10.880	131,648.000	
M & T BANK CORP	2,400	76.990	184,776.000	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	10,936	60.990	666,986.640	
MARSH & MCLENNAN COS	14,900	25.070	373,543.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,782	39.140	304,587.480	
NETAPP INC	8,900	50.930	453,277.000	
NIKE INC -CL B	9,400	85.160	800,504.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	60.910	566,463.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,600	34.080	156,768.000	
NATIONAL SEMICONDUCTOR	7,700	13.550	104,335.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,300	61.220	446,906.000	
NEWMONT MINIG CORP	12,900	58.090	749,361.000	
MCKESSON CORP	6,800	64.260	436,968.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,900	23.820	188,178.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	46,800	57.820	2,705,976.000	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	5,600	11.810	66,136.000	
NUCOR CORP	8,300	37.620	312,246.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	8,900	22.190	197,491.000	
WESTERN UNION CO	16,746	17.860	299,083.560	
NEWELL RUBBERMAID INC	7,500	17.140	128,550.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM	21,100	88.980	1,877,478.000	
OMNICARE INC	3,200	23.450	75,040.000	
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	12.680	97,319.000	
PAYCHEX INC	8,400	28.700	241,080.000	
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	5,600	32.770	183,512.000	
PATTERSON COS INC	2,900	29.830	86,507.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	59.920	227,696.000	
ALTRIA GROUP INC	53,900	24.430	1,316,777.000	
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	27.080	146,232.000	
PG & E CORPORATION	9,700	46.730	453,281.000	
PFIZER INC	204,563	16.560	3,387,563.280	
XCEL ENERGY INC	11,600	23.440	271,904.000	
STRYKER CORP	7,600	50.770	385,852.000	
PARKER HANNIFIN CORP	4,300	80.500	346,150.000	
PALL CORP	4,000	45.160	180,640.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	80.150	256,480.000	
PROCTER & GAMBLE CO	72,737	62.130	4,519,149.810	
EXELON CORP	16,500	39.360	649,440.000	
CONOCOPHILLIPS	36,300	60.680	2,202,684.000	
PEPSICO INC	41,100	64.010	2,630,811.000	
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	3,600	28.850	103,860.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,700	51.330	600,561.000	
AMERICAN WATER WORKS CO	4,500	24.540	110,430.000	
ACCENTURE LTD-CL A	16,000	43.900	702,400.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,600	35.690	164,174.000	
PENTAIR INC	2,600	32.790	85,254.000	
QUALCOMM INC	40,800	47.280	1,929,024.000	
PARTNERRE LTD	2,200	78.000	171,600.000	
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,200	25.000	72,500.000	
INVESCO LTD	11,750	21.690	254,857.500	
ADVANCE AUTO PARTS	2,050	66.910	137,165.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	·	27.580	242,704.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,800 5,700			
ENERGEN CORP	5,700	20.670 44.050	117,819.000	
ENERGEN CORP	2,000	44.050	88,100.000	

			有価証券届出書(内国投	資信託
RAYTHEON CO	9,600	46.540	446,784.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	3,100	51.540	159,774.000	
RED HAT INC	5,200	43.040	223,808.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,500	28.340	269,230.000	
PRICELINE.COM INC	1,200	404.660	485,592.000	
ROSS STORES INC	2,900	64.230	186,267.000	
QEP RESOURCES INC	4,600	35.230	162,058.000	
QUEST DIAGNOSTICS	3,900	49.490	193,011.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,700	27.990	103,563.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	8,600	31.530	271,158.000	
POLO RALPH LAUREN CORP	1,800	108.700	195,660.000	
ROWAN COS INC	3,300	30.760	101,508.000	
AUTONATION INC	2,500	26.030	65,075.000	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	42,200	6.970	294,134.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	3,900	56.400	219,960.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,435	5.370	163,435.950	
SUNOCO INC	3,200	40.140	128,448.000	
CHEVRON CORP	52,118	81.690	4,257,519.420	
EDISON INTERNATIONAL	7,800	36.950	288,210.000	
SYMANTEC CORP	20,600	16.680	343,608.000	
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,022	60.340	242,687.480	
SYNOPSYS INC	3,900	25.800	100,620.000	
TRANSOCEAN LTD	8,122	68.670	557,737.740	
SLM CORP	11,900	11.390	135,541.000	
SANDISK CORP	5,700	45.220	257,754.000	
SOUTHERN CO	21,200	37.550	796,060.000	
SYSCO CORP	14,900	29.030	432,547.000	
TRAVELERS COS INC	11,923	54.180	645,988.140	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,000	36.490	328,410.000	
SPX CORP	1,400	65.960	92,344.000	-
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,400	22.870	77,758.000	-
STERICYCLE INC	2,200	73.400	161,480.000	-
SCHLUMBERGER LTD	34,667	77.000	2,669,359.000	
SUPERVALU INC	6,973	8.800	61,362.400	
AT&T INC	151,195	27.700	4,188,101.500	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	13.550	81,300.000	
SIGMA-ALDRICH	3,300	63.780	210,474.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,700	74.220	200,394.000	
SEMPRA ENERGY	6,300	49.880	314,244.000	
TIFFANY & CO	3,300	60.640	200,112.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,300	13.860	170,478.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	30,400	32.200	978,880.000	
SALESFORCE.COM INC	3,000	143.810	431,430.000	-
				-
TIME WARNER CABLE	9,053	61.570	557,393.210	
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,525	37.720	472,443.000	
TRANSATLANTIC HOLDINGS IN	1,700	51.000	86,700.000	
UNION PACIFIC CORP	12,700	90.650	1,151,255.000	
MARATHON OIL CORP	18,000	33.690	606,420.000	
UNITED TECHNOLOGIES	22,700	74.800	1,697,960.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	19,000	69.880	1,327,720.000	
SPRINT NEXTEL CORP	81,222	3.920	318,390.240	
UNUM GROUP	8,900	21.730	193,397.000	
AMEREN CORPORATION	5,800	28.750	166,750.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	29,126	36.590	1,065,720.340	
USX-US STEEL GRP	3,800	47.890	181,982.000	
VERISIGN INC	5,400	34.610	186,894.000	
VALERO ENERGY CORP	14,492	19.570	283,608.440	

			有価証券届出書(内国投資信
WEYERHAEUSER CO	13,194	16.830	222,055.020
WELLPOINT INC	10,100	57.070	576,407.000
THE WALT DISNEY CO.	46,100	36.420	1,678,962.000
WELLS FARGO & CO	126,072	27.200	3,429,158.400
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,500	48.650	121,625.000
WASTE MANAGEMENT INC	11,300	34.420	388,946.000
WILLIAMS COMPANY	14,500	22.860	331,470.000
WHIRLPOOL CORP	1,900	75.130	142,747.000
WAL-MART STORES	52,800	53.850	2,843,280.000
ZIMMER HOLDINGS INC	5,100	49.940	254,694.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	20,000	20.400	408,000.000
WYNN RESORTS LTD	2,200	102.230	224,906.000
XEROX CORP	36,944	11.600	428,550.400
TJX COMPANIES INC	10,400	45.290	471,016.000
WATERS CORP	2,500	77.610	194,025.000
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,400	48.970	166,498.000
WHOLE FOODS MARKET INC	4,100	46.890	192,249.000
WASHINGTON POST -CL B	240	382.030	91,687.200
WALGREEN CO	24,800	34.800	863,040.000
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	32.170	151,199.000
WESTERN DIGITAL CORP	5,700	33.720	192,204.000
WISCONSIN ENERGY CORP	2,800	60.000	168,000.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,300	30.840	410,172.000
VISA INC-CLASS A SHS	12,800	74.190	949,632.000
PPL CORPORATION	11,800	25.460	300,428.000
PITNEY BOWES INC	6,300	22.340	140,742.000
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	18.230	116,672.000
PULTE GROUP INC	9,500	6.240	59,280.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	46.990	192,659.000
PPG INDUSTRIES INC	4,300	77.800	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
NORTHERN TRUST CORP	5,500	50.590	334,540.000
NSTAR			278,245.000
	3,300	41.500 137.230	136,950.000
PRECISION CASTPARTS CORP	3,700		507,751.000
NVIDIA CORP	15,250	13.750	209,687.500
PNC FINANCIAL SERVICES	13,193	54.320	716,643.760
LIBERTY MEDIA-INTERACTI A	14,950	15.760	235,612.000
TERADATA CORP	4,700	41.140	193,358.000
TYSON FOODS INC-CL A	7,400	16.190	119,806.000
NETFLIX.COM INC	1,100	198.920	218,812.000
NII HOLDINGS INC	4,000	40.160	160,640.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	51.080	526,124.000
NRG ENERGY INC	6,000	19.550	117,300.000
TORCHMARK CORP	2,100	58.360	122,556.000
TEXTRON INC	7,500	22.350	167,625.000
NEWS CORP-CL A	46,550	13.880	646,114.000
NEWS CORP-CLASS B	12,100	15.540	188,034.000
OMNICOM GROUP	8,000	45.440	363,520.000
ORACLE CORPORATION	101,583	27.220	2,765,089.260
MASTERCARD INC-CLASS A	2,600	235.560	612,456.000
ONEOK INC	2,900	51.100	148,190.000
CENTURYLINK INC	8,273	42.900	354,911.700
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	72.220	180,550.000
CEPHALON INC	1,900	64.570	122,683.000
YUM! BRANDS INC	12,200	50.020	610,244.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,900	62.770	119,263.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,200	48.020	201,684.000
NOBLE ENERGY INC	4,400	82.630	363,572.000

			有価証券届出書(内国投資信
BANK OF AMERICA CORP	259,101	11.310	2,930,432.310
NORDSTROM INC	4,500	42.580	191,610.000
AMERICAN EXPRESS CO	27,200	43.330	1,178,576.000
ANALOG DEVICES	7,900	35.780	282,662.000
ADVANCED MICRO DEVICES	20,927	7.380	154,441.260
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	16.970	110,305.000
AMERICAN INTL GROUP	2,772	41.530	115,121.160
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,700	64.040	813,308.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,700	40.900	151,330.000
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	11.540	141,942.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,700	66.950	247,715.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	37.780	113,340.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	8,100	65.630	531,603.000
EMERSON ELECTRIC CO	19,200	55.380	1,063,296.000
AON CORP	6,100	40.450	246,745.000
AMGEN	24,600	53.320	1,311,672.000
ALLERGAN INC	7,800	67.280	524,784.000
COACH INC	7,900	55.960	442,084.000
EATON CORP	4,100	96.620	396,142.000
CROWN CASTLE INTL CORP	7,300	41.620	303,826.000
CELGENE CORP	11,700	59.890	700,713.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	20.730	
APPLIED MATERIALS INC	•		118,161.000
	34,300	12.520	429,436.000
CIT GROUP INC	5,400	39.510	213,354.000
CIMAREX ENERGY CO	2,000	81.580	163,160.000
CME GROUP INC	1,700	285.900	486,030.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	10,644	61.390	653,435.160
ECOLAB INC	5,900	48.560	286,504.000
EQUIFAX INC	3,800	35.060	133,228.000
GAP INC	12,100	20.720	250,712.000
GILEAD SCIENCES INC	21,300	37.060	789,378.000
MARSHALL & ILSLEY CORP	12,599	4.810	60,601.190
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	25.740	111,969.000
ST JUDE MEDICAL INC	8,300	39.000	323,700.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,148	36.570	224,832.360
HORMEL FOODS CORP	2,200	49.130	108,086.000
SAFEWAY INC	10,100	22.570	227,957.000
STATE STREET CORP	12,743	43.700	556,869.100
STAPLES INC	19,700	21.930	432,021.000
SUNTRUST BANKS INC	12,448	23.750	295,640.000
SCHWAB(CHARLES) CORP	25,100	15.030	377,253.000
IHS INC-CLASS A	1,400	72.950	102,130.000
BAXTER INTL INC	15,100	49.630	749,413.000
CONSTELLATION ENERGY	5,600	28.540	159,824.000
CAMPBELL SOUP CO	5,000	34.030	170,150.000
CROWN HOLDINGS INC	5,100	31.000	158,100.000
CHUBB CORP	8,300	57.080	473,764.000
CARDINAL HEALTH INC	9,700	35.650	345,805.000
CAREFUSION CORP	4,750	23.000	109,250.000
FEDEX CORP	7,800	91.590	714,402.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,254	37.730	462,343.420
FMC CORP	2,100	78.810	165,501.000
FLEXTRONICS INTL LTD	24,600	7.000	
			172,200.000
CERNER CORP	1,800	88.240	158,832.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,100	52.790	110,859.000
CITRIX SYSTEMS INC	4,700	67.380	316,686.000
INTEL CORP	144,600	21.330	3,084,318.000

			有価証券届出書(内国投資	信託
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,700	48.810	327,027.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	16,600	10.520	174,632.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	10,600	22.620	239,772.000	
IRON MOUNTAIN INC	5,050	22.590	114,079.500	
CREE INC	2,900	65.120	188,848.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,900	47.400	516,660.000	
ILLUMINA INC	3,400	60.670	206,278.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	16,500	22.050	363,825.000	
SEALED AIR CORP	4,500	23.530	105,885.000	
ITT EDUCATIONAL SERVICES	1,000	61.090	61,090.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,000	254.450	254,450.000	
SARA LEE CORP	15,600	15.080	235,248.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	31.430	191,723.000	
COVANCE INC	1,700	45.450	77,265.000	
CARMAX INC	5,300	32.810	173,893.000	
COMERICA INC	4,900	36.980	181,202.000	
DUKE ENERGY CORP	33,392	17.510	584,693.920	
TARGET CORP	18,000	56.330	1,013,940.000	
DOVER CORP	5,200	55.220	287,144.000	
RR DONNELLEY & SONS CO	7,200	15.970	114,984.000	
WW GRAINGER INC	1,700	125.060	212,602.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	4,000	38.880	155,520.000	
JOHNSON CONTROLS INC	17,500	36.710	642,425.000	
CINTAS CORP	4,600	27.080	124,568.000	
CA INC	11,205	23.190	259,843.950	
CONAGRA INC	11,000	21.770	239,470.000	
CLOROX COMPANY	3,600	61.800	222,480.000	
ENTERGY CORP	5,000	71.950	359,750.000	
MICROSOFT CORP	199,900	25.310	5,059,469.000	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,800	50.350	241,680.000	
CVS CAREMARK CORP	35,274	31.440	1,109,014.560	
MEDTRONIC INC	27,900	33.900	945,810.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,400	7.580	184,952.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	900	163.100	146,790.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	15.600	166,920.000	
HASBRO INC	3,600	47.020	169,272.000	
KELLOGG CO	7,300	49.190	359,087.000	
KEYCORP	23,400	7.700	180,180.000	
KRAFT FOODS INC-A	45,511	30.190	1,373,977.090	
KOHLS CORP	-	56.440	412,012.000	
SEARS HOLDING CORP	7,300 1,525	65.440	99,796.000	
URS CORP			83,328.000	
	2,100	39.680		
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	10,000	17.030	170,300.000	
APACHE CORP	9,310	108.420	1,009,390.200	
ACE LTD	8,500	59.270	503,795.000	
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	31.510	100,832.000	
ALLSTATE	13,600	29.360	399,296.000	
EBAY INC	30,000	30.230	906,900.000	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,900	79.270	150,613.000	
XILINX INC	7,200	27.430	197,496.000	
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	13,200	52.800	696,960.000	
DISH NETWORK CORP	5,400	18.470	99,738.000	
YAHOO! INC	34,000	16.380	556,920.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	3,100	74.900	232,190.000	
TOLL BROTHERS INC	3,400	17.820	60,588.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,400	32.880	177,552.000	
NOBLE CORP	7,100	34.770	246,867.000	

				月1個証券由出書(内国投資
PROGR	ESSIVE CORP	17,100	20.500	350,550.000
PRAXA	IR INC	7,600	91.920	698,592.000
PACCA	R INC	8,837	54.170	478,700.290
PETSM	IART INC	3,700	38.090	140,933.000
EL PA	SO CORPORATION	18,500	13.650	252,525.000
EMC C	ORP/MASS	51,900	21.660	1,124,154.000
	INTERNATIONAL INC	5,600	31.410	175,896.000
	N IDEC INC	6,030	64.720	390,261.600
	GAME TECHNOLOGY	9,300	15.540	144,522.000
		· · ·		
	FOODS CO	5,100	7.350	37,485.000
	SUCKS CORP	18,700	30.790	575,773.000
	GO CO	2,200	61.010	134,222.000
	EAST UTILITIES	4,700	31.200	146,640.000
	T INC	7,700	45.450	349,965.000
BORG-	WARNER AUTOMOTIVE	2,800	59.940	167,832.000
BEST	BUY COMPANY INC	9,000	43.410	390,690.000
BALL	CORP	2,100	64.550	135,555.000
BOSTO	N SCIENTIFIC CORP	38,247	6.500	248,605.500
	ATH & BEYOND INC	6,700	43.940	294,398.000
	OUP PLC	7,600	19.840	150,784.000
	RONIC ARTS INC	9,100	15.010	136,591.000
	N MATERIALS CO	3,300	39.460	130,218.000
	X PHARMACEUTICALS IN	5,500	33.870	186,285.000
VF CC		2,400	83.330	199,992.000
	ORP-CL B	16,571	16.400	271,764.400
	M INC-CLASS B	14,271	37.470	534,734.370
MOHAW	K INDUSTRIES INC	1,900	53.130	100,947.000
NUANC	E COMMUNICATIONS INC	6,400	17.940	114,816.000
VAR I A	N MEDICAL SYSTEMS IN	3,500	65.730	230,055.000
CARNI	VAL CORP	12,200	41.140	501,908.000
CLEVE	LAND-CLIFFS INC	3,600	68.980	248,328.000
COMCA	ST CORP -CL A	52,570	20.210	1,062,439.700
COMCA	ST CORP-SPECIAL CL A	19,500	19.100	372,450.000
アメリカ・ドル 小計		株		アメリカ・ドル
,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		8,415,294		285,074,362.790
		0,110,201		(24,023,216,552)
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
KAZAK	HMYS PLC	5,900	13.950	82,305.000
BP PL		495,700	4.282	2,122,587.400
	VER PLC	33,160	17.950	
		+		595,222.000
	AYS PLC	300,200	2.629	789,225.800
	R-ROYCE GROUP PLC	50,700	6.080	308,256.000
	-ROYCE GROUP-C SHRS	3,244,800	0.001	3,244.800
THOMA	S COOK GROUP PLC	22,300	1.920	42,816.000
TUI T	RAVEL PLC	16,100	2.144	34,518.400
MARKS	& SPENCER GROUP PLC	41,900	3.774	158,130.600
RANDG	OLD RESOURCES LTD	2,400	60.400	144,960.000
REXAM	I PLC	32,500	3.057	99,352.500
	NTIAL PLC	65,100	5.685	370,093.500
	N PLC	4,800	16.830	80,784.000
	SAT PLC	12,800	6.530	83,584.000
	BANK OF SCOTLAND GR	467,215	0.385	179,877.770
	ON MATTHEY PLC	6,400	18.140	116,096.000
	YSTEMS PLC	89,700	3.339	299,508.300
AVIVA		78,500	3.590	281,815.000
EURAS	IAN NATURAL RESOURCE	8,400	8.835	74,214.000

			有価証券届出書(内国投資信託
CAIRN ENERGY PLC	37,400	3.776	141,222.400
GLAXOSMITHKLINE PLC	137,202	12.245	1,680,038.490
CABLE&WIRELESS WORLDWIDE	71,100	0.620	44,082.000
INVENSYS PLC	20,500	3.189	65,374.500
REED ELSEVIER PLC	34,946	5.160	180,321.360
BG GROUP PLC	87,400	11.685	1,021,269.000
DIAGEO PLC	66,200	11.500	761,300.000
RIO TINTO PLC-REG	38,500	40.430	1,556,555.000
BRITISH AIRWAYS PLC	21,300	2.612	55,635.600
STANDARD CHARTERED PLC	56,700	17.495	991,966.500
TESCO PLC	211,300	4.216	890,840.800
FRESNILLO PLC	5,000	14.060	70,300.000
SMITH & NEPHEW PLC	24,300	5.865	142,519.500
SMITHS GROUP PLC	10,333	11.590	119,759.470
PEARSON PLC	21,863	9.315	203,653.840
SAINSBURY (J) PLC	30,325	3.600	109,170.000
NEXT PLC	5,200	20.150	104,780.000
WHITBREAD PLC	6,111	16.970	103,703.670
BUNZL PLC	11,555	7.150	82,618.250
VODAFONE GROUP PLC	1,365,237	1.593	2,174,822.540
BALFOUR BEATTY PLC	21,400	2.726	58,336.400
KINGFISHER PLC	66,111	2.720	157,013.620
WPP PLC	34,500	7.125	245,812.500
UNITED UTILITIES GROUP PL	16,827	5.960	
SEVERN TRENT PLC	7,533	14.380	100,288.920 108,324.540
RECKITT BENCKISER PLC			
	16,100	34.230	551,103.000
SCHRODERS PLC	3,900	16.300	63,570.000
INTERNATIONAL POWER PLC	40,500	4.099	166,009.500
AMEC PLC	8,200	11.080	90,856.000
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	23,800	11.210	266,798.000
ASTRAZENECA PLC	38,300	30.230	1,157,809.000
WOLSELEY PLC	8,290	17.200	142,588.000
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	151,800	0.940	142,692.000
31 GROUP PLC	27,591	3.023	83,407.590
BRITISH SKY BROADCASTING	29,600	7.190	212,824.000
SAGE GROUP PLC (THE)	38,600	2.582	99,665.200
NATIONAL GRID PLC	94,228	5.670	534,272.760
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,083,265	0.605	655,375.320
RSA INSURANCE GROUP PLC	100,500	1.203	120,901.500
IMPERIAL TOBACCO GROUP	26,100	18.950	494,595.000
CENTRICA PLC	133,460	3.110	415,060.600
ARM HOLDINGS PLC	33,100	3.909	129,387.900
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	52,560	23.335	1,226,487.600
ICAP PLC	15,100	4.737	71,528.700
SABMILLER PLC	26,000	20.490	532,740.000
BHP BILLITON PLC	57,177	22.655	1,295,344.930
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	10.670	105,633.000
HSBC HOLDINGS PLC	465,200	6.514	3,030,312.800
SHIRE PLC	14,600	15.220	222,212.000
OLD MUTUAL PLC	139,200	1.215	169,128.000
ANGLO AMERICAN PLC	34,283	28.210	967,123.430
MORRISON SUPERMARKETS	62,000	2.726	169,012.000
CARNIVAL PLC	4,961	25.690	127,448.090
AUTONOMY CORP PLC	5,900	13.250	78,175.000
FIRSTGROUP PLC	12,800	3.607	46,169.600
COMPASS GROUP PLC	50,000	5.495	274,750.000
BT GROUP PLC	200,800	1.690	339,352.000

				有仙証券届出書(内国投資
	MAN GROUP PLC	47,925	2.607	124,940.470
	XSTRATA PLC	55,900	12.945	723,625.500
	BURBERRY GROUP PLC	10,789	9.960	107,458.440
	INTERCONTINENTAL HOTELS	8,200	11.330	92,906.000
	AGGREKO PLC	7,300	14.550	106,215.000
	CAPITA GROUP PLC	16,490	6.590	108,669.100
	SERCO GROUP PLC	13,500	5.500	74,250.000
	ITV PLC	98,000	0.671	65,758.000
	TULLOW OIL PLC	22,900	11.510	263,579.000
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,600	20.100	72,360.000
	PETROFAC LTD	7,400	13.920	103,008.000
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	7.770	33,791.730
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	91,500	19.455	1,780,132.500
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	69,381	19.190	1,331,421.390
	G4S PLC	36,600	2.377	86,998.200
	COBHAM PLC	38,200	1.941	74,146.200
	ADMIRAL GROUP PLC	6,000	15.410	92,460.000
	INVESTEC PLC	13,900	5.035	69,986.500
	ANTOFAGASTA PLC	9,900	12.990	128,601.000
	STANDARD LIFE PLC	63,800	2.090	133,342.000
	EXPERIAN PLC	27,654	7.440	205,745.760
	HOME RETAIL GROUP	29,454	2.018	59,438.170
	RESOLUTION LTD	39,276	2.196	86,250.090
 イギリス・ポント		株	21.00	イギリス・ポンド
1177 371	14. C	11,117,251		36,943,715.540
		11,117,231		(4,846,646,042)
 イスラエル・ショ				
ケル	L	株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル
	BEZEQ ISRAELI TELECOM COR	56,400	9.920	559,488.000
	BEZEQ ISRAELI TELECOM COR ISRAEL CHEMICALS LTD	56,400 14,000	9.920 53.300	559,488.000 746,200.000
		· ·	+	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	53.300	746,200.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD	14,000	53.300 174.400	746,200.000 139,520.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L	14,000 800 26,200	53.300 174.400 186.300	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000
	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL	14,000 800 26,200 32,000 37,600	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000
イスラエル・シュ	ISRAEL CHEMICALS LTD  ELBIT SYSTEMS LTD  TEVA PHARMACEUTICAL IND L  BANK HAPOALIM BM  BANK LEUMI LE-ISRAEL  NICE SYSTEMS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100	53.300 174.400 186.300 17.620	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000
イスラエル・シュ	ISRAEL CHEMICALS LTD  ELBIT SYSTEMS LTD  TEVA PHARMACEUTICAL IND L  BANK HAPOALIM BM  BANK LEUMI LE-ISRAEL  NICE SYSTEMS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル
イスラエル・シュ	ISRAEL CHEMICALS LTD  ELBIT SYSTEMS LTD  TEVA PHARMACEUTICAL IND L  BANK HAPOALIM BM  BANK LEUMI LE-ISRAEL  NICE SYSTEMS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734)
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計 BHP BILLITON LTD LEND LEASE	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計 BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計 BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD  Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドリレ 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケリレ 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケリレ 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドル 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK WESTPAC BANKING	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600 77,298	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドリレ 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530 21.550	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000 1,665,771.900
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK WESTPAC BANKING SANTOS LIMITED	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600 77,298 21,300	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドリレ 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530 21.550 12.370	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000 1,308,268.000 1,665,771.900 263,481.000
オーストラリア・	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lプル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK WESTPAC BANKING SANTOS LIMITED AUSTRALIA & NZLAND BK	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600 77,298 21,300 68,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドルレ 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530 21.550 12.370 22.780	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000 1,308,268.000 1,665,771.900 263,481.000 1,551,318.000
イスラエル・シュ オーストラリア・ ドル	ISRAEL CHEMICALS LTD ELBIT SYSTEMS LTD TEVA PHARMACEUTICAL IND L BANK HAPOALIM BM BANK LEUMI LE-ISRAEL NICE SYSTEMS LTD Lケル 小計  BHP BILLITON LTD LEND LEASE ASCIANO LTD ALUMINA LTD WOODSIDE PETROLEUM OZ MINERALS LTD FORTESCUE METALS GROUP CSR LIMITED BENDIGO AND ADELAIDE BANK NATIONAL AUSTRALIA BANK WESTPAC BANKING SANTOS LIMITED AUSTRALIA & NZLAND BK RIO TINTO LTD	14,000 800 26,200 32,000 37,600 2,100 株 169,100 株 90,300 16,100 85,800 69,900 14,500 97,079 30,900 41,700 10,000 55,600 77,298 21,300 68,100 12,100	53.300 174.400 186.300 17.620 17.770 115.400 オーストラリア・ドリレ 43.240 7.710 1.630 2.000 41.710 1.585 6.540 1.720 9.880 23.530 21.550 12.370 22.780 83.840	746,200.000 139,520.000 4,881,060.000 563,840.000 668,152.000 242,340.000 イスラエル・シュケル 7,800,600.000 (178,555,734) オーストラリア・ドル 3,904,572.000 124,131.000 139,854.000 139,800.000 604,795.000 153,870.210 202,086.000 71,724.000 98,800.000 1,308,268.000 1,308,268.000 1,551,318.000 1,551,318.000 1,014,464.000

	GOODMAN FIELDER LTD	47,200	1.380	65,136.000
	FOSTER'S GROUP LTD	49,400	5.660	279,604.000
	NEWCREST MINING	16,800	39.770	668,136.000
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.810	173,736.000
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	39,800	48.570	1,933,086.000
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	13.370	64,176.000
	ORICA LIMITED	9,200	25.180	231,656.000
	QBE INSURANCE	26,100	16.700	435,870.000
	LEIGHTON HOLDINGS	4,000	31.910	127,640.000
	WOOLWORTHS	32,300	26.970	871,131.000
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	11.220	178,398.000
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	7.180	147,190.000
	CROWN LTD	16,900	8.240	139,256.000
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	29,700	2.660	79,002.000
	TELSTRA CORPORATION	124,600	2.840	353,864.000
				· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
	AMP LIMITED	58,500	5.090	297,765.000
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	15,900	5.370	85,383.000
	MACQUARIE GROUP LIMITED	8,800	35.570	313,016.000
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	1.360	105,672.000
	CSL LIMITED	15,300	35.240	539,172.000
	ONESTEEL LIMITED	44,700	2.520	112,644.000
	WESFARMERS LIMITED	25,900	31.940	827,246.000
	WESFARMERS LTD-PPS	4,400	32.310	142,164.000
	COCHLEAR LIMITED	1,700	80.950	137,615.000
	BLUESCOPE STEEL LTD	53,900	1.915	103,218.500
	SUNCORP-METWAY LIMITED	37,000	9.040	334,480.000
	BORAL LIMITED	22,700	4.500	102,150.000
	ASX LTD	5,300	38.050	201,665.000
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	9.850	136,915.000
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	2.990	41,860.000
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	60,800	3.850	234,080.000
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	11.880	119,988.000
	TRANSURBAN GROUP	33,300	5.120	170,496.000
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	6.150	115,620.000
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	17.880	96,552.000
	MACQUARIE AIRPORTS	18,900	3.040	57,456.000
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	31,600	6.180	195,288.000
	WORLEYPARSONS LTD	5,300	25.890	137,217.000
	PALADIN ENERGY LTD	18,400	4.930	90,712.000
		<del>                                     </del>		
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.440	90,036.000
	AGL ENERGY LTD	11,100	15.680	174,048.000
	BRAMBLES LTD	38,700	6.900	267,030.000
オーストラリア・	ドル 小計	株		オーストラリア・ドル
		1,944,177		22,910,338.610
				(1,865,588,873)
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	37.250	294,275.000
	SINO-FOREST CORPORATION	7,100	22.120	157,052.000
	SILVER WHEATON CORP	8,200	36.400	298,480.000
	INTACT FINANCIAL CORP	4,000	48.180	192,720.000
	BCE INC	7,430	34.840	258,861.200
	FRANCO-NEVADA CORP	3,600	32.520	117,072.000
	SUNCOR ENERGY INC	40,780	34.690	1,414,658.200
		1 1		
		3.300	46.110	152.163.000
	METRO INC-A SHERRITT INTERNATIONAL CO	3,300 9,500	46.110 7.690	152,163.000 73,055.000

3,300 3,500 2,300 3,100 7,400 3,700 3,900 4,400 4,500 3,500 3,500 4,300	79.410       833,805.000         74.830       1,668,709.000         25.800       208,980.000         55.380       2,071,212.000         11.680       66,576.000         36.280       721,972.000         4.710       194,994.000         51.190       1,387,249.000         11.180       102,856.000         37.680       395,790.720         146.800       1,145,040.000         60.900       97,440.000         40.650       142,275.000	
2,300 3,100 7,400 5,700 7,900 7,100 7,100 7,100 7,800 7,800 7,800 7,800 7,800 7,800 7,900 7,800 7,900 7,800 7,900 7,800 7,800 7,900 7,800 7,	74.830       1,668,709.000         25.800       208,980.000         55.380       2,071,212.000         11.680       66,576.000         36.280       721,972.000         4.710       194,994.000         51.190       1,387,249.000         11.180       102,856.000         37.680       395,790.720         146.800       1,145,040.000         60.900       97,440.000         40.650       142,275.000	
3,100 7,400 6,700 9,900 ,400 7,100 9,504 7,800 ,600 8,500 9,500 1,500	25.800     208,980.000       55.380     2,071,212.000       11.680     66,576.000       36.280     721,972.000       4.710     194,994.000       51.190     1,387,249.000       11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
7,400 6,700 ,900 ,400 7,100 0,200 0,504 7,800 ,600 8,500 2,500 ,700	55.380     2,071,212.000       11.680     66,576.000       36.280     721,972.000       4.710     194,994.000       51.190     1,387,249.000       11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,700 ,900 ,400 ,100 ),200 ),504 ,800 ,600 3,500 2,500	11.680     66,576.000       36.280     721,972.000       4.710     194,994.000       51.190     1,387,249.000       11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,900 ,400 ,100 ,200 ,504 ,800 ,600 ,500 ,700	36.280     721,972.000       4.710     194,994.000       51.190     1,387,249.000       11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,400 7,100 0,200 0,504 7,800 ,600 8,500 2,500 ,700	4.710     194,994.000       51.190     1,387,249.000       11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
7,100 0,200 0,504 7,800 ,600 8,500 2,500	51.190       1,387,249.000         11.180       102,856.000         37.680       395,790.720         146.800       1,145,040.000         60.900       97,440.000         40.650       142,275.000	
,200 ,504 ,800 ,600 ,500 ,500	11.180     102,856.000       37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,504 ,800 ,600 3,500 2,500	37.680     395,790.720       146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,800 ,600 3,500 2,500 ,700	146.800     1,145,040.000       60.900     97,440.000       40.650     142,275.000	
,600 3,500 2,500 ,700	60.900 97,440.000 40.650 142,275.000	
,600 3,500 2,500 ,700	60.900 97,440.000 40.650 142,275.000	
3,500 2,500 ,700	40.650 142,275.000	
,500 ,700		
,700		
	-	
	-	
	-	
	-	
	-	
	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
		<del></del>
	-	
,400	-	
	1	<del></del>
,400	77.710 108,794.000	
,400		
, 100	60.010 786,131.000	
,600	27.890 407,194.000	
,500	56.760 595,980.000	
,200	30.150 428,130.000	
750	16.720 146,300.000	
,900	14.460 692,634.000	
, 100	26.030 210,843.000	
, 159	45.730 876,141.070	
,800	28.510 621,518.000	
		<del></del>
_		<del></del>
	1	
_		<del></del>
_		
_		
_		
	1,700 1,600 9,300 900 7,400 3,900 5,500 5,500 6,500 6,500 6,700 6,700 1,600 3,700 1,600 3,700 1,600 1,	3,700       21.080       141,236.000         1,400       77.710       108,794.000         3,400       37.430       127,262.000         3,100       60.010       786,131.000         4,600       27.890       407,194.000         0,500       56.760       595,980.000         4,200       30.150       428,130.000         3,750       16.720       146,300.000         7,900       14.460       692,634.000         3,100       26.030       210,843.000         3,159       45.730       876,141.070         1,800       28.510       621,518.000         4,500       65.850       296,325.000         0,900       16.760       165,924.000

				<u>有価証券届出書(内国投資</u>
	SHOPPERS DRUG MART CORP	6,600	37.710	248,886.000
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	54.890	247,005.000
	ELDORADO GOLD CORPORATION	14,600	17.200	251,120.000
	IGM FINANCIAL INC	3,900	42.810	166,959.000
	TMX GROUP INC	2,700	34.820	94,014.000
	OPEN TEXT CORP	2,000	44.030	88,060.000
	CI FINANCIAL CORP	5,600	21.500	120,400.000
	SAPUTO INC	4,800	37.300	179,040.000
	FIRST QUANTUM MINERALS LT	2,500	91.140	227,850.000
	ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	25.920	121,824.000
	YAMANA GOLD INC	21,500	11.520	247,680.000
	FORTIS INC	5,800	32.330	187,514.000
	NIKO RESOURCES LTD	1,500	91.690	137,535.000
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	20.040	68,136.000
	CRESCENT POINT ENERGY COR	6,800	41.000	278,800.000
	CENOVUS ENERGY INC	20,800	29.690	617,552.000
	TIM HORTONS INC	5,000	40.260	201,300.000
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	7,000	32.000	224,000.000
	PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,400	18.680	44,832.000
	PETROBANK ENERGY&RESOURCE	3,300	40.500	133,650.000
カナダ・ドル 小i		株		カナダ・ドル
	••	907,323		32,391,312.190
		55.,525		(2,681,676,736)
 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	18.500	610,500.000
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	13.920	668,160.000
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	15.520	255,614.400
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	6.060	199,980.000
	KEPPEL CORP	43,000	10.920	469,560.000
	UOL GROUP LIMITED	19,400	4.560	88,464.000
			7.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	12.220	207,740.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED	17,000 51,000	12.220 3.690	207,740.000 188,190.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000 51,000 49,000	12.220 3.690 4.170	207,740.000 188,190.000 204,330.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	17,000 51,000 49,000 3,000	12.220 3.690 4.170 37.080	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C.	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000
シンガポール・ド	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000
シンガポール・ド	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000 株 1,296,901	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090 2.020	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640 (393,362,327)
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000 株 1,296,901	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090 2.020	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640 (393,362,327) スイス・フラン
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD  SJV /J\====================================	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000 株 1,296,901	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090 2.020	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640 (393,362,327) スイス・フラン 204,125.000
シンガポール・ド	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000 株 1,296,901 株 3,550 18,650	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090 2.020	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 104,720.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640 (393,362,327) スイス・フラン 204,125.000 2,584,890.000
	CITY DEVELOPMENT CAPITALAND LIMITED SINGAPORE PRESS HOLDINGS JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT O.C.B.C. GENTING SINGAPORE PLC SINGAPORE TELECOM NOBLE GROUP LTD SINGAP. TECH ENGINEERING SEMBCORP INDUSTRIES LTD GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD SINGAPORE EXCHANGE LTD OLAM INTERNATIONAL LTD COSCO CORP SINGAPORE LTD WILMAR INTERNATIONAL LTD CAPITAMALLS ASIA LTD ELL JA	17,000 51,000 49,000 3,000 75,000 175,000 236,450 57,181 48,000 36,000 194,400 27,000 34,000 20,000 48,000 33,000 株 1,296,901 株 3,550 18,650 800	12.220 3.690 4.170 37.080 9.630 2.030 3.100 2.040 3.260 4.850 0.735 8.660 3.080 2.050 6.090 2.020 スイス・フラン 57.500 138.600 77.600	207,740.000 188,190.000 204,330.000 111,240.000 722,250.000 355,250.000 732,995.000 116,649.240 156,480.000 174,600.000 142,884.000 233,820.000 41,000.000 292,320.000 66,660.000 シンガポール・ドル 6,143,406.640 (393,362,327) スイス・フラン 204,125.000 2,584,890.000 62,080.000

1				有11世紀分庙山青(内国投頁)	5 it 5
	ARYZTA AG	2,300	42.750	98,325.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	91,550	55.750	5,103,912.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,200	113.800	136,560.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	29,700	38.010	1,128,897.000	
	GAM HOLDING LTD	5,900	14.700	86,730.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	37.950	223,905.000	
	SGS SA	150	1,644.000	246,600.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	800	404.500	323,600.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	3,882	228.400	886,648.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	87.500	140,000.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	55,550	54.050	3,002,477.500	
	SWISS RE-REG	9,150	46.820	428,403.000	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	13,450	54.750	736,387.500	
	UBS AG-REGISTERED	95,900	15.330	1,470,147.000	
	SWISSCOM AG-REG	620	414.000	256,680.000	
	GEBERIT AG-REG	1,100	203.300	223,630.000	
	GIVAUDAN REG	210	1,018.000	213,780.000	-
	ACTELION LTD-REG	3,000	53.050	159,150.000	-
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	210.700	52,675.000	
	SYNGENTA AG	2,462	279.800	688,867.600	$\dashv$
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,250	125.400	156,750.000	
				· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	_
	LOGITECH INTL-REG	5,350	20.000	107,000.000	_
	SYNTHES INC	1,750	121.600	212,800.000	_
	LONZA GROUP AG-REG	1,350	77.200	104,220.000	_
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	72.900	109,350.000	_
	HOLCIM LTD-REG	6,400	65.400	418,560.000	_
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	114.200	108,490.000	_
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,500	126.500	189,750.000	_
スイス・フラン ノ	J\=t	株		スイス・フラン	
		423,638		21,194,942.900	
				(1,786,945,636)	
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	81,430	72.550	5,907,746.500	
	VOLVO AB-B SHS	30,150	99.450	2,998,417.500	-
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,200	621.000	1,366,200.000	-
	S.K.F. AB-B SHS	11,400	186.700	2,128,380.000	-
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	167.900	1,074,560.000	
	NORDEA AB	85,200	69.750	5,942,700.000	
		·			-
	SCANIA AB-B SHS SWEDISH MATCH AB	9,250	142.500	1,318,125.000	_
		5,650	195.500	1,104,575.000	-
	TELE2 AB-B SHS	8,950	141.200	1,263,740.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	146.500	908,300.000	_
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	36,150	51.100	1,847,265.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	12,600	210.100	2,647,260.000	_
	SWEDBANK AB	20,450	88.850	1,816,982.500	_
	HENNES & MAURITZ AB-B	27,400	236.200	6,471,880.000	
					-
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	16,450	103.400	1,700,930.000	
	SKANSKA AB-B	16,450 10,800	124.300	1,342,440.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB	16,450 10,800 28,050	124.300 118.000	1,342,440.000 3,309,900.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS	16,450 10,800	124.300	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS	16,450 10,800 28,050	124.300 118.000	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000 2,788,725.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS	16,450 10,800 28,050 12,300	124.300 118.000 137.000	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS	16,450 10,800 28,050 12,300 18,050	124.300 118.000 137.000 154.500	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000 2,788,725.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS SECURITAS AB-B SHS	16,450 10,800 28,050 12,300 18,050 9,200	124.300 118.000 137.000 154.500 75.250	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000 2,788,725.000 692,300.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS SECURITAS AB-B SHS TELIASONERA AB	16,450 10,800 28,050 12,300 18,050 9,200 58,300	124.300 118.000 137.000 154.500 75.250 54.800	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000 2,788,725.000 692,300.000 3,194,840.000	
	SKANSKA AB-B SANDVIK AB INVESTOR AB-B SHS ATLAS COPCO AB-A SHS SECURITAS AB-B SHS TELIASONERA AB ALFA LAVAL AB	16,450 10,800 28,050 12,300 18,050 9,200 58,300 10,800	124.300 118.000 137.000 154.500 75.250 54.800 122.400	1,342,440.000 3,309,900.000 1,685,100.000 2,788,725.000 692,300.000 3,194,840.000 1,321,920.000	

				有価証券届出書(内国投
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,200	519.000	622,800.000
	SSAB AB-A SHARES	6,100	94.350	575,535.000
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	48.270	605,788.500
	RATOS AB-B SHS	2,950	229.900	678,205.000
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,650	139.000	924,350.000
	HEXAGON AB-B SHS	4,100	126.200	517,420.000
スウェーデン・ク	フローナ 小計	株		スウェーデン・クローナ
		558,980		59,673,280.000
				(720,256,490)
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	567.500	6,526,250.000
	DANSKE BANK A/S	12,300	143.900	1,769,970.000
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	44,850.000	852,150.000
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,450	156.500	852,925.000
	CARLSBERG AS-B	3,050	541.500	1,651,575.000
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,600	736.500	1,178,400.000
	COLOPLAST-B	550	756.000	415,800.000
	DSV A/S	5,600	112.900	632,240.000
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	400.600	330,495.000
	A P MOLLER-MAERSK A/S	25	45,990.000	1,149,750.000
 デンマーク・クロ			40,990.000	デンマーク・クローネ
テンマーク・グレ	1一小 小門	株 40.010		
		40,919		15,359,555.000
				(228,089,392)
ニュージーラント ・ドル				ニュージーランド・ドル
	TELECOM CORP OF NZ	58,589	2.210	
	FLETCHER BUILDING LTD	16,800	7.950	<u>'</u>
ニュージーラント	・・ドル 小計	株		ニュージーランド・ドル
		75,389		263,041.690
				(16,561,105)
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	24,700	36.240	895,128.000
	DNB NOR ASA	27,700	76.350	2,114,895.000
	ORKLA ASA	20,750	52.600	1,091,450.000
	TELENOR ASA	21,100	87.800	1,852,580.000
	STATOIL ASA	29,273	123.400	3,612,288.200
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,110	300.100	1,533,511.000
	SEADRILL LTD	9,650	192.900	1,861,485.000
	AKER SOLUTIONS ASA	3,500	92.700	324,450.000
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	13,900	15.280	212,392.000
ノルウェー・クロ		株		ノルウェー・クローネ
		155,683		13,498,179.200
				(184,925,055)
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ
-	BAYER AG	21,600	56.060	1,210,896.000
	DEUTSCHE BANK AG-REG	20,550	37.120	762,816.000
	COMMERZBANK AG	21,600	5.715	123,444.000
	VOLKSWAGEN AG	1,150	104.800	120,520.000
	VOLKSWAGEN AG PFD	4,050	124.300	503,415.000
	TUI AG	<u> </u>		
		4,950	8.280	40,986.000
	M.A.N.	2,900	90.590	262,711.000
	SIEMENS AG	22,600	84.520	1,910,152.000
	E.ON AG	48,750	22.300	1,087,125.000
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,950	57.740	574,513.000
	GEA GROUP AG	5,050	18.210	91,960.500

			有価証券届出書(内国投資信託
CONTINENTAL AG	1,200	58.080	69,696.000
BASF SE	23,550	56.290	1,325,629.500
LINDE	4,650	107.050	497,782.500
K+S AG	4,150	50.520	209,658.000
ALLIANZ SE-REG	11,700	85.570	1,001,169.000
THYSSENKRUPP AG	8,850	29.560	261,606.000
HENKEL AG & CO KGAA	5,100	46.760	238,476.000
R.W.E. AG	11,000	48.090	528,990.000
LUFTHANSA	6,750	16.395	110,666.250
FRAPORT AG	1,100	45.165	49,681.500
FRESENIUS SE	850	66.090	56,176.500
UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	10.980	45,018.000
HOCHTIEF AG	1,450	55.930	81,098.500
SAP AG	22,342	35.905	802,189.510
MUNCHENER RUECK AG-REG	5,100	109.550	558,705.000
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	41.550	162,045.000
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	2,350	55.880	131,318.000
BEIERSDORF AG	3,000	44.625	133,875.000
CELESIO AG	2,800	18.540	51,912.000
MERCK KGAA	1,750	60.680	106,190.000
ADIDAS AG	5,970	48.185	287,664.450
FRESENIUS SE-PFD	2,600	66.870	173,862.000
PUMA AG	180	229.000	41,220.000
HENKEL KGAA	3,750	38.800	145,500.000
METRO AG	3,450	55.580	191,751.000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	72,800	9.866	718,244.800
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,400	44.130	238,302.000
DAIMLER AG	23,150	49.790	1,152,638.500
QIAGEN N.V.	6,800	14.130	96,084.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,700	6.776	208,023.200
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	36.250	67,062.500
DEUTSCHE POST AG	21,800	12.660	275,988.000
DEUTSCHE BOERSE AG	5,150	47.150	242,822.500
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	45.065	
SUEDZUCKER AG	, ,		51,824.750
SALZGITTER AG	1,800	16.735	30,123.000
	1,050	49.985	52,484.250
WACKER CHEMIE AG	500	132.750	66,375.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	25,826	21.175	546,865.550
ARCELORMITTAL	22,100	23.875	527,637.500
UNILEVER NV-CVA	42,450	21.820	926,259.000
HEINEKEN NV	6,700	35.500	237,850.000
REED ELSEVIER NV	18,927	9.085	171,951.790
AEGON NV	44,644	4.315	192,638.860
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	32,110	9.390	301,512.900
AKZO NOBEL	6,500	42.040	273,260.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,200	38.225	160,545.000
WOLTERS KLUWER	8,150	15.300	124,695.000
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	32.555	68,365.500
ING GROEP N.V.	100,850	7.001	706,050.850
KONINKLIJKE KPN NV	42,500	11.185	475,362.500
ASML HOLDING NV	11,488	25.150	288,923.200
TNT NV	10,195	18.225	185,803.870
VOPAK	1,700	35.300	60,010.000
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	35.035	99,849.750
SBM OFFSHORE NV	5,407	15.425	83,402.970
FUGRO NV-CVA	2,200	52.400	115,280.000
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	30.900	94,245.000

		7	<u>有価証券届出書(内国投資信詞</u>
TOTAL SA	56,150	37.100	2,083,165.000
MICHELIN (CGDE) - B	3,900	52.170	203,463.000
AIR LIQUIDE	7,510	90.000	675,900.000
PPR	2,050	122.400	250,920.000
SCHNEIDER ELECTRIC SA	6,350	107.100	680,085.000
BOUYGUES	6,250	30.740	192,125.000
LAFARGE SA	5,150	42.420	218,463.000
BNP PARIBAS	24,700	47.180	1,165,346.000
PEUGEOT SA	4,100	29.525	121,052.500
NATIXIS	21,200	3.518	74,581.600
THALES SA	2,650	27.070	71,735.500
GROUPE DANONE	15,550	45.180	702,549.000
CARREFOUR	15,950	35.620	568,139.000
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	13.700	110,627.500
VIVENDI SA	31,550	19.050	601,027.500
L'OREAL	6,100	82.050	500,505.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,000	34.985	349,850.000
LEGRAND SA	3,650	28.880	105,412.000
ALCATEL-LUCENT	63,600	2.085	132,606.000
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,750	69.210	121,117.500
PERNOD-RICARD	5,167	62.720	324,074.240
EURAZEO	787	52.320	41,175.840
SOCIETE GENERALE-A	15,950	37.050	590,947.500
LVMH	6,250	117.050	731,562.500
ACCOR SA	3,700	32.915	121,785.500
CAP GEMINI SA	3,900	32.395	126,340.500
PUBLICIS GROUPE	3,100	34.375	106,562.500
VALLOUREC	3,000	74.090	222,270.000
BUREAU VERITAS SA	1,550	56.090	86,939.500
EIFFAGE	1,300	32.650	42,445.000
SODEXO	2,650	47.850	126,802.500
ESSILOR INTERNATIONAL	5,450	47.230	257,403.500
AXA	43,850	11.470	502,959.500
TELEVISION FRANCAISE	4,200	11.430	48,006.000
CHRISTIAN DIOR	1,700	107.250	182,325.000
LAGARDERE S.C.A.	3,800	28.620	108,756.000
	,		167,664.000
TECHNIP S.A.	2,800 4,600	59.880 16.575	76,245.000
EDENRED PENALUT	,		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
RENAULT	4,950	41.245	204,162.750
HERMES INTERNATIONAL	600	142.000	85,200.000
ERAMET CTRONLOG ANV	200	239.700	47,940.000
STMICROELECTRONICS NV	21,650	6.900	149,385.000
ATOS ORIGIN	1,600	30.725	49,160.000
DASSAULT SYSTEMS SA	2,150	51.930	111,649.500
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	18.460	85,839.000
FRANCE TELECOM SA	49,350	15.755	777,509.250
ALSTOM	5,250	30.945	162,461.250
CNP ASSURANCES	4,000	12.705	50,820.000
AIR FRANCE-KLM	4,000	13.600	54,400.000
NEOPOST SA	1,000	66.820	66,820.000
SANOFI-AVENTIS	27,925	46.970	1,311,637.250
VINCI	11,200	38.265	428,568.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	10,750	17.215	185,061.250
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,750	20.520	200,070.000
CREDIT AGRICOLE SA	25,600	9.700	248,320.000
GDF SUEZ	32,323	25.585	826,983.950
IMERYS SA	1,100	44.650	49,115.000

			有価証券届出書(内国投	貧信計:
PAGESJAUNES GROUPE SA	3,550	7.018	24,913.900	
ELECTRICITE DE FRANCE	7,000	31.960	223,720.000	
SES	7,950	18.000	143,100.000	
SAFRAN SA	5,250	23.860	125,265.000	
ILIAD SA	450	77.670	34,951.500	
ADP	950	58.380	55,461.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,800	25.825	72,310.000	
SCOR SE	5,900	18.020	106,318.000	
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	14,300	6.480	92,664.000	
UCB SA	3,350	25.065	83,967.750	
KBC GROUPE	4,000	27.500	110,000.000	
COLRUYT SA	2,500	38.340	95,850.000	
DELHAIZE GROUP	2,400	52.520	126,048.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	1,950	61.200	119,340.000	
SOLVAY SA	1,750	74.840	130,970.000	
UMICORE	4,250	36.170	153,722.500	
DEXTA	18,176	2.935	53,346.560	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	18,600	42.410	788,826.000	
AGEAS	42,400		76,913.600	
BELGACOM SA	4,900		128,282.000	
MOBISTAR SA	1,050	44.905	47,150.250	
BANCO POPOLARE SCARL	18,150		58,170.750	
FIAT SPA	19,450		248,960.000	
PARMALAT SPA	48,350		94,379.200	
PRYSMIAN SPA	5,700		69,825.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	30,143		412,657.670	
SAIPEM	6,650		214,861.500	
MEDIOBANCA SPA	17,115		111,504.220	
TENARIS SA	12,400		200,136.000	
UNICREDIT SPA	356,699		550,386.550	
TELECOM ITALIA SPA	248,082		238,158.720	
TELECOM ITALIA-RNC	170,950		139,495.200	
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350		35,569.100	
INTESA SANPAOLO	200,097		408,598.070	
ATLANTIA SPA	8,715		134,123.850	
ENI SPA	66,200		1,016,170.000	-
MEDIASET SPA	18,200		78,842.400	-
A2A SPA	42,800		42,800.000	-
FINMECCANICA SPA	11,225		99,678.000	
MONTE DEI PASCHI SIENA				
ENEL SPA	77,300 181,600		65,163.900 665,927.200	
SNAM RETE GAS	42,000		154,854.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750			
UNIONE DI BANCHE ITALIANE			75,000.000	
	16,100		103,845.000	
TERNA SPA PIRELLI & C.	39,000		123,240.000	
	7,645		45,067.270	
TELEFONICA S.A.	108,027	16.590	1,792,167.930	
BANCO POPULAR ESPANOL	24,415		95,169.670	
BANCO BILBAO VIZCAYA	104,712		756,963.040	
ACERINOX SA	3,900		43,563.000	
IBERDROLA BENOVARI ES CA	104,000		559,520.000	
IBERDROLA RENOVABLES SA	23,400		53,632.800	
BANCO DE SABADELL SA	29,969		89,907.000	
BANKINTER SA	8,850		35,594.700	
REPSOL YPF SA	20,950		383,175.500	
GRIFOLS SA	3,700		33,651.500	
BANCO SANTANDER SA	222,150	7.331	1,628,581.650	

			有価証券届出書(内国投資	食信計
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	7,500	12.385	92,887.500	
GAS NATURAL SDG SA	8,300	10.360	85,988.000	
MAPFRE SA	17,100	1.995	34,114.500	
CRITERIA CAIXACORP SA	24,750	3.761	93,084.750	
ZARDOYA OTIS SA	3,700	11.070	40,959.000	
BANCO DE VALENCIA SA	5,848	3.320	19,415.360	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	17.475	22,717.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,526	33.885	119,478.510	
ACCIONA SA	750	50.900	38,175.000	
INDRA SISTEMAS SA	2,400	12.315	29,556.000	
INDITEX	5,350	57.410	307,143.500	
ENAGAS	4,900	14.375	70,437.500	
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	33.430	101,961.500	
GESTEVISION TELECINCO SA	3,500	7.364	25,774.000	
GESTEVISION TELECINCO-RTS	3,500	0.560	1,960.000	
FERROVIAL SA	14,500	7.270	105,415.000	
UPM-KYMMENE OYJ	15,450	11.450	176,902.500	
NOKIA OYJ	97,650	7.050	688,432.500	
WARTSILA OYJ	2,350	53.300	125,255.000	
RAUTARUUKKI OYJ	2,650	14.130	37,444.500	
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,350	6.635	128,387.250	
METSO OYJ	3,250	39.430	128,147.500	
ELISA OYJ-A SHARES	3,550	15.410	54,705.500	
SAMPO OYJ-A SHS	10,650	19.030	202,669.500	
FORTUM OYJ	10,750	20.590	221,342.500	
KESKO OYJ-B SHS	1,950	36.180	70,551.000	
KONE OYJ-B	4,250	39.860	169,405.000	
OUTOKUMPU OYJ	3,400	12.720	43,248.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	25.140	95,532.000	
NESTE OIL OYJ	4,300	10.840	46,612.000	
POHJOLA BANK PLC	4,800	8.745	41,976.000	
VERBUND AG	1,700	24.385	41,454.500	-
IMMOFINANZ AG	24,000	2.820	67,680.000	
OMV AG	3,950	26.140	103,253.000	
ERSTE GROUP BANK AG	5,950	30.715	182,754.250	
TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	10.905	119,955.000	
VOESTALPINE AG	2,450	31.465	77,089.250	
RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	38.875	73,862.500	
VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	36.320	36,320.000	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA		9.900	184,140.000	
BRISA	18,600 7,950	4.941	39,280.950	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	2.428	131,233.400	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES		0.597		
GALP ENERGIA SGPS SA-B	75,750		45,222.750	
EDP RENOVAVEIS SA	5,900	12.880	75,992.000	
	7,700	3.817	29,390.900	
HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	6.700	50,920.000	
NATIONAL BANK OF GREECE	15,713	6.260	98,363.380	
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO	17,769	2.730	48,509.370	
ELAN CORPORATION PLC	14,200	3.990	56,658.000	
KERRY GROUP PLC-A	4,600	25.280	116,288.000	
CRH PLC	20,400	13.600	277,440.000	
PUBLIC POWER CORP	3,400	11.010	37,434.000	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,500	2.871	21,532.500	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	19.270	92,496.000	
EFG EUROBANK ERGASIAS	9,008	3.830	34,500.640	
OPAP SA	6,100	12.480	76,128.000	
ALPHA BANK A.E.	12,051	4.370	52,662.870	

				有価証券届出書(内国投	<u> </u>
ユーロ 小計		株		ユーロ	
		4,619,311		59,921,636.910	
				(6,630,928,340)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONGKONG ELECTRIC	43,500	50.050	2,177,175.000	
	MTR CORP	42,500	28.800	1,224,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,000	128.000	4,480,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	24.050	505,050.000	
	SINO LAND	60,000	15.840	950,400.000	
	CHEUNG KONG	36,000	117.100	4,215,600.000	
	WHARF HOLDINGS	36,000	52.750	1,899,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	117.100	2,342,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	64.150	3,367,875.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	22.850	936,850.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	55,300	78.900	4,363,170.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	54.650	1,967,400.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	48.400	1,210,000.000	
	HK & CHINA GAS	107,756	19.020	2,049,519.120	
	HANG SENG BANK	19,200	126.900	2,436,480.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	28.100	702,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	73,000	15.180	1,108,140.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	94,000	2.540	238,760.000	
	WING HANG BANK LIMITED	6,000	101.200	607,200.000	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	75.150	488,475.000	
	HONG KONG EX & CL	28,900	179.100	5,175,990.000	
	LI & FUNG LTD	65,000	47.750	3,103,750.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	35.800	2,255,400.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	72.300	469,950.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	27.750	582,750.000	
	NWS HOLDINGS LTD	34,500	11.820	407,790.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	39.450	887,625.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	33.050	1,686,872.000	
	AIA GROUP LTD	126,000	22.600	2,847,600.000	
	SANDS CHINA LTD	52,000	17.260	897,520.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	5.520	309,120.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	19.520	819,840.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	92,500	26.750	2,474,375.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	29,225	38.450	1,123,701.250	
	WYNN MACAU LTD	28,000	15.600	436,800.000	
香港・ドル 小計		株		香港・ドル	
		1,553,421		60,748,677.370	
				(659, 123, 149)	
合計		株		44,215,875,431	
		31,277,387		[44,215,875,431]	

# (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	2,047	225,415.640	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,687	758,937.510	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,700	311,503.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,427	362,394.220	
		EQUITY RESIDENTIAL	7,500	375,000.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	17,493	287,934.780	
		KIMCO REALTY CORP	10,500	176,190.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	3,900	141,219.000	

			有価証券届出書(内国投資係
	RAYONIER INC	2,200	112,354.000
	VENTAS INC	4,300	222,439.000
	AMB PROPERTY CORP	5,000	147,400.000
	DUKE REALTY CORP	6,400	72,640.000
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,400	110,040.000
	HEALTH CARE REIT INC	3,200	148,288.000
	HCP INC	8,100	266,247.000
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	104,511.000
	MACERICH CO/THE	3,300	154,704.000
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	17,000	307,530.000
	PROLOGIS	13,000	171,600.000
	PUBLIC STORAGE	3,700	360,602.000
	REGENCY CENTERS CORP	2,300	95,243.000
 アメリカ・ドル 〃		2,000	アメリカ・ドル
	ומינ	130,454	4,912,192.150
		130,434	(413,950,432)
イギリス・ポンド	:		イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	20,000	126,800.000
	SEGRO PLC	19,850	55,480.750
	HAMMERSON PLC	20,400	80,518.800
	BRITISH LAND CO PLC	24,700	118,584.700
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	13,400	53,613.400
 イギリス・ポンド	1	13,400	イギリス・ポンド
モッス・かン	ווייני	98,350	434,997.650
		90,330	·
+ 71=117			(57,067,342)
オーストラリア・ ドル			オーストラリア・ドル
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200	92,160.000
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	111,367.500
	GPT GROUP	53,960	151,088.000
	MIRVAC GROUP	93,400	120,486.000
	STOCKLAND	67,300	249,683.000
	WESTFIELD GROUP	57,196	703,510.800
	GOODMAN GROUP	177,900	112,966.500
オーストラリア・	- ドル 小計		オーストラリア・ドル
		644,656	1,541,261.800
		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	(125,504,948)
シンガポール・ド	2		シンガポール・ドル
ル	CARLTAMALL TRUCT	70.000	
	CAPITAMALL TRUST	79,000	146,940.000
シンガポール・ド	ル 小計		シンガポール・ドル
		79,000	146,940.000
			(9,408,568)
ユーロ			그-미
	CORIO NV	1,500	67,732.500
	ICADE	800	59,280.000
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,400	323,640.000
	GECINA SA	550	44,330.000
	KLEPIERRE	2,800	69,412.000
	FONCIERE DES REGIONS	750	53,767.500
ユーロ 小計			ユーロ
		8,800	618,162.000
			(68,405,807)
香港・ドル			香港・ドル
		1	
	LINK REIT	72,000	1,753,200.000 香港・ドル

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

			IHHU
	72,000	1,753,200.000	
		(19,022,220)	
投資証券 合計		693,359,317	
		[693,359,317]	
合計		693,359,317	
		[693,359,317]	

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 投資証券	562銘柄 21銘柄	98.3%	1.7%	54.5%
イギリス・ポンド	株式 投資証券	99銘柄	98.8%	1.2%	10.9%
イスラエル・シュケル	株式	7銘柄	100%	-%	0.4%
オーストラリア・ドル	株式 投資証券	59銘柄 7銘柄	93.7%	6.3%	4.4%
カナダ・ドル	株式	87銘柄	100%	-%	6.0%
シンガポール・ドル	株式 投資証券	22銘柄 1銘柄	97.7%	2.3%	0.9%
スイス・フラン	株式	34銘柄	100%	-%	4.0%
スウェーデン・クローナ	株式	30銘柄	100%	-%	1.6%
デンマーク・クローネ	株式	10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 投資証券	239銘柄 6銘柄	99.0%	1.0%	14.9%
香港・ドル	株式 投資証券	35銘柄 1銘柄	97.2%	2.8%	1.5%

- 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(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「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

<b>美田</b> 為流化		平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		304,551,148	22,067,283
コール・ローン		1,000,433,450	1,035,875,820
国債証券		99,685,281,944	100,914,823,952
派生商品評価勘定		153,903	22,295,448
未収入金		607,742,637	30,267,231
未収利息		1,312,523,246	1,213,506,152
前払費用		80,263,602	65,139,483
流動資産合計		102,990,949,930	103,303,975,369
資産合計		102,990,949,930	103,303,975,369
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		34,560,296	5,500,124
未払金		564,672,003	310,153
未払解約金		83,000	-
流動負債合計		599,315,299	5,810,277
負債合計		599,315,299	5,810,277
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,257,278,019	58,762,234,120
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		48,134,356,612	44,535,930,972
元本等合計		102,391,634,631	103,298,165,092
純資産合計		102,391,634,631	103,298,165,092
負債純資産合計		102,990,949,930	103,303,975,369

## 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20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22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	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。	同左
2.	デリバティブ取引の評価基準及 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 同左 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。

3. その他財務諸表作成のための基外貨建取引等の処理基準 本となる重要な事項

|外貨建取引等の処理基準

同左

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。

(貸借対照表に関する注記)

<u>(貝旧別煕衣に関する注記)</u>		
区 分	平成21年11月30日現在	平成22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	42,371,630,589円	54,257,278,019円
同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額	14,735,003,425円 2,849,355,995円	6,701,378,651円 2,196,422,550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 V A	3,478,207,239円	3,311,430,139円
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	97,143,037円	101,809,977円
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	736,271,135円	740,675,120円
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	238,430,558円	240,619,691円
ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A(一般投資家私募)	2,186,512,902円	2,239,754,053円
D C ダイワ外国債券インデックス	20,597,727,536円	24,170,405,109円
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	316,096,987円	355,179,920円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	8,307,664円	18,942,122円

		有価証券届出書(内国投資信託等
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	4,062,129円	10,561,784円
D C ダイワ・ワールドアセット ( 六つの羽 / 安定コース )	56,467,030円	87,901,955円
D C ダイワ・ワールドアセット (六つの羽 / 6 分散コース)	45,482,134円	62,288,888円
D C ダイワ・ワールドアセット (六つの羽 / 成長コース)	9,135,492円	13,165,507円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	3,102,056円	4,547,046円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	472,531円	1,387,417円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	28,978円	24,118円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	3,633,693,132円	3,738,312,581円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	363,602,261円	390,499,413円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	13,601,204,072円	13,782,880,123円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	2,531,561,434円	2,531,346,833円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	2,254,587,104円	2,187,663,969円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家専用)	629,237,291円	787,018,884円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	3,416,283,730円	3,923,477,100円
ダイワライフスタイル 2 5	17,225,767円	21,967,550円
ダイワライフスタイル50	25,110,700円	31,550,258円
ダイワライフスタイル 7 5	7,325,120円	8,824,563円
計	54,257,278,019円	58,762,234,120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	54,257,278,019□	58,762,234,120□

## (金融商品に関する注記)

# (追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリが所属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクでありま

す。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項につい ての補足説明

#### 金融商品の時価等に関する事項

	区 分	平成22年11月30日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に 関する注記に記載しておりま す。
		(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注 記に記載しております。
		(3)コールローン等の金銭債権 及び金銭債務
		これらは短期間で決済される ため、時価は帳簿価額にほぼ等 しいことから、当該帳簿価額を 時価としております。

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

	- / J				
		平成21年11	月30日現在	平成22年11月30日現在	
種 類		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)	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		99,685,281,944	913,607,648	168,132,335	
合計		99,685,281,944	913,607,648	168,132,335	

(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12月2日から平成21年11月30日まで、及び平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)を指しております。

# (デリバティブ取引に関する注記)

(平成20年12月2日から平成21年11月30日まで)

取引の状況に関する事項

	取引の状况に関する事項	
	区 分	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。
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、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。
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。
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。

### 取引の時価等に関する事項

诵貨関連

<b>世貝矧廷</b>				
		平成21年11	月30日 現在	
種 類	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち	(円)	(円)

1		1 年却	mi 6-1	
		1 年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,492,887,041	-	1,458,480,648	34,406,393
アメリカ・ドル	618,800,930	-	601,513,117	17,287,813
イギリス・ポンド	97,307,616	-	94,712,190	
オーストラリア・	28,526,902	-	27,732,134	
ドル	, ,		, ,	,
カナダ・ドル	32,735,388	-	32,023,030	712,358
スイス・フラン	7,651,749	-	7,509,840	·
スウェーデン・ク	8,756,525	-	8,540,700	
ローナ	2,132,525		5,515,155	_;;,==;
デンマーク・ク	55,219,899	-	54,167,818	1,052,081
ローネ	33,273,333		.,,	1,552,551
ポーランド・ズロ	11,444,412	-	11,342,020	102,392
チ	,,		, ,	,
ユーロ	632,443,620	-	620,939,799	11,503,821
	332, 1.3, 323		5_5,555,100	,555,521
合計	1,492,887,041	_	1,458,480,648	34,406,393
Нні	., .52,001,011		1, 100, 100,010	31,100,000

### (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。

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

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

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

(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 诵貨関連

心只因在					
	平成22年11月30日 現在				
種 類	契約額等	契約額等		評価損益	
	(円)	うち	(円)	(円)	
		1 年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
買建	1,506,999,665	-	1,523,794,989	16,795,324	
アメリカ・ドル	603,315,452	-	620,814,260	17,498,808	

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

			1月1川	証券油出書(内国投資信託5
イギリス・ポンド	140,851,609	-	142,694,040	1,842,431
オーストラリア・	17,562,233	-	18,047,240	485,007
ドル				
カナダ・ドル	49,568,293	-	51,306,609	1,738,316
スイス・フラン	3,369,241	-	3,371,600	2,359
スウェーデン・ク	6,433,030	-	6,441,400	8,370
ローナ				
デンマーク・ク	9,075,369	-	9,096,920	21,551
ローネ				·
ポーランド・ズロ	7,707,726	-	7,727,720	19,994
チ	, ,		, ,	,
メキシコ・ペソ	24,265,121	-	24,890,200	625,079
ユーロ	644,851,591	-	639,405,000	5,446,591
合計	1,506,999,665	-	1,523,794,989	16,795,324

### (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。

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算し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21年11月30日現在	平成22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	1.8872円	1.7579円
(1万口当たり純資産額)	(18,872円)	(17,579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

(2) 1/1		/1			
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	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	1,974,960.000	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,404,619.440	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,851,611.920	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,653,578.550	

1	1	有価証券届出書(内国投資化	1言計
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,899,403.640	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,884,838.880	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,375,637.090	
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,157,037.040	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000		
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,905,188.190	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,126,450.620	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,959,210.000	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000		
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,443,407.540	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,094,339.600	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,096,759.280	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,296,610.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,343,827.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,195,586.000	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,711,582.080	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,225,145.040	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,090,239.300	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,304,566.800	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,366,667.300	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,448,947.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,029,284.210	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,746,673.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,068,593.900	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,238,296.920	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,392,720.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,176,824.000	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,807,273.210	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,263,039.220	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,129,128.000	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,149,760.820	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,917,487.800	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,057,690.000	

1	ı	有伽証秀届出書(内国投資	貧1吉託
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,345,132.890	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,386,545.990	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,173,376.900	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,573,995.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,975,843.800	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,520,826.960	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,291,608.800	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,568,784.480	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,473,409.400	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,584,626.800	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,555,981.100	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000		
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,800,066.720	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,297,053.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,111,787.060	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	7,707,088.830	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,556,526.860	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000		
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,207,273.250	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20120115	2,825,000.000	2,850,142.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,521,099.000	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120215	2,353,000.000	2,381,941.900	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	7,097,333.080	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,839,371.200	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,310,566.750	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120315	2,326,000.000	2,356,982.320	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,408,935.820	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,559,401.820	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120415	2,241,000.000	2,271,813.750	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,498,008.880	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,102,910.930	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120515	2,454,000.000	2,488,601.400	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	6,144,000.000	6,430,064.640	

		有価証券届出書(内国投資信託
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,156,829.300
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	673,493.130
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20120615	2,550,000.000	2,606,865.000
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	5,267,000.000	5,577,647.660
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,296,958.160
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20120715	4,765,000.000	4,848,387.500
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,428,329.640
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	1,984,497.450
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20120815	3,247,000.000	3,318,141.770
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,328,930.700
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,153,564.780
3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,658,253.840
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120915	3,272,000.000	3,323,763.040
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,167,524.790
3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,667,857.430
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20121015	5,247,000.000	5,333,260.680
1% U.S. TREASURY NOTE 20111031	4,093,000.000	4,119,686.360
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,283,691.620
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,490,374.100
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20121115	4,113,000.000	4,181,728.230
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	7,436,000.000	7,884,465.160
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20111130	4,132,000.000	4,150,139.480
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,736,070.820
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,362,922.440
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20121215	3,851,000.000	3,896,865.410
1% U.S. TREASURY NOTE 20111231	2,313,000.000	2,329,699.860
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,700,602.170
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,328,430.540
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130115	4,644,000.000	4,725,595.080
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20120131	2,296,000.000	2,310,258.160
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,416,721.100
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,087,898.800
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130215	4,445,000.000	4,526,076.800
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,072,912.100
<del></del>		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·

	ī	有価証券届出書(内国投資信
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20120229	4,612,000.000	4,642,254.720
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	2,275,000.000	2,383,858.750
3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	4,687,000.000	4,978,062.700
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130315	2,898,000.000	2,951,091.360
1% U.S. TREASURY NOTE 20120331	4,608,000.000	4,646,476.800
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,317,000.000	2,440,704.630
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	4,992,729.300
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20130415	2,877,000.000	2,956,203.810
1% U.S. TREASURY NOTE 20120430	4,519,000.000	4,557,998.970
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,335,221.300
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,765,337.880
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130515	2,259,000.000	2,301,695.100
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	5,603,674.860
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	4,583,000.000	4,605,915.000
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,666,752.480
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	2,961,667.800
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20130615	3,097,000.000	3,136,672.570
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20120630	4,600,000.000	4,613,432.000
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,768,068.540
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,564,167.640
1% U.S. TREASURY NOTE 20130715	2,440,000.000	2,463,350.800
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	3,037,000.000	3,045,776.930
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,426,156.380
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,805,534.550
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130815	3,043,000.000	3,050,364.060
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	2,407,000.000	2,374,842.480
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20120831	3,054,000.000	3,048,747.120
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,501,266.240
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	2,861,254.860
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130915	1,878,000.000	1,881,211.380
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20120930	2,733,000.000	2,727,424.680
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,546,428.800
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,784,769.770
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131015	1,937,000.000	1,925,184.300

1		有価証券届出書(内国投資 	急1言計
11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,326,628.590	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,395,750.000	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,052,628.640	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,161,529.580	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,080,888.200	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,346,245.840	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,283,506.260	
8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,103,295.560	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,094,688.200	
7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,153,743.750	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,080,951.720	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	1,003,016.120	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,451,711.000	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000		
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,241,294.120	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,181,926.880	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,154,298.390	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,014,396.720	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,137,157.790	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,101,881.250	
6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000		
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	853,152.300	
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	943,688.320	
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,027,249.650	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,024,010.840	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	998,973.750	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,121,641.640	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,775,532.240	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	873,237.300	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,803,390.540	
5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,608,130.400	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,437,246.980	
4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,041,290.700	
5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	3,323,366.550	
	, , ,	, , ,	

		1	有価証券届出書(内国投資化
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,101,767.760
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	2,950,507.440
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,043,690.160
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	2,759,143.590
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	3,755,268.270
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	4,554,000.000	4,735,795.680
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	1,749,000.000	1,895,478.750
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,255,239.440
	3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	3,991,787.040
アメリカ・ドル ノ		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル
		464,956,000.000	499,235,875.920
		(39,181,842,120)	(42,070,607,264)
イギリス・ポンド	:	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,199,662.800
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	705,664.000
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,003,853.400
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	942,000.000	1,322,944.800
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,319,495.600
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	1,815,000.000
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,585,634.000
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,910,000.000	2,142,447.000
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,856,121.600
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,491,242.900
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,142,332.400
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,025,894.200
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,976,780.400
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,339,000.000	1,338,196.600
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,693,790.000
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,045,336.400
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,379,000.000	1,402,167.200
	5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	3,335,000.000	3,561,446.500
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	902,000.000	1,031,076.200
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,855,396.400
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND	1,380,000.000	1,478,118.000

		1	有価証券届出書(内国投資
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,183,962.500
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,495,000.000	2,480,529.000
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,001,636.000
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	1,798,000.000	1,846,546.000
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	125,000.000	123,987.500
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,191,000.000	1,228,754.700
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	1,914,000.000	1,963,381.200
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	343,000.000	352,672.600
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	2,483,000.000	2,577,602.300
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	363,000.000	343,398.000
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,619,032.400
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	1,295,000.000	1,326,339.000
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	921,000.000	909,119.100
イギリス・ポンド	: 小計	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド
		55,823,000.000	59,949,560.700
		(7,323,419,370)	(7,864,782,868)
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	1,423,000.000	1,470,314.750
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,442,255.900
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	986,000.000	1,019,139.460
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	780,000.000	769,376.400
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,741,000.000	1,760,464.380
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,219,000.000	1,241,502.740
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	770,000.000	797,843.200
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	1,790,109.440
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20121115	733,000.000	729,195.730
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	187,000.000	189,997.610
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	327,000.000	330,999.210
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	509,000.000	496,045.950
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	508,000.000	496,021.360
オーストラリア・	ドル 小計	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル
		12,496,000.000	12,533,266.130
		(1,017,549,280)	(1,020,583,861)
		カナダ・ドル	カナダ・ドル
 カナダ・ドル		757 7 1 77	
カナダ・ドル	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	627,447.920

			有価証券届出書(内国投資
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,357,000.000	2,129,797.930
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,681,437.600
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,127,698.790
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	924,959.080
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,836,931.250
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,321,425.920
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,134,606.480
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	1,980,035.280
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,058,838.450
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,014,889.800
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	651,740.970
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,611,892.380
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,423,757.840
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,041,000.000	2,155,500.100
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,658,780.640
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	659,800.680
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,646,014.090
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120901	1,661,000.000	1,672,311.410
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20111201	1,529,000.000	1,526,630.050
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	695,000.000	718,407.600
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120301	598,000.000	598,221.260
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	251,000.000	253,356.890
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130301	359,000.000	359,104.110
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	212,000.000	211,896.120
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,001,061.320
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	418,000.000	425,060.020
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	882,000.000	886,480.560
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20121201	449,000.000	447,567.690
ナダ・ドル 小計	+	カナダ・ドル	カナダ・ドル
		30,812,000.000	34,356,249.310
		(2,550,925,480)	(2,844,353,880)
ンガポール・ド		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	506,956.320
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT	347,000.000	363,971.770

			有価証券届出書(内国投資係
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	582,257.900
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	537,311.880
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	555,155.370
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	438,597.740
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	339,616.000
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	730,000.000	751,206.500
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	315,414.000
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	107,815.760
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	346,297.900
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	327,520.480
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	243,242.840
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	184,273.340
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	117,000.000	119,527.200
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	142,000.000	148,428.340
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	237,653.220
シンガポール・ド	ル 小計	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル
		5,739,000.000	6,105,246.560
		(367,468,170)	(390,918,937)
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	972,000.000	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	917,000.000	1,017,860.830
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	763,000.000	946,173.410
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	410,000.000	538,006.100
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	721,000.000	774,887.540
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	316,000.000	375,584.960
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,332,000.000	1,480,358.160
スイス・フラン	小計	スイス・フラン	スイス・フラン
		5,431,000.000	6,178,402.800
		(457,887,610)	(520,901,140)
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	7,275,000.000	8,372,652.000
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	8,315,000.000	8,903,452.550
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	4,550,000.000	4,973,059.000
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,495,498.000
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,338,400.000
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,486,949.000
	454/0		

	1	1	有価証券届出書(内国投資
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,010,000.000	11,002,291.300
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	4,617,475.200
スウェーデン・ク	ローナ 小計	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ
		49,805,000.000	54,189,777.050
		(601,146,350)	(654,070,609)
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	3,341,054.750
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 201111115	5,212,000.000	5,464,834.120
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,728,000.000	8,527,461.600
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 201511115	6,810,000.000	7,437,882.000
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,535,000.000	9,355,896.300
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	12,228,836.290
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,309,000.000	9,032,298.450
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20121115	6,175,000.000	6,532,162.000
デンマーク・クロ	ーネ 小計	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ
		54,981,000.000	61,920,425.510
		(816,467,850)	(919,518,319)
ノルウェー・ク コーネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,884,000.000	6,476,165.760
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,898,000.000	5,384,224.460
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,421,983.760
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	2,431,000.000	2,643,542.330
ノルウェー・クロ	ーネ 小計	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
		17,345,000.000	18,925,916.310
		(237,626,500)	(259, 285, 053)
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	2,382,046.800
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,318,145.360
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,232,964.630
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,762,298.150
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,702,447.940
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	3,317,000.000	3,351,961.180
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,753,000.000	3,819,240.450
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,373,076.100
	POLAND GOVERNMENT BOND 20120125	2,210,000.000	2,103,920.000
	5.75% Poland Governmet Bond 20290425	1,078,000.000	1,023,237.600
	Poland Governmet Bond 20120725	1,974,000.000	1,834,142.100

ı	1		有価証券届出書(内国投	資信語
	5.5% Poland Governmet Bond 20150425	1,964,000.000	1,968,811.800	
	Poland Governmet Bond 20121025	2,046,000.000	1,876,202.460	
	5.25% Poland Governmet Bond 20201025	978,000.000	921,227.100	
ポーランド・ズロ	チ 小計	ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
		33,243,000.000		
	T	(900,885,300)	(885,349,457)	
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	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,666,288.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,290,953.600	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	700,000.000	741,202.000	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,576,000.000	1,671,206.160	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,184,457.160	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,073,494.100	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,371,173.640	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,031,788.100	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	534,586.080	
	3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	769,012.440	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	619,153.700	
	2.509% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120827	1,189,000.000	1,178,810.270	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,141,868.030	
	2.711% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120214	573,000.000	571,779.510	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,074,606.720	
	3.21% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130531	721,000.000	722,348.270	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	375,429.920	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	877,000.000	897,890.140	
マレーシア・リン	ギット 小計	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
		19,310,000.000	19,916,047.840	
		(515,190,800)	(531,360,156)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20121220	9,383,000.000	10,110,182.500	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	2,719,544.400	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	8,434,000.000	9,031,127.200	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	10,432,565.300	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	9,403,000.000	10,759,476.780	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20111222	12,432,000.000	13,045,519.200	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	4,427,000.000	4,772,527.350	

i.	1	1	有侧趾分曲山青 ( 内国投 ) [1]
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	8,649,396.000
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	5,687,000.000	5,960,544.700
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20120621	10,480,000.000	10,929,592.000
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20130620	7,121,000.000	7,735,898.350
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,551,647.500
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	8,529,259.200
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	5,579,000.000	6,270,851.790
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	4,922,000.000	5,462,583.260
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	4,343,000.000	4,838,536.300
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,716,932.900
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	6,819,000.000	7,365,201.900
	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	2,511,000.000	2,539,148.310
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ
グイシコ・ベン	ווייני		
		128,331,000.000	140,420,534.940
		(863,667,630)	(945,030,200)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	347,534.060
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,699,000.000	2,287,635.540
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,509,965.050
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,126,791.400
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,149,051.280
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,803,882.080
	5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	2,056,593.480
	5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,482,521.560
	5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,126,567.450
	4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	2,978,637.980
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,039,671.050
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,654,417.280
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,391,129.600
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,986,607.910
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,267,379.410
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,862,369.450
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,135,040.000
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,707,637.400

		有価証券届出書(内国投資	資信託
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,893,706.910	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,383,835.000	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,539,200.090	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,352,559.200	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,985,279.680	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,074,471.230	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,368,507.680	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,905,812.900	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,462,039.680	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	1,171,000.000	1,222,125.860	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	640,000.000	653,043.200	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	571,000.000	573,472.430	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	572,000.000	550,424.160	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111216	2,200,000.000	2,210,450.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120316	423,000.000	424,311.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120615	826,000.000	822,026.940	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120914	383,000.000	382,337.410	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,894,860.000	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	1,219,000.000	1,294,541.430	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	2,027,002.560	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,211,234.960	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,472,399.740	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,461,452.640	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,487,123.870	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	688,000.000	705,158.720	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	1,378,000.000	1,376,718.460	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	965,059.200	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	931,537.150	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,954,677.750	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,537,696.640	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	2,118,059.020	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,336,079.500	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,089,751.400	

		有価証券届出書(内国投資	信託
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	2,149,921.210	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,867,108.720	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,811,367.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,175,618.120	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,289,951.090	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,688,909.950	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,925,271.740	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,753,346.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,909,302.280	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,685,552.400	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,902,980.480	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,377,352.600	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,446,617.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	3,264,000.000	3,458,599.680	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,361,475.800	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	2,117,000.000	2,301,835.270	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,056,541.760	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,446,379.390	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,473,000.000	1,617,162.510	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,710,000.000	1,967,474.700	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,354,000.000	2,477,608.540	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	1,647,000.000	1,694,713.590	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	339,000.000	364,113.120	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	729,000.000	724,225.050	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	570,000.000	536,010.900	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,512,179.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	2,183,000.000	2,303,894.540	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,885,767.010	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	1,920,000.000	2,074,483.200	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,360,279.460	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	1,388,000.000	1,452,555.880	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,232,428.220	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120920	1,367,000.000	1,359,139.750	

	i	有価証券届出書(内国投資	資信託
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	1,115,000.000	1,111,298.200	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,005,193.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,091,000.000	1,395,148.980	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,100,155.330	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,150,566.580	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,973,323.630	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	886,461.540	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	928,973.280	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	807,061.900	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	721,616.820	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,091,863.740	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,283,776.950	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120115	1,766,000.000	1,798,847.600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,540,576.570	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,564,703.880	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130115	1,469,000.000	1,490,667.750	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	846,000.000	879,103.980	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,095,000.000	1,179,260.250	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,868,426.340	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	904,933.920	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,309,413.880	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,684,229.060	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,399,399.500	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,097,601.040	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,996,654.000	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	2,989,055.560	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,697,199.040	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,506,352.640	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,791,189.760	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,596,509.630	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,928,876.100	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,288,245.050	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,555,178.850	

		有価証券届出書(内国投資係	信託
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,188,876.440	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,553,718.560	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	2,927,244.960	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	3,949,327.650	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,290,419.600	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	2,317,000.000	2,357,686.520	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,011,335.360	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,545,351.780	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,870,190.240	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	2,057,409.270	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,892,825.800	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,741,194.840	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	3,213,000.000	3,246,254.550	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	2,615,000.000	2,659,585.750	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120301	1,954,000.000	1,966,896.400	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,732,110.080	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,711,404.060	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,341,000.000	1,353,377.430	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120701	1,037,000.000	1,034,853.410	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,436,000.000	1,375,429.520	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,527,000.000	1,501,941.930	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121215	411,000.000	404,074.650	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,822,916.950	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,524,000.000	1,462,079.880	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130601	562,000.000	548,590.680	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	809,451.090	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	739,000.000	697,941.160	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	751,000.000	701,058.500	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,608,996.050	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	464,448.780	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	889,171.010	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	964,226.900	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	912,805.200	

i		有価証券届出書(内国投資	信託
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,315,765.220	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	927,241.200	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,786,541.550	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,148,039.060	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,207,855.850	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	853,865.880	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,086,664.150	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,405,059.570	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,558,207.860	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,653,569.100	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,579,738.830	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,932,917.840	
2% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120328	1,080,000.000	1,088,748.000	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,299,000.000	1,284,918.840	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	506,923.560	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	435,000.000	430,123.650	
5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	579,199.400	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	544,953.460	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	426,191.700	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	580,120.000	
4% IRISH TREASURY 20111111	278,000.000	276,790.700	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,031,755.450	
3.9% IRISH TREASURY 20120305	820,000.000		
5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000		
5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000		
5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000		
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	984,939.900	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000		
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	765,653.480	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,979,551.000	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,463,131.350	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,495,616.710	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,269,820.380	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	702,764.320	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	854,668.160	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	982,047.240	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	843,000.000	906,941.550	
,		<u>'</u>	

4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915 4.36% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20130315 1.302,000.000 1.402,495.020 1.304,000.000 1.402,495.020 1.302,000.000 1.402,495.020 1.402,495.020 1.402,495.020 1.403,400.000 1.109,740.390 1.669,669.180 202020315 1.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020 1.137,000.000 1.174,737.030 1.175,7500.000 1.174,737.030 1.174,737.030 1.175,7500.000 1.174,737.030 1.175,7500.000 1.174,737.030 1.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140715 1.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915 1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140913 1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140930 20140730 2			有価証券届出書(内国投資	<b>資信託</b>
20190315		509,000.000	557,543.330	
20141020		1,302,000.000	1,420,495.020	
20260315   3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND   1,137,000.000   1,174,737.030     3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND   1,137,000.000   1,174,737.030     5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   725,000.000   801,654.250     4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   350,000.000   385,063.000     3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   424,340.570     4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   559,000.000   591,427.590     4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   559,000.000   611,077.500     4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   550,000.000   611,077.500     3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND   687,000.000   726,090.300     20140915   4% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   421,052.260     3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   443,080.930     1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND   20200415   4359,000.000   822,840.860     6% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080     6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   20290131   1,255,000.000   1,316,294.200     4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080     5% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080     5% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,055,229.440     20320730   1,088,000.000   1,704,364.300     5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,654,000.000   1,704,364.300     4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,654,000.000   1,755,668.970     20110731   1,240,000.000   1,583,538.480     2012031   2,725,000.000   1,583,538.480     2012031   2,985,581,581,600,681,681,681,681,681,681,681,681,681,681		1,051,000.000	1,109,740.390	
1,137,000.000		929,000.000	1,069,669.180	
20130704		1,137,000.000	1,174,737.030	
20150704   387,000.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   388,003.000   424,340.570   4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   559,000.000   591,427.590   4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   550,000.000   611,077.500   3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND   687,000.000   726,090.300   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   431,000.000   443,080.930   1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND   839,000.000   422,840.860   66% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080   6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   20140730   998,000.000   1,316,294.200   4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080   5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   953,000.000   1,017,920.080   5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,055,229.440   20120730   5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,439,996.050   5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,055,229.440   20120730   1,055,229.440   20120730   1,033,549.000   1,704,364.300   20120730   1,038,549.000   1,038,549.000   20130730   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,030,000.000   1,038,549.000   20150131   4.24,790.000   2,775,668.970   2076,286.500   2370131   1,881,000.000   1,755,668.970   2076,286.500   2076,		725,000.000	801,654.250	
20170915   391,000.000   424,340.570   4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND   559,000.000   591,427.590   20120915   4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   550,000.000   611,077.500   3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND   687,000.000   726,090.300   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   431,000.000   443,080.930   1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND   839,000.000   822,840.860   6% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080   6% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,255,000.000   1,316,294.200   20140730   6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080   20140730   976,358.030   976,358.030   20120730   5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   953,000.000   1,055,229.440   20320730   5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,439,996.050   20110730   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,704,364.300   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,080,000.000   1,038,549.000   4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,030,000.000   1,038,549.000   4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,030,000.000   1,038,549.000   4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,240,000.000   1,755,668.970   20150131   3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,881,000.000   1,755,668.970   20170131   3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,016,000.000   959,733.920   20170131   3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,016,000.000   1,583,538.480   20121031   2,000,0000   1,583,538.480   20121031		350,000.000	385,063.000	
20120915   559,000.000   591,427.590   4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   550,000.000   611,077.500   3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   431,000.000   443,080.930   422,840.860   422,840.860   422,840.860   422,840.860   423,000.000   424,052.260   424,052.260   424,052.260   424,052.260   425,000.000   424,080.930   424,080.930   424,080.930   424,080.930   424,080.930   425,840.860   42		391,000.000	424,340.570	
20190704   350,000.000   611,077.300   3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND   687,000.000   726,090.300   726,090.300   20140915   4% FINNISH GOVERNMENT BOND   391,000.000   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   431,000.000   443,080.930   1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND   839,000.000   822,840.860   6.15% FINNISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080   6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,255,000.000   1,316,294.200   4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080   5% SPANISH GOVERNMENT BOND   993,000.000   976,358.030   57.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,055,229.440   5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,411,000.000   1,439,996.050   5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,654,000.000   1,704,364.300   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,654,000.000   1,038,549.000   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,240,000.000   1,242,790.000   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,240,000.000   1,242,790.000   4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,240,000.000   1,755,668.970   20170731   1,881,000.000   1,755,668.970   20160131   3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,881,000.000   1,755,668.970   20170131   3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,572,000.000   1,583,538.480   20121031		559,000.000	591,427.590	
20140915		550,000.000	611,077.500	
20250704   391,000.000   421,052.260   3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND   431,000.000   443,080.930   1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND   839,000.000   822,840.860   6.15% FINNISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080   6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,255,000.000   1,316,294.200   1,316,294.200   1,316,294.200   1,017,920.08		687,000.000	726,090.300	
20200415		391,000.000	421,052.260	
20160415   639,000.000   622,840.860   68   SPANISH GOVERNMENT BOND   1,302,000.000   1,304,656.080   6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,255,000.000   1,316,294.200   1,017,920.080   4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   998,000.000   1,017,920.080   20120730   953,000.000   976,358.030   5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND   1,088,000.000   1,055,229.440   20320730   1,088,000.000   1,439,996.050   1,411,000.000   1,439,996.050   1,411,000.000   1,704,364.300   1,654,000.000   1,704,364.300   1,704,364.300   1,242,790.000   1,242,790.000   1,242,790.000   2,076,286.500   20370131   1,240,000.000   1,755,668.970   20160131   1,881,000.000   1,755,668.970   20121031   1,572,000.000   1,583,538.480   202121031   1,572,000.000   1,583,538.480   202121031   1,572,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   2020150131   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   1,582,000.000   1,583,538.480   202121031   2,000.000   1,583,538.480   202121031   2,000.000   1,583,538.480   202121031   2,000.000   2,000.000   1,583,538.480   202121031   2,000.000   2,000.00		431,000.000	443,080.930	
20290131		839,000.000	822,840.860	
20130131		1,302,000.000	1,304,656.080	
20140730 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730 5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131 3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131 4.0% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031 4.0% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031 4.0% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031		1,255,000.000	1,316,294.200	
20120730 953,000.000 976,358.030 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,088,000.000 1,055,229.440 5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,411,000.000 1,439,996.050 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,654,000.000 1,704,364.300 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,030,000.000 1,038,549.000 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,240,000.000 1,242,790.000 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 2,725,000.000 2,076,286.500 20370131 2,725,000.000 1,755,668.970 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,881,000.000 1,755,668.970 20160131 1,016,000.000 959,733.920 20170131 1,572,000.000 1,583,538.480 20121031 1,572,000.000 1,583,538.480		998,000.000	1,017,920.080	
20320730		953,000.000	976,358.030	
20111031		1,088,000.000	1,055,229.440	
20170730		1,411,000.000	1,439,996.050	
20130730		1,654,000.000	1,704,364.300	
20150131		1,030,000.000	1,038,549.000	
20370131		1,240,000.000	1,242,790.000	
20160131 1,755,668.970  3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,016,000.000 959,733.920  3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,572,000.000 1,583,538.480		2,725,000.000	2,076,286.500	
20170131 1,016,000.000 959,733.920 3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,572,000.000 1,583,538.480		1,881,000.000	1,755,668.970	
20121031 1,5/2,000.000 1,583,538.480		1,016,000.000	959,733.920	
4 OV SPANISH COVEDNMENT BOND		1,572,000.000	1,583,538.480	
20400730 1,139,000.000 966,168.140	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND	1,139,000.000	966,168.140	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,493,000.000 1,397,298.700	4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND	1,493,000.000	1,397,298.700	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,232,000.000 1,136,150.400	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND	1,232,000.000	1,136,150.400	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,866,000.000 1,882,775.340	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND	1,866,000.000	1,882,775.340	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 2,036,000.000 2,018,877.240	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND	2,036,000.000	2,018,877.240	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 1,517,000.000 1,450,949.820	4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND	1,517,000.000	1,450,949.820	

ĺ	1		有個証券由出書(內国投資)
	4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,654,033.750
	3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,150,500.180
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	457,000.000	369,763.270
	2.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130430	1,704,000.000	1,645,058.640
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	1,245,000.000	1,124,471.550
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	835,000.000	740,093.900
	3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,705,743.050
	2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20131031	668,000.000	637,318.760
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,401,000.000	1,342,732.410
	5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	383,344.000
	5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,240,767.900
	4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	580,776.200
	3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	497,510.880
	3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	271,358.500
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	286,390.800
	4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	563,593.750
	4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	498,423.900
	4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	376,750.000
	4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	540,770.710
	4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	1,520,000.000	1,298,368.800
	3.6% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20141015	711,000.000	657,760.320
	4.8% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20200615	416,000.000	351,495.040
ュ-	- 口 小計	ユーロ	ユーロ
		362,464,000.000	379,613,791.870
		(40,110,266,240)	(42,008,062,208)
 国債証券 合計		94,944,342,700	100,914,823,952
		[94,944,342,700]	[100,914,823,952]
 合計		94,944,342,700	100,914,823,952
- H		[94,944,342,700]	[100,914,823,952]
		[01,044,042,700]	[100,014,020,002]

- (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		合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	181銘柄	100%	41.8%
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	13銘柄	100%	1.0%
カナダ・ドル	国債証券	30銘柄	100%	2.8%
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	100%	0.4%

大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

スイス・フラン	国債証券	7銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.6%
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	14銘柄	100%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券	18銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	19銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	242銘柄	100%	41.6%

- 第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。
- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」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22年12月30日

資産総額 333,362,941円 負債総額 257,061円

純資産総額( - ) 333,105,880円

発行済数量 433,677,085口

1単位当たり純資産額( / ) 0.7681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22年12月30日

資産総額 97,039,493,063円 負債総額 357,189,887円

純資産総額( - ) 96,682,303,176円

発行済数量 200,531,326,611口

1 単位当たり純資産額 ( / ) 0.4821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22年12月30日

資産総額 51,082,780,820円 負債総額 157,547,080円

純資産総額( - ) 50,925,233,740円

発行済数量 41,925,100,263口

1 単位当たり純資産額 ( / ) 1.2147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22年12月30日

資産総額 47,040,504,095円 負債総額 389,159,685円

純資産総額( - ) 46,651,344,410円

発行済数量 51,822,548,143口

1単位当たり純資産額( / ) 0.9002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22年12月30日

資産総額 103,627,515,841円 負債総額 3,173,559,693円

EDINET提出書類 大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

純資産総額( - ) 100,453,956,148円発行済数量 59,384,265,796口1単位当たり純資産額( / ) 1.6916円

### 第4 【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

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。

上記 の申請のある場合には、上記 の振替機関等は、当該譲渡に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 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。

上記 の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に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。

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

### 1 【委託会社等の概況】

### a. 資本金の額

平成22年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減:該当事項はありません。

### b. 委託会社の機構

### 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。

### 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。

## 口.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。

### 八.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。

### 二.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 設定を行なうとともに「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 なっています。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なっています。

平成22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(親投資信託を除きます。)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	10	29,262
追加型株式投資信託	357	6,869,733
株式投資信託 合計	367	6,898,995
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,933,442
公社債投資信託 合計	17	2,933,442
総合計	384	9,832,438

### 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、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第51期事業年度(平成21年4月1日から平成22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)の財務諸表及び第51期事業年度(平成21年4月1日から平成22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52期事業年度に係る中間会計期間(平成22年4月1日から平成22年9月30日まで)の中間 財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

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) 当事業年度 前事業年度 (平成21年3月31日現在) (平成22年3月31日現在) 資産の部 流動資産 現金・預金 3,961,462 4,783,803 有価証券 28,233,112 26,970,072 前払金 453 136 前払費用 84,549 77,248 未収入金 20,722 3,858 未収消費税等 27,138 未収委託者報酬 5,273,080 7,030,430 未収収益 25.476 90.787 貯蔵品 38,909 30,324 繰延税金資産 227,536 566,334 2,030 256,955 その他 流動資産計 37,894,473 39,809,953 固定資産 有形固定資産 1 1,252,162 1,186,818 建物(純額) 349,484 318, 162 器具備品(純額) 900,893 757,333

大和証券投資信託委託株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

		有価証	<b>秀届出書(内国投資信託</b> :
建設仮勘定	1,785		111,322
無形固定資産	1,980,730		1,751,209
ソフトウェア	1,967,944		1,558,342
ソフトウェア仮勘定	-		179,630
電話加入権	11,850		11,850
商標権	-		660
その他	936		725
投資その他の資産	8,317,769		10,657,920
投資有価証券	7,780,508		10,018,677
関係会社株式	737,012		737,012
出資金	178,806		178,806
従業員に対する長期貸付			
金	155,692		104,419
差入保証金	618,264		617,615
長期前払費用	8,394		8,402
投資不動産(純額)	1 579,162	1	489,861
貸倒引当金	3 1,740,069	3	1,496,873
固定資産計	11,550,663		13,595,948
資産合計	49,445,137		53,405,901
<del></del>			

(単位:千円)

	前事業年度 (平成21年 3 月31日:		当事業 (平成22年 3 月	
負債の部				
流動負債				
預り金		48,999		46,289
未払金	5	,335,193		7,304,929
未払収益分配金		32,233		31,110
未払償還金		278,950		261,645
未払手数料	2	,896,691		3,847,895
その他未払金	2 2	,127,318	2	3,164,277
未払費用	1,	,528,570		2,212,051
未払法人税等		442,052		692,446
未払消費税等		-		104,897
賞与引当金		223,000		838,400
その他		1,951		168,621
流動負債計	7	,579,766		11,367,635
固定負債				
退職給付引当金	1,	,150,011		1,179,482
役員退職慰労引当金		62,520		39,300
繰延税金負債	1,	,767,537		1,963,856
固定負債計	2,	,980,068		3,182,638
負債合計	10	,559,835		14,550,274
純資産の部	,			
株主資本				
資本金	15	,174,272		15,174,272
資本剰余金				

11,495,727	11,495,727
11,495,727	11,495,727
374,297	374,297
2,800,000	2,800,000
9,659,553	9,085,103
12,833,851	12,259,401
39,503,851	38,929,401
618,549	18,061
-	55,712
618,549	73,774
38,885,301	38,855,627
49,445,137	53,405,901
	11,495,727 374,297 2,800,000 9,659,553 12,833,851 39,503,851 618,549 - 618,549 38,885,301

(単位:千円)

# (2) 【損益計算書】

		(単位:千円)  当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
委託者報酬	67,765,880	63,362,142
その他営業収益	391,449	432,889
営業収益計	68,157,330	63,795,032
営業費用		
支払手数料	40,411,927	37,293,022
広告宣伝費	836,270	917,652
公告費	2,131	257
受益証券発行費	4,887	131
調査費	4,089,629	4,336,342
調査費	752,522	771,298
委託調査費	3,337,107	3,565,043
委託計算費	657,069	601,778
営業雑経費	1,828,907	1,793,369
通信費	264,500	284,273
印刷費	908,407	837,408
協会費	49,882	45,168
諸会費	11,279	11,118
その他営業雑経費	594,837	615,400
営業費用計	47,830,823	44,942,552
一般管理費		
給料	3,940,850	4,847,709
役員報酬	149,400	217,200
給料・手当	3,408,724	3,478,553
賞与	159,726	313,555
賞与引当金繰入額	223,000	838,400
福利厚生費	573,052	680,311
交際費	89,101	80,019
寄付金	630	-
旅費交通費	233,872	178,718
租税公課	328,325	166,974
不動産賃借料	730,467	731,728
退職給付費用	310,345	303,972
役員退職慰労引当金繰入額	26,700	37,500
固定資産減価償却費	1,012,489	941,172
諸経費	904,760	990,534
一般管理費計	8,150,595	8,958,640
営業利益	12,175,911	9,893,838

		有価証券届出書(内国投資信託
	前事業年度	当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	33,852	61,884
有価証券利息	350,432	87,447
受取利息	4,904	3,425
時効成立分配金・償還金	38,525	40,507
投資有価証券売却益	-	213,196
有価証券償還益	26,762	33,090
為替差益	721,935	<u>-</u>
その他	20,641	82,595
	1,197,054	522,147
三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三 三		
時効成立後支払分配金・償還金	127,439	101,945
貯蔵品廃棄損	74,887	44,214
投資有価証券売却損	-	263,840
為替差損	-	7,870
デリバティブ損失	885,196	-
貸倒引当金繰入額	2 621,387	-
その他	50,066	68,406
	1,758,977	486,276
経常利益 -	11,613,987	9,929,709
特別利益		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
投資有価証券売却益	2,157	<u>-</u>
貸倒引当金戻入額	, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	159,959
	2,157	159,959
特別損失	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	·
投資有価証券売却損	2,298	-
投資有価証券評価損	218,872	-
投資有価証券清算損	10,639	<del>-</del>
固定資産除売却損	1 11,886	1 16,233
減損損失	, -	3 76,450
その他	4 42,274	, -
	285,971	92,683
税引前当期純利益	11,330,173	9,996,985
法人税、住民税及び事業税	4,648,684	4,592,433
法人税等調整額	168,125	516,225
法人税等合計	4,816,810	4,076,208
当期純利益	6,513,363	5,920,777
— ™ ר.ו.ח זיייר —	0,010,000	0,020,111

## (3) 【株主資本等変動計算書】

		(単位:千円)
	前事業年度	当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
	<u> </u>	<u> </u>
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		
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	11,702,152	9,659,553
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計	<del></del>	
前期末残高	14,876,450	12,833,851
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777

		13月世3月日日(13月357日日
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	12,833,851	12,259,401

		(単位:千円)
	前事業年度 (自 平成20年4月1日	当事業年度 (自 平成21年4月1日
	至 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	至 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	41,546,450	39,503,851
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	39,503,851	38,929,401
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	402,154	618,549
当期变動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	600,487
当期変動額合計	216,395	600,487
当期末残高	618,549	18,061
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	-	-
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	55,712
当期変動額合計	-	55,712
当期末残高	-	55,712
評価・換算差額等合計		
前期末残高	402,154	618,549
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	544,775
当期変動額合計	216,395	544,775
当期末残高	618,549	73,774
純資産合計		
前期末残高	41,144,295	38,885,301
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	216,395	544,775
当期変動額合計	2,258,994	29,674
当期末残高	38,885,301	38,855,627

## 重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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。	(1)子会社及び関連会社株式 同左
	(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。	(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 (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	(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(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。	(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

5.ヘッジ会計の方法	(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 年度未要支給額を計上しており来な 早度未要支給額を計上しており来な 「三、当社の退職金動の変勢にの 関係を制力では、当年度であります。 「四、1000年のでは、当年度を は、当社の退職を計しして も、当社の退職を計しして も、当社の退職を計算を ります。 (4) 役員の退職慰労引当金 役員の退職慰労員とに構える るため、当社の役員退職を 程に基づく当事業年度 を計上しております。	(3) 退職結合 (3) 退職結合 (4) 役員同 (4) 役員同 (4) の方型で、 (4) の方型で、 (2) へのようが、 (2) のが、 (2) のが、 (3) のが、 (4) のが、 (5) のが、 (6) のが、 (7) のが、 (8) のが、 (9) のが、 (1) ののが、 (2) のが、 (2) のが、 (3) のが、 (4) のが、 (5) のが、 (6) のが、 (7) のが、 (7) のが、 (8) のが、 (9) のが、 (9) のが、 (1) のが、 (1) のが、 (2) のが、 (3) のが、 (4) のが、 (4) のが、 (5) のが、 (6) のが、 (6) のが、 (7) のが、 (7) のが、 (8) のが、 (9) のが、 (9
6.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。	同左
7.その他財務諸表作成 のための基本となる 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。 (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。	(1)消費税等の会計処理 同左 (2)連結納税制度の適用 同左

# 会計方針の変更

前事業年度	当事業年度
(自 平成20年4月1日	(自 平成21年4月1日
至 平成21年3月31日)	至 平成22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h。

### 追加情報

前事業年度	当事業年度
(自 平成20年4月1日	(自 平成21年4月1日
至 平成21年3月31日)	至 平成22年3月31日)
	(投資有価証券売却損益の計上区分の変更) 従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。 この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利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	当事業年度	
(平成21年 3 月31日現在)	(平成22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	1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却	
累計額	累計額	
建物 776,838千円	建物 815,365千円	
器具備品 1,691,069千円	器具備品 1,938,369千円	
投資建物 675,647千円	投資建物 688,305千円	
投資器具備品 26,929千円	投資器具備品 27,339千円	
2 関係会社項目	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	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。	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	未払金 3,002,391千円	
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。	3 同左	
4 保証債務	4 保証債務	
子会社であるDaiwa Asset Management	子会社であるDaiwa Asset Management	
(Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して	(Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して	
保証を行っております。	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20年4月1日 至 平成21年3月31日)

当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 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 1 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 1,439千円 ソフトウェア 14.793千円

2 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 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グルー プについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産(浦安寮)

種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完 的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグ ルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッ シュ・フローが継続してマイナスとなっており、 減損の兆候が認められたため、当該資産グループ の帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少 額を減損損失(76,450千円)として特別損失に 計上しております。その内訳は、建物7,750千円及 び土地68,700千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味 売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額 により評価しております。

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。

剰余金の配当の総額 6,495百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 2,490円

基準日 平成21年3月31日

効力発生日 平成21年6月22日

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

(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

(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22年6月25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。

剰余金の配当の総額 11,216百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,300円

基準日 平成22年3月31日

## 効力発生日

## 平成22年6月28日

## (リース取引関係)

	T		
前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		
(借主側)	(借主側)		
リース取引開始日が平成20年3月31日以前の	リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所		
所有権移転外ファイナンス・リース取引	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	(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	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	該当事項はありません。		
減価償却累計額相当額 3,613千円			
期末残高相当額 985千円			
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	(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 - 千円	   該当事項はありません。		
合計 985千円			
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	(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	支払リース料 985千円		
減価償却費相当額 1,314千円	減価償却費相当額 985千円		
(4)減価償却費相当額の算定方法	(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	同左		
る定額法によっております。			

### (金融商品関係)

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式、債券であり

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

ます。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。債券は外貨建資産担保債券を保有しており、発行体の信用リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

#### ( ) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

#### ( )価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

#### ( ) デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

## 信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「 2 . 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、 その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

#### 2.金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:千円)

	1	日叫毗刀店	11日 ( ) 四汉县后司
	貸借対照表 計上 額	時価	差額
(1)現金・預金	4,783,803	4,783,803	-
(2)未収委託者報酬	7,030,430	7,030,430	-
(3)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	34,012,542	34,012,542	-
資産計	45,826,776	45,826,776	-
(1)未払手数料	3,847,895	3,847,895	-
(2)その他未払金	3,164,277	3,164,277	-
(3)未払費用(*1)	1,696,832	1,696,832	-
負債計	8,709,004	8,709,004	-
デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(7,985)	(7,985)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(159,516)	(159,516)	-
デリバティブ取引計	(167,501)	(167,501)	-

- (\*1) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。
- (\*2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、( )で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資 産

(1)現金・預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

## 負債

(1)未払手数料、(2)その他未払金、並びに(3)未払費用

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

## <u>デリバティブ取引</u>

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	

i e	
外貨建資産担保債券(*1)	311,905
非上場株式	1,172,137
(2) 子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	737,012
(3) 長期差入保証金	617,615

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(\*1)外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

## <注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	4,783,803	-	-	-
未収委託者報酬	7,030,430	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期	-	746,330	1,547,596	-
があるもの				
合計	11,814,233	746,330	1,547,596	-

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には 含めておりません。

## (追加情報)

当事業年度より、平成20年3月10日公表の「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第10号)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号)を適用しております。

## (有価証券関係)

前事業年度(平成21年3月31日現在)

## 1.その他有価証券で時価のあるもの

	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	67,520	12,418
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	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			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,766,074	2,627,319	1,138,755

小計	3,766,074	2,627,319	1,138,755
合計	5,553,176	4,510,267	1,042,909

## 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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
売却額 ( 千円 )	190,340	
売却益の合計額 (千円)	2,157	
売却損の合計額 (千円)	2,298	

## 3.時価評価されていない主な有価証券の内容

	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
小計	737,012
その他有価証券	
非上場株式	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,098,103
MMF・中期国債ファンド	28,233,112
小計	31,503,352
合計	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

	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	-

## 当事業年度(平成22年3月31日現在)

## 1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(貸借対照表計上額 737,012千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1)株式	76,077	55,101	20,975

(2)その他			
証券投資信託の受益証券	4,728,727	4,379,317	349,410
小計	4,804,805	4,434,419	370,385
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	29,207,737	29,608,576	400,839
小計	29,207,737	29,608,576	400,839
合計	34,012,542	34,042,996	30,453

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)、外貨建資産担保債券(貸借対照表計上額(貸倒引当金控除前) 1,804,069千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

#### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

種類	売却額 ( 千円 )	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	13,871,201	213,196	263,840
合計	13,871,201	213,196	263,840

## (デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

## 1.取引の状況に関する事項

前事業年度 (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。

## (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。

## (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。

#### (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。

#### 2.取引の時価等に関する事項(平成21年3月31日現在)

## 通貨関連

(単位:千

円)

	デリバ	契約額等		時価	評価損益
区分	トラィブ 取引の種 類		うち1 年超		
市場取引	為替予約 取引				
以外の取引	売建				
	米ドル	410,852	-	1,622	1,622
合計		410,852	ı	1,622	1,622

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

当事業年度(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における 契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとお りであります。

通貨関連 (単位:千円)

区分	デリバティブ	契約	的額等	時価	評価損益
	取引の種類等		うち1年超		
市場取引	為替予約取引				
以外の取引	売建				
7,01 37 17,31	米ドル	280,388	-	7,985	7,985
	合計	280,388	-	7,985	7,985

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連 (単位:千円)

ヘッジ会	デリバティブ					当該時価の
計の方法	取引の種類等	対象		うち1年超		算定方法
	株価指数先物取引					東京証券取引所
繰延へッ ジ処理	売建	投資 有価証券				から公表された 価格によってい
	TOPIX		2,303,784	-	159,516	る。
	合計		2,303,784		159,516	

#### (退職給付関係)

	有侧证分周山音(内国权其后和		
前事業年度	当事業年度		
(平成21年 3 月31日現在)	(平成22年 3 月31日現在)		
1.採用している退職給付制度の概要 当社は、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	2 . 退職給付債務に関する事項		
退職給付債務 1,150,011千円	退職給付債務 1,179,482千円		
退職給付引当金 1,150,011千円	退職給付引当金 1,179,482千円		
3.退職給付費用に関する事項	3 . 退職給付費用に関する事項		
勤務費用 168,703千円	勤務費用 175,249千円		
その他 141,642千円	<u>その他 128,723千円</u>		
退職給付費用 310,345千円	退職給付費用 303,972千円		
なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛	なお、「その他」の128,723千円は、確定		
金支払額は118,690千円であります。	拠出年金への掛金支払額であります。		

## (税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年 3 月31		当事業年度 (平成22年3月31日現在)			
1 . 繰延税金資産及び繰延税金 主な原因別内訳	·	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			
│ │ 繰延税金資産	千円	   繰延税金資産	千円		
   減損損失	886,012	   減損損失	915,392		
貸倒引当金	708,034	貸倒引当金	609,077		
退職給付引当金	467,939	退職給付引当金	479,931		
その他有価証券評価差額金	424,359	賞与引当金	302,163		
投資有価証券評価損	303,843	株式譲渡損繰延	287,965		
株式譲渡損繰延	287,965	投資有価証券評価損	225,062		
出資金評価損	126,163	外貨建有価証券換算差額	176,654		
未払事業税	108,049	未払事業税	163,956		
賞与引当金	90,738	出資金評価損	126,163		
器具備品	38,093	その他有価証券評価差額金	65,652		
役員退職慰労引当金	25,439	未払社会保険料	44,836		
未払社会保険料	11,283	繰延ヘッジ損益	38,221		
その他	31,981	器具備品	38,093		
繰延税金資産小計	3,509,905	役員退職慰労引当金	15,991		
評価性引当額	2,210,636	その他	27,316		
繰延税金資産合計	1,299,269	繰延税金資産小計	3,516,480		
   繰延税金負債		評価性引当額	2,139,543		
株式譲渡益繰延	2,837,113	操延税金資産合計 	1,376,937		
その他	2,156	   繰延税金負債			
繰延税金負債合計	2,839,269	株式譲渡益繰延	2,772,301		
   繰延税金負債の純額	1,540,000	その他	2,156		
		繰延税金負債合計	2,774,458		
		   繰延税金負債の純額	1,397,521		
			<u> </u>		

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
(調整)

交際費等永久に損金に算入されない項目
の.35
受取配当金等永久に益金に算入されない項目
住民税均等割
の.03
評価性引当額
その他
0.74

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

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

## (関連当事者情報)

税効果会計適用後の法人税等の負担率

前事業年度(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。

42.52

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	(所有) 直接 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 (株)	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	255,700	金融商品取引	-	証券投資信 託受益証券	証券投資信託 の代行手数料	980,553	未払手数料	58,506
ノ芸社	(株)	X		業		の募集販売	為替予約	17,314,889	-	-

同一の親 会社をも つ会社	(株)大和総 東京都 研 江東区	1,000	情報 サー ヒ 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) (株)大和総研との取引金額には、(株)大和総研ホールディングス(旧・株)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

(株)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)

当事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

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	(所有) 直接100.0	経営管 理	債務保 証	598,500	) -	-

#### (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	住所	資本金ま たは出資 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 (株)	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	22,043,473	未払手数料	2,870,857
同一の親会社をも	大和証券 キャピタ ル・マー	東京都千代田	255,700	金融商品取引	-	証券投資信託 受益証券の募	証券投資信 託の代行手 数料	676,687	未払手数料	64,597
つ会社	ケッツ(株)	☒		業		集販売	為替予約	3,946,508	-	-

- (注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の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、代行手数料を支払って おります。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 . 大和証券エスエムビーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケッツ(株)に商 号変更しております。

## 2.親会社に関する注記

(株)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	当事業年度			
(自 平成20年4月1日	(自 平成21年4月1日			
至 平成21年3月31日)	至 平成22年3月31日)			
1 株当たり純資産額 14,907.00円	1 株当たり純資産額 14,895.63円			
1 株当たり当期純利益 2,496.95円	1 株当たり当期純利益 2,269.77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。	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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益(千円)	6,513,363	5,920,777
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	当事業年度
(自 平成20年4月1日	(自 平成21年4月1日
至 平成21年3月31日)	至 平成22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22年9月30日)
資産の部	
流動資産	
現金・預金	6,449,461
有価証券	15,679,929
未収委託者報酬	6,749,851
貯蔵品	31,123
繰延税金資産	149,110
その他	499,217
流動資産計	29,558,694
固定資産	
有形固定資産	1 1,027,173
無形固定資産	2,186,747
投資その他の資産	
投資有価証券	10,171,248
その他	1 1,364,720
貸倒引当金	4,750
投資その他の資産合計	11,531,218
固定資産計	14,745,139
資産合計	44,303,833

(単位:千円) 当中間会計期間末 (平成22年9月30日) 負債の部 流動負債 未払金 5,238,233 未払法人税等 667,986 賞与引当金 202,000 その他 3 2,493,174 流動負債計 8,601,395 固定負債 繰延税金負債 1,933,977 退職給付引当金 1,282,101 役員退職慰労引当金 44,910 固定負債計 3,260,989 負債合計 11,862,385 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	
繰越利益剰余金	5,495,206
利益剰余金合計	5,869,503
株主資本合計	32,539,503
その他有価証券評価差額金	256,133
繰延へッジ損益	158,077
	98,055
—————————————————————————————————————	32,441,448
 負債・純資産合計	44,303,833
<del></del>	

# (2) 中間損益計算書

	(単位:千円)	
	当中間会計期間	
	(自 平成22年4月1日	
245 ATK 1142 2-4	至 平成22年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	35,840,980	
その他営業収益	182,006	
営業収益計	36,022,986	
営業費用		
支払手数料	20,637,131	
その他営業費用	4,755,940	
営業費用計	25,393,071	
一般管理費	1 4,061,645	
営業利益	6,568,268	
営業外収益	2 141,078	
営業外費用	1, 3 151,930	
経常利益	6,557,417	
特別利益	4 614,232	
特別損失	16,401	
税引前中間純利益	7,155,248	
法人税、住民税及び事業税	1,924,484	
法人税等調整額	404,004	
中間純利益	4,826,760	

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

	(十四:113)
	当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
	,
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
当中間期变動額	
別途積立金の取崩	2,800,000
当中間期変動額合計	2,800,000
当中間期末残高	-
繰越利益剰余金	
前期末残高	9,085,103
当中間期変動額	
別途積立金の取崩	2,800,000
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
当中間期変動額合計	3,589,897
当中間期末残高	5,495,206
	<del></del>

(単位:千円)

当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

	有価証券届出書(内国投資
利益剰余金合計	
前期末残高	12,259,401
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
当中間期変動額合計	6,389,897
当中間期末残高	5,869,503
株主資本合計	
前期末残高	38,929,401
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
当中間期変動額合計	6,389,897
当中間期末残高	32,539,503
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	18,061
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)	238,071
当中間期変動額合計	238,071
—————————————————————————————————————	256,133
 繰延へッジ損益	
前期末残高	55,712
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)	213,790
当中間期変動額合計	213,790
当中間期末残高	158,077
前期末残高	73,774
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)	24,281
当中間期変動額合計	24,281
当中間期末残高	98,055
純資産合計	
前期末残高	38,855,627
当中間期変動額	
剰余金の配当	11,216,657
中間純利益	4,826,760
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	24,281
当中間期変動額合計	6,414,178
当中間期末残高	32,441,448

	当中間会計期間
	(自 平成22年4月1日
	至 平成22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.固定資産の減価償却 の方法	<ul> <li>(2)デリバティブ 時価法により計上しております。</li> <li>(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。</li> <li>なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</li> <li>建物 6~47年 器具備品 3~20年</li> </ul>
	(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。 (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. その他中間財務諸表 作成のための基本と なる重要な事項 (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。

#### 会計方針の変更

# 当中間会計期間(自 平成22年4月1日

至 平成22年9月30日)

(資産除去債務に関する会計基準)

当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。

なお、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

## (中間貸借対照表関係)

# 当中間会計期間末(平成22年9月30日)

1. 減価償却累計額

有形固定資産 2,859,040千円 投資不動産 721,987千円

2. 債務保証

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務1,336,230千円に対して保証を行っております。

3. 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22年4月1日 至 平成22年9月30日)

1.減価償却実施額

有形固定資産	119,658千円	
無形固定資産	317,892千円	
投資不動産	6,342千円	
2 . 営業外収益の主要項目		
受取配当金	67,527千円	
有価証券利息	13,996千円	
時効成立分配金・償還金	37,338千円	
3 . 営業外費用の主要項目		
時効成立後分配金・償還金	92,732千円	
為替差損	18,809千円	
4 . 特別利益の主要項目		
貸倒引当金戻入額	614,232千円	

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22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22年 6 月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3 月31日	平成22年 6 月28日

## (金融商品関係)

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

#### (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払金は主に投資信託の販売に係る手数料及び連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であり、 そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。 なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の中間財務諸表作成の基本となる重要な事項「4.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

#### (3)金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

#### ( ) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

#### ( )価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

#### ( ) デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

#### 信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

#### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2.金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

#### 2.金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(<注2>参照のこと)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1)現金・預金	6,449,461	6,449,461	-
(2)未収委託者報酬	6,749,851	6,749,851	-
(3)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	23,942,028	23,942,028	-
資産計	37,141,341	37,141,341	-
未払金	5,238,233	5,238,233	-
負債計	5,238,233	5,238,233	
デリバティブ取引 (*1)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(33,670)	(33,670)	-
デリバティブ取引計	(33,670)	(33,670)	-

(\*1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の 債務となる項目については、( )で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## 資産

(1)現金・預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

## 負債

## 未払金

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

## <u>デリバティブ取引</u>

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	
非上場株式	1,172,137
(2)子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	737,012

614,389

(3)差入保証金

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を 把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

#### <注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	4年以出	1 年超	5 年超	40年却	
	1年以内	5年以内	10年以内	10年超	
現金・預金	6,449,461	-	-	-	
未収委託者報酬	6,749,851	-	-	-	
有価証券及び投資有価証券					
その他有価証券のうち満期	-	712,226	3,285,860	-	
があるもの					
合計	13,199,313	712,226	3,285,860	-	

## (有価証券関係)

当中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

#### 1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 737,012千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

#### 2. その他有価証券

	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
(1)株式	57,359	55,101	2,257
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	4,413,951	4,074,189	339,762
小計	4,471,310	4,129,291	342,019
中間貸借対照表計上額が取 得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	19,470,717	20,244,591	773,874
小計	19,470,717	20,244,591	773,874
合計	23,942,028	24,373,883	431,854

(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額 1,172,137千円)については、市場価格がなく、 時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 該当する取引はありません。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連 (単位:千円)

ヘッジ デリバティブ 会計の 四月のほ物等		主な契約を		額等	時価	当該時価の
方法	取引の種類等	対象		うち1年超	H4JJM	算定方法
原則的処理方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,106,965	-	33,670	東京証券取引所か ら公表された価格 によっている。
	合計		2,106,965	-	33,670	

## (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

#### [関連情報]

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

## 1.サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

#### 2.地域ごとの情報

#### (1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2)有形固定資産

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

#### 3.主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありませ

h.

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日) 該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日) 該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日) 該当事項はありません。

#### (追加情報)

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

## (1株当たり情報)

(「休当たり情報)				
当中間会計期間				
(自 平成22年4月1日				
至 平成22年9月30日)				
1 株当たり純資産額	12,436.70円			
   1 株当たり中間純利益金額	1,850.37円			
	, , , ,			
	性 式が方たしかいため 臼 載して			
│ (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 │				
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)	4,826,760			
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,826,760			
普通株主に帰属しない金額(千円)	-			

#### (重要な後発事象)

該当事項はありません。

普通株式の期中平均株式数(株)

2,608,525

## (追加情報)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インドにおいてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited (以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited (以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得することを決定しており、本件について、平成22年10月までにインド金融当局及び中央銀行からの承認を取得いたしました。

今後、最終的な取得手続を経た上で、SAMI及びSTCは大和証券グループの100%子会社になる予定です。

#### 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。

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なうことを内容とした運用を行なうこと (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。)。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(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。)。

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 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なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行な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なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記 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22年12月20日付で、Shinsei Asset Management (India) Pvt. Ltd. (現Daiwa Asset Management (India) Private Limited) およびShinsei Trustee Company (India) Pvt. Ltd. (現Daiwa Trustee Company (India) Private Limited) への出資を行い、当該2社を子会社といたしました。

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

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円(平成22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.

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位:百万円 (平成22年 3月末日現在)	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	342,037	(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22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) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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ある旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨 使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日 次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその 旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載 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。 ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

- (2) 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。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年1月7日

大和証券投資信託委託株式会社 取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 佐藤 茂 印

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印 業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワライフスタイル75の平成21年12月1日から平成22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22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

委託会社の監査報告書(当期)へ

<sup>(</sup>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。

<sup>(</sup>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。

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月25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 銀務執行社員

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22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

(注)上記は、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22年12月17日

#### 大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

#### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 森公高 公認会計士 囙 業務執行社員

指定有限責任社員

福井淳 公認会計士 EΠ 業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 梅津広 ΕIJ 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22年4月1日から平成23年3月31日まで の第52期事業年度の中間会計期間(平成22年4月1日から平成22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22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22年4月1日から平成22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

委託会社の監査報告書(前期)へ

<sup>(</sup>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。

<sup>(</sup>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。

## 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 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。