【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24年2月22日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 石橋 俊朗
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】	長谷川 英男 連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】	03-5695-2111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワライフスタイル７５
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成24年2月23日から平成25年2月21日まで） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワライフスタイル７５

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

(7) 【申込期間】

平成24年2月23日から平成25年2月21日まで（継続申込期間）

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

(9) 【払込期日】

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

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

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

⑤ 取得申込金額に利息は付きません。

⑥ 振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第１ 【ファンドの状況】

１ 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

（注1）商品分類の定義

- 「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- 「内外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- 「資産複合」…目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- 「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- 「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

・「その他の指数」…日経225、ＴＯＰＩＸにあてはまらないすべてのもの

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

＜信託金の限度額＞

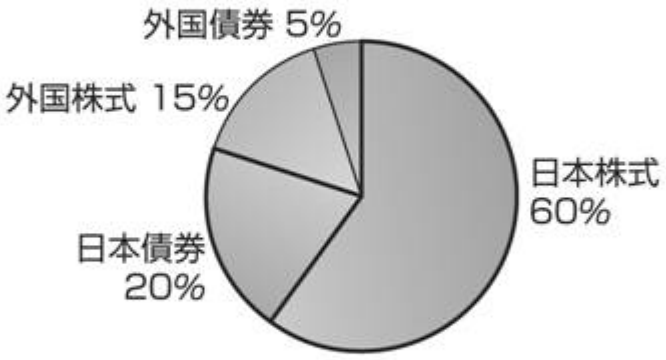
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。＜ファンドの特色＞

1 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。

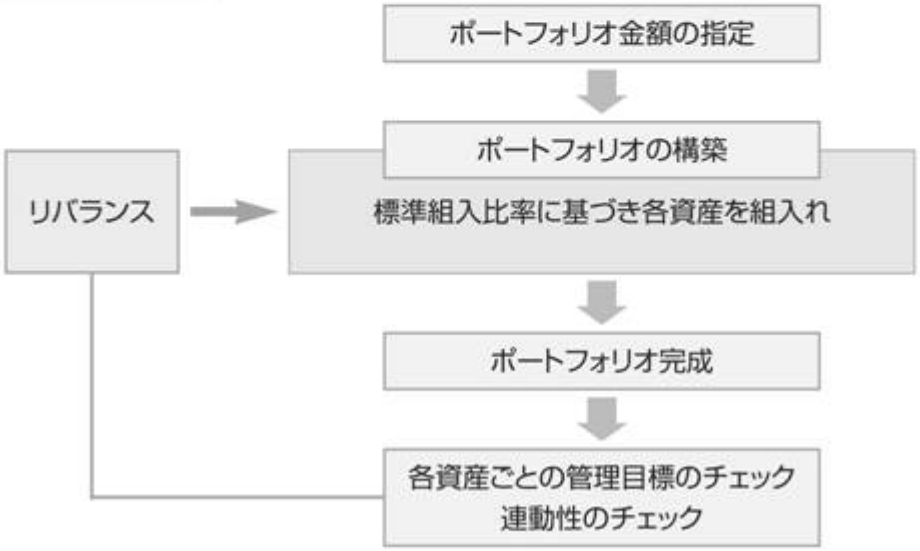
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

●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、投資者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、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

3 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。ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用いてポートフォリオを構築します。ＴＯＰＩＸへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

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

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。

ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利、ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標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ます。

株式会社東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値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ことができます。

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。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデル(注)の使用により効率的なＤＢＩ総合指数の複製を行ない同指数と連動するポートフォリオを構築します。またＤＢＩ総合指数の構成銘柄変更等に対しては、マルチファクターモデルを使用しポートフォリオのリバランスを行ないます。

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

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、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

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）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	住友信託銀行株式会社（※4） 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　　など

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、 わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、 外国の公社債 など （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。

※4：関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

◎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23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	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。

＜標準組入比率＞

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

日本債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の5%

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

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

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

へ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されると

き、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

① 委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から4．までに掲げる親投資信託（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の5．から25．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1．トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券

2．日本債券インデックスマザーファンド受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンド受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンド受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

9．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

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

14．コマーシャル・ペーパー

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

16．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

20．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

21．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

25．外国の者に対する権利で前24.の有価証券の性質を有するもの

なお、前5.の証券または証書ならびに前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。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

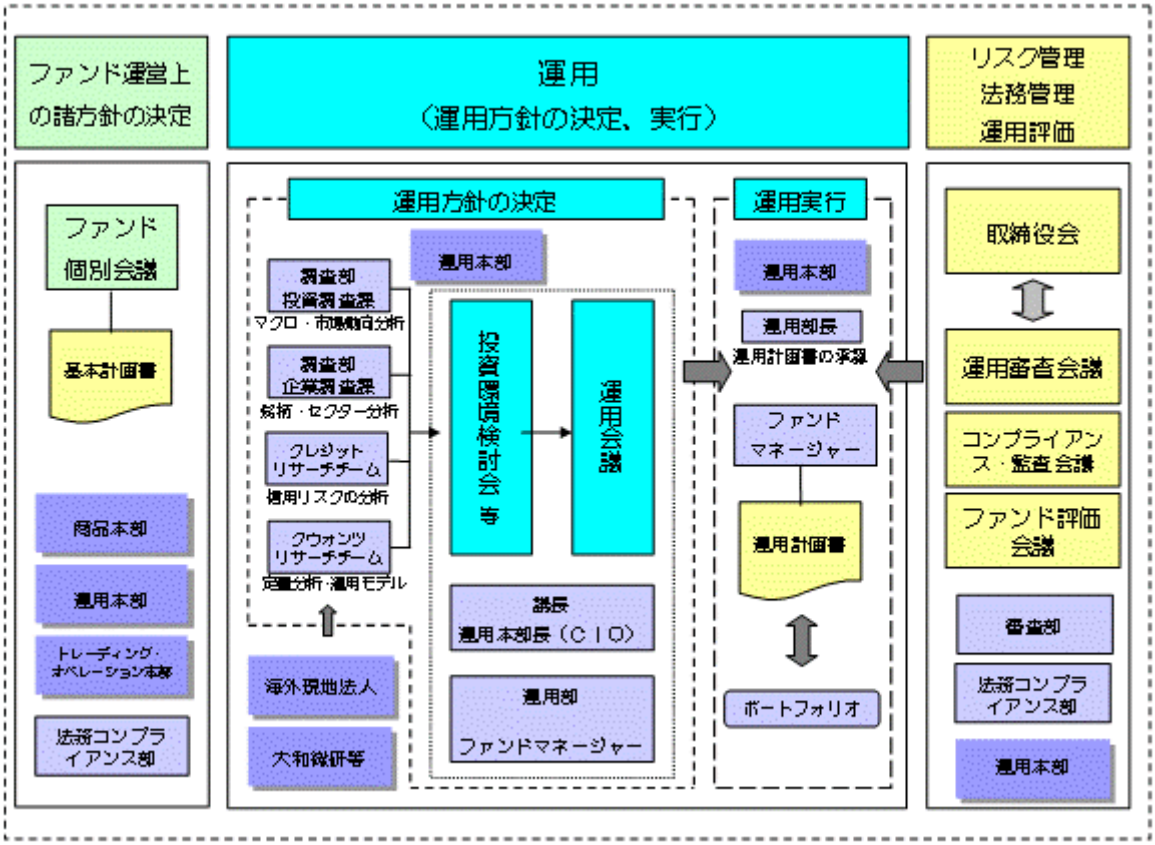
6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．運用本部長（ＣＩＯ）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営

・ファンドマネージャーの任命・変更

・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定

・各ファンドの分配政策の決定

・代表取締役に対する随時の的確な状況報告

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、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取っています。

※ 上記の運用体制は平成23年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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

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

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

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

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

⑦ 先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

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

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

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

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

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

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

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

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

⑧ スワップ取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

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

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

ニ．前ハ.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

ヘ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑩ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

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

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

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

ロ．前イ.の1.および2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑫ 外貨建資産（信託約款）

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

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

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参 考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけ

るわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

(注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは
東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年（昭和43年）1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969年（昭和44年）7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利、ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標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ます。
株式会社東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値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ことができます。

２．日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

ものをいいます。）

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

④ 外貨建資産への投資は、行ないません。

(注）ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数とは
ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が開発した日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定する指数であり、下記の債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。
対 象：日本で発行されている確定利付公募債券
残存額：50億円以上
期 間：残存期間1年以上
種 類：国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下

同じ。）および新株予約権証券

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

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

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

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

16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは
ＭＳＣＩコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

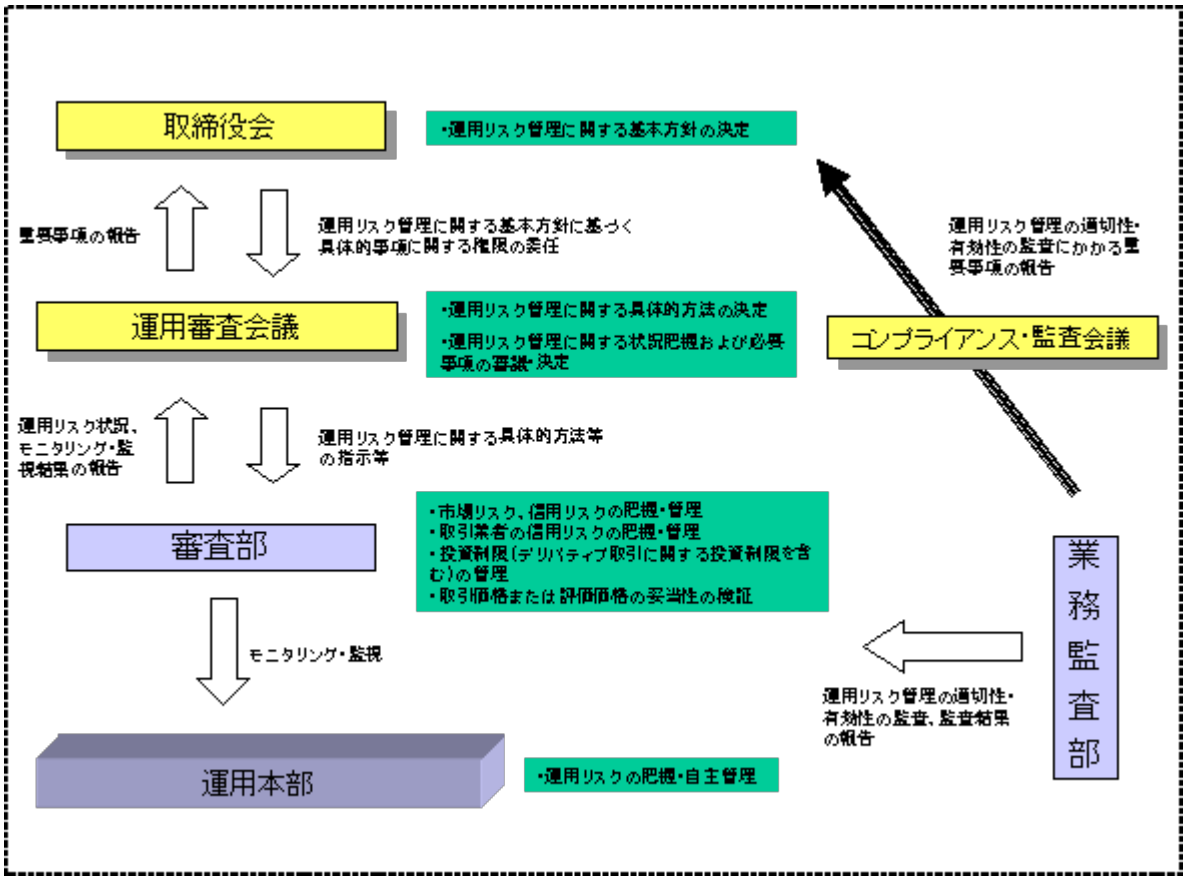
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) 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】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率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。

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

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

（※）「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、信託財産に関する租税、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。

① 個人の投資者に対する課税

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、配当所得として課税され、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25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）
平成26年1月1日から	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

ハ．損益通算について

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

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

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資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配当所得として課税され、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、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	7%（所得税7%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147%（所得税7%および復興特別所得税0.147%）
平成26年1月1日から	15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）

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

③ 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②にかかわらず所得税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

＜注1＞個別元本について

① 投資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。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資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、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 投資者が元本払戻金（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元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資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投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資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元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（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23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23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	313,879,999	99.70
内 日本	313,879,999	99.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	934,797	0.30
純資産総額	314,814,796	100.00

(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。

(2) 【投資資産】（平成23年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価(円)	評価単価 時価(円)	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	470,461,529	0.3994 187,927,898	0.4003 188,325,750	59.82
2	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	50,482,858	1.2300 62,094,310	1.2374 62,467,488	19.84
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	57,980,122	0.7913 45,880,007	0.8192 47,497,315	15.09
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,072,071	1.7086 15,500,542	1.7184 15,589,446	4.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 （分配落） (円)	純資産総額 （分配付） (円)	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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
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
平成22年12月末日	333,105,880	―	0.7681	―
平成23年1月末日	337,825,960	―	0.7761	―
2月末日	349,112,863	―	0.7997	―
3月末日	342,584,410	―	0.7673	―
4月末日	342,015,522	―	0.7618	―
5月末日	329,810,990	―	0.7498	―
6月末日	333,207,527	―	0.7533	―
7月末日	331,216,328	―	0.7428	―
8月末日	314,823,376	―	0.6955	―
9月末日	314,598,990	―	0.6873	―
10月末日	321,820,649	―	0.7021	―
第12計算期間末 (平成23年11月30日)	312,447,792	312,447,792	0.6722	0.6722
12月末日	314,814,796	―	0.6770	―

② 【分配の推移】

	１口当たり分配金(円)
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
第12計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第12計算期間	△9.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
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12計算期間	72,376,535	33,373,557

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成23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(%)
株式		80,421,475,960	97.15
	内 日本	80,421,475,960	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,361,795,934	2.85
純資産総額		82,783,271,894	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）	2,446,080,000	2.95
内 日本	2,446,080,000	2.95

(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。

(2) 投資資産（平成23年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	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 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,039,400	2,683.71 2,789,456,540	2,565.00 2,666,061,000	3.22
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,036,200	335.26 2,023,744,060	327.00 1,973,837,400	2.38
3	キヤノン	日本	株式	電気機器	501,700	3,383.08 1,697,295,177	3,410.00 1,710,797,000	2.07
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	682,500	2,372.63 1,619,322,245	2,348.00 1,602,510,000	1.94
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	367,000	3,763.51 1,381,210,000	3,935.00 1,444,145,000	1.74
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	603,300	2,123.02 1,280,821,291	2,144.00 1,293,475,200	1.56
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	316,900	3,661.21 1,160,239,501	3,380.00 1,071,122,000	1.29
8	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,220,800	112.83 1,153,303,062	104.00 1,062,963,200	1.28
9	ファナック	日本	株式	電気機器	84,200	11,147.00 938,577,975	11,780.00 991,876,000	1.20
10	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,572	146,324.88 961,647,167	141,500.00 929,938,000	1.12
11	三菱商事	日本	株式	卸売業	580,900	1,740.48 1,011,048,602	1,555.00 903,299,500	1.09
12	三井物産	日本	株式	卸売業	687,600	1,275.85 877,277,002	1,197.00 823,057,200	0.99
13	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	362,700	2,705.09 981,138,647	2,267.00 822,240,900	0.99
14	日 立	日本	株式	電気機器	1,814,000	390.57 708,503,400	404.00 732,856,000	0.89
15	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	2,000	369,674.01 739,348,021	362,000.00 724,000,000	0.87

16	小松製作所	日本	株式	機械	401,900	1,733.42 696,661,950	1,799.00 723,018,100	0.87
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	332,900	2,150.37 715,859,712	2,145.00 714,070,500	0.86
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,018,700	665.68 678,138,112	692.00 704,940,400	0.85
19	ソニー	日本	株式	電気機器	506,300	1,530.96 775,128,200	1,382.00 699,706,600	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	140,500	4,556.48 640,186,300	4,900.00 688,450,000	0.83
21	三菱地所	日本	株式	不動産業	559,000	1,237.10 691,541,600	1,150.00 642,850,000	0.78
22	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報・通信業	1,244	623,918.01 776,154,011	495,000.00 615,780,000	0.74
23	パナソニック	日本	株式	電気機器	926,700	752.65 697,488,996	654.00 606,061,800	0.73
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	808,000	685.59 553,959,610	738.00 596,304,000	0.72
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	187,400	2,893.01 542,151,644	3,130.00 586,562,000	0.71
26	信越化学	日本	株式	化学	151,500	3,907.91 592,049,500	3,790.00 574,185,000	0.69
27	東 芝	日本	株式	電気機器	1,706,000	323.77 552,360,000	315.00 537,390,000	0.65
28	国際石油開発帝石	日本	株式	鉱業	1,101	507,515.36 558,774,416	485,000.00 533,985,000	0.65
29	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	303,000	1,906.64 577,712,190	1,705.00 516,615,000	0.62
30	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	634,400	815.44 517,319,500	782.00 496,100,800	0.60

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.15%
合計	97.15%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.73%
建設業	2.34%
食料品	3.61%
繊維製品	0.94%
パルプ・紙	0.41%
化学	5.92%
医薬品	5.02%
石油・石炭製品	0.88%

ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	1.15%
鉄鋼	1.82%
非鉄金属	1.13%
金属製品	0.67%
機械	4.90%
電気機器	13.37%
輸送用機器	9.26%
精密機器	1.33%
その他製品	1.62%
電気・ガス業	3.15%
陸運業	4.11%
海運業	0.39%
空運業	0.29%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.58%
卸売業	5.27%
小売業	4.28%
銀行業	9.05%
証券、商品先物取引業	0.93%
保険業	2.09%
その他金融業	0.77%
不動産業	2.12%
サービス業	1.90%
合計	97.15%

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2012年3月	買建	336	2,473,335,655	2,446,080,000	2.95%

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

（参考）日本債券インデックスマザーファンド

（1）投資状況（平成23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(%)
国債証券	31,400,765,370	64.73

	内 日本	31,400,765,370	64.73
地方債証券		4,786,205,176	9.87
	内 日本	4,786,205,176	9.87
特殊債券		6,084,106,841	12.54
	内 日本	6,084,106,841	12.54
社債券		5,956,015,010	12.28
	内 日本	5,956,015,010	12.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		280,223,528	0.58
純資産総額		48,507,315,925	100.00

(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。

(2) 投資資産（平成23年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	３１２　１０年国債	日本	国債証券	690,000,000	101.95 703,482,480	102.86 709,796,100	1.200000 2020/12/20	1.46
2	３０５　１０年国債	日本	国債証券	474,000,000	103.73 491,690,360	104.63 495,984,120	1.300000 2019/12/20	1.02
3	３１８　１０年国債	日本	国債証券	435,000,000	99.39 432,362,430	100.35 436,544,250	1.000000 2021/09/20	0.90
4	３１０　１０年国債	日本	国債証券	428,000,000	100.52 430,256,840	101.46 434,257,360	1.000000 2020/09/20	0.90
5	３０４　２年国債	日本	国債証券	430,000,000	100.10 430,460,430	100.10 430,434,300	0.200000 2013/05/15	0.89
6	３０９　１０年国債	日本	国債証券	397,000,000	101.62 403,455,407	102.53 407,071,890	1.100000 2020/06/20	0.84
7	３０３　１０年国債	日本	国債証券	372,000,000	104.74 389,655,192	105.57 392,753,880	1.400000 2019/09/20	0.81
8	７８　５年国債	日本	国債証券	360,000,000	101.54 365,565,365	101.51 365,436,000	0.900000 2013/12/20	0.75
9	９８　５年国債	日本	国債証券	365,000,000	99.68 363,857,360	99.95 364,839,400	0.300000 2016/06/20	0.75
10	３１４　１０年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.84 352,940,350	101.74 356,097,000	1.100000 2021/03/20	0.73
11	９２　５年国債	日本	国債証券	355,000,000	100.01 355,035,355	100.16 355,585,750	0.300000 2015/09/20	0.73
12	９６　５年国債	日本	国債証券	347,000,000	100.65 349,255,349	100.85 349,949,500	0.500000 2016/03/20	0.72
13	３１５　１０年国債	日本	国債証券	305,000,000	101.47 309,501,302	102.39 312,289,500	1.200000 2021/06/20	0.64
14	１００　５年国債	日本	国債証券	310,000,000	99.65 308,939,309	99.88 309,640,400	0.300000 2016/09/20	0.64

15	３１６　１０年国債	日本	国債証券	302,000,000	100.52 303,570,400	101.47 306,460,540	1.100000 2021/06/20	0.63
16	３１３　１０年国債	日本	国債証券	295,000,000	102.59 302,649,200	103.48 305,283,700	1.300000 2021/03/20	0.63
17	３０７　１０年国債	日本	国債証券	290,000,000	103.52 300,219,600	104.41 302,789,000	1.300000 2020/03/20	0.62
18	２６９　１０年国債	日本	国債証券	278,000,000	103.45 287,610,460	103.46 287,629,920	1.300000 2015/03/20	0.59
19	１１３　２０年国債	日本	国債証券	269,000,000	105.60 284,085,520	106.75 287,157,500	2.100000 2029/09/20	0.59
20	２８８　１０年国債	日本	国債証券	265,000,000	106.78 282,976,920	107.22 284,133,000	1.700000 2017/09/20	0.59
21	２９６　１０年国債	日本	国債証券	260,000,000	105.70 274,820,200	106.38 276,595,800	1.500000 2018/09/20	0.57
22	８８　５年国債	日本	国債証券	268,000,000	100.84 270,272,640	100.90 270,425,400	0.500000 2015/03/20	0.56
23	３０７　２年国債	日本	国債証券	265,000,000	100.10 265,288,250	100.12 265,318,000	0.200000 2013/08/15	0.55
24	９３　５年国債	日本	国債証券	260,000,000	100.71 261,866,260	100.87 262,285,400	0.500000 2015/12/20	0.54
25	２９９　１０年国債	日本	国債証券	244,000,000	104.26 254,413,920	105.04 256,317,120	1.300000 2019/03/20	0.53
26	２８０　１０年国債	日本	国債証券	237,000,000	106.87 253,300,260	107.02 253,658,730	1.900000 2016/06/20	0.52
27	９７　５年国債	日本	国債証券	245,000,000	100.13 245,325,850	100.39 245,967,750	0.400000 2016/06/20	0.51
28	９９　５年国債	日本	国債証券	235,000,000	100.07 235,167,250	100.32 235,761,400	0.400000 2016/09/20	0.49
29	３０６　１０年国債	日本	国債証券	224,000,000	104.33 233,719,360	105.18 235,609,920	1.400000 2020/03/20	0.49
30	２９２　１０年国債	日本	国債証券	217,000,000	106.95 232,094,520	107.50 233,290,190	1.700000 2018/03/20	0.48

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	64.73%
地方債証券	9.87%
特殊債券	12.54%
社債券	12.28%
合計	99.42%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成23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(%)
株式		42,737,105,997	96.67
	内 香港	551,924,687	1.25
	内 シンガポール	323,963,786	0.73
	内 イスラエル	125,700,842	0.28
	内 ノルウェー	183,084,488	0.41
	内 スウェーデン	617,177,539	1.40
	内 デンマーク	214,365,167	0.48
	内 イギリス	4,695,582,383	10.62
	内 アイルランド	58,286,315	0.13
	内 オランダ	500,641,842	1.13
	内 ベルギー	202,599,879	0.46
	内 フランス	1,785,857,690	4.04
	内 ドイツ	1,596,979,987	3.61
	内 スイス	1,753,050,120	3.97
	内 ポルトガル	37,558,787	0.08
	内 スペイン	663,706,490	1.50
	内 イタリア	459,789,789	1.04
	内 フィンランド	171,253,489	0.39
	内 オーストリア	51,317,511	0.12
	内 ギリシャ	16,345,944	0.04
	内 カナダ	2,491,971,369	5.64
	内 アメリカ	24,576,283,013	55.59
	内 オーストラリア	1,644,250,633	3.72
	内 ニュージーランド	15,414,247	0.03
投資証券		790,170,801	1.79
	内 香港	20,484,000	0.05
	内 シンガポール	8,096,584	0.02
	内 イギリス	48,576,131	0.11
	内 オランダ	5,617,302	0.01
	内 フランス	56,930,608	0.13
	内 アメリカ	531,189,858	1.20
	内 オーストラリア	119,276,318	0.27

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	681,514,171	1.54
純資産総額	44,208,790,969	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）	659,814,363	1.49
内 アメリカ	659,814,363	1.49
為替予約取引（買建）	71,527,500	0.16
内 日本	71,527,500	0.16

(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23年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	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 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	133,055	5,987.92 796,723,766	6,628.88 882,006,932	2.00
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	25,400	29,049.33 737,853,973	31,494.02 799,948,332	1.81
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	32,100	14,066.27 451,527,447	14,473.63 464,603,626	1.05
4	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	54,218	7,576.46 410,781,815	8,354.71 452,976,090	1.02
5	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	205,800	1,933.08 397,840,669	2,022.79 416,291,170	0.94
6	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	93,850	4,192.38 393,455,145	4,432.18 415,960,468	0.94
7	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	289,200	1,165.71 337,145,864	1,404.76 406,257,113	0.92
8	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	74,137	4,861.08 360,386,051	5,206.24 385,975,593	0.87
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	74,200	4,882.92 362,317,532	5,121.51 380,016,131	0.86
10	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	159,595	2,181.38 348,138,043	2,345.41 374,316,635	0.85
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	208,263	1,508.15 314,093,093	1,687.73 351,492,838	0.80
12	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,900	45,350.79 312,920,992	49,940.17 344,587,214	0.78

13	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	56,300	5,153.15 290,125,758	5,454.23 307,073,622	0.69
14	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,409,037	203.43 286,650,795	214.34 302,013,117	0.68
15	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	136,772	1,878.43 256,927,105	2,158.06 295,162,511	0.67
16	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	492,300	582.87 286,949,682	589.46 290,193,718	0.66
17	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	47,100	5,788.52 272,639,311	6,149.23 289,628,921	0.66
18	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	518,800	525.72 272,746,794	552.08 286,421,428	0.65
19	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	99,600	2,565.13 255,487,157	2,847.88 283,649,217	0.64
20	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	64,100	4,037.75 258,819,948	4,403.24 282,247,844	0.64
21	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	104,220	2,220.25 231,394,914	2,598.07 270,770,939	0.61
22	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	139,800	1,833.10 256,268,666	1,908.51 266,810,677	0.60
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,300	11,708.90 225,981,847	13,155.97 253,910,395	0.57
24	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	141,002	1,637.80 230,933,456	1,765.40 248,924,980	0.56
25	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	78,200	2,857.72 223,474,047	3,113.48 243,474,683	0.55
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	81,821	2,680.47 219,319,161	2,933.13 239,991,646	0.54
27	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	50,700	4,522.13 229,272,285	4,663.62 236,445,666	0.53
28	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	86,500	2,767.61 239,398,922	2,729.64 236,113,860	0.53
29	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	57,250	3,752.45 214,828,026	3,953.37 226,330,493	0.51
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	43,700	4,956.70 216,608,206	5,172.81 226,052,217	0.51

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.67%
投資証券	1.79%
合計	98.46%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	12.52%
素材	7.14%

資本財・サービス	9.82%
一般消費財・サービス	9.30%
生活必需品	11.37%
ヘルスケア	10.70%
金融	15.73%
情報技術	11.81%
電気通信サービス	4.34%
公益事業	3.94%
合計	96.67%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2012年3月	買建	27	657,521,227	659,814,363	1.49%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2012年1月	買建	300,000	35,936,100	35,937,000	0.08%
		スイス・フラン買/円売 2012年1月	買建	200,000	16,540,000	16,538,000	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2012年1月	買建	250,000	19,053,250	19,052,500	0.04%

(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。
(注3) 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4) 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。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成23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(%)
国債証券		103,883,243,937	97.31
	内 ユーロ	42,086,719,630	39.42
	内 シンガポール	405,788,234	0.38
	内 マレーシア	564,600,994	0.53
	内 ノルウェー	314,472,233	0.29
	内 スウェーデン	645,128,477	0.60
	内 デンマーク	912,821,501	0.86
	内 イギリス	9,070,108,137	8.50
	内 スイス	473,278,291	0.44
	内 ポーランド	749,300,871	0.70

	内 カナダ	3,157,906,493	2.96
	内 アメリカ	43,117,581,351	40.39
	内 メキシコ	845,776,679	0.79
	内 オーストラリア	1,539,761,046	1.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,876,077,849	2.69
純資産総額		106,759,321,786	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）		1,480,554,372	1.39
	内 日本	1,480,554,372	1.39

(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) 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23年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価(円)	評価単価 時価(円)	利率(%) 償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
1	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	7,436,000	113.00 653,264,658	113.78 658,785,352	3.375000 2019/11/15	0.62
2	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,999,000	115.52 628,563,031	116.10 631,751,693	3.750000 2018/11/15	0.59
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,947,000	108.55 586,256,490	109.32 590,436,556	2.750000 2019/02/15	0.55
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,144,000	111.15 530,919,434	111.95 534,726,218	3.125000 2019/05/15	0.50
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,842,000	114.79 521,354,165	115.64 525,223,579	3.625000 2019/08/15	0.49
6	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	114.97 503,222,587	115.85 507,087,268	3.625000 2020/02/15	0.47
7	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	3,780,000	104.28 472,265,475	105.04 475,707,042	2.000000 2016/01/22	0.45
8	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	113.96 465,940,665	114.90 469,775,554	3.500000 2020/05/15	0.44
9	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,554,000	128.27 454,122,287	129.36 457,995,351	4.375000 2039/11/15	0.43
10	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,814,000	132.26 445,908,426	133.24 449,212,451	4.750000 2038/12/07	0.42
11	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,202,000	133.31 435,481,638	134.36 438,927,918	4.625000 2040/02/15	0.41
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,929,000	106.68 408,803,737	107.74 412,846,291	2.625000 2020/08/15	0.39
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,180,000	100.24 403,683,803	100.23 403,619,394	0.375000 2013/06/30	0.38

14	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.55 401,956,402	111.78 403,803,602	3.250000 2017/03/31	0.38
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,930,000	104.74 401,432,400	104.57 403,773,099	2.250000 2014/05/31	0.38
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	102.50 387,340,796	104.89 396,345,244	3.000000 2015/10/25	0.37
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,585,000	105.13 379,595,869	109.12 393,972,685	4.250000 2023/10/25	0.37
18	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,184,000	118.35 384,979,487	119.41 388,410,944	3.875000 2040/08/15	0.36
19	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,873,000	112.27 386,449,286	112.43 386,999,946	5.000000 2014/09/07	0.36
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	110.42 379,188,427	111.45 382,704,614	3.125000 2021/05/15	0.36
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	103.98 379,299,621	104.50 381,189,990	3.000000 2014/07/12	0.36
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,430,000	106.36 367,418,880	110.14 380,483,165	4.250000 2019/04/25	0.36
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.68 379,070,678	104.66 379,012,729	1.875000 2015/06/30	0.36
24	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	106.46 373,173,876	107.53 376,928,048	2.625000 2020/11/15	0.35
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,256,000	110.84 363,480,374	114.24 374,632,627	3.500000 2019/07/04	0.35
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,841,000	92.61 358,263,796	96.09 371,713,774	2.500000 2020/10/25	0.35
27	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,437,000	106.71 368,077,342	106.58 367,635,829	2.625000 2014/12/31	0.34
28	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,025,000	155.25 365,107,767	156.11 367,130,201	8.000000 2021/11/15	0.34
29	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,076,000	114.88 364,024,367	115.84 367,069,675	3.625000 2021/02/15	0.34
30	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,644,000	101.34 365,887,365	101.26 365,577,079	1.375000 2013/01/15	0.34

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.31%
合計	97.31%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2012年2月	買建	44,000	3,623,800	3,638,360	0.00%
		ユーロ買/円売 2012年1月	買建	1,555,446	161,906,400	156,633,436	0.15%
		米ドル買/円売 2012年2月	買建	4,055,146	315,493,205	315,044,272	0.30%
		豪ドル買/円売 2012年2月	買建	129,000	10,114,839	10,161,330	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012年1月	買建	93,494	7,033,359	7,125,151	0.01%
		ユーロ買/円売 2012年2月	買建	4,086,554	412,571,338	411,393,367	0.39%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2012年2月	買建	411,000	9,378,273	9,333,810	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2012年1月	買建	497,000	6,949,782	6,729,380	0.01%
		英ポンド買/円売 2012年1月	買建	695,316	84,427,464	83,291,957	0.08%
		豪ドル買/円売 2012年1月	買建	146,000	11,373,775	11,542,760	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2012年2月	買建	429,000	5,844,633	5,808,660	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2012年2月	買建	1,901,000	10,518,161	10,531,540	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2012年2月	買建	664,000	7,469,191	7,470,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012年2月	買建	506,506	38,491,706	38,580,588	0.04%
		英ポンド買/円売 2012年2月	買建	932,000	112,173,340	111,560,400	0.10%
		米ドル買/円売 2012年1月	買建	3,752,854	292,279,260	291,709,361	0.27%

(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。

次へ

（参考情報）

2011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

基準価額	6,770円
純資産総額	3.1億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.7%
3カ月間	-1.5%
6カ月間	-10.1%
1年間	-11.9%
3年間	-3.5%
5年間	-40.4%
設定来	-32.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

2002年1月4日～2011年12月30日

※「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。

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 00年11月	第2期 01年11月	第3期 02年12月	第4期 03年12月	第5期 04年11月	第6期 05年11月	第7期 06年11月	第8期 07年11月	第9期 08年12月	第10期 09年11月	第11期 10年11月	第12期 11年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	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。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式・先物	1,301	59.9%
国内債券	413	19.7%
外国株式・先物	1,189	14.8%
外国債券	627	4.8%
外国リート	43	0.3%
コール・ローン、その他		2.5%
合計	3,573	-

通貨別構成	比率
日本円	80.0%
米ドル	10.8%
ユーロ	3.9%
英ポンド	2.1%
カナダ・ドル	1.0%
豪ドル	0.7%
スイス・フラン	0.6%
スウェーデン・クローネ	0.2%
香港ドル	0.2%
その他	0.5%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.8
最終利回り(%)	1.0
修正デュレーション	6.9
残存年数	8.1

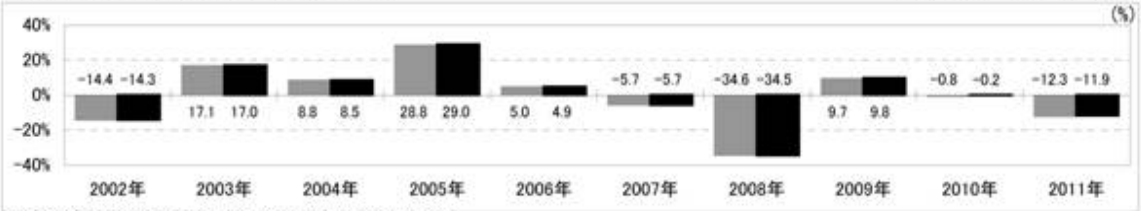
債券格付別構成	比率
AAA	16.7%
AA	71.5%
A	7.0%
BBB	0.8%
BB以下・無格付	4.1%
合計	100.0%

組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
トヨタ自動車	日本	1.9%
TOPIX先物　2403月	日本	1.8%
三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.4%
キヤノン	日本	1.2%
本田技研	日本	1.2%
日本電信電話	日本	1.0%
三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%
武田薬品	日本	0.8%
みずほフィナンシャルG	日本	0.8%
ファナック	日本	0.7%
合計		11.8%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を4.1%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&I、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。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2011年は12月30日までの騰落率を表しています。
・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。

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。

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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらか

じめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

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

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

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

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請

求することができます。

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

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。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、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。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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）及び第12期計算期間（平成22年12月1日から平成23年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

ダイワライフスタイル７５

ダイワライフスタイル７５
(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 平成22年11月30日現在	第12期 平成23年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,456,033	2,531,207
親投資信託受益証券	316,417,410	311,550,486
流動資産合計	318,873,443	314,081,693
資産合計	318,873,443	314,081,693
負債の部		
流動負債		
未払解約金	71,227	115,467
未払受託者報酬	127,800	133,824
未払委託者報酬	1,310,338	1,372,148
その他未払費用	11,891	12,462
流動負債合計	1,521,256	1,633,901
負債合計	1,521,256	1,633,901
純資産の部		
元本等		
元本	※1 425,803,234	※1 464,806,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △108,451,047	※2 △152,358,420
（分配準備積立金）	30,575,444	28,367,262
元本等合計	317,352,187	312,447,792
純資産合計	317,352,187	312,447,792
負債純資産合計	318,873,443	314,081,693

(2) 【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
営業収益		
受取利息	1,593	1,516
有価証券売買等損益	10,160,544	△30,363,924
営業収益合計	10,162,137	△30,362,408
営業費用		
受託者報酬	253,573	275,128
委託者報酬	2,600,080	2,821,025
その他費用	23,590	25,618
営業費用合計	2,877,243	3,121,771
営業利益又は営業損失（△）	7,284,894	△33,484,179
経常利益又は経常損失（△）	7,284,894	△33,484,179
当期純利益又は当期純損失（△）	7,284,894	△33,484,179
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,089,835	△247,625
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△104,282,287	△108,451,047
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,605,011	8,459,578
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,605,011	8,459,578
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,968,830	19,130,397
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,968,830	19,130,397
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△108,451,047	△152,358,420

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第11期 平成22年11月30日現在	第12期 平成23年11月30日現在
1. ※1 期首元本額	379,779,092円	425,803,234円
期中追加設定元本額	81,429,409円	72,376,535円
期中一部解約元本額	35,405,267円	33,373,557円
2. 計算期間末日における受益権の総数	425,803,234口	464,806,212口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は108,451,047円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は152,358,420円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23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（1,018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（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、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（89,270,931円）及び分配準備積立金（28,367,262円）より分配対象額は117,638,193円（1万口当たり2,530.91円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23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。	同左
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、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	同左
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。	同左
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。	同左

Ⅱ　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	第12期 平成23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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（追加情報）

第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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。	―――――――

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種 類	第11期 平成22年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第12期 平成23年11月30日現在 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	9,053,551	△31,013,958
合計	9,053,551	△31,013,958

（デリバティブ取引に関する注記）
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	第12期 平成23年11月30日現在
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	第12期 自 平成22年12月1日 至 平成23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11期 平成22年11月30日現在	第12期 平成23年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7453円 (7,453円)	0.6722円 (6,722円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	462,467,105	184,755,608	
	日本債券インデックスマザーファンド	51,755,223	63,658,924	
	外国株式インデックスマザーファンド	59,924,521	47,418,273	
	外国債券インデックスマザーファンド	9,199,158	15,717,681	
親投資信託受益証券 合計		583,346,007	311,550,486	

合計	583,346,007	311,550,486	

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

		平成22年11月30日現在 金 額（円）	平成23年11月30日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,818,834,278	2,107,306,890
株式	※3	91,225,627,750	79,663,342,555
派生商品評価勘定		61,166,178	2,047,829
未収入金		443,587	13,351,015
未収配当金		504,038,275	579,288,117
前払金		―	36,454,000
流動資産合計		93,610,110,068	82,401,790,406
資産合計		93,610,110,068	82,401,790,406
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,494,511	41,550,352
前受金		91,911,000	―
未払金		―	407,856,227
未払解約金		387,775,000	38,200,000
流動負債合計		482,180,511	487,606,579
負債合計		482,180,511	487,606,579
純資産の部			
元本等			
元本	※1	201,865,410,927	205,035,658,182
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△108,737,481,370	△123,121,474,355
元本等合計		93,127,929,557	81,914,183,827
純資産合計		93,127,929,557	81,914,183,827
負債純資産合計		93,610,110,068	82,401,790,406

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21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23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 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。	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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び評価方法	先物取引	先物取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年11月30日現在	平成23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	198,496,539,943円	201,865,410,927円
同期中における追加設定元本額	18,482,977,114円	19,572,419,561円
同期中における一部解約元本額	15,114,106,130円	16,402,172,306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	1,827,977,064円	2,166,113,764円
トピックス・インデックスファンド	11,355,152,914円	10,515,654,250円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	37,540,919,907円	34,848,763,098円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	1,053,248,340円	874,956,562円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	408,819,017円	413,145,012円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	6,624,272,198円	6,729,476,076円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	406,311,668円	395,488,289円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	8,944,337,173円	8,787,991,571円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	55,387,545,369円	60,508,521,981円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,870,711,058円	2,413,289,209円
ダイワ・ライフ・バランス５０	217,055,087円	1,001,092,232円
ダイワ・ライフ・バランス７０	181,688,938円	763,040,454円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,265,555,828円	1,754,742,321円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	16,553,954円	18,469,036円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	14,675,588円	19,012,899円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	919,041円	1,548,073円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	500,282,197円	479,797,970円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	3,473,643,223円	3,619,442,756円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	2,075,331,030円	2,092,447,602円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	115,778,941円	119,251,952円

ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	797,303,991円	813,328,821円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	373,445,348円	374,139,595円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	4,062,250,479円	4,165,537,556円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	596,105,462円	615,498,415円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	35,877,519,420円	33,146,326,670円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	2,410,471,798円	2,572,885,536円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	5,582,048,617円	5,438,517,962円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,033,655,709円	3,021,942,080円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	533,316,921円	576,398,066円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	460,974,143円	706,526,826円
ダイワライフスタイル２５	177,432,821円	212,395,585円
ダイワライフスタイル５０	504,129,905円	592,840,851円
ダイワライフスタイル７５	416,798,965円	462,467,105円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	13,759,178,813円	14,814,608,007円
計	201,865,410,927円	205,035,658,182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	201,865,410,927口	205,035,658,182口
3．※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は108,737,481,370円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は123,121,474,355円であります。
4．※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　434,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　447,700,000円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　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	自　平成22年12月1日 至　平成23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。	同左

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。	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（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3．　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。	同左
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。 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。	同左

Ⅱ　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	平成23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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（追加情報）

自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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。	―――――――

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成23年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,314,435,928	△2,919,462,830
合計	1,314,435,928	△2,919,462,830

（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22年9月22日から平成22年11月30日まで、及び平成23年9月21日から平成23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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成22年11月30日 現在				平成23年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	1,768,509,000	―	1,827,540,000	59,031,000	2,287,114,000	―	2,247,975,000	△39,139,000
合計	1,768,509,000	―	1,827,540,000	59,031,000	2,287,114,000	―	2,247,975,000	△39,139,000

（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22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4613円 (4,613円)	0.3995円 (3,995円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備考
		単 価	金 額	
極　洋	39,000	175	6,825,000	
日本水産	111,100	258	28,663,800	
マルハニチロホールディングス	197,000	135	26,595,000	
サカタのタネ	14,100	1,083	15,270,300	
ホクト	9,100	1,645	14,969,500	
ショーボンドＨＤ	7,900	1,649	13,027,100	
ミライト・ホールディングス	25,000	597	14,925,000	
住石ホールディングス	55,600	65	3,614,000	
日鉄鉱業	24,000	304	7,296,000	
三井松島	63,000	137	8,631,000	
国際石油開発帝石	1,092	504,000	550,368,000	
日本海洋掘削	3,000	2,476	7,428,000	
関東天然瓦斯	10,000	407	4,070,000	
石油資源開発	13,200	3,085	40,722,000	
東急建設	31,030	188	5,833,640	
コムシスホールディングス	45,500	772	35,126,000	
ミサワホーム	10,300	525	5,407,500	
高松コンストラクションＧＰ	7,500	1,131	8,482,500	
東建コーポレーション	3,320	2,848	9,455,360	
大成建設	458,000	197	90,226,000	
大　林　組	272,000	318	86,496,000	
清水建設	275,000	311	85,525,000	
長谷工コーポレーシヨン	583,500	49	28,591,500	
鹿島建設	424,000	229	97,096,000	
不動テトラ	71,400	152	10,852,800	
鉄建建設	68,000	86	5,848,000	
安藤建設	49,000	90	4,410,000	
太平工業	16,000	417	6,672,000	
西松建設	123,000	123	15,129,000	
前田建設	60,000	277	16,620,000	
奥　村　組	85,000	309	26,265,000	
東鉄工業	12,000	650	7,800,000	
イチケン	16,000	126	2,016,000	
戸田建設	96,000	278	26,688,000	
熊　谷　組	78,000	66	5,148,000	
北野建設	30,000	169	5,070,000	
三井ホーム	11,000	381	4,191,000	
矢作建設	14,200	402	5,708,400	
大東建託	33,600	6,810	228,816,000	
ＮＩＰＰＯ	20,000	661	13,220,000	
前田道路	26,000	751	19,526,000	
日本道路	26,000	196	5,096,000	
東亜建設	85,000	134	11,390,000	
東洋建設	143,000	75	10,725,000	
五洋建設	117,500	239	28,082,500	
福　田　組	21,000	259	5,439,000	
住友林業	60,100	649	39,004,900	
日本基礎技術	18,400	233	4,287,200	
日成ビルド工業	37,000	182	6,734,000	
エス・バイ・エル	56,000	208	11,648,000	
巴コーポレーション	19,800	263	5,207,400	

パナホーム	31,000	527	16,337,000	
大和ハウス	222,000	916	203,352,000	
ライト工業	22,900	367	8,404,300	
積水ハウス	254,000	665	168,910,000	
ユアテック	15,000	371	5,565,000	
四電工	10,000	319	3,190,000	
中電工	15,200	823	12,509,600	
関　電　工	48,000	325	15,600,000	
きんでん	59,000	626	36,934,000	
東京エネシス	15,000	410	6,150,000	
トーエネック	16,000	351	5,616,000	
日本電設工業	17,000	699	11,883,000	
協和エクシオ	29,200	739	21,578,800	
新日本空調	12,900	399	5,147,100	
日本工営	30,000	297	8,910,000	
日本電話施設	20,000	253	5,060,000	
九電工	17,000	460	7,820,000	
三機工業	25,000	377	9,425,000	
日　揮	84,000	1,889	158,676,000	
中外炉工業	32,000	263	8,416,000	
太平電業	15,000	588	8,820,000	
高砂熱学	27,500	632	17,380,000	
三晃金属	17,000	230	3,910,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	7,800	1,168	9,110,400	
朝日工業社	12,000	316	3,792,000	
大　氣　社	13,900	1,779	24,728,100	
ダイダン	15,000	478	7,170,000	
日比谷総合設	11,900	780	9,282,000	
東芝プラントシステム	15,000	832	12,480,000	
日本製粉	55,000	341	18,755,000	
日清製粉Ｇ本社	82,000	916	75,112,000	
昭和産業	43,000	236	10,148,000	
鳥越製粉	8,300	698	5,793,400	
協同飼料	62,000	83	5,146,000	
中部飼料	9,900	474	4,692,600	
日本配合飼料	43,000	105	4,515,000	
日本甜菜糖	60,000	149	8,940,000	
三井製糖	35,000	267	9,345,000	
ネクスト	8,300	290	2,407,000	
日本Ｍ＆Ａセンター	20	422,500	8,450,000	
アコーディア・ゴルフ	356	59,300	21,110,800	
パソナグループ	93	79,400	7,384,200	
テンプホールディングス	13,900	728	10,119,200	
森永製菓	86,000	184	15,824,000	
中　村　屋	25,000	400	10,000,000	
江崎グリコ	34,000	907	30,838,000	
名糖産業	5,500	983	5,406,500	
不　二　家	66,000	168	11,088,000	
山崎製パン	65,000	1,019	66,235,000	
モロゾフ	23,000	271	6,233,000	
カルビー	5,100	3,665	18,691,500	
森永乳業	75,000	292	21,900,000	
ヤクルト	48,000	2,360	113,280,000	
明治ホールディングス	27,300	3,320	90,636,000	
雪印メグミルク	19,100	1,484	28,344,400	

プリマハム	53,000	117	6,201,000	
日本ハム	70,000	957	66,990,000	
伊藤ハム	53,000	295	15,635,000	
丸大食品	41,000	269	11,029,000	
米　久	9,700	679	6,586,300	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,000	606	3,636,000	
スタジオアリス	4,900	1,105	5,414,500	
シミック	3,600	1,261	4,539,600	
システナ	131	53,300	6,982,300	
ＮＥＣフィールディング	6,600	942	6,217,200	
新日鉄ソリューションズ	5,900	1,567	9,245,300	
綜合警備保障	30,400	807	24,532,800	
日本駐車場開発	1,237	3,495	4,323,315	
カカクコム	13,300	2,916	38,782,800	
新日本科学	17,000	194	3,298,000	
エムスリー	67	379,500	25,426,500	
ディー・エヌ・エー	37,700	2,357	88,858,900	
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	10,460	4,160	43,513,600	
ぐるなび	7,400	862	6,378,800	
サッポロホールディングス	158,000	290	45,820,000	
アサヒグループホールディン	167,500	1,697	284,247,500	
キリンＨＤ	360,000	933	335,880,000	
宝ホールディングス	82,000	483	39,606,000	
オエノンホールディングス	35,000	179	6,265,000	
養　命　酒	11,000	726	7,986,000	
三国コカ・コーラ	8,400	688	5,779,200	
コカ・コーラウエスト	30,700	1,300	39,910,000	
コカコーラセントラルジャパン	11,300	1,000	11,300,000	
ダイドードリンコ	4,200	3,015	12,663,000	
伊　藤　園	25,900	1,335	34,576,500	
日清オイリオグループ	35,000	311	10,885,000	
不二製油	22,100	1,101	24,332,100	
Ｊ－オイルミルズ	35,000	215	7,525,000	
ローソン	24,300	4,575	111,172,500	
サンエー	2,500	2,982	7,455,000	
キリン堂	5,000	474	2,370,000	
カワチ薬品	6,000	1,496	8,976,000	
エービーシー・マート	10,800	2,837	30,639,600	
アスクル	8,100	1,046	8,472,600	
ゲオホールディングス	137	82,800	11,343,600	
ポイント	6,920	3,180	22,005,600	
伊藤忠食品	1,600	2,665	4,264,000	
くらコーポレーション	5,300	966	5,119,800	
キャンドゥ	77	84,600	6,514,200	
エレマテック	6,200	1,276	7,911,200	
パル	2,650	2,984	7,907,600	
エディオン	32,000	593	18,976,000	
サーラコーポレーション	16,000	454	7,264,000	
あみやき亭	19	194,500	3,695,500	
ひらまつ	58	66,800	3,874,400	
双日	533,500	119	63,486,500	
ゲンキー	1,400	1,691	2,367,400	
アルフレッサホールディングス	20,700	2,820	58,374,000	
ハニーズ	8,530	962	8,205,860	
キッコーマン	76,000	843	64,068,000	

味　の　素	236,000	917	216,412,000	
キユーピー	42,600	1,056	44,985,600	
ハウス食品	30,400	1,398	42,499,200	
カ　ゴ　メ	33,400	1,519	50,734,600	
焼津水産化工	8,500	698	5,933,000	
アリアケジャパン	9,200	1,456	13,395,200	
ニチレイ	103,000	358	36,874,000	
横浜冷凍	19,200	593	11,385,600	
東洋水産	38,000	1,890	71,820,000	
日清食品ＨＤ	33,900	2,951	100,038,900	
永　谷　園	10,000	886	8,860,000	
フジッコ	10,000	939	9,390,000	
ロックフィールド	4,900	1,245	6,100,500	
日本たばこ産業	1,988	364,500	724,626,000	
わらべや日洋	5,300	949	5,029,700	
片倉工業	12,000	730	8,760,000	
グ　ン　ゼ	66,000	220	14,520,000	
昭　栄	16,200	542	8,780,400	
アルペン	4,900	1,311	6,423,900	
アルコニックス	2,900	1,593	4,619,700	
ビックカメラ	288	41,850	12,052,800	
ＤＣＭホールディングス	41,900	582	24,385,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6,400	775	4,960,000	
あい　ホールディングス	12,100	336	4,065,600	
Ｊ．　フロント　リテイリング	196,000	335	65,660,000	
ドトール・日レスＨＤ	13,800	981	13,537,800	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	14,300	1,502	21,478,600	
ココカラファイン	8,700	2,049	17,826,300	
三越伊勢丹ＨＤ	160,600	742	119,165,200	
東洋紡績	364,000	103	37,492,000	
ユニチカ	241,000	41	9,881,000	
富士紡ホールディングス	41,000	157	6,437,000	
日清紡ホールディングス	55,000	640	35,200,000	
倉敷紡績	83,000	148	12,284,000	
ダイワボウＨＤ	83,000	179	14,857,000	
シキボウ	70,000	90	6,300,000	
日東紡績	66,000	326	21,516,000	
トヨタ紡織	28,800	843	24,278,400	
クリエイトＳＤＨ	3,800	1,581	6,007,800	
バイタルＫＳＫＨＤ	17,100	610	10,431,000	
ＵＫＣホールディングス	4,500	697	3,136,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	50,800	402	20,421,600	
日本毛織	28,000	555	15,540,000	
ダイドーリミテツド	11,100	703	7,803,300	
野村不動産ＨＬＤＧＳ	38,600	1,175	45,355,000	
ヒューリック	24,300	857	20,825,100	
帝国繊維	7,000	497	3,479,000	
ブックオフコーポレーション	6,000	646	3,876,000	
日本コークス工業	80,500	100	8,050,000	
ＪＦＥ商事ＨＬＤＧＳ	49,000	319	15,631,000	
あさひ	5,200	1,581	8,221,200	
サークルＫサンクス	16,500	1,249	20,608,500	
日本調剤	1,220	2,541	3,100,020	
コスモス薬品	3,900	3,740	14,586,000	
シップヘルスケアＨＤ	10,300	1,806	18,601,800	

セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	330,000	2,127	701,910,000	
ツルハホールディングス	7,200	4,020	28,944,000	
サンマルクホールディングス	2,500	2,990	7,475,000	
トリドール	9,900	746	7,385,400	
帝　人	348,000	231	80,388,000	
東　レ	607,000	570	345,990,000	
ク　ラ　レ	132,800	1,085	144,088,000	
旭　化　成	484,000	459	222,156,000	
サカイ　オーベックス	43,000	109	4,687,000	
稲葉製作所	5,300	902	4,780,600	
三協・立山ＨＬＤＧＳ	123,000	102	12,546,000	
トーカロ	5,100	1,690	8,619,000	
ＳＵＭＣＯ	55,000	631	34,705,000	
住江織物	35,000	139	4,865,000	
日本バイリーン	11,000	314	3,454,000	
芦森工業	39,000	102	3,978,000	
アツギ	65,000	95	6,175,000	
セーレン	21,900	459	10,052,100	
小松精練	15,000	336	5,040,000	
ワコールホールディングス	50,000	998	49,900,000	
ホギメディカル	5,300	3,145	16,668,500	
レナウン	34,900	151	5,269,900	
ＴＳＩホールディングス	45,200	419	18,938,800	
ＩＴホールディングス	26,500	859	22,763,500	
グリー	34,800	2,546	88,600,800	
コーエーテクモＨＤ	16,900	622	10,511,800	
三菱総合研究所	4,400	1,346	5,922,400	
ボルテージ	2,000	941	1,882,000	
特種東海製紙	64,000	182	11,648,000	
ドワンゴ	51	135,700	6,920,700	
マクロミル	10,200	822	8,384,400	
ティーガイア	57	149,600	8,527,200	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	23	350,000	8,050,000	
ザッパラス	63	68,600	4,321,800	
インターネットイニシアティブ	49	293,400	14,376,600	
ソネットエンタテインメント	46	290,300	13,353,800	
ＳＲＡホールディングス	5,100	761	3,881,100	
ＪＢＩＳホールディングス	17,600	230	4,048,000	
王子製紙	364,000	380	138,320,000	
三菱製紙	176,000	71	12,496,000	
北越紀州製紙	52,500	483	25,357,500	
中越パルプ	48,000	124	5,952,000	
大王製紙	37,000	539	19,943,000	
日本製紙Ｇ本社	41,600	1,646	68,473,600	
レンゴー	65,000	546	35,490,000	
トーモク	23,000	203	4,669,000	
ザ・パック	4,800	1,147	5,505,600	
昭和電工	523,000	155	81,065,000	
住友化学	580,000	288	167,040,000	
住友精化	19,000	338	6,422,000	
日産化学	66,300	712	47,205,600	
ラサ工業	42,000	125	5,250,000	
クレハ	60,000	369	22,140,000	
テイカ	18,000	287	5,166,000	
石原産業	154,000	88	13,552,000	

日本曹達	53,000	319	16,907,000	
東ソー	230,000	221	50,830,000	
トクヤマ	139,000	256	35,584,000	
セントラル硝子	80,000	369	29,520,000	
東亜合成	101,000	324	32,724,000	
ダイソー	38,000	255	9,690,000	
関東電化	24,000	307	7,368,000	
電気化学	182,000	297	54,054,000	
イビデン	53,100	1,771	94,040,100	
信越化学	150,200	3,805	571,511,000	
日本カーバイド	46,000	101	4,646,000	
堺　化　学	27,000	305	8,235,000	
エア・ウォーター	69,000	994	68,586,000	
大陽日酸	110,000	554	60,940,000	
日本化学工業	52,000	124	6,448,000	
日本パーカライジング	20,000	969	19,380,000	
高圧ガス	12,000	455	5,460,000	
チタン工業	13,000	399	5,187,000	
四国化成	12,000	407	4,884,000	
戸田工業	14,000	677	9,478,000	
ステラ　ケミファ	4,900	2,380	11,662,000	
保土谷化学	24,000	239	5,736,000	
日本触媒	63,000	828	52,164,000	
大日精化	30,000	343	10,290,000	
カネカ	104,000	410	42,640,000	
協和発酵キリン	115,000	901	103,615,000	
三菱瓦斯化学	144,000	449	64,656,000	
三井化学	359,000	244	87,596,000	
ＪＳＲ	76,600	1,466	112,295,600	
東京応化工業	14,700	1,596	23,461,200	
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	519,500	437	227,021,500	
日本合成化学	20,000	441	8,820,000	
ダイセル	110,000	423	46,530,000	
住友ベークライト	73,000	432	31,536,000	
積水化学	169,000	570	96,330,000	
日本ゼオン	77,000	643	49,511,000	
アイカ工業	21,300	1,038	22,109,400	
宇部興産	350,000	213	74,550,000	
積水樹脂	12,000	702	8,424,000	
タキロン	22,000	257	5,654,000	
旭有機材	32,000	195	6,240,000	
日立化成	36,500	1,457	53,180,500	
大倉工業	22,000	247	5,434,000	
積水化成品	24,000	295	7,080,000	
日本化薬	59,000	765	45,135,000	
イーピーエス	52	157,000	8,164,000	
パナソニック電工ＩＳ	2,100	2,007	4,214,700	
フェイス	464	8,250	3,828,000	
野村総合研究所	43,900	1,683	73,883,700	
ケネディクス	1,094	11,210	12,263,740	
電通	75,700	2,194	166,085,800	
インテージ	2,400	1,465	3,516,000	
シンプレクスホールディング	202	28,500	5,757,000	
日本精化	8,900	506	4,503,400	
ＡＤＥＫＡ	36,800	730	26,864,000	

日油	66,000	387	25,542,000	
ミヨシ油脂	66,000	103	6,798,000	
ハリマ化成	7,300	638	4,657,400	
花　王	221,400	2,016	446,342,400	
第一工業製薬	20,000	211	4,220,000	
三洋化成	27,000	528	14,256,000	
武田薬品	312,900	3,145	984,070,500	
アステラス製薬	185,400	2,938	544,705,200	
大日本住友製薬	61,000	788	48,068,000	
塩野義製薬	132,500	894	118,455,000	
田辺三菱製薬	83,600	1,195	99,902,000	
わかもと製薬	22,000	243	5,346,000	
あすか製薬	12,000	500	6,000,000	
日本新薬	18,000	879	15,822,000	
中外製薬	97,500	1,166	113,685,000	
科研製薬	32,000	934	29,888,000	
エーザイ	102,400	2,963	303,411,200	
ロート製薬	35,000	972	34,020,000	
小野薬品	40,400	3,980	160,792,000	
久光製薬	26,000	3,080	80,080,000	
持田製薬	29,000	825	23,925,000	
参天製薬	27,800	2,901	80,647,800	
扶桑薬品	40,000	202	8,080,000	
日本ケミファ	17,000	292	4,964,000	
ツムラ	22,800	2,123	48,404,400	
日医工	15,300	1,724	26,377,200	
テ　ル　モ	62,700	3,695	231,676,500	
みらかホールディングス	21,700	2,935	63,689,500	
キッセイ薬品工業	16,000	1,488	23,808,000	
生化学工業	17,700	844	14,938,800	
栄研化学	7,100	991	7,036,100	
日水製薬	3,000	651	1,953,000	
鳥居薬品	6,400	1,438	9,203,200	
東和薬品	4,700	3,420	16,074,000	
沢井製薬	5,500	8,160	44,880,000	
ゼリア新薬工業	13,000	1,224	15,912,000	
第一三共	281,300	1,373	386,224,900	
キョーリン製薬ＨＤ	20,000	1,295	25,900,000	
大幸薬品	6,500	855	5,557,500	
大塚ホールディングス	163,800	2,102	344,307,600	
大正製薬ＨＤ	20,000	5,190	103,800,000	
大日本塗料	77,000	88	6,776,000	
日本ペイント	76,000	545	41,420,000	
関西ペイント	93,000	725	67,425,000	
中国塗料	25,000	514	12,850,000	
藤倉化成	13,000	366	4,758,000	
太陽ホールディングス	7,000	1,950	13,650,000	
ＤＩＣ	326,000	127	41,402,000	
サカタインクス	15,000	316	4,740,000	
東洋インキＳＣホールディン	75,000	282	21,150,000	
アルプス技研	5,900	681	4,017,900	
サニックス	18,300	240	4,392,000	
オリエンタルランド	22,600	8,030	181,478,000	
ダスキン	23,500	1,491	35,038,500	
パーク２４	42,000	933	39,186,000	

明光ネットワークジャパン	10,100	668	6,746,800	
ファルコＳＤホールディングス	6,200	900	5,580,000	
フジ・メディア・ＨＤ	811	105,100	85,236,100	
ラウンドワン	29,000	452	13,108,000	
リゾートトラスト	13,400	1,107	14,833,800	
オービック	2,450	14,000	34,300,000	
ヤフー	5,805	24,090	139,842,450	
ビー・エム・エル	5,200	1,908	9,921,600	
ワタベウェディング	5,200	629	3,270,800	
トレンドマイクロ	35,700	2,324	82,966,800	
もしもしホットライン	16,300	705	11,491,500	
東急コミュニティー	2,000	2,403	4,806,000	
リソー教育	1,065	4,360	4,643,400	
日本オラクル	14,000	2,566	35,924,000	
アルファシステムズ	4,200	1,011	4,246,200	
フューチャーアーキテクト	141	30,400	4,286,400	
ユー・エス・エス	10,370	6,660	69,064,200	
伊藤忠テクノソリュー	9,600	3,325	31,920,000	
テー・オー・ダブリュー	4,100	447	1,832,700	
大塚商会	6,300	5,240	33,012,000	
総合メディカル	1,700	2,608	4,433,600	
セントラルスポーツ	4,200	957	4,019,400	
電通国際情報Ｓ	7,600	758	5,760,800	
ウェザーニューズ	2,600	2,356	6,125,600	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	180,200	1,826	329,045,200	
コニカミノルタＨＬＤＧＳ	214,500	570	122,265,000	
資　生　堂	140,600	1,417	199,230,200	
ライオン	95,000	444	42,180,000	
高砂香料	30,000	376	11,280,000	
マンダム	9,000	1,951	17,559,000	
ミルボン	4,800	2,435	11,688,000	
ファンケル	22,400	1,072	24,012,800	
コーセー	13,100	1,809	23,697,900	
ドクターシーラボ	52	472,500	24,570,000	
ポーラ・オルビスＨＤ	9,000	1,964	17,676,000	
エステー	6,900	977	6,741,300	
コ　ニ　シ	6,100	997	6,081,700	
長谷川香料	10,900	1,228	13,385,200	
小林製薬	11,000	3,880	42,680,000	
荒川化学工業	9,500	625	5,937,500	
日本高純度化学	32	227,000	7,264,000	
アース製薬	5,300	2,880	15,264,000	
イハラケミカル	16,000	263	4,208,000	
大成ラミック	2,500	2,370	5,925,000	
クミアイ化学	23,000	261	6,003,000	
日本農薬	22,000	328	7,216,000	
昭和シエル石油	78,300	506	39,619,800	
コスモ石油	231,000	209	48,279,000	
ニチレキ	14,000	378	5,292,000	
東燃ゼネラル石油	116,000	872	101,152,000	
ユシロ化学	6,600	883	5,827,800	
ＡＯＣホールディングス	21,400	455	9,737,000	
出光興産	9,800	8,050	78,890,000	
ＪＸホールディングス	927,700	481	446,223,700	
横浜ゴム	101,000	421	42,521,000	

東洋ゴム	65,000	178	11,570,000	
ブリヂストン	262,100	1,752	459,199,200	
住友ゴム	63,000	912	57,456,000	
オカモト	30,000	329	9,870,000	
アキレス	74,000	104	7,696,000	
フ　コ　ク	3,500	657	2,299,500	
ニッタ	8,500	1,395	11,857,500	
東海ゴム工業	15,500	904	14,012,000	
三ツ星ベルト	23,000	407	9,361,000	
バンドー化学	31,000	305	9,455,000	
鬼怒川ゴム	19,000	683	12,977,000	
旭　硝　子	412,000	644	265,328,000	
日本板硝子	369,000	145	53,505,000	
有沢製作所	17,800	304	5,411,200	
日本山村硝子	39,000	182	7,098,000	
日本電気硝子	163,000	770	125,510,000	
オハラ	6,200	765	4,743,000	
住友大阪セメント	171,000	219	37,449,000	
太平洋セメント	498,000	147	73,206,000	
東海カーボン	77,000	383	29,491,000	
日本カーボン	43,000	213	9,159,000	
東洋炭素	5,000	3,715	18,575,000	
ノリタケ	43,000	225	9,675,000	
ＴＯＴＯ	131,000	615	80,565,000	
日本碍子	111,000	824	91,464,000	
日本特殊陶業	72,000	970	69,840,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,300	3,400	7,820,000	
品川リフラクトリーズ	25,000	208	5,200,000	
黒崎播磨	22,000	257	5,654,000	
フジミインコーポレーテッド	8,800	898	7,902,400	
ニチアス	37,000	417	15,429,000	
新日本製鐵	2,199,000	183	402,417,000	
住友金属工業	1,559,000	133	207,347,000	
神戸製鋼所	1,173,000	120	140,760,000	
日新製鋼	307,000	108	33,156,000	
中山製鋼所	70,000	63	4,410,000	
合同製鐵	53,000	188	9,964,000	
ＪＦＥホールディングス	199,600	1,389	277,244,400	
東京製鐵	43,900	644	28,271,600	
共英製鋼	9,500	1,518	14,421,000	
大和工業	19,100	2,095	40,014,500	
大阪製鐵	5,800	1,350	7,830,000	
淀川製鋼所	60,000	338	20,280,000	
東洋鋼鈑	22,000	265	5,830,000	
丸一鋼管	24,700	1,680	41,496,000	
大同特殊鋼	139,000	496	68,944,000	
日本金属工業	88,000	64	5,632,000	
日本冶金工	76,500	118	9,027,000	
山陽特殊製鋼	42,000	417	17,514,000	
愛知製鋼	44,000	397	17,468,000	
日立金属	54,000	847	45,738,000	
日本金属	25,000	154	3,850,000	
大平洋金属	64,000	383	24,512,000	
日本電工	34,000	339	11,526,000	
栗本鉄工所	53,000	150	7,950,000	

日本製鋼所	134,000	501	67,134,000	
三菱製鋼	52,000	203	10,556,000	
日本精線	7,000	390	2,730,000	
日本軽金属	206,000	100	20,600,000	
三井金属	235,000	194	45,590,000	
東邦亜鉛	53,000	300	15,900,000	
三菱マテリアル	530,000	211	111,830,000	
住友鉱山	217,000	1,015	220,255,000	
ＤＯＷＡホールディングス	103,000	503	51,809,000	
古河機金	166,000	63	10,458,000	
大阪チタニウム	8,800	3,815	33,572,000	
東邦チタニウム	15,300	1,454	22,246,200	
住友軽金属	216,000	71	15,336,000	
古河スカイ	37,000	170	6,290,000	
古河電工	276,000	172	47,472,000	
住友電工	296,700	821	243,590,700	
フジクラ	137,000	232	31,784,000	
昭和電線ＨＬＤＧＳ	141,000	70	9,870,000	
タツタ電線	18,000	338	6,084,000	
日立電線	81,000	160	12,960,000	
リョービ	47,000	295	13,865,000	
アサヒＨＤ	11,600	1,538	17,840,800	
東洋製罐	60,800	1,043	63,414,400	
ホッカンホールディングス	21,000	223	4,683,000	
コロナ	4,800	1,252	6,009,600	
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	21,000	473	9,933,000	
駒井ハルテック	30,000	179	5,370,000	
三和ホールディングス	89,000	234	20,826,000	
文化シヤツター	29,000	266	7,714,000	
住生活グループ	109,700	1,447	158,735,900	
日本フイルコン	10,700	388	4,151,600	
ノーリツ	16,700	1,394	23,279,800	
長府製作所	8,200	2,083	17,080,600	
リンナイ	13,300	5,820	77,406,000	
ユニプレス	12,600	2,086	26,283,600	
日東精工	17,000	189	3,213,000	
岡　部	17,100	392	6,703,200	
東　プ　レ	15,900	739	11,750,100	
高周波熱錬	12,900	576	7,430,400	
東京製綱	66,000	158	10,428,000	
パイオラックス	3,600	1,508	5,428,800	
日本発条	60,300	685	41,305,500	
三浦工業	12,400	2,200	27,280,000	
タ　ク　マ	31,000	323	10,013,000	
ツ　ガ　ミ	24,000	515	12,360,000	
オークマ	54,000	571	30,834,000	
東芝機械	49,000	412	20,188,000	
ア　マ　ダ	122,000	471	57,462,000	
アイダエンジニア	23,600	393	9,274,800	
牧野フライス	45,000	525	23,625,000	
オーエスジー	37,600	988	37,148,800	
旭ダイヤモンド	22,100	1,038	22,939,800	
森精機製作所	45,800	727	33,296,600	
ディスコ	8,600	4,010	34,486,000	
日東工器	5,100	1,880	9,588,000	

豊田自動織機	71,800	2,094	150,349,200	
大阪機工	56,000	89	4,984,000	
津田駒工業	33,000	135	4,455,000	
島精機製作所	11,600	1,316	15,265,600	
日阪製作所	12,000	820	9,840,000	
ナブテスコ	35,500	1,655	58,752,500	
三井海洋開発	7,200	1,269	9,136,800	
ＳＭＣ	25,000	12,520	313,000,000	
新川	13,200	354	4,672,800	
ホソカワミクロン	17,000	381	6,477,000	
ユニオンツール	5,900	1,416	8,354,400	
オイレス工業	9,300	1,441	13,401,300	
サトーホールディングス	9,000	930	8,370,000	
ワイエイシイ	5,100	637	3,248,700	
小松製作所	398,500	1,895	755,157,500	
住友重機械	218,000	455	99,190,000	
日立建機	44,200	1,326	58,609,200	
日　工	14,000	269	3,766,000	
巴工業	2,900	1,214	3,520,600	
井関農機	94,000	170	15,980,000	
ＴＯＷＡ	10,900	405	4,414,500	
丸山製作所	28,000	168	4,704,000	
北川鉄工所	51,000	138	7,038,000	
クボタ	384,000	685	263,040,000	
東洋エンジニア	50,000	277	13,850,000	
三菱化工機	38,000	129	4,902,000	
月島機械	13,000	587	7,631,000	
帝国電機製作所	3,300	1,429	4,715,700	
新東工業	18,600	704	13,094,400	
アイチ　コーポレーション	15,700	302	4,741,400	
小森コーポレーション	30,600	474	14,504,400	
住友精密	13,000	523	6,799,000	
荏原製作所	143,000	275	39,325,000	
酉島製作所	10,500	987	10,363,500	
千代田化工建	73,000	828	60,444,000	
ダイキン工業	102,300	2,218	226,901,400	
オルガノ	15,000	614	9,210,000	
トーヨーカネツ	57,000	145	8,265,000	
栗田工業	45,700	2,032	92,862,400	
椿本チエイン	43,000	410	17,630,000	
日　機　装	27,000	643	17,361,000	
木村化工機	12,600	309	3,893,400	
新興プランテック	18,800	672	12,633,600	
アネスト岩田	15,000	304	4,560,000	
ダイフク	40,500	400	16,200,000	
加藤製作所	24,000	209	5,016,000	
タダノ	40,000	493	19,720,000	
フジテック	21,000	418	8,778,000	
シーケーディ	25,700	561	14,417,700	
平和	16,000	1,367	21,872,000	
理想科学工業	5,900	1,272	7,504,800	
ＳＡＮＫＹＯ	23,800	3,825	91,035,000	
日本金銭機械	8,700	629	5,472,300	
マースエンジニアリング	4,800	1,305	6,264,000	
ダイコク電機	7,500	680	5,100,000	

ア　マ　ノ	23,500	682	16,027,000	
ＪＵＫＩ	54,000	180	9,720,000	
サンデン	46,000	228	10,488,000	
ブラザー工業	104,300	1,021	106,490,300	
マックス	12,000	894	10,728,000	
モリタホールディングス	12,000	425	5,100,000	
グローリー	24,100	1,612	38,849,200	
大和冷機工業	9,000	411	3,699,000	
セガサミーホールディングス	85,600	1,552	132,851,200	
日本ピストンリング	36,000	139	5,004,000	
リ　ケ　ン	30,000	290	8,700,000	
ＴＰＲ	8,800	805	7,084,000	
ホシザキ電機	15,100	1,931	29,158,100	
大豊工業	6,600	674	4,448,400	
日本精工	180,000	497	89,460,000	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	188,000	298	56,024,000	
ジェイテクト	77,800	742	57,727,600	
不　二　越	84,000	351	29,484,000	
ミネベア	128,000	338	43,264,000	
日本トムソン	29,000	428	12,412,000	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	54,300	1,507	81,830,100	
ユーシン精機	4,400	1,400	6,160,000	
前澤給装工業	3,600	1,052	3,787,200	
イーグル工業	11,000	620	6,820,000	
日本ピラー工業	9,000	502	4,518,000	
キッツ	34,700	318	11,034,600	
日　立	1,798,000	423	760,554,000	
東　芝	1,690,000	347	586,430,000	
三菱電機	802,000	712	571,024,000	
富士電機	248,000	223	55,304,000	
東洋電機製造	16,000	295	4,720,000	
安川電機	98,000	639	62,622,000	
シンフォニア　テクノロジー	55,000	166	9,130,000	
明　電　舎	84,000	272	22,848,000	
オリジン電気	17,000	241	4,097,000	
デンヨー	8,000	975	7,800,000	
日立工機	23,400	560	13,104,000	
三桜工業	10,200	548	5,589,600	
マキタ	52,300	2,627	137,392,100	
東芝テック	50,000	286	14,300,000	
芝浦メカトロニクス	19,000	208	3,952,000	
マブチモーター	10,700	3,385	36,219,500	
日本電産	43,200	6,900	298,080,000	
高岳製作所	41,000	177	7,257,000	
ダイヘン	51,000	275	14,025,000	
第一精工	2,600	2,279	5,925,400	
日新電機	18,000	435	7,830,000	
大崎電気	12,000	717	8,604,000	
オムロン	89,700	1,605	143,968,500	
日東工業	12,000	919	11,028,000	
ＩＤＥＣ	11,900	774	9,210,600	
エルピーダメモリ	112,600	368	41,436,800	
ジーエス・ユアサ　コーポ	160,000	438	70,080,000	
メルコホールディングス	4,800	2,043	9,806,400	
日本電気	1,111,000	163	181,093,000	

富　士　通	777,000	400	310,800,000	
沖　電　気	328,000	62	20,336,000	
岩崎通信機	66,000	66	4,356,000	
電気興業	29,000	262	7,598,000	
サンケン電気	45,000	257	11,565,000	
アイホン	5,100	1,507	7,685,700	
ルネサスエレクトロニクス	25,100	503	12,625,300	
セイコーエプソン	55,600	1,058	58,824,800	
ワコム	167	120,700	20,156,900	
アルバック	16,700	1,027	17,150,900	
アクセル	4,000	1,607	6,428,000	
ナナオ	7,700	1,498	11,534,600	
日本信号	18,900	426	8,051,400	
京三製作所	18,000	305	5,490,000	
能美防災	12,000	476	5,712,000	
日本無線	17,000	172	2,924,000	
パナソニック	917,600	727	667,095,200	
シャープ	389,000	771	299,919,000	
アンリツ	39,000	861	33,579,000	
富士通ゼネラル	21,000	415	8,715,000	
日立国際電気	21,000	606	12,726,000	
ソ　ニ　ー	501,500	1,372	688,058,000	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	42,500	3,825	162,562,500	
帝国通信工業	37,000	123	4,551,000	
ミツミ電機	33,300	544	18,115,200	
タムラ製作所	32,000	188	6,016,000	
アルプス電気	66,600	526	35,031,600	
パイオニア	118,300	368	43,534,400	
日本電波工業	7,500	1,071	8,032,500	
ローランド　ディー．ジー．	5,200	855	4,446,000	
フオスター電機	9,200	1,114	10,248,800	
クラリオン	58,000	129	7,482,000	
Ｓ　Ｍ　Ｋ	30,000	261	7,830,000	
ヨコオ	8,000	395	3,160,000	
東　光	46,000	151	6,946,000	
ホシデン	25,000	535	13,375,000	
ヒロセ電機	13,600	7,030	95,608,000	
日本航空電子	19,000	551	10,469,000	
Ｔ　Ｏ　Ａ	10,000	444	4,440,000	
ユニデン	27,000	288	7,776,000	
アルパイン	16,300	881	14,360,300	
スミダコーポレーション	5,800	522	3,027,600	
アイコム	5,200	1,990	10,348,000	
船井電機	8,400	1,640	13,776,000	
横河電機	89,100	714	63,617,400	
新電元工業	29,000	320	9,280,000	
山武	20,400	1,657	33,802,800	
日本光電工業	16,000	1,765	28,240,000	
堀場製作所	14,800	2,385	35,298,000	
アドバンテスト	63,100	838	52,877,800	
エスペック	10,800	467	5,043,600	
パナソニック電工ＳＵＮＸ	9,100	388	3,530,800	
キーエンス	17,800	19,420	345,676,000	
日置電機	4,500	1,378	6,201,000	
シスメックス	27,900	2,631	73,404,900	

メガチップス	7,600	1,296	9,849,600	
日本電産コパル電子	9,100	475	4,322,500	
デンソー	197,500	2,150	424,625,000	
コーセル	11,300	987	11,153,100	
日立メディコ	6,000	803	4,818,000	
オプテックス	5,900	960	5,664,000	
千代田インテグレ	3,900	991	3,864,900	
東光電気	10,000	335	3,350,000	
スタンレー電気	54,100	1,109	59,996,900	
岩崎電気	39,000	161	6,279,000	
ウシオ電機	47,800	1,146	54,778,800	
日本セラミック	4,800	1,402	6,729,600	
新神戸電機	6,000	1,699	10,194,000	
日本デジタル研究所	8,500	735	6,247,500	
古河電池	8,000	354	2,832,000	
図　研	7,500	514	3,855,000	
日本電子	36,000	204	7,344,000	
カ　シ　オ	79,800	472	37,665,600	
ファナック	83,600	12,270	1,025,772,000	
日本シイエムケイ	21,700	274	5,945,800	
エンプラス	4,700	1,369	6,434,300	
ロ　ー　ム	39,000	3,620	141,180,000	
浜松ホトニクス	30,400	2,792	84,876,800	
新光電気工業	30,100	570	17,157,000	
京　セ　ラ	66,600	6,760	450,216,000	
太陽誘電	40,600	625	25,375,000	
村田製作所	83,900	4,465	374,613,500	
ユーシン	12,600	634	7,988,400	
双葉電子工業	13,600	1,319	17,938,400	
日東電工	69,200	3,110	215,212,000	
北陸電気工業	44,000	113	4,972,000	
東海理化電機	18,900	1,165	22,018,500	
ニチコン	26,400	809	21,357,600	
日本ケミコン	52,000	279	14,508,000	
Ｋ　Ｏ　Ａ	10,200	750	7,650,000	
三井造船	322,000	116	37,352,000	
日立造船	321,500	99	31,828,500	
佐世保重工業	49,000	113	5,537,000	
三菱重工業	1,339,000	318	425,802,000	
川崎重工業	590,000	194	114,460,000	
ＩＨＩ	549,000	176	96,624,000	
日本車輌	32,000	293	9,376,000	
近畿車輌	17,000	236	4,012,000	
日産自動車	1,010,200	690	697,038,000	
いすゞ自動車	507,000	354	179,478,000	
トヨタ自動車	1,028,900	2,509	2,581,510,100	※
日野自動車	116,000	463	53,708,000	
三菱自動車工業	1,786,000	92	164,312,000	
エフテック	4,200	841	3,532,200	
武蔵精密工業	7,700	1,687	12,989,900	
トヨタ車体	14,200	1,124	15,960,800	
日産車体	22,000	748	16,456,000	
関東自動車	12,000	627	7,524,000	
新明和工業	37,000	269	9,953,000	
日信工業	15,100	1,027	15,507,700	

トピー工業	66,000	193	12,738,000	
ティラド	32,000	250	8,000,000	
曙ブレーキ	42,900	342	14,671,800	
タチエス	10,300	1,290	13,287,000	
Ｎ　Ｏ　Ｋ	38,500	1,322	50,897,000	
フタバ産業	24,000	467	11,208,000	
カヤバ工業	58,000	359	20,822,000	
シロキ工業	18,000	198	3,564,000	
市光工業	39,000	133	5,187,000	
大同メタル工業	12,000	780	9,360,000	
プレス工業	38,000	353	13,414,000	
カルソニックカンセイ	48,000	433	20,784,000	
太平洋工業	18,000	337	6,066,000	
ケーヒン	17,500	1,188	20,790,000	
河西工業	12,000	390	4,680,000	
アイシン精機	65,200	2,260	147,352,000	
富士機工	15,000	213	3,195,000	
マ　ツ　ダ	678,000	137	92,886,000	
ダイハツ	73,000	1,331	97,163,000	
愛知機械	21,000	221	4,641,000	
今仙電機製作所	5,800	943	5,469,400	
本田技研	676,400	2,389	1,615,919,600	
スズキ	167,300	1,608	269,018,400	
富士重工業	256,000	435	111,360,000	
ヤマハ発動機	131,300	1,046	137,339,800	
ショーワ	20,200	417	8,423,400	
小糸製作所	40,000	1,049	41,960,000	
ＴＢＫ	13,000	343	4,459,000	
エクセディ	11,200	2,280	25,536,000	
ミツバ	16,000	507	8,112,000	
豊田合成	23,300	1,314	30,616,200	
愛三工業	10,100	622	6,282,200	
ヨ　ロ　ズ	4,600	1,621	7,456,600	
エフ・シー・シー	13,100	1,628	21,326,800	
新家工業	31,000	113	3,503,000	
シマノ	30,000	3,710	111,300,000	
タカタ	14,700	1,635	24,034,500	
テイ・エス　テック	17,300	1,065	18,424,500	
小　野　建	5,000	627	3,135,000	
佐鳥電機	5,100	454	2,315,400	
カッパクリエイト	6,350	1,750	11,112,500	
伯東	3,100	698	2,163,800	
ナガイレーベン	10,200	1,031	10,516,200	
三菱食品	8,100	1,935	15,673,500	
良品計画	8,600	3,495	30,057,000	
三城ホールディングス	13,400	637	8,535,800	
松田産業	7,000	1,160	8,120,000	
メディパルＨＤ	87,300	750	65,475,000	
アズワン	4,900	1,576	7,722,400	
シモジマ	7,500	962	7,215,000	
ドウシシャ	4,000	2,019	8,076,000	
コ　ジ　マ	10,200	507	5,171,400	
コーナン商事	7,800	1,222	9,531,600	
黒田電気	8,300	819	6,797,700	
ネットワンシステムズ	177	197,300	34,922,100	

ワタミ	9,700	1,878	18,216,600	
ドン・キホーテ	15,000	2,634	39,510,000	
メガネトップ	12,500	929	11,612,500	
西松屋チェーン	19,100	583	11,135,300	
ゼンショーホールディングス	29,800	1,026	30,574,800	
幸楽苑	6,000	1,133	6,798,000	
サイゼリヤ	12,200	1,261	15,384,200	
ガリバーインターナショナル	2,720	3,225	8,772,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	1,351	11,888,800	
ハイデイ日高	3,800	1,202	4,567,600	
シークス	5,000	996	4,980,000	
京都きもの友禅	5,200	909	4,726,800	
コロワイド	28,000	512	14,336,000	
田中商事	5,200	395	2,054,000	
壱番屋	3,000	2,295	6,885,000	
マクニカ	3,700	1,678	6,208,600	
トップカルチャー	6,300	352	2,217,600	
スギホールディングス	14,000	2,201	30,814,000	
島津製作所	96,000	622	59,712,000	
Ｊ　Ｍ　Ｓ	16,000	247	3,952,000	
ブイ・テクノロジー	15	393,000	5,895,000	
スター精密	14,300	710	10,153,000	
東京計器	41,000	138	5,658,000	
日本電産トーソク	4,700	950	4,465,000	
東京精密	14,800	1,555	23,014,000	
ニコン	140,000	1,771	247,940,000	
トプコン	21,500	363	7,804,500	
オリンパス	95,000	1,025	97,375,000	
理研計器	7,500	565	4,237,500	
大日本スクリーン	78,000	567	44,226,000	
キヤノン電子	7,300	1,979	14,446,700	
タムロン	7,400	2,022	14,962,800	
ＨＯＹＡ	194,100	1,619	314,247,900	
エー・アンド・デイ	11,600	309	3,584,400	
キヤノン	497,300	3,420	1,700,766,000	
リ　コ　ー	245,000	682	167,090,000	
日本電産コパル	8,600	868	7,464,800	
日本電産サンキョー	20,000	521	10,420,000	
シチズンホールディングス	101,000	438	44,238,000	
リズム時計	56,000	129	7,224,000	
ＳＨＯ‐ＢＩ	5,200	417	2,168,400	
ＳＲＩスポーツ	4,900	836	4,096,400	
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	85,800	1,104	94,723,200	
フランスベッドＨＬＤＧＳ	75,000	130	9,750,000	
パイロットコーポレーション	72	161,600	11,635,200	
エイベックス・グループＨＤ	15,900	870	13,833,000	
トッパン・フォームズ	18,100	564	10,208,400	
フジシールインターナショナル	9,600	1,424	13,670,400	
タカラトミー	26,500	540	14,310,000	
廣済堂	14,100	188	2,650,800	
レック	3,200	998	3,193,600	
プロネクサス	13,500	399	5,386,500	
大建工業	38,000	224	8,512,000	
き　も　と	8,400	543	4,561,200	
凸版印刷	244,000	558	136,152,000	

大日本印刷	245,000	744	182,280,000	
共同印刷	37,000	189	6,993,000	
日本写真印刷	16,900	962	16,257,800	
藤森工業	6,700	1,129	7,564,300	
宝印刷	7,600	575	4,370,000	
前澤化成工業	7,900	808	6,383,200	
アシックス	74,900	916	68,608,400	
ツ　ツ　ミ	4,700	1,786	8,394,200	
ジェイ　エス　ピー	5,600	1,066	5,969,600	
ニ　チ　ハ	10,000	825	8,250,000	
ローランド	11,900	657	7,818,300	
エフピコ	3,700	5,010	18,537,000	
小松ウオール工業	5,200	852	4,430,400	
ヤマハ	61,900	729	45,125,100	
河合楽器	39,000	144	5,616,000	
クリナップ	12,700	488	6,197,600	
ピジョン	7,400	3,030	22,422,000	
天馬	10,100	693	6,999,300	
兼松日産農林	26,000	160	4,160,000	
リンテック	15,800	1,387	21,914,600	
信越ポリマー	17,700	344	6,088,800	
東　リ	32,000	140	4,480,000	
イトーキ	32,300	168	5,426,400	
任　天　堂	45,900	11,630	533,817,000	
三菱鉛筆	7,300	1,353	9,876,900	
タカラスタンダード	38,000	611	23,218,000	
コ　ク　ヨ	43,200	544	23,500,800	
ナカバヤシ	32,000	186	5,952,000	
ニ　フ　コ	18,300	2,073	37,935,900	
グローブライド	69,000	79	5,451,000	
岡村製作所	30,000	528	15,840,000	
日本バルカー	34,000	188	6,392,000	
伊　藤　忠	628,200	763	479,316,600	
丸　紅	693,000	461	319,473,000	
スクロール	15,100	260	3,926,000	
高　島	23,000	214	4,922,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	8,400	737	6,190,800	
三陽商会	60,000	181	10,860,000	
長瀬産業	42,100	826	34,774,600	
蝶　理	46,000	85	3,910,000	
豊田通商	87,900	1,263	111,017,700	
オンワードホールディングス	52,000	545	28,340,000	
三共生興	17,700	258	4,566,600	
兼　松	163,000	73	11,899,000	
美　津　濃	42,000	389	16,338,000	
ファミリーマート	23,300	3,070	71,531,000	
三井物産	681,400	1,182	805,414,800	
日本紙パルプ	35,000	275	9,625,000	
東京エレクトロン	67,700	4,090	276,893,000	
日立ハイテクノロジーズ	24,300	1,674	40,678,200	
カメイ	13,000	676	8,788,000	
東都水産	32,000	129	4,128,000	
スターゼン	29,000	225	6,525,000	
セイコーＨＤ	55,000	152	8,360,000	
山　善	31,000	542	16,802,000	

住友商事	462,800	1,007	466,039,600	
日本ユニシス	23,800	480	11,424,000	
内田洋行	29,000	212	6,148,000	
三菱商事	575,700	1,551	892,910,700	
第一実業	22,000	300	6,600,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	27,200	864	23,500,800	
西華産業	24,000	210	5,040,000	
菱洋エレクトロ	7,600	711	5,403,600	
ユアサ商事	85,000	104	8,840,000	
神鋼商事	20,000	179	3,580,000	
阪和興業	80,000	328	26,240,000	
カナデン	10,000	510	5,100,000	
菱電商事	13,000	425	5,525,000	
ニプロ	32,200	624	20,092,800	
岩谷産業	86,000	266	22,876,000	
すてきナイスグループ	43,000	162	6,966,000	
昭光通商	56,000	119	6,664,000	
極東貿易	20,000	178	3,560,000	
イ　ワ　キ	12,000	183	2,196,000	
兼松エレクトロニクス	2,000	756	1,512,000	
三愛石油	18,000	318	5,724,000	
稲畑産業	21,000	442	9,282,000	
ゴールドウイン	21,000	277	5,817,000	
ユニ・チャーム	45,400	3,645	165,483,000	
デサント	23,000	420	9,660,000	
ヤマトインターナシヨナル	6,600	351	2,316,600	
東邦ホールディングス	27,100	985	26,693,500	
サンゲツ	14,200	2,029	28,811,800	
ミツウロコグループ	16,500	465	7,672,500	
シナネン	18,000	348	6,264,000	
伊藤忠エネクス	23,900	430	10,277,000	
サンリオ	20,000	3,980	79,600,000	
リョーサン	12,200	1,716	20,935,200	
新光商事	8,000	600	4,800,000	
トーホー	13,000	304	3,952,000	
三信電気	10,200	632	6,446,400	
東陽テクニカ	11,000	796	8,756,000	
モスフード　サービス	9,500	1,519	14,430,500	
加賀電子	7,200	796	5,731,200	
三益半導体	8,400	626	5,258,400	
木曽路	10,300	1,401	14,430,300	
千　趣　会	14,800	520	7,696,000	
ケーヨー	16,000	461	7,376,000	
アデランス	13,500	805	10,867,500	
上新電機	15,000	857	12,855,000	
日本瓦斯	12,300	1,172	14,415,600	
マルエツ	22,000	277	6,094,000	
ロイヤルホールディングス	13,400	914	12,247,600	
島　忠	17,400	1,691	29,423,400	
チヨダ	10,900	1,251	13,635,900	
ライフコーポレーション	6,200	1,425	8,835,000	
カ　ス　ミ	17,700	495	8,761,500	
リンガーハツト	7,500	1,055	7,912,500	
ＭＲ　ＭＡＸ	15,600	306	4,773,600	
ＡＯＫＩホールディングス	8,200	1,141	9,356,200	

オークワ	13,000	1,280	16,640,000	
コメリ	11,200	2,342	26,230,400	
青山商事	22,300	1,239	27,629,700	
しまむら	9,000	7,290	65,610,000	
ＣＦＳコーポレーション	11,500	334	3,841,000	
高　島　屋	112,000	542	60,704,000	
松　屋	21,300	435	9,265,500	
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	575	24,725,000	
ニッセンＨＤ	16,500	430	7,095,000	
パ　ル　コ	16,900	576	9,734,400	
丸井グループ	109,300	551	60,224,300	
クレディセゾン	66,000	1,376	90,816,000	
原信ナルスＨＬＤＧＳ	4,900	1,240	6,076,000	
ダイエー	57,350	278	15,943,300	
イズミヤ	33,000	384	12,672,000	
イオン	277,600	1,048	290,924,800	
ユ　ニ　ー	62,400	697	43,492,800	
イ　ズ　ミ	23,800	1,139	27,108,200	
東武ストア	17,000	254	4,318,000	
平　和　堂	14,600	987	14,410,200	
フ　ジ	8,800	1,828	16,086,400	
ヤオコー	3,500	2,621	9,173,500	
ゼビオ	9,900	1,767	17,493,300	
ケーズホールディングス	19,600	2,996	58,721,600	
Ｐａｌｔａｃ	6,800	1,456	9,900,800	
新生銀行	633,000	76	48,108,000	
あおぞら銀行	251,000	204	51,204,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	5,978,000	328	1,960,784,000	※
りそなホールディングス	693,600	339	235,130,400	
三井住友トラストＨＤ	1,556,000	231	359,436,000	
三井住友フィナンシャルＧ	596,800	2,089	1,246,715,200	
第四銀行	102,000	256	26,112,000	
北越銀行	84,000	157	13,188,000	
西日本シティ銀行	269,000	224	60,256,000	
札幌北洋ホール	122,500	264	32,340,000	
千葉銀行	311,000	498	154,878,000	
横浜銀行	503,000	363	182,589,000	
常陽銀行	302,000	332	100,264,000	
群馬銀行	177,000	430	76,110,000	
武蔵野銀行	12,200	2,567	31,317,400	
千葉興業銀行	15,200	410	6,232,000	
筑波銀行	39,500	284	11,218,000	
東京都民銀行	16,900	950	16,055,000	
七十七銀行	132,000	297	39,204,000	
青森銀行	61,000	240	14,640,000	
秋田銀行	62,000	228	14,136,000	
山形銀行	52,000	395	20,540,000	
岩手銀行	5,700	3,630	20,691,000	
東邦銀行	74,000	214	15,836,000	
東北銀行	67,000	117	7,839,000	
みちのく銀行	49,000	146	7,154,000	
ふくおかフィナンシャルＧ	324,000	313	101,412,000	
静岡銀行	235,000	790	185,650,000	
十六銀行	104,000	255	26,520,000	
スルガ銀行	77,000	701	53,977,000	

八十二銀行	143,000	450	64,350,000	
山梨中央銀行	52,000	321	16,692,000	
大垣共立銀行	101,000	254	25,654,000	
福井銀行	70,000	247	17,290,000	
北國銀行	93,000	283	26,319,000	
清水銀行	3,200	3,200	10,240,000	
滋賀銀行	77,000	530	40,810,000	
南都銀行	76,000	465	35,340,000	
百五銀行	71,000	311	22,081,000	
京都銀行	136,000	663	90,168,000	
三重銀行	35,000	173	6,055,000	
ほくほくフィナンシャルG	546,000	149	81,354,000	
広島銀行	227,000	365	82,855,000	
山陰合同銀行	45,000	551	24,795,000	
中国銀行	63,000	1,054	66,402,000	
鳥取銀行	29,000	151	4,379,000	
伊予銀行	81,000	755	61,155,000	
百十四銀行	91,000	363	33,033,000	
四国銀行	60,000	309	18,540,000	
阿波銀行	68,000	543	36,924,000	
鹿児島銀行	46,000	533	24,518,000	
大分銀行	54,000	226	12,204,000	
宮崎銀行	54,000	186	10,044,000	
肥後銀行	59,000	432	25,488,000	
佐賀銀行	54,000	200	10,800,000	
十八銀行	55,000	204	11,220,000	
沖縄銀行	5,800	3,510	20,358,000	
琉球銀行	15,800	956	15,104,800	
八千代銀行	4,500	2,000	9,000,000	
みずほフィナンシャルG	10,108,800	100	1,010,880,000	
紀陽ホールディングス	301,000	119	35,819,000	
山口フィナンシャルG	77,000	729	56,133,000	
芙蓉総合リース	7,500	2,599	19,492,500	
興銀リース	11,600	1,578	18,304,800	
東京センチュリーリース	20,700	1,505	31,153,500	
ＳＢＩホールディングス	8,709	6,080	52,950,720	
日本証券金融	38,000	357	13,566,000	
長野銀行	37,000	161	5,957,000	
名古屋銀行	78,000	266	20,748,000	
愛知銀行	3,200	4,675	14,960,000	
第三銀行	60,000	159	9,540,000	
中京銀行	44,000	196	8,624,000	
東日本銀行	29,000	158	4,582,000	
大光銀行	31,000	234	7,254,000	
愛媛銀行	48,000	227	10,896,000	
トマト銀行	46,000	126	5,796,000	
みなと銀行	74,000	144	10,656,000	
京葉銀行	61,000	386	23,546,000	
関西アーバン銀行	117,000	130	15,210,000	
栃木銀行	41,000	281	11,521,000	
北日本銀行	3,900	1,810	7,059,000	
東和銀行	72,000	96	6,912,000	
福島銀行	135,000	38	5,130,000	
リコーリース	6,100	1,782	10,870,200	
イオン　クレジットサービス	36,000	1,163	41,868,000	

ア　コ　ム	17,030	1,217	20,725,510	
プロミス	42,950	796	34,188,200	
ジャックス	52,000	234	12,168,000	
オ　リ　コ	131,000	68	8,908,000	
日立キャピタル	16,900	1,060	17,914,000	
オリックス	41,310	6,340	261,905,400	
三菱ＵＦＪリース	20,160	2,896	58,383,360	
ジャフコ	11,400	1,385	15,789,000	
トモニホールディングス	61,500	344	21,156,000	
大和証券Ｇ本社	788,000	252	198,576,000	
野村ホールディングス	1,716,200	248	425,617,600	
岡三証券グループ	67,000	240	16,080,000	
丸三証券	32,600	246	8,019,600	
東洋証券	39,000	107	4,173,000	
東海東京ＨＤ	90,000	212	19,080,000	
水戸証券	47,000	100	4,700,000	
いちよし証券	21,200	381	8,077,200	
松井証券	53,100	354	18,797,400	
ＮＫＳＪホールディングス	166,000	1,504	249,664,000	
マネックスＧ	850	11,890	10,106,500	
カブドットコム証券	39,100	221	8,641,100	
極東証券	10,000	434	4,340,000	
岩井コスモホールディング	15,600	233	3,634,800	
フィデアホール	53,300	205	10,926,500	
池田泉州ＨＤ	320,800	118	37,854,400	
ＭＳ＆ＡＤ	235,900	1,486	350,547,400	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	76,800	1,246	95,692,800	
第一生命	4,255	83,200	354,016,000	
東京海上ＨＤ	299,500	1,832	548,684,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	290,900	734	213,520,600	
三井不動産	352,000	1,218	428,736,000	
三菱地所	554,000	1,262	699,148,000	
平和不動産	93,500	152	14,212,000	
東京建物	162,000	220	35,640,000	
ダイビル	25,400	510	12,954,000	
サンケイビル	18,800	306	5,752,800	
東急不動産	166,000	295	48,970,000	
京阪神ビルディング	8,900	348	3,097,200	
住友不動産	190,000	1,491	283,290,000	
東宝不動産	13,200	411	5,425,200	
大京	129,000	146	18,834,000	
テーオーシー	32,200	345	11,109,000	
レオパレス２１	70,900	173	12,265,700	
空港施設	14,600	302	4,409,200	
住友不動産販売	3,100	3,005	9,315,500	
ゴールドクレスト	8,050	1,260	10,143,000	
東栄住宅	6,000	776	4,656,000	
東急リバブル	9,400	596	5,602,400	
飯田産業	9,000	612	5,508,000	
アーネストワン	13,100	777	10,178,700	
タカラレーベン	12,000	427	5,124,000	
イオンモール	36,300	1,768	64,178,400	
タクトホーム	38	63,800	2,424,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	531	51,400	27,293,400	
東武鉄道	465,000	389	180,885,000	

相鉄ホールディングス	133,000	242	32,186,000	
東京急行	472,000	370	174,640,000	
京浜急行	208,000	676	140,608,000	
小田急電鉄	260,000	725	188,500,000	
京王電鉄	230,000	519	119,370,000	
京成電鉄	135,000	535	72,225,000	
東日本旅客鉄道	139,300	4,695	654,013,500	
西日本旅客鉄道	69,700	3,185	221,994,500	
東海旅客鉄道	693	614,000	425,502,000	
西日本鉄道	99,000	365	36,135,000	
近畿鉄道	721,000	285	205,485,000	
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	536,000	313	167,768,000	
南海電鉄	163,000	335	54,605,000	
京阪電鉄	176,000	365	64,240,000	
名古屋鉄道	278,000	207	57,546,000	
日本通運	318,000	289	91,902,000	
ヤマトホールディングス	162,500	1,222	198,575,000	
山　九	96,000	287	27,552,000	
日　新	31,000	180	5,580,000	
丸全昭和運輸	30,000	239	7,170,000	
センコー	33,000	287	9,471,000	
日本梱包運輸	25,700	723	18,581,100	
福山通運	47,000	430	20,210,000	
セイノーホールディングス	62,000	551	34,162,000	
神奈川中央交通	13,000	409	5,317,000	
日立物流	16,300	1,283	20,912,900	
日本郵船	650,000	169	109,850,000	
商船三井	432,000	239	103,248,000	
川崎汽船	273,000	130	35,490,000	
ＮＳユナイテッド海運	60,000	104	6,240,000	
乾　汽　船	13,800	250	3,450,000	
飯野海運	43,200	352	15,206,400	
第一中央汽船	72,000	98	7,056,000	
全日本空輸	1,083,000	232	251,256,000	
国際航業ＨＬＤＧＳ	14,000	187	2,618,000	
三菱倉庫	60,000	780	46,800,000	
三井倉庫	41,000	273	11,193,000	
住友倉庫	59,000	356	21,004,000	
渋沢倉庫	24,000	210	5,040,000	
ヤマタネ	58,000	112	6,496,000	
東陽倉庫	18,000	164	2,952,000	
日本トランスシティ	20,000	238	4,760,000	
安田倉庫	8,100	463	3,750,300	
東洋埠頭	37,000	120	4,440,000	
上　組	84,000	628	52,752,000	
郵船ロジスティクス	7,100	979	6,950,900	
近鉄エクスプレス	7,300	2,263	16,519,900	
東京放送ＨＤ	47,900	928	44,451,200	
日本テレビ放送網	6,690	10,390	69,509,100	
テレビ朝日	193	116,700	22,523,100	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	622	39,050	24,289,100	
テレビ東京ＨＤ	6,400	1,063	6,803,200	
アイ・ティー・シーネットワーク	10,700	469	5,018,300	
イー・アクセス	716	17,180	12,300,880	
ＮＥＣモバイリング	2,300	2,533	5,825,900	

日本電信電話	363,500	3,775	1,372,212,500	
ＫＤＤＩ	1,228	505,000	620,140,000	
光通信	7,300	1,940	14,162,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,500	135,000	877,500,000	
ＧＭＯインターネット	28,100	295	8,289,500	
ゼンリン	13,000	696	9,048,000	
昭文社	5,700	575	3,277,500	
角川グループＨＬＤＧＳ	7,500	2,661	19,957,500	
中部電力	269,600	1,454	391,998,400	
関西電力	335,400	1,144	383,697,600	
中国電力	118,800	1,309	155,509,200	
北陸電力	86,900	1,368	118,879,200	
東北電力	210,700	793	167,085,100	
四国電力	77,900	2,142	166,861,800	
九州電力	187,800	1,061	199,255,800	
北海道電力	86,300	1,032	89,061,600	
沖縄電力	7,400	3,265	24,161,000	
電源開発	54,000	1,929	104,166,000	
東京瓦斯	998,000	330	329,340,000	
大阪瓦斯	812,000	294	238,728,000	
東邦瓦斯	219,000	457	100,083,000	
北海道瓦斯	39,000	260	10,140,000	
西部瓦斯	145,000	205	29,725,000	
静岡瓦斯	32,000	513	16,416,000	
松　竹	54,000	713	38,502,000	
東　宝	57,500	1,311	75,382,500	
エイチ・アイ・エス	9,200	1,902	17,498,400	
東　映	36,000	347	12,492,000	
ＮＴＴデータ	495	236,100	116,869,500	
共立メンテナンス	4,700	1,291	6,067,700	
建設技術研究所	6,800	513	3,488,400	
アインファーマシーズ	4,400	3,420	15,048,000	
東京テアトル	58,000	110	6,380,000	
よみうりランド	23,000	242	5,566,000	
東京都競馬	82,000	105	8,610,000	
常磐興産	55,000	76	4,180,000	
カナモト	12,000	494	5,928,000	
東京ドーム	82,000	171	14,022,000	
ＤＴＳ	9,600	908	8,716,800	
スクウェア・エニックス・ＨＤ	27,800	1,556	43,256,800	
カプコン	15,500	1,943	30,116,500	
日本空港ビルデング	26,300	1,111	29,219,300	
トランス・コスモス	11,100	886	9,834,600	
乃村工藝社	21,000	226	4,746,000	
ＳＣＳＫ	17,400	1,240	21,576,000	
藤田観光	34,000	272	9,248,000	
日本管財	3,200	1,390	4,448,000	
トーカイ	3,500	1,725	6,037,500	
セコム	80,600	3,445	277,667,000	
アイネス	13,200	542	7,154,400	
丹青社	14,000	212	2,968,000	
メイテツク	13,800	1,467	20,244,600	
ＴＫＣ	7,000	1,546	10,822,000	
アサツー　ディ・ケイ	15,100	1,894	28,599,400	
富士ソフト	11,900	1,290	15,351,000	

応用地質	9,900	783	7,751,700	
船井総合研究所	7,900	534	4,218,600	
ＮＳＤ	19,500	602	11,739,000	
コナミ	36,400	2,286	83,210,400	
ベネッセホールディングス	25,600	3,480	89,088,000	
イオンディライト	9,900	1,623	16,067,700	
ニチイ学館	18,100	872	15,783,200	
ダイセキ	13,700	1,356	18,577,200	
元気寿司	4,700	947	4,450,900	
トラスコ中山	9,800	1,468	14,386,400	
ヤマダ電機	38,310	5,500	210,705,000	
オートバックスセブン	9,000	3,570	32,130,000	
アークランドサカモト	5,700	1,312	7,478,400	
ニトリホールディングス	15,200	7,190	109,288,000	
愛　眼	13,100	397	5,200,700	
吉野家ホールディングス	208	101,000	21,008,000	
加藤産業	12,100	1,578	19,093,800	
イエローハット	7,500	1,328	9,960,000	
富士エレクトロニクス	4,100	1,000	4,100,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,300	511	4,752,300	
サガミチェーン	12,000	503	6,036,000	
日　伝	3,000	2,593	7,779,000	
因幡電機産業	8,500	2,198	18,683,000	
住金物産	31,000	182	5,642,000	
プレナス	9,200	1,212	11,150,400	
ミニストップ	5,400	1,430	7,722,000	
アークス	11,000	1,462	16,082,000	
バ　ロ　ー	16,200	1,215	19,683,000	
ミスミグループ本社	29,100	1,644	47,840,400	
ベ　ル　ク	3,900	1,122	4,375,800	
大　庄	6,500	952	6,188,000	
タキヒヨー	13,000	431	5,603,000	
ファーストリテイリング	18,500	12,320	227,920,000	
ソフトバンク	359,100	2,547	914,627,700	
スズケン	31,000	1,978	61,318,000	
サンドラッグ	14,900	2,430	36,207,000	
ベルーナ	10,800	575	6,210,000	
合計	122,246,309		79,663,342,555	

（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　100,000株　三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ　600,000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。

次へ

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

貸借対照表

	平成22年11月30日現在 金 額（円）	平成23年11月30日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	366,843,756	260,939,375
国債証券	31,790,733,280	31,438,783,910
地方債証券	4,860,092,226	4,670,635,439
特殊債券	6,570,148,795	6,177,651,132
社債券	6,839,224,693	6,073,028,082
未収入金	207,498,000	131,944,810
未収利息	206,547,506	194,071,499
前払費用	5,110,045	4,006,931
流動資産合計	50,846,198,301	48,951,061,178
資産合計	50,846,198,301	48,951,061,178
負債の部		
流動負債		
未払金	382,462,600	100,088,000
未払解約金	―	129,396,408
流動負債合計	382,462,600	229,484,408
負債合計	382,462,600	229,484,408
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	41,807,537,065	39,611,456,673
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,656,198,636	9,110,120,097
元本等合計	50,463,735,701	48,721,576,770
純資産合計	50,463,735,701	48,721,576,770
負債純資産合計	50,846,198,301	48,951,061,178

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21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年11月30日現在	平成23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	42,125,615,868円	41,807,537,065円
同期中における追加設定元本額	3,344,297,484円	1,835,777,472円
同期中における一部解約元本額	3,662,376,287円	4,031,857,864円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	376,131,723円	351,184,539円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,601,285,936円	2,360,749,095円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	362,250,200円	312,109,067円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	3,395,456,274円	3,150,435,720円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	2,510,184,596円	2,939,809,701円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	23,640,373,546円	21,256,922,633円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,809,890,838円	3,442,473,631円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	627,229,851円	589,379,527円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	397,790,597円	536,875,110円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	3,644,130,813円	4,199,231,925円
ダイワライフスタイル２５	208,419,388円	222,639,252円
ダイワライフスタイル５０	183,383,805円	197,891,250円
ダイワライフスタイル７５	51,009,498円	51,755,223円
計	41,807,537,065円	39,611,456,673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	41,807,537,065口	39,611,456,673口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 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	自 平成22年12月1日 至 平成23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。	同左
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。	同左

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。	同左
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。	同左

Ⅱ　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	平成23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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（追加情報）

自　平成21年12月1日 至　平成22年11月30日	自　平成22年12月1日 至　平成23年11月30日
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。	―――――――

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
	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	212,544,060	381,488,750
地方債証券	2,659,285	4,312,967
特殊債券	△7,642,900	△25,698,701
社債券	10,436,601	△44,164,387
合計	217,997,046	315,938,629

（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12月1日から平成22年11月30日まで、及び平成22年12月1日から平成23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）

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	平成23年11月30日現在
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2070円 (12,070円)	1.2300円 (12,300円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	３００　２年国債	340,000,000	340,299,200	
	３０１　２年国債	290,000,000	290,258,100	
	３０２　２年国債	545,000,000	545,517,750	
	３０３　２年国債	200,000,000	200,202,000	
	３０４　２年国債	430,000,000	430,460,100	
	３０５　２年国債	150,000,000	150,159,000	
	３０６　２年国債	50,000,000	50,056,000	
	３０７　２年国債	265,000,000	265,288,850	
	７０　５年国債	92,000,000	92,797,640	
	７４　５年国債	20,000,000	20,268,800	
	７５　５年国債	113,000,000	114,948,120	
	７６　５年国債	103,000,000	104,960,090	
	７７　５年国債	156,000,000	158,411,760	
	７８　５年国債	40,000,000	40,618,400	
	７９　５年国債	100,000,000	101,139,000	
	８０　５年国債	101,000,000	102,356,430	
	８１　５年国債	107,000,000	108,584,670	
	８２　５年国債	45,000,000	45,769,050	
	８３　５年国債	45,000,000	45,836,100	
	８４　５年国債	13,000,000	13,175,890	
	８５　５年国債	170,000,000	172,431,000	
	８６　５年国債	136,000,000	137,566,720	
	８７　５年国債	185,000,000	186,592,850	
	８８　５年国債	268,000,000	270,272,640	
	８９　５年国債	133,000,000	133,629,090	
	９０　５年国債	190,000,000	190,231,800	
	９１　５年国債	55,000,000	55,226,600	
	９２　５年国債	410,000,000	410,073,800	
	９３　５年国債	260,000,000	261,866,800	
	９４　５年国債	213,000,000	215,379,210	

	９５　５年国債	40,000,000	40,430,800	
	９６　５年国債	382,000,000	384,498,280	
	９７　５年国債	245,000,000	245,325,850	
	９８　５年国債	365,000,000	363,857,550	
	９９　５年国債	215,000,000	215,101,050	
	１　４０年国債	85,000,000	90,717,950	
	２　４０年国債	131,000,000	132,767,190	
	３　４０年国債	74,000,000	74,855,440	
	４　４０年国債	47,000,000	47,298,920	
	２４４　１０年国債	60,000,000	60,552,000	
	２４７　１０年国債	48,000,000	48,419,520	
	２４８　１０年国債	6,000,000	6,044,700	
	２５０　１０年国債	34,000,000	34,195,840	
	２５１　１０年国債	30,000,000	30,357,000	
	２５２　１０年国債	55,000,000	55,739,200	
	２５３　１０年国債	30,000,000	30,785,400	
	２５４　１０年国債	85,000,000	86,921,850	
	２５５　１０年国債	72,000,000	73,756,080	
	２５６　１０年国債	105,000,000	107,692,200	
	２５７　１０年国債	20,000,000	20,472,000	
	２５８　１０年国債	38,000,000	38,991,800	
	２５９　１０年国債	115,000,000	118,525,900	
	２６０　１０年国債	49,000,000	50,778,210	
	２６１　１０年国債	64,000,000	66,646,400	
	２６２　１０年国債	76,000,000	79,334,880	
	２６３　１０年国債	145,000,000	150,718,800	
	２６４　１０年国債	123,000,000	127,509,180	
	２６５　１０年国債	102,000,000	105,975,960	
	２６６　１０年国債	78,000,000	80,804,100	
	２６７　１０年国債	107,000,000	110,507,460	
	２６８　１０年国債	157,000,000	163,452,700	
	２６９　１０年国債	278,000,000	287,610,460	
	２７０　１０年国債	185,000,000	191,746,950	
	２７１　１０年国債	72,000,000	74,373,120	
	２７２　１０年国債	58,000,000	60,425,560	
	２７３　１０年国債	151,000,000	157,881,070	
	２７４　１０年国債	107,000,000	112,058,960	
	２７５　１０年国債	25,000,000	26,082,250	
	２７６　１０年国債	50,000,000	52,563,500	
	２７７　１０年国債	133,000,000	140,080,920	
	２７８　１０年国債	104,000,000	110,416,800	
	２７９　１０年国債	121,000,000	129,514,770	
	２８０　１０年国債	237,000,000	253,300,860	
	２８１　１０年国債	138,000,000	148,108,500	
	２８２　１０年国債	100,000,000	106,212,000	
	２８３　１０年国債	10,000,000	10,668,200	
	２８４　１０年国債	211,000,000	224,497,670	
	２８５　１０年国債	63,000,000	67,136,580	
	２８６　１０年国債	175,000,000	187,666,500	
	２８７　１０年国債	80,000,000	86,222,400	
	２８８　１０年国債	280,000,000	298,995,200	
	２８９　１０年国債	102,000,000	107,823,180	
	２９０　１０年国債	121,000,000	127,172,210	
	２９１　１０年国債	204,000,000	213,167,760	
	２９２　１０年国債	217,000,000	232,094,520	
	２９３　１０年国債	138,000,000	148,559,760	
	２９４　１０年国債	154,000,000	164,815,420	

	２９５　１０年国債	155,000,000	163,881,500	
	２９６　１０年国債	260,000,000	274,820,000	
	２９７　１０年国債	118,000,000	123,916,520	
	２９８　１０年国債	110,000,000	114,736,600	
	２９９　１０年国債	244,000,000	254,413,920	
	３００　１０年国債	186,000,000	196,588,980	
	３０１　１０年国債	146,000,000	154,197,900	
	３０２　１０年国債	193,000,000	202,457,000	
	３０３　１０年国債	372,000,000	389,655,120	
	３０４　１０年国債	148,000,000	153,878,560	
	３０５　１０年国債	574,000,000	595,456,120	
	３０６　１０年国債	224,000,000	233,719,360	
	３０７　１０年国債	290,000,000	300,219,600	
	３０８　１０年国債	155,000,000	160,105,700	
	３０９　１０年国債	397,000,000	403,455,220	
	３１０　１０年国債	438,000,000	440,312,640	
	３１１　１０年国債	210,000,000	207,612,300	
	３１２　１０年国債	715,000,000	728,971,100	
	３１３　１０年国債	325,000,000	333,427,250	
	３１４　１０年国債	357,000,000	360,030,930	
	３１５　１０年国債	305,000,000	309,501,800	
	３１６　１０年国債	302,000,000	303,570,400	
	３１７　１０年国債	141,000,000	141,437,100	
	３１８　１０年国債	145,000,000	144,099,550	
	１　３０年国債	16,000,000	18,607,520	
	２　３０年国債	24,000,000	26,409,600	
	３　３０年国債	30,000,000	32,528,400	
	４　３０年国債	36,000,000	42,498,360	
	５　３０年国債	28,000,000	29,850,240	
	６　３０年国債	24,000,000	26,365,920	
	７　３０年国債	37,000,000	40,035,110	
	８　３０年国債	19,000,000	18,927,800	
	９　３０年国債	37,000,000	34,270,510	
	１０　３０年国債	45,000,000	39,245,850	
	１１　３０年国債	44,000,000	42,917,160	
	１２　３０年国債	39,000,000	40,735,500	
	１３　３０年国債	44,000,000	45,139,160	
	１４　３０年国債	52,000,000	57,053,360	
	１５　３０年国債	56,000,000	62,485,360	
	１６　３０年国債	47,000,000	52,486,780	
	１７　３０年国債	45,000,000	49,396,950	
	１８　３０年国債	55,000,000	59,414,850	
	１９　３０年国債	57,000,000	61,559,430	
	２０　３０年国債	52,000,000	58,063,200	
	２１　３０年国債	48,000,000	51,723,360	
	２２　３０年国債	56,000,000	62,571,600	
	２３　３０年国債	55,000,000	61,500,450	
	２４　３０年国債	44,000,000	49,153,280	
	２５　３０年国債	65,000,000	70,065,450	
	２６　３０年国債	116,000,000	127,429,480	
	２７　３０年国債	111,000,000	124,247,850	
	２８　３０年国債	123,000,000	137,625,930	
	２９　３０年国債	159,000,000	174,664,680	
	３０　３０年国債	168,000,000	180,887,280	
	３１　３０年国債	170,000,000	179,112,000	
	３２　３０年国債	177,000,000	189,850,200	
	３３　３０年国債	209,000,000	210,538,240	

	３４　３０年国債	202,000,000	212,005,060	
	３５　３０年国債	70,000,000	70,261,800	
	２２　利付国債２０年	3,000,000	3,199,770	
	２３　利付国債２０年	2,000,000	2,191,580	
	２４　利付国債２０年	4,000,000	4,415,400	
	２６　利付国債２０年	4,000,000	4,479,040	
	２８　利付国債２０年	6,000,000	6,934,980	
	２９　利付国債２０年	7,000,000	8,030,260	
	３０　利付国債２０年	30,000,000	33,852,000	
	３１　利付国債２０年	18,000,000	20,418,120	
	３２　利付国債２０年	16,000,000	18,284,960	
	３３　利付国債２０年	22,000,000	25,570,820	
	３４　利付国債２０年	9,000,000	10,444,680	
	３５　利付国債２０年	22,000,000	25,296,920	
	３６　利付国債２０年	21,000,000	23,988,720	
	３７利付国債２０年	23,000,000	26,403,080	
	３８利付国債２０年	60,000,000	67,860,000	
	３９　２０年国債	90,000,000	101,243,700	
	４０　２０年国債	57,000,000	63,261,450	
	４１　２０年国債	136,000,000	143,693,520	
	４２　２０年国債	87,000,000	98,735,430	
	４３　２０年国債	105,000,000	121,842,000	
	４４　２０年国債	85,000,000	96,044,050	
	４５　２０年国債	78,000,000	87,597,120	
	４６　２０年国債	73,000,000	80,689,820	
	４７　２０年国債	89,000,000	98,428,660	
	４８　２０年国債	54,000,000	61,097,760	
	４９　２０年国債	64,000,000	70,164,480	
	５０　２０年国債	107,000,000	115,384,520	
	５１　２０年国債	82,000,000	89,143,020	
	５２　２０年国債	52,000,000	57,000,840	
	５３　２０年国債	66,000,000	72,360,420	
	５４　２０年国債	65,000,000	71,887,400	
	５５　２０年国債	74,000,000	80,453,540	
	５６　２０年国債	58,000,000	63,019,320	
	５７　２０年国債	65,000,000	69,977,050	
	５８　２０年国債	67,000,000	72,100,710	
	５９　２０年国債	92,000,000	96,956,960	
	６０　２０年国債	62,000,000	63,424,760	
	６１　２０年国債	76,000,000	74,377,400	
	６２　２０年国債	55,000,000	52,450,750	
	６３　２０年国債	90,000,000	95,472,900	
	６４　２０年国債	87,000,000	93,146,550	
	６５　２０年国債	95,000,000	101,568,300	
	６６　２０年国債	32,000,000	33,859,520	
	６７　２０年国債	40,000,000	42,700,800	
	６８　２０年国債	51,000,000	56,160,690	
	６９　２０年国債	100,000,000	108,937,000	
	７０　２０年国債	88,000,000	98,756,240	
	７１　２０年国債	67,000,000	73,620,270	
	７２　２０年国債	158,000,000	171,674,900	
	７３　２０年国債	67,000,000	71,868,890	
	７４　２０年国債	70,000,000	75,989,900	
	７５　２０年国債	63,000,000	68,284,440	
	７６　２０年国債	51,000,000	54,038,070	
	７７　２０年国債	65,000,000	69,681,300	
	７８　２０年国債	61,000,000	64,544,710	

	７９　２０年国債	62,000,000	66,347,440	
	８０　２０年国債	53,000,000	57,385,750	
	８１　２０年国債	61,000,000	65,193,140	
	８２　２０年国債	114,000,000	123,223,740	
	８３　２０年国債	93,000,000	100,344,210	
	８４　２０年国債	103,000,000	109,864,950	
	８５　２０年国債	89,000,000	95,846,770	
	８６　２０年国債	55,000,000	60,676,550	
	８７　２０年国債	72,000,000	78,483,600	
	８８　２０年国債	113,000,000	124,383,620	
	８９　２０年国債	88,000,000	95,752,800	
	９０　２０年国債	138,000,000	149,965,980	
	９１　２０年国債	70,000,000	76,965,000	
	９２　２０年国債	189,000,000	202,543,740	
	９３　２０年国債	81,000,000	85,557,060	
	９４　２０年国債	129,000,000	138,023,550	
	９５　２０年国債	103,000,000	112,814,870	
	９６　２０年国債	97,000,000	103,551,380	
	９７　２０年国債	111,000,000	119,848,920	
	９８　２０年国債	95,000,000	101,307,050	
	９９　２０年国債	196,000,000	208,775,280	
	１００　２０年国債	163,000,000	175,748,230	
	１０１　２０年国債	28,000,000	30,994,040	
	１０２　２０年国債	103,000,000	113,925,210	
	１０３　２０年国債	67,000,000	73,133,850	
	１０４　２０年国債	60,000,000	63,756,600	
	１０５　２０年国債	147,000,000	156,108,120	
	１０６　２０年国債	83,000,000	89,354,480	
	１０７　２０年国債	61,000,000	64,694,160	
	１０８　２０年国債	180,000,000	185,614,200	
	１０９　２０年国債	79,000,000	81,328,130	
	１１０　２０年国債	138,000,000	146,155,800	
	１１１　２０年国債	79,000,000	84,736,980	
	１１２　２０年国債	180,000,000	190,369,800	
	１１３　２０年国債	269,000,000	284,085,520	
	１１４　２０年国債	178,000,000	187,699,220	
	１１５　２０年国債	89,000,000	95,275,390	
	１１６　２０年国債	96,000,000	102,552,960	
	１１７　２０年国債	201,000,000	211,771,590	
	１１８　２０年国債	59,000,000	61,149,960	
	１１９　２０年国債	68,000,000	68,380,120	
	１２０　２０年国債	175,000,000	170,488,500	
	１２１　２０年国債	217,000,000	221,287,920	
	１２２　２０年国債	64,000,000	64,225,280	
	１２３　２０年国債	145,000,000	152,247,100	
	１２４　２０年国債	153,000,000	158,235,660	
	１２５　２０年国債	70,000,000	74,595,500	
	１２６　２０年国債	75,000,000	77,480,250	
	１２７　２０年国債	154,000,000	156,878,260	
	１２８　２０年国債	128,000,000	130,037,760	
	１２９　２０年国債	155,000,000	155,000,000	
	１３０　２０年国債	125,000,000	124,908,750	
国債証券　合計		30,164,000,000	31,438,783,910	
地方債証券	５９５　東京都公債	100,000,000	100,838,500	
	６０４　東京都公債	120,000,000	123,261,720	
	６０８　東京都公債	100,000,000	103,158,900	

	６３５　東京都公債	100,000,000	107,155,100	
	６５１　東京都公債	100,000,000	106,127,100	
	６５４　東京都公債	104,000,000	110,154,200	
	６６５　東京都公債	100,000,000	104,916,100	
	１３９　神奈川県公債	100,000,000	106,553,800	
	１６３　神奈川県公債	100,000,000	104,482,100	
	２６７　大阪府公債	100,000,000	103,372,300	
	３０８　大阪府公債	112,000,000	119,142,240	
	１７－８　兵庫県公債	100,000,000	103,797,000	
	１７－７　静岡県公債	100,000,000	105,557,400	
	２０－６　愛知県公債	100,000,000	106,758,900	
	１７－２　広島県公債	100,000,000	104,546,000	
	１７－５　埼玉県公債	100,000,000	103,999,800	
	２１－３　埼玉県公債	100,000,000	106,228,500	
	１９－８　福岡県公債	100,000,000	106,027,500	
	２１－２　千葉県公債	100,000,000	105,762,400	
	２１－６　千葉県公債	100,000,000	104,394,400	
	１６－１　新潟県公債	100,000,000	103,664,600	
	６　共同発行地方債	110,100,000	112,904,467	
	８　共同発行地方債	111,000,000	114,091,572	
	１２　共同発行地方	120,000,000	123,287,040	
	１４　共同発行地方	100,000,000	103,160,600	
	１５　共同発行地方	100,000,000	103,520,600	
	２４　共同発行地方	100,000,000	103,973,000	
	２７　共同発行地方	100,000,000	103,484,400	
	３０　共同発行地方	100,000,000	103,607,600	
	４１　共同発行地方	100,000,000	107,319,300	
	５１　共同発行地方	100,000,000	107,517,400	
	５４　共同発行地方	100,000,000	106,534,900	
	５７　共同発行地方	100,000,000	106,273,100	
	６１　共同発行地方	100,000,000	105,715,000	
	８１　共同発行地方	100,000,000	103,530,000	
	１９－２　大阪市公債	100,000,000	106,845,300	
	１２－ゆ　名古屋市債	100,000,000	102,728,900	
	１２－ひ　名古屋市債	100,000,000	103,521,900	
	１４　名古屋市５年	100,000,000	100,774,900	
	２０－３　京都市５年	100,000,000	101,529,400	
	２１－５　京都市公債	100,000,000	104,210,300	
	１４－５　横浜市公債	100,000,000	100,777,200	
	１７－４　横浜市公債	100,000,000	104,601,300	
	７６　川崎市公債	100,000,000	100,828,700	
地方債証券　合計		4,477,100,000	4,670,635,439	
特殊債券	６　政保政策投資ＢＫ	118,000,000	119,001,938	
	７　日本政策投資ＣＯ	100,000,000	101,354,700	
	２７　日本政策投資Ｂ	100,000,000	107,010,500	
	３１７　政保道路債	72,000,000	72,381,960	
	３１９　政保道路債	147,000,000	148,849,260	
	３２３　政保道路債	119,000,000	122,233,230	
	３２８　政保道路債	112,000,000	115,607,968	
	３３１　政保道路債	149,000,000	155,469,729	
	３３３　政保道路債	115,000,000	119,571,480	
	３３４　政保道路債	100,000,000	103,754,500	
	１３　道路機構	100,000,000	106,604,400	
	１５　道路機構	100,000,000	107,298,900	
	２８　道路機構	100,000,000	106,521,900	
	３２　道路機構	100,000,000	105,639,200	

	１　政保道路機構	124,000,000	129,715,532	
	２３　政保道路機構	100,000,000	106,248,400	
	２７　政保道路機構	100,000,000	106,896,400	
	３０　政保道路機構	112,000,000	119,197,680	
	３３　政保道路機構	100,000,000	106,466,300	
	４７　政保道路機構	100,000,000	105,504,300	
	６４　政保道路機構	100,000,000	106,140,800	
	６６　政保道路機構	100,000,000	105,475,300	
	１１０　政保道路機構	100,000,000	102,963,900	
	３７　道路債券	100,000,000	103,745,100	
	８２８　政保公営企業	100,000,000	100,529,200	
	８２９　政保公営企業	139,000,000	141,124,893	
	８３１　政保公営企業	125,000,000	128,247,250	
	８４２　政保公営企業	111,000,000	115,807,854	
	８６８　政保公営企業	100,000,000	106,608,800	
	２　政保地方公営機	100,000,000	106,143,400	
	１９　公営企業	100,000,000	106,913,700	
	１９０　政保首都高速	10,000,000	10,275,040	
	４　政保首都高速	100,000,000	106,655,300	
	６　首都高速道路	100,000,000	100,719,600	
	１０　首都高速道路	100,000,000	103,975,900	
	１３　首都高速道路	100,000,000	103,623,600	
	２７　国際協力銀行	100,000,000	106,344,900	
	３２２　東京交通債	100,000,000	111,541,400	
	３９　政保関西空港	100,000,000	100,519,700	
	５　政保中部空港	36,000,000	36,305,676	
	２　住宅支援機構	100,000,000	106,444,500	
	１４　政保国民生活	179,000,000	185,420,372	
	２　成田国際空港	100,000,000	104,388,500	
	い６９４　利付商工債	100,000,000	101,148,600	
	い６９７　利付商工債	100,000,000	101,906,900	
	い７２０　利付商工債	100,000,000	100,835,600	
	い６９２　利付農林債	100,000,000	101,004,300	
	い６９４　利付農林債	100,000,000	101,088,700	
	い７０８　利付農林債	100,000,000	101,922,600	
	い７２６　利付農林債	100,000,000	99,921,700	
	２２０　信金中金	100,000,000	101,088,100	
	２３０　信金中金	100,000,000	102,039,900	
	１アフリカ開発銀行ＳＵＢ	170,000,000	183,498,170	
	２４　政保中日本道	100,000,000	104,077,900	
	１　中日本高速道路	100,000,000	102,898,600	
	２　中日本高速道路	100,000,000	103,803,800	
	５　中日本高速道路	100,000,000	107,173,300	
特殊債券　合計		5,938,000,000	6,177,651,132	
社債券	１２　ＧＥキヤピタル	100,000,000	97,325,700	
	６ドイツ銀行ＡＧシドニー	100,000,000	95,483,600	
	２１　サントリー	100,000,000	102,449,700	
	１　三越伊勢丹ＨＤ	100,000,000	100,350,000	
	３　塩野義製薬	100,000,000	102,042,400	
	２３　新日本石油	100,000,000	100,879,700	
	２０　太平洋セメント	100,000,000	100,371,200	
	５４　新日本製鐵	100,000,000	101,869,900	
	１３　豊田自動織機	100,000,000	103,315,400	
	１５　ダイキン工業	100,000,000	104,005,000	
	１４　日立製作所	100,000,000	104,035,700	
	４３　日本電気	100,000,000	99,812,900	

	１０　パナソニツク	100,000,000	101,047,400	
	２４　シャープ	100,000,000	101,377,400	
	１９　ソニー	100,000,000	101,607,000	
	５　デンソー	100,000,000	102,268,500	
	３４　石川島播磨	100,000,000	103,499,300	
	１　明治安田２０１１基	100,000,000	100,026,700	
	１フコク生命２０１１基金	100,000,000	99,658,600	
	９　トヨタ自動車	100,000,000	101,992,300	
	６８　丸紅	100,000,000	102,077,100	
	１　みずほコーポ劣後	100,000,000	103,267,700	
	１２　みずほコーポレート	100,000,000	101,347,400	
	１００三菱東京ＵＦＪＢＫ	100,000,000	101,757,900	
	３　ＵＦＪ銀行　ＳＵＢ	100,000,000	101,279,200	
	２　三菱信託ＢＫ劣後	100,000,000	103,599,900	
	４　住友信託　劣後	100,000,000	103,252,900	
	３７　ＮＴＴフアイナンス	100,000,000	101,214,500	
	３８　ＮＴＴフアイナンス	100,000,000	100,507,500	
	１４　日産フイナンシヤル	100,000,000	100,540,200	
	４０　トヨタフアイナンス	100,000,000	102,961,500	
	１４８　オリックス	100,000,000	100,343,000	
	９　三菱ＵＦＪリース	100,000,000	100,872,100	
	１－Ｂ　日本生命２００９	100,000,000	102,359,100	
	８　三井不動産	100,000,000	104,073,200	
	６６　三菱地所	100,000,000	100,759,500	
	６１　住友不動産	100,000,000	102,736,300	
	７　ジヤパンリアルエステイト	100,000,000	101,782,500	
	２　日本リテールフアンド	100,000,000	102,839,800	
	６　日本リテールフアンド	100,000,000	106,284,700	
	１　オリツクス不動産投	100,000,000	101,216,800	
	１０　相模鉄道	100,000,000	102,295,700	
	２８　京浜急行電鉄	100,000,000	103,875,800	
	２８　東海旅客鉄道	100,000,000	106,666,900	
	４　日本通運	100,000,000	102,011,000	
	４９　電信電話債	100,000,000	103,969,500	
	１５　ＮＴＴドコモ	100,000,000	108,000,700	
	４０５　中部電力	100,000,000	111,908,700	
	４７４　中部電力	100,000,000	104,195,500	
	４４０　関西電力	100,000,000	103,486,000	
	４７２　関西電力	100,000,000	104,853,500	
	３０６　中国電力	100,000,000	113,677,800	
	３２８　中国電力	111,000,000	112,722,054	
	２５８　四国電力	100,000,000	102,763,700	
	２６１　北海道電力	6,000,000	6,660,228	
	１０　電源開発	100,000,000	102,234,100	
	１６　電源開発	100,000,000	105,445,800	
	２４　東京瓦斯	100,000,000	102,275,900	
	２２　大阪瓦斯	100,000,000	106,166,200	
	２０　ＮＴＴデータ	100,000,000	101,327,800	
社債券　合計		5,917,000,000	6,073,028,082	
合計		46,496,100,000	48,360,098,563	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

次へ

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

貸借対照表

		平成22年11月30日現在 金 額（円）	平成23年11月30日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		119,178,636	201,686,621
コール・ローン		47,911,852	258,456,883
株式		44,215,875,431	40,763,409,216
投資証券		693,359,317	734,153,088
派生商品評価勘定		36,101,498	21,583,412
未収入金		116,384,318	52,874,347
未収配当金		97,279,344	115,907,882
差入委託証拠金		236,676,383	241,414,552
流動資産合計		45,562,766,779	42,389,486,001
資産合計		45,562,766,779	42,389,486,001
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		820	―
未払金		59,444,431	260,270,492
未払解約金		49,200,000	25,600,000
流動負債合計		108,645,251	285,870,492
負債合計		108,645,251	285,870,492
純資産の部			
元本等			
元本	※1	52,126,031,241	53,208,558,694
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△6,671,909,713	△11,104,943,185
元本等合計		45,454,121,528	42,103,615,509
純資産合計		45,454,121,528	42,103,615,509
負債純資産合計		45,562,766,779	42,389,486,001

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21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券	(1)株式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、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券

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

	外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年11月30日現在	平成23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	52,731,230,778円	52,126,031,241円
同期中における追加設定元本額	7,273,699,166円	7,739,320,585円
同期中における一部解約元本額	7,878,898,703円	6,656,793,132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	1,949,068,368円	1,949,306,097円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	108,815,688円	103,914,113円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,543,921,087円	1,411,957,538円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	217,611,180円	197,166,260円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	4,881,089,070円	4,663,354,500円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	13,076,995,518円	15,917,822,844円
ダイワ・ライフ・バランス３０	491,350,806円	625,800,871円
ダイワ・ライフ・バランス５０	76,132,151円	345,396,117円
ダイワ・ライフ・バランス７０	53,087,790円	219,689,659円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,414,979,097円	1,572,082,094円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	5,200,339円	6,278,506円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	4,289,919円	5,308,098円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	309,320円	521,022円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	128,427,020円	123,847,179円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	1,889,067,515円	1,859,829,310円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	43,329,047円	41,866,940円

ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	431,898,797円	415,146,585円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	6,570,917,361円	6,085,063,678円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	1,598,318,957円	1,497,560,885円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	14,181,213,813円	12,410,007,067円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	683,438,883円	632,371,434円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,634,664,841円	2,959,688,878円
ダイワライフスタイル２５	22,882,837円	27,497,819円
ダイワライフスタイル５０	65,046,051円	77,156,679円
ダイワライフスタイル７５	53,975,786円	59,924,521円
計	52,126,031,241円	53,208,558,694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	52,126,031,241口	53,208,558,694口
3．※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,671,909,713円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,104,943,185円であります。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 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	自 平成22年12月1日 至 平成23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。	同左
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、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	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、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3．　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。	同左
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。 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。	同左

Ⅱ　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	平成23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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（追加情報）

自　平成21年12月1日 至　平成22年11月30日	自　平成22年12月1日 至　平成23年11月30日
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。	―――――――

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在

種 類	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	2,823,064,120	△2,246,713,422
投資証券	92,720,905	△11,035,477
合計	2,915,785,025	△2,257,748,899

（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12月1日から平成22年11月30日まで、及び平成22年12月1日から平成23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）
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

種 類	平成22年11月30日 現在				平成23年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	488,827,095	－	524,928,363	36,101,268	562,682,493	－	584,265,905	21,583,412
合計	488,827,095	－	524,928,363	36,101,268	562,682,493	－	584,265,905	21,583,412

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

2． 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4． 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種 類	平成22年11月30日 現在				平成23年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	33,233,590	－	33,233,000	△590	－	－	－	－
カナダ・ドル	8,278,820	－	8,278,000	△820	－	－	－	－
香港・ドル	24,954,770	－	24,955,000	230	－	－	－	－
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。
① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8720円 (8,720円)	0.7913円 (7,913円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通 貨	銘 柄	株 式 数	評価額		備考
			単 価	金 額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,500	43.810	65,715.000	
	AVON PRODUCTS	11,900	16.580	197,302.000	
	ABBOTT LABS	41,300	53.050	2,190,965.000	
	ALCOA	27,400	9.310	255,094.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	3,400	37.360	127,024.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,500	43.670	414,865.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,800	42.740	205,152.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,629	22.790	151,074.910	
	AFLAC INC	12,800	40.880	523,264.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,900	46.400	180,960.000	
	HANSEN NATURAL CORPORATIO	2,200	89.110	196,042.000	
	ADOBE SYSTEMS	13,200	26.070	344,124.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,900	143.760	273,144.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,800	47.760	133,728.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	11.790	122,616.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	58.490	105,282.000	
	GARMIN LTD	3,200	35.600	113,920.000	
	AETNA INC	10,300	39.930	411,279.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,600	78.930	442,008.000	
	ALTERA CORPORATION	8,800	34.900	307,120.000	
	BEAM INC	3,600	50.720	182,592.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	19,600	51.560	1,010,576.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	19.290	82,001.790	
	WR BERKLEY CORP	3,100	32.810	101,711.000	
	AUTOZONE INC	700	323.430	226,401.000	
	DOLLAR TREE INC	3,350	79.720	267,062.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	46.100	147,520.000	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES	2,600	45.650	118,690.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	4,200	42.560	178,752.000	

D.R.HORTON INC	8,766	11.290	98,968.140	
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,800	33.790	128,402.000	
AUTODESK INC	6,100	31.490	192,089.000	
MOODY'S CORP	5,500	31.970	175,835.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	10,900	61.910	674,819.000	
CONSOL ENERGY INC	6,100	37.490	228,689.000	
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	41.080	131,456.000	
CITIGROUP INC	76,923	25.240	1,941,536.520	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,000	48.760	633,880.000	
AMERICAN ELEC POWER	13,000	38.260	497,380.000	
DUN&BRADSTREET CORP	1,400	67.360	94,304.000	
HESS CORP	7,900	57.390	453,381.000	
COVIDIEN PLC	13,325	43.790	583,501.750	
DAVITA INC	2,500	74.170	185,425.000	
DANAHER CORP	15,300	46.550	712,215.000	
AVNET INC	4,600	28.070	129,122.000	
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,900	117.380	223,022.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,700	29.060	543,422.000	
PEABODY ENERGY CORP	7,400	34.320	253,968.000	
BUNGE LIMITED	3,800	60.500	229,900.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,225	31.060	348,648.500	
APPLE INC	25,000	373.200	9,330,000.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	14,100	22.740	320,634.000	
BOEING CO	18,500	65.260	1,207,310.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	28.100	124,061.500	
MEADWESTVACO CORP	4,800	28.240	135,552.000	
SPECTRA ENERGY CORP	17,696	28.830	510,175.680	
BECTON DICKINSON & CO	5,900	71.770	423,443.000	
SAIC INC	8,600	11.370	97,782.000	
NISOURCE INC	7,600	22.100	167,960.000	
JOY GLOBAL INC	2,800	82.670	231,476.000	
BMC SOFTWARE INC	4,800	34.290	164,592.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	65.600	288,640.000	
ALPHA NATURAL RESOURCES I	6,000	20.840	125,040.000	
BARD(C.R.) INC	2,300	83.770	192,671.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	33,171	18.080	599,731.680	
VERIZON COMMUNICATIONS	75,100	36.630	2,750,913.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	23,700	75.130	1,780,581.000	
H&R BLOCK INC	8,800	15.180	133,584.000	
BB&T CORPORATION	19,200	21.670	416,064.000	
HOSPIRA INC	4,520	28.170	127,328.400	
BROADCOM CORP-CL A	12,450	29.330	365,158.500	
BAKER HUGHES INC	11,623	51.020	593,005.460	
BRISTOL MYERS SQUIBB	45,100	31.500	1,420,650.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	70.440	133,836.000	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	15.220	108,640.360	
JPMORGAN CHASE & CO	104,220	28.560	2,976,523.200	
LEGG MASON INC	3,850	24.540	94,479.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,900	53.210	367,149.000	
CIGNA CORP	8,000	42.060	336,480.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	4,200	23.300	97,860.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,600	71.250	114,000.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS	26,442	5.470	144,637.740	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,200	76.770	168,894.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,760	42.880	289,868.800	
DOLLAR GENERAL CORP	4,000	39.930	159,720.000	
CATERPILLAR INC DEL	17,000	90.540	1,539,180.000	

GENWORTH FINANCIAL INC-A	12,900	6.140	79,206.000	
VIRGIN MEDIA INC	8,600	22.330	192,038.000	
MOSAIC CO/THE	8,600	50.110	430,946.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,600	73.480	411,488.000	
CORNING INC	40,800	13.190	538,152.000	
CISCO SYSTEMS	144,000	17.680	2,545,920.000	
DU PONT	24,800	45.080	1,117,984.000	
MORGAN STANLEY	39,700	13.310	528,407.000	
DOW CHEMICAL	30,800	25.750	793,100.000	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,200	28.870	178,994.000	
DELL INC	44,800	14.940	669,312.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,600	50.940	234,324.000	
DEVRY INC	1,800	33.300	59,940.000	
AGCO CORP	2,800	42.770	119,756.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,300	50.850	778,005.000	
DENBURY RESOURCES INC	10,500	15.980	167,790.000	
DEERE & CO	11,200	75.840	849,408.000	
AIRGAS INC	2,100	72.810	152,901.000	
WALTER ENERGY INC	1,700	65.850	111,945.000	
QUANTA SERVICES INC	6,400	19.440	124,416.000	
TIME WARNER INC	28,233	33.380	942,417.540	
VMWARE INC-CLASS A	2,500	92.060	230,150.000	
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	26.100	96,570.000	
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	25.010	97,539.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,600	57.970	440,572.000	
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,900	44.520	129,108.000	
JEFFERIES GROUP INC(NEW)	4,300	10.750	46,225.000	
NYSE EURONEXT	6,900	27.300	188,370.000	
COLGATE PALMOLIVE CO	13,100	89.700	1,175,070.000	
AMETEK INC	4,350	40.470	176,044.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,000	43.780	175,120.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,000	30.360	242,880.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	11,500	83.510	960,365.000	
SCANA CORP	3,500	42.090	147,315.000	
GREEN MOUNTAIN COFFEE	3,400	48.920	166,328.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	800	312.970	250,376.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,800	21.720	125,976.000	
CUMMINS INC	4,900	88.470	433,503.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,500	12.090	163,215.000	
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	47.120	164,920.000	
LORILLARD INC	3,700	108.530	401,561.000	
PROGRESS ENERGY INC	7,500	52.630	394,725.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	3,200	39.500	126,400.000	
HCA HOLDINGS INC	5,100	24.050	122,655.000	
CABOT OIL & GAS CORP	2,800	83.090	232,652.000	
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	7.750	56,575.000	
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	31.150	46,725.000	
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,500	46.940	117,350.000	
COCA COLA CO	54,700	66.190	3,620,593.000	
COCA-COLA ENTERPRISES	8,800	24.740	217,712.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	41.020	233,814.000	
EATON VANCE CORP	3,700	22.290	82,473.000	
COOPER INDUSTRIES LTD-A	4,800	53.050	254,640.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	6,200	49.480	306,776.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,200	93.880	394,296.000	
CSX CORP	29,400	20.680	607,992.000	
FLUOR CORP	4,700	52.070	244,729.000	

LABORATORY CRP OF AMER HL	2,700	83.490	225,423.000	
EXPEDIA INC	5,350	27.380	146,483.000	
AUTOLIV INC	2,300	49.910	114,793.000	
AMAZON.COM INC	9,500	188.390	1,789,705.000	
FLOWSERVE CORP	1,500	96.010	144,015.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,200	63.530	203,296.000	
EXXON MOBIL CORP	131,355	76.930	10,105,140.150	
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	80.340	128,544.000	
FLIR SYSTEMS INC	4,500	25.400	114,300.000	
AES CORP	17,900	11.650	208,535.000	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	3,000	64.720	194,160.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,700	84.820	144,194.000	
EOG RESOURCES INC	7,200	98.230	707,256.000	
EQUITABLE RESOURCES INC	3,900	58.730	229,047.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,600	27.740	155,344.000	
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	57.740	594,722.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	36.380	258,298.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,090	35.020	318,331.800	
FORD MOTOR CO	93,023	9.990	929,299.770	
MACY'S INC	11,698	31.030	362,988.940	
ARCH COAL INC	6,000	14.610	87,660.000	
DISCOVERY COMMUNICATION-A	3,640	40.250	146,510.000	
FOREST LABORATORIES INC	7,500	29.020	217,650.000	
LIBERTY GLOBAL INC	3,735	38.240	142,826.400	
DISCOVERY COMMUNICATION-C	3,240	36.410	117,968.400	
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	4,000	15.130	60,520.000	
FOSSIL INC	1,500	86.380	129,570.000	
NEXTERA ENERGY INC	10,700	54.400	582,080.000	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	25,408	36.480	926,883.840	
US BANCORP	51,500	24.610	1,267,415.000	
FAMILY DOLLAR STORES	3,400	57.050	193,970.000	
F5 NETWORKS INC	2,100	103.410	217,161.000	
FASTENAL CO	7,400	40.150	297,110.000	
FISERV INC	3,800	55.480	210,824.000	
GENERAL ELECTRIC CO	281,700	14.920	4,202,964.000	
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,100	12.810	90,951.000	
GENERAL MOTORS CO	20,200	20.310	410,262.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,600	63.890	549,454.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,000	88.810	1,154,530.000	
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	22.750	111,475.000	
GOODRICH CORP	3,300	122.610	404,613.000	
GOOGLE INC-CL A	6,700	582.930	3,905,631.000	
GENERAL MILLS INC	17,300	39.060	675,738.000	
FIRSTENERGY CORP	10,868	43.240	469,932.320	
GENUINE PARTS CO	4,200	55.800	234,360.000	
FIFTH THIRD BANCORP	25,800	11.220	289,476.000	
HARRIS CORP	3,400	33.890	115,226.000	
HALLIBURTON CO	24,500	33.630	823,935.000	
HOME DEPOT INC	42,000	38.960	1,636,320.000	
ASSURANT INC	3,300	37.250	122,925.000	
HERSHEY CO/THE	4,300	56.240	241,832.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	6,200	34.840	216,008.000	
HUMANA INC	4,600	85.480	393,208.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,100	45.300	231,030.000	
HELMERICH & PAYNE	3,000	52.840	158,520.000	
WINDSTREAM CORP	13,800	11.500	158,700.000	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	4,800	7.100	34,080.000	

HENRY SCHEIN INC	2,600	62.390	162,214.000	
HEWLETT-PACKARD CO	58,200	26.900	1,565,580.000	
DIRECTV	20,782	45.670	949,113.940	
HOLLYFRONTIER CORP	5,400	22.630	122,202.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	36.890	132,804.000	
HEINZ H J CO	8,400	51.180	429,912.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	32,100	180.940	5,808,174.000	
INTERNATIONAL PAPER	11,600	26.670	309,372.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	9,229	30.920	285,360.680	
LEGGETT & PLATT INC	4,200	21.380	89,796.000	
LIBERTY GLOBAL INC-C	2,935	36.650	107,567.750	
JUNIPER NETWORKS INC	14,600	20.850	304,410.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	74.130	229,803.000	
JOHNSON & JOHNSON	72,300	62.780	4,538,994.000	
HOLOGIC INC	7,100	16.550	117,505.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	69.750	732,375.000	
KROGER CO	15,600	22.350	348,660.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	4,600	43.300	199,180.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,900	76.510	604,429.000	
LIMITED BRANDS	7,200	41.010	295,272.000	
LOWE'S COS INC	34,200	24.300	831,060.000	
ELI LILLY & CO	27,700	36.140	1,001,078.000	
LAM RESEARCH CORP	3,200	37.820	121,024.000	
RANGE RESOURCES CORP	4,400	68.580	301,752.000	
LSI CORP	17,000	5.400	91,800.000	
LOEWS CORP	8,500	36.700	311,950.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,349	18.490	154,373.010	
MCDONALD'S CORP	27,200	93.460	2,542,112.000	
3M CO	17,900	77.240	1,382,596.000	
MANPOWER INC	2,300	33.820	77,786.000	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,800	41.090	320,502.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	72.810	94,653.000	
CONCHO RESOURCES INC	2,700	96.570	260,739.000	
MURPHY OIL CORP	4,900	52.950	259,455.000	
MATTEL INC	9,000	28.160	253,440.000	
KBR INC	4,200	27.230	114,366.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,600	47.840	172,224.000	
MYLAN INC	12,400	18.490	229,276.000	
METLIFE INC	27,700	28.900	800,530.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	13.200	191,400.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,028	45.250	363,267.000	
MONSANTO CO	14,306	70.150	1,003,565.900	
ROCKWELL INTL CORP	4,000	70.930	283,720.000	
MERCK & CO INC	81,821	34.480	2,821,188.080	
MASCO CORP	9,700	9.000	87,300.000	
M & T BANK CORP	3,100	68.350	211,885.000	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	10,936	54.870	600,058.320	
MARSH & MCLENNAN COS	14,100	28.700	404,670.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,782	29.290	227,934.780	
NETAPP INC	10,200	35.630	363,426.000	
NIKE INC -CL B	9,600	94.870	910,752.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	72.960	678,528.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,300	32.970	174,741.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,200	55.130	396,936.000	
NEWMONT MINIG CORP	13,200	65.290	861,828.000	
MCKESSON CORP	6,600	78.690	519,354.000	
MOTOROLA MOBILITY HLGS	7,725	38.790	299,652.750	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,900	24.300	191,970.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	47,100	74.460	3,507,066.000	
NUCOR CORP	8,300	36.830	305,689.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	7,400	16.650	123,210.000	
WESTERN UNION CO	16,746	16.720	279,993.120	
NEWELL RUBBERMAID INC	7,500	15.050	112,875.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM	21,700	92.190	2,000,523.000	
OMNICARE INC	3,200	31.500	100,800.000	
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	7.650	58,713.750	
PAYCHEX INC	8,400	28.070	235,788.000	
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	4,400	30.270	133,188.000	
PATTERSON COS INC	2,900	28.730	83,317.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	75.920	288,496.000	
ALTRIA GROUP INC	55,300	27.950	1,545,635.000	
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	18.100	83,260.000	
PG & E CORPORATION	10,400	38.010	395,304.000	
PFIZER INC	208,263	19.400	4,040,302.200	
XCEL ENERGY INC	12,700	25.710	326,517.000	
STRYKER CORP	7,600	46.620	354,312.000	
PARKER HANNIFIN CORP	4,200	78.260	328,692.000	
PALL CORP	3,100	51.950	161,045.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES	2,800	89.380	250,264.000	
PROCTER & GAMBLE CO	74,137	62.530	4,635,786.610	
EXELON CORP	17,700	42.940	760,038.000	
ALEXION PHARMACEUTICALS	4,700	65.970	310,059.000	
CONOCOPHILLIPS	35,600	68.140	2,425,784.000	
PEPSICO INC	41,900	63.660	2,667,354.000	
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	4,300	33.570	144,351.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,700	46.860	595,122.000	
AMERICAN WATER WORKS CO	5,300	30.670	162,551.000	
ACCENTURE LTD-CL A	17,200	55.570	955,804.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,200	30.430	97,376.000	
PENTAIR INC	2,600	35.830	93,158.000	
QUALCOMM INC	43,900	53.110	2,331,529.000	
PARTNERRE LTD	1,800	64.390	115,902.000	
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,900	33.200	96,280.000	
INVESCO LTD	13,150	18.970	249,455.500	
ADVANCE AUTO PARTS	2,050	67.520	138,416.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,700	22.360	194,532.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	5,200	20.580	107,016.000	
ENERGEN CORP	2,000	48.810	97,620.000	
RAYTHEON CO	9,700	43.690	423,793.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	2,800	38.770	108,556.000	
RED HAT INC	5,200	47.150	245,180.000	
REPUBLIC SERVICES INC	8,100	26.810	217,161.000	
PRICELINE.COM INC	1,300	463.000	601,900.000	
ROSS STORES INC	3,200	89.400	286,080.000	
QEP RESOURCES INC	4,600	30.730	141,358.000	
QUEST DIAGNOSTICS	4,400	56.510	248,644.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,700	24.710	91,427.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	9,000	40.870	367,830.000	
RALPH LAUREN CORP	1,700	140.660	239,122.000	
ROWAN COS INC	3,300	32.520	107,316.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	4,400	53.180	233,992.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	33,235	3.590	119,313.650	
SUNOCO INC	3,200	38.450	123,040.000	
CHEVRON CORP	53,018	97.390	5,163,423.020	

EDISON INTERNATIONAL	8,600	38.200	328,520.000	
SYMANTEC CORP	20,000	15.600	312,000.000	
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,522	63.040	285,066.880	
SYNOPSYS INC	3,900	27.040	105,456.000	
CBRE GROUP INC	8,500	15.130	128,605.000	
SLM CORP	14,900	12.090	180,141.000	
SANDISK CORP	6,200	46.150	286,130.000	
SOUTHERN CO	22,600	43.260	977,676.000	
SYSCO CORP	16,400	27.790	455,756.000	
TRAVELERS COS INC	11,323	54.070	612,234.610	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,000	36.900	332,100.000	
SPX CORP	1,400	60.080	84,112.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,100	15.680	64,288.000	
STERICYCLE INC	2,200	77.440	170,368.000	
SCHLUMBERGER LTD	35,967	70.430	2,533,155.810	
AT&T INC	159,595	28.060	4,478,235.700	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	7.930	47,580.000	
SIGMA-ALDRICH	3,300	61.060	201,498.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,500	84.260	210,650.000	
SEMPRA ENERGY	6,000	51.660	309,960.000	
TIFFANY & CO	3,300	67.220	221,826.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,300	16.580	203,934.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	31,200	28.640	893,568.000	
SALESFORCE.COM INC	3,500	110.590	387,065.000	
TRW INC	3,000	30.260	90,780.000	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,000	55.480	110,960.000	
TIME WARNER CABLE	9,053	57.810	523,353.930	
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,525	45.980	575,899.500	
UNION PACIFIC CORP	13,100	99.230	1,299,913.000	
MARATHON OIL CORP	19,500	26.520	517,140.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	9,900	33.170	328,383.000	
UNITED TECHNOLOGIES	22,900	72.980	1,671,242.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	19,500	68.410	1,333,995.000	
SPRINT NEXTEL CORP	78,022	2.500	195,055.000	
UNUM GROUP	8,600	21.350	183,610.000	
AMEREN CORPORATION	6,500	32.500	211,250.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	28,426	45.880	1,304,184.880	
USX-US STEEL GRP	3,800	23.670	89,946.000	
VERISIGN INC	4,200	32.360	135,912.000	
VALERO ENERGY CORP	15,892	21.390	339,929.880	
WEYERHAEUSER CO	13,994	15.920	222,784.480	
WELLPOINT INC	9,600	67.420	647,232.000	
THE WALT DISNEY CO.	46,700	34.000	1,587,800.000	
WELLS FARGO & CO	133,172	24.080	3,206,781.760	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,200	49.640	109,208.000	
WASTE MANAGEMENT INC	12,400	30.420	377,208.000	
WILLIAMS COMPANY	15,900	31.100	494,490.000	
WHITING PETROLEUM CORP	3,300	44.410	146,553.000	
WHIRLPOOL CORP	2,100	46.740	98,154.000	
WAL-MART STORES	50,700	58.170	2,949,219.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	5,100	48.030	244,953.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	19,700	14.120	278,164.000	
WYNN RESORTS LTD	2,100	110.140	231,294.000	
XEROX CORP	37,044	7.610	281,904.840	
TJX COMPANIES INC	10,300	60.600	624,180.000	
WATERS CORP	2,500	75.180	187,950.000	
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,800	67.290	255,702.000	

WHOLE FOODS MARKET INC	4,200	65.190	273,798.000	
WASHINGTON POST -CL B	200	348.000	69,600.000	
WALGREEN CO	24,000	32.540	780,960.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	34.540	162,338.000	
WESTERN DIGITAL CORP	6,300	27.510	173,313.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	6,400	32.350	207,040.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,200	31.950	421,740.000	
VISA INC-CLASS A SHS	13,900	92.900	1,291,310.000	
PPL CORPORATION	15,700	29.230	458,911.000	
PITNEY BOWES INC	5,500	17.880	98,340.000	
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	19.220	123,008.000	
PULTE GROUP INC	9,500	5.660	53,770.000	
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	33.970	139,277.000	
PPG INDUSTRIES INC	4,300	83.140	357,502.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,100	35.390	215,879.000	
NSTAR	2,500	44.250	110,625.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	3,900	159.110	620,529.000	
NVIDIA CORP	17,050	14.910	254,215.500	
PNC FINANCIAL SERVICES	14,193	50.830	721,430.190	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	14,950	15.820	236,509.000	
TERADATA CORP	4,700	50.700	238,290.000	
TYSON FOODS INC-CL A	8,800	19.680	173,184.000	
NETFLIX.COM INC	1,300	67.570	87,841.000	
NII HOLDINGS INC	4,500	21.980	98,910.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	46.090	474,727.000	
NRG ENERGY INC	6,900	19.010	131,169.000	
TORCHMARK CORP	3,150	41.080	129,402.000	
TEXTRON INC	7,500	18.640	139,800.000	
NEWS CORP-CL A	48,150	16.540	796,401.000	
NEWS CORP-CLASS B	11,600	16.910	196,156.000	
OMNICOM GROUP	7,300	41.420	302,366.000	
ORACLE CORPORATION	107,683	29.740	3,202,492.420	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,900	357.680	1,037,272.000	
ONEOK INC	2,900	80.560	233,624.000	
CENTURYLINK INC	15,995	36.350	581,418.250	
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	82.830	207,075.000	
YUM! BRANDS INC	12,100	54.890	664,169.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,400	97.380	136,332.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,200	39.500	165,900.000	
NOBLE ENERGY INC	4,800	91.990	441,552.000	
BANK OF AMERICA CORP	268,601	5.080	1,364,493.080	
NORDSTROM INC	4,400	44.660	196,504.000	
AMERICAN EXPRESS CO	28,800	45.550	1,311,840.000	
ANALOG DEVICES	7,900	33.230	262,517.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	14,927	5.320	79,411.640	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	15.530	100,945.000	
AMERICAN INTL GROUP	12,872	21.130	271,985.360	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,000	76.760	997,880.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,700	25.050	92,685.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	5.150	63,345.000	
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,600	42.260	152,136.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	25.290	75,870.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,900	64.780	511,762.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,800	49.100	972,180.000	
AON CORP	7,800	44.460	346,788.000	
AMGEN	24,300	56.140	1,364,202.000	
ALLERGAN INC	8,000	81.380	651,040.000	

COACH INC	7,800	60.200	469,560.000	
EATON CORP	9,000	42.370	381,330.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,400	40.690	301,106.000	
CELGENE CORP	12,100	61.230	740,883.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	18.540	105,678.000	
APPLIED MATERIALS INC	34,300	10.250	351,575.000	
CIT GROUP INC	5,100	31.570	161,007.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,200	63.530	139,766.000	
CME GROUP INC	1,700	239.610	407,337.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	11,444	67.650	774,186.600	
ECOLAB INC	6,500	55.470	360,555.000	
EQUIFAX INC	3,500	35.330	123,655.000	
GAP INC	11,400	17.970	204,858.000	
GILEAD SCIENCES INC	20,700	39.270	812,889.000	
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	30.420	132,327.000	
ST JUDE MEDICAL INC	8,900	35.690	317,641.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,148	35.570	218,684.360	
HORMEL FOODS CORP	4,400	29.270	128,788.000	
SAFEWAY INC	10,100	19.090	192,809.000	
STATE STREET CORP	13,743	36.640	503,543.520	
STAPLES INC	19,900	14.240	283,376.000	
SUNTRUST BANKS INC	13,848	16.940	234,585.120	
SCHWAB(CHARLES) CORP	29,800	11.070	329,886.000	
IHS INC-CLASS A	1,200	85.850	103,020.000	
BAXTER INTL INC	14,900	49.420	736,358.000	
CONSTELLATION ENERGY	5,400	38.910	210,114.000	
CAMPBELL SOUP CO	5,000	32.000	160,000.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,300	31.510	135,493.000	
CHUBB CORP	7,800	64.910	506,298.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,500	40.900	388,550.000	
CAREFUSION CORP	5,850	23.770	139,054.500	
FEDEX CORP	7,800	78.580	612,924.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,254	41.530	508,908.620	
FMC CORP	1,900	79.810	151,639.000	
FLEXTRONICS INTL LTD	22,600	5.520	124,752.000	
CERNER CORP	4,000	58.190	232,760.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,100	52.620	110,502.000	
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	66.310	338,181.000	
INTEL CORP	139,800	23.580	3,296,484.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,400	49.780	318,592.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	13,800	8.840	121,992.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	12,000	16.390	196,680.000	
IRON MOUNTAIN INC	5,050	29.630	149,631.500	
CREE INC	3,300	24.150	79,695.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,700	43.390	507,663.000	
SIRIUS XM RADIO INC	98,000	1.720	168,560.000	
ILLUMINA INC	3,400	26.960	91,664.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	17,900	23.780	425,662.000	
SEALED AIR CORP	4,500	16.720	75,240.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,000	422.620	422,620.000	
SARA LEE CORP	15,600	18.370	286,572.000	
CALPINE CORP	9,300	15.000	139,500.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	14.740	89,914.000	
COVANCE INC	1,700	45.100	76,670.000	
CARMAX INC	6,500	28.480	185,120.000	
COMERICA INC	5,800	23.940	138,852.000	
DUKE ENERGY CORP	35,692	20.210	721,335.320	

TARGET CORP	17,100	52.240	893,304.000	
DOVER CORP	4,900	53.000	259,700.000	
RR DONNELLEY & SONS CO	5,500	14.470	79,585.000	
WW GRAINGER INC	1,600	176.490	282,384.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,500	39.830	139,405.000	
JOHNSON CONTROLS INC	18,600	28.900	537,540.000	
CINTAS CORP	3,700	29.050	107,485.000	
CA INC	10,805	20.380	220,205.900	
CONAGRA INC	11,000	24.530	269,830.000	
CLOROX COMPANY	3,600	65.000	234,000.000	
ENTERGY CORP	4,700	67.950	319,365.000	
MICROSOFT CORP	200,700	24.840	4,985,388.000	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,800	37.540	180,192.000	
CVS CAREMARK CORP	36,374	37.680	1,370,572.320	
MEDTRONIC INC	28,700	34.910	1,001,917.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	23,300	5.640	131,412.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	2,600	161.030	418,678.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	19.220	205,654.000	
HASBRO INC	3,600	34.770	125,172.000	
KELLOGG CO	6,500	48.340	314,210.000	
KEYCORP	26,000	6.960	180,960.000	
KRAFT FOODS INC-A	44,611	35.330	1,576,106.630	
KOHLS CORP	7,300	52.660	384,418.000	
SEARS HOLDING CORP	1,225	57.480	70,413.000	
URS CORP	2,100	34.840	73,164.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	11,500	11.520	132,480.000	
APACHE CORP	10,110	92.960	939,825.600	
ACE LTD	9,200	66.020	607,384.000	
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	34.400	110,080.000	
ALLSTATE	13,700	25.530	349,761.000	
EBAY INC	30,800	28.750	885,500.000	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,800	37.030	140,714.000	
XILINX INC	7,500	30.950	232,125.000	
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	13,100	43.200	565,920.000	
DISH NETWORK CORP	5,400	24.010	129,654.000	
YAHOO! INC	31,900	15.700	500,830.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	3,300	111.050	366,465.000	
TOLL BROTHERS INC	4,500	18.990	85,455.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,300	28.870	181,881.000	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	7,500	10.530	78,975.000	
NOBLE CORP	7,400	34.130	252,562.000	
PROGRESSIVE CORP	17,000	17.880	303,960.000	
PRAXAIR INC	8,100	96.810	784,161.000	
PACCAR INC	8,937	38.320	342,465.840	
PETSMART INC	3,300	47.440	156,552.000	
EL PASO CORPORATION	21,000	25.210	529,410.000	
EMC CORP/MASS	54,200	22.390	1,213,538.000	
BIOGEN IDEC INC	6,030	110.410	665,772.300	
INTL GAME TECHNOLOGY	8,100	16.640	134,784.000	
STARBUCKS CORP	20,100	42.210	848,421.000	
PERRIGO CO	2,200	97.740	215,028.000	
NORTHEAST UTILITIES	4,700	33.700	158,390.000	
INTUIT INC	7,700	50.860	391,622.000	
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,100	62.190	192,789.000	
BEST BUY COMPANY INC	9,000	27.860	250,740.000	
BALL CORP	4,200	34.000	142,800.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,947	5.550	238,355.850	

	BED BATH & BEYOND INC	6,700	59.690	399,923.000	
	XL GROUP PLC	8,400	19.460	163,464.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,100	21.690	197,379.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,700	30.490	112,813.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,400	27.330	147,582.000	
	VF CORP	2,400	134.230	322,152.000	
	CBS CORP-CL B	16,571	24.620	407,978.020	
	VIACOM INC-CLASS B	14,271	42.620	608,230.020	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,700	51.490	87,533.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,400	23.030	147,392.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,200	58.990	188,768.000	
	CARNIVAL CORP	12,400	32.050	397,420.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	3,800	63.110	239,818.000	
	COMCAST CORP -CL A	55,070	21.750	1,197,772.500	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	17,900	21.560	385,924.000	
アメリカ・ドル 小計		株 8,103,747		アメリカ・ドル 295,440,859.880 (23,082,794,382)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	KAZAKHMYS PLC	5,900	8.685	51,241.500	
	BP PLC	518,800	4.388	2,276,494.400	
	UNILEVER PLC	35,260	20.860	735,523.600	
	BARCLAYS PLC	319,700	1.690	540,293.000	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	49,900	7.050	351,795.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C SH	3,629,400	0.001	3,629.400	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	1.640	26,404.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,600	3.182	145,099.200	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,600	66.000	171,600.000	
	REXAM PLC	24,200	3.407	82,449.400	
	PRUDENTIAL PLC	68,300	6.105	416,971.500	
	LONMIN PLC	4,800	10.180	48,864.000	
	INMARSAT PLC	12,800	4.230	54,144.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	500,915	0.195	97,678.420	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,800	18.420	106,836.000	
	BAE SYSTEMS PLC	94,800	2.612	247,617.600	
	AVIVA PLC	79,200	3.028	239,817.600	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	7,400	6.330	46,842.000	
	CAIRN ENERGY PLC	40,900	2.750	112,475.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	141,002	13.670	1,927,497.340	
	INVENSYS PLC	23,500	1.977	46,459.500	
	REED ELSEVIER PLC	32,646	5.120	167,147.520	
	BG GROUP PLC	92,800	13.100	1,215,680.000	
	DIAGEO PLC	68,000	13.285	903,380.000	
	RIO TINTO PLC-REG	39,300	31.385	1,233,430.500	
	STANDARD CHARTERED PLC	64,500	13.315	858,817.500	
	TESCO PLC	217,200	3.983	865,107.600	
	FRESNILLO PLC	5,000	16.390	81,950.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	25,700	5.640	144,948.000	
	GLENCORE INTERNATIONAL PL	22,200	3.801	84,382.200	
	SMITHS GROUP PLC	11,433	9.220	105,412.260	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	10,000	6.890	68,900.000	
	PEARSON PLC	23,263	11.270	262,174.010	
	SAINSBURY (J) PLC	36,125	2.975	107,471.870	
	NEXT PLC	5,100	26.650	135,915.000	
	WHITBREAD PLC	4,911	15.950	78,330.450	
	BUNZL PLC	9,055	8.195	74,205.720	

GKN PLC	41,000	1.845	75,645.000	
VODAFONE GROUP PLC	1,409,037	1.698	2,392,544.820	
BALFOUR BEATTY PLC	21,400	2.417	51,723.800	
KINGFISHER PLC	67,511	2.501	168,845.010	
WPP PLC	34,100	6.490	221,309.000	
UNITED UTILITIES GROUP PL	18,527	6.120	113,385.240	
SEVERN TRENT PLC	6,633	15.360	101,882.880	
RECKITT BENCKISER PLC	16,800	32.000	537,600.000	
SCHRODERS PLC	3,200	12.960	41,472.000	
INTERNATIONAL POWER PLC	43,300	3.254	140,898.200	
AMEC PLC	9,600	8.665	83,184.000	
SSE PLC	25,000	12.930	323,250.000	
WEIR GROUP PLC (THE)	5,700	19.600	111,720.000	
ASTRAZENECA PLC	37,500	28.405	1,065,187.500	
WOLSELEY PLC	8,190	18.390	150,614.100	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	159,500	1.030	164,285.000	
3I GROUP PLC	27,591	1.859	51,291.660	
BRITISH SKY BROADCASTING	31,900	7.450	237,655.000	
SAGE GROUP PLC (THE)	39,200	2.750	107,800.000	
NATIONAL GRID PLC	94,528	6.410	605,924.480	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,139,965	0.231	263,331.910	
RSA INSURANCE GROUP PLC	102,300	1.078	110,279.400	
IMPERIAL TOBACCO GROUP	27,600	22.540	622,104.000	
CENTRICA PLC	141,760	2.946	417,624.960	
ARM HOLDINGS PLC	37,800	5.765	217,917.000	
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	52,860	28.840	1,524,482.400	
ICAP PLC	16,900	3.443	58,186.700	
SABMILLER PLC	25,800	21.935	565,923.000	
BHP BILLITON PLC	57,577	18.360	1,057,113.720	
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	10.990	108,801.000	
HSBC HOLDINGS PLC	492,300	4.865	2,395,039.500	
SHIRE PLC	15,500	20.450	316,975.000	
OLD MUTUAL PLC	157,400	1.093	172,038.200	
ANGLO AMERICAN PLC	35,683	23.085	823,742.050	
MORRISON SUPERMARKETS	60,900	3.190	194,271.000	
CARNIVAL PLC	5,061	21.000	106,281.000	
COMPASS GROUP PLC	52,500	5.710	299,775.000	
BT GROUP PLC	215,500	1.854	399,537.000	
MAN GROUP PLC	51,525	1.380	71,104.500	
XSTRATA PLC	55,800	9.550	532,890.000	
BURBERRY GROUP PLC	12,189	11.980	146,024.220	
INTERCONTINENTAL HOTELS	8,300	10.580	87,814.000	
AGGREKO PLC	7,671	18.410	141,223.110	
CAPITA GROUP PLC	18,190	6.380	116,052.200	
SERCO GROUP PLC	13,500	4.800	64,800.000	
INTERTEK GROUP PLC	4,700	19.050	89,535.000	
ITV PLC	112,200	0.635	71,247.000	
TULLOW OIL PLC	25,400	13.320	338,328.000	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,500	9.975	34,912.500	
PETROFAC LTD	7,000	13.660	95,620.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	8.345	36,292.400	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	99,600	21.410	2,132,436.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	72,081	22.090	1,592,269.290	
G4S PLC	40,800	2.468	100,694.400	
COBHAM PLC	31,500	1.714	53,991.000	
ADMIRAL GROUP PLC	5,700	9.180	52,326.000	
INVESTEC PLC	13,900	3.391	47,134.900	

	ANTOFAGASTA PLC	10,800	10.840	117,072.000	
	STANDARD LIFE PLC	67,400	1.969	132,710.600	
	EXPERIAN PLC	28,054	8.175	229,341.450	
	RESOLUTION LTD	42,476	2.405	102,154.780	
イギリス・ポンド 小計		株 11,778,268		イギリス・ポンド 36,902,598.970 (4,499,164,866)	
イスラエル・シュケル		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	6.980	393,672.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	39.130	547,820.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	800	150.100	120,080.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	26,200	145.000	3,799,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	32,000	11.890	380,480.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	10.120	380,512.000	
	NICE SYSTEMS LTD	2,100	122.800	257,880.000	
イスラエル・シュケル 小計		株 169,100		イスラエル・シュケル 5,879,444.000 (121,116,546)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	86,500	34.980	3,025,770.000	
	LEND LEASE	16,100	7.210	116,081.000	
	ASCIANO LTD	85,800	1.470	126,126.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.325	92,617.500	
	WOODSIDE PETROLEUM	17,800	33.350	593,630.000	
	OZ MINERALS LTD	9,707	10.330	100,273.310	
	FORTESCUE METALS GROUP	33,900	4.650	157,635.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,000	8.800	88,000.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	58,300	23.100	1,346,730.000	
	WESTPAC BANKING	80,898	20.450	1,654,364.100	
	SANTOS LIMITED	26,800	12.820	343,576.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	70,900	19.510	1,383,259.000	
	RIO TINTO LTD	12,200	63.500	774,700.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	28,400	13.950	396,180.000	
	AMCOR	33,100	7.280	240,968.000	
	METCASH LTD	23,500	3.970	93,295.000	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP	20,500	3.600	73,800.000	
	QR NATIONAL LTD	46,800	3.410	159,588.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	55,900	5.370	300,183.000	
	NEWCREST MINING	21,400	35.070	750,498.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.160	144,096.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	42,600	47.370	2,017,962.000	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	12.370	59,376.000	
	ORICA LIMITED	10,300	24.930	256,779.000	
	QBE INSURANCE	30,800	13.450	414,260.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,600	20.190	92,874.000	
	WOOLWORTHS	33,300	24.480	815,184.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	11.570	183,963.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	2.830	58,015.000	
	CROWN LTD	16,900	8.160	137,904.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,700	1.515	58,630.500	
	TELSTRA CORPORATION	121,200	3.160	382,992.000	
	AMP LIMITED	79,400	4.100	325,540.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	15,900	6.630	105,417.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	9,800	23.240	227,752.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	0.825	64,102.500	

	CSL LIMITED	14,100	30.860	435,126.000	
	ONESTEEL LIMITED	44,700	0.840	37,548.000	
	WESFARMERS LIMITED	26,900	30.710	826,099.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,700	53.290	90,593.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD-RIGHT	43,120	0.014	603.680	
	SUNCORP GROUP LTD	36,300	8.060	292,578.000	
	BORAL LIMITED	22,700	3.470	78,769.000	
	ASX LTD	5,000	30.210	151,050.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	8.040	111,756.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	2.050	28,700.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	58,400	2.870	167,608.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	11.420	115,342.000	
	TRANSURBAN GROUP	37,500	5.530	207,375.000	
	ILUKA RESOURCES LTD	11,000	14.550	160,050.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	4.610	86,668.000	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	12.490	67,446.000	
	MACQUARIE AIRPORTS	18,900	3.430	64,827.000	
	WORLEYPARSONS LTD	5,300	25.940	137,482.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.280	84,132.000	
	AGL ENERGY LTD	12,800	14.200	181,760.000	
	BRAMBLES LTD	42,700	6.970	297,619.000	
	LYNAS CORP LTD	49,900	1.180	58,882.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 1,906,525		オーストラリア・ドル 20,844,134.590 (1,637,932,096)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	41.980	331,642.000	
	SILVER WHEATON CORP	10,200	32.300	329,460.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,700	56.490	209,013.000	
	BCE INC	7,530	39.320	296,079.600	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,600	42.180	151,848.000	
	SUNCOR ENERGY INC	42,480	29.350	1,246,788.000	
	METRO INC-A	3,000	50.750	152,250.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,400	64.750	284,900.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	30,400	49.580	1,507,232.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	10,500	69.870	733,635.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	24,200	69.630	1,685,046.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	19.500	157,950.000	
	MEG ENERGY CORP	3,400	43.000	146,200.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	39,300	45.010	1,768,893.000	
	TOURMALINE OIL CORP	3,800	29.470	111,986.000	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES	5,700	13.900	79,230.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,400	46.260	111,024.000	
	TRANSCANADA CORP	19,400	41.550	806,070.000	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,400	50.390	171,326.000	
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,600	26.330	121,118.000	
	PENGROWTH ENERGY CORP	10,700	10.250	109,675.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	41,400	3.690	152,766.000	
	BARRICK GOLD CORP	27,000	51.470	1,389,690.000	
	CAE INC	9,200	9.600	88,320.000	
	THOMSON REUTERS CORP	10,104	27.040	273,212.160	
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	23,000	43.690	1,004,870.000	
	INMET MINING CRP	1,600	54.920	87,872.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	36.920	129,220.000	
	OSISKO MINING CORP	9,500	10.840	102,980.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	61.500	153,750.000	

ROGERS COMMUNICATIONS-B	11,700	36.850	431,145.000	
AGNICO-EAGLE MINES	4,800	42.370	203,376.000	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	9,000	11.630	104,670.000	
KINROSS GOLD CORP	32,100	13.450	431,745.000	
BANK OF MONTREAL	16,800	57.410	964,488.000	
POWER CORP OF CANADA	9,300	21.620	201,066.000	
CAMECO CORP	10,500	18.030	189,315.000	
TELUS CORP	900	54.180	48,762.000	
POWER FINANCIAL CORP	6,700	23.740	159,058.000	
NEW GOLD INC	12,400	10.730	133,052.000	
TECK RESOURECES LIMITED-B	15,500	34.270	531,185.000	
NEXEN INC	14,500	15.950	231,275.000	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,500	63.430	158,575.000	
VITERRA INC	10,500	9.850	103,425.000	
TALISMAN ENERGY INC	29,700	13.060	387,882.000	
IVANHOE MINES LTD	7,500	20.620	154,650.000	
AGRIUM INC	4,400	69.510	305,844.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCE	29,400	36.350	1,068,690.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	600	416.750	250,050.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,800	34.310	198,998.000	
TRANSALTA CORP	6,700	21.700	145,390.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	65.340	91,476.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	3,400	24.910	84,694.000	
RESEARCH IN MOTION	12,600	17.950	226,170.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	16,000	17.990	287,840.000	
ENBRIDGE INC	20,400	35.640	727,056.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	15,400	27.090	417,186.000	
BROOKFIELD OFFICE PROPERT	8,750	14.480	126,700.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	48,800	10.850	529,480.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,700	45.150	347,655.000	
GOLDCORP INC	22,659	51.240	1,161,047.160	
ENCANA CORP	19,800	19.770	391,446.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,500	60.030	270,135.000	
IAMGOLD CORPORATION	11,000	19.110	210,210.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	25.930	72,604.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	23.970	81,498.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,200	77.230	942,206.000	
CGI GROUP INC - CL A	6,400	18.760	120,064.000	
HUSKY ENERGY INC	9,700	23.810	230,957.000	
ONEX CORPORATION	3,500	33.710	117,985.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,000	20.390	203,900.000	
TELUS CORPORATION-NON VOT	4,400	51.090	224,796.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	21.790	113,308.000	
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,900	41.600	245,440.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,400	49.020	215,688.000	
ELDORADO GOLD CORPORATION	14,600	17.330	253,018.000	
CENTERRA GOLD INC	4,600	20.380	93,748.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	42.600	132,060.000	
TMX GROUP INC	2,700	44.750	120,825.000	
OPEN TEXT CORP	2,000	56.360	112,720.000	
CI FINANCIAL CORP	5,600	20.270	113,512.000	
SAPUTO INC	4,000	37.410	149,640.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,600	18.570	252,552.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	29.250	137,475.000	
YAMANA GOLD INC	21,500	16.050	345,075.000	
FORTIS INC	5,000	33.360	166,800.000	
NIKO RESOURCES LTD	1,500	50.460	75,690.000	

	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	19.850	67,490.000	
	CRESCENT POINT ENERGY COR	6,800	43.530	296,004.000	
	CENOVUS ENERGY INC	20,900	31.510	658,559.000	
	TIM HORTONS INC	4,400	51.010	224,444.000	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	13,500	20.450	276,075.000	
	ENERPLUS CORP	5,300	26.140	138,542.000	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	17.710	240,856.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,700	25.230	194,271.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	7,000	20.250	141,750.000	
カナダ・ドル 小計		株 1,043,623		カナダ・ドル 31,927,333.920 (2,418,176,271)	
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	36,000	15.170	546,120.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	12.250	588,000.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.350	170,464.500	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	6.340	209,220.000	
	KEPPEL CORP	41,500	9.000	373,500.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	4.190	81,286.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	9.580	162,860.000	
	CAPITALAND LIMITED	73,000	2.490	181,770.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	25,000	3.740	93,500.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.850	188,650.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	45.850	137,550.000	
	O.C.B.C.	67,000	7.900	529,300.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	175,000	1.500	262,500.000	
	SINGAPORE TELECOM	236,450	3.060	723,537.000	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.120	129,002.720	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	2.700	129,600.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	4.070	146,520.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.695	152,483.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	6.100	164,700.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	44,000	2.290	100,760.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	28,000	0.870	24,360.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	5.030	281,680.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	45,000	1.270	57,150.000	
シンガポール・ドル 小計		株 1,458,401		シンガポール・ドル 5,434,513.220 (328,298,944)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,850	37.550	144,567.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	19,300	141.600	2,732,880.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	63.150	50,520.000	
	SIKA AG-BR	60	1,656.000	99,360.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	31,880.000	127,520.000	
	ABB LTD	60,650	16.440	997,086.000	
	ARYZTA AG	2,700	41.500	112,050.000	
	TRANSOCEAN LTD	8,650	39.200	339,080.000	
	SWISS RE LTD	9,800	46.410	454,818.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	93,850	50.700	4,758,195.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,250	104.600	130,750.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	31,450	20.980	659,821.000	
	GAM HOLDING LTD	5,900	10.250	60,475.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	31.430	185,437.000	
	SGS SA	150	1,492.000	223,800.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	850	340.500	289,425.000	

	ZURICH FINANCIAL SERVICES	4,032	196.100	790,675.200	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	63.700	101,920.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	64,100	48.830	3,130,003.000	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	13,800	46.730	644,874.000	
	UBS AG-REGISTERED	98,100	10.680	1,047,708.000	
	SWISSCOM AG-REG	620	336.300	208,506.000	
	GEBERIT AG-REG	1,000	170.300	170,300.000	
	GIVAUDAN REG	230	842.500	193,775.000	
	ACTELION LTD-REG	3,450	30.130	103,948.500	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	149.700	37,425.000	
	SYNGENTA AG	2,612	263.000	686,956.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,250	93.400	116,750.000	
	SYNTHES INC	1,800	149.500	269,100.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,550	54.450	84,397.500	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	61.300	91,950.000	
	HOLCIM LTD-REG	6,700	49.200	329,640.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	92.600	87,970.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,500	110.000	165,000.000	
スイス・フラン 小計		株 450,208		スイス・フラン 19,626,682.700 (1,666,305,361)	
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	82,430	68.350	5,634,090.500	
	VOLVO AB-B SHS	38,900	72.700	2,828,030.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,200	715.500	1,574,100.000	
	S.K.F. AB-B SHS	10,900	134.700	1,468,230.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	109.300	699,520.000	
	NORDEA AB	72,000	50.650	3,646,800.000	
	SCANIA AB-B SHS	9,250	99.000	915,750.000	
	SWEDISH MATCH AB	6,200	218.000	1,351,600.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	130.200	1,165,290.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	167.100	1,036,020.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	40,050	36.440	1,459,422.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	13,600	168.800	2,295,680.000	
	SWEDBANK AB	22,550	83.650	1,886,307.500	
	HENNES & MAURITZ AB-B	27,400	206.400	5,655,360.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	16,450	97.050	1,596,472.500	
	SKANSKA AB-B	10,800	98.000	1,058,400.000	
	SANDVIK AB	27,950	79.350	2,217,832.500	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	122.000	1,500,600.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,150	135.000	2,585,250.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	58.800	540,960.000	
	TELIASONERA AB	58,300	44.170	2,575,111.000	
	ALFA LAVAL AB	9,400	122.200	1,148,680.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,400	120.800	1,256,320.000	
	ASSA ABLOY AB-B	8,450	157.200	1,328,340.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,450	304.600	441,670.000	
	SSAB AB-A SHARES	6,100	56.400	344,040.000	
	BOLIDEN AB	7,900	88.550	699,545.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	31.160	391,058.000	
	RATOS AB-B SHS	5,900	75.100	443,090.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,650	134.700	895,755.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,000	96.200	673,400.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 576,980		スウェーデン・クローナ 51,312,724.000 (582,399,417)	

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	11,700	614.000	7,183,800.000	
	DANSKE BANK A/S	17,100	74.650	1,276,515.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	33,160.000	630,040.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,450	71.800	391,310.000	
	TDC A/S	11,500	44.800	515,200.000	
	CARLSBERG AS-B	3,050	392.500	1,197,125.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,000	170.200	1,361,600.000	
	COLOPLAST-B	750	824.500	618,375.000	
	DSV A/S	5,600	104.300	584,080.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	432.800	357,060.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	32	34,920.000	1,117,440.000	
デンマーク・クローネ 小計		株		デンマーク・クローネ	
		64,026		15,232,545.000	
				(213,255,630)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	TELECOM CORP OF NZ	65,589	1.990	130,522.110	
	CHORUS LTD	13,117	3.310	43,417.270	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.880	118,188.000	
ニュージーランド・ドル 小計		株		ニュージーランド・ドル	
		98,806		292,127.380	
				(17,434,162)	
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	26.250	648,375.000	
	DNB ASA	27,600	56.000	1,545,600.000	
	ORKLA ASA	20,750	41.690	865,067.500	
	TELENOR ASA	21,100	95.150	2,007,665.000	
	STATOIL ASA	29,873	143.300	4,280,800.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,460	239.100	1,305,486.000	
	SEADRILL LTD	9,200	193.000	1,775,600.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	4,250	64.000	272,000.000	
	SUBSEA 7 SA	8,000	107.600	860,800.000	
ノルウェー・クローネ 小計		株		ノルウェー・クローネ	
		150,933		13,561,394.400	
				(181,315,843)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	22,400	45.790	1,025,696.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	25,600	26.950	689,920.000	
	COMMERZBANK AG	104,850	1.334	139,869.900	
	VOLKSWAGEN AG	750	106.550	79,912.500	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,900	119.900	467,610.000	
	M.A.N.	1,800	60.320	108,576.000	
	SIEMENS AG	22,400	72.250	1,618,400.000	
	E.ON AG	49,700	17.580	873,726.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,450	52.920	500,094.000	
	GEA GROUP AG	5,050	20.430	103,171.500	
	CONTINENTAL AG	2,200	48.875	107,525.000	
	BASF SE	25,150	50.560	1,271,584.000	
	LINDE	4,650	109.550	509,407.500	
	K+S AG	4,850	39.460	191,381.000	
	ALLIANZ SE-REG	12,200	72.870	889,014.000	
	THYSSENKRUPP AG	10,600	17.780	188,468.000	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,800	42.960	206,208.000	
	R.W.E. AG	11,950	29.260	349,657.000	

LUFTHANSA	6,750	9.200	62,100.000	
FRAPORT AG	1,100	39.890	43,879.000	
BRENNTAG AG	1,000	69.040	69,040.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,100	68.200	211,420.000	
UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	14.055	57,625.500	
HOCHTIEF AG	1,450	39.685	57,543.250	
SAP AG	24,792	42.840	1,062,089.280	
MUNCHENER RUECK AG-REG	5,050	89.450	451,722.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	29.055	113,314.500	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	4,450	41.985	186,833.250	
BEIERSDORF AG	3,000	41.120	123,360.000	
CELESIO AG	2,800	11.240	31,472.000	
MERCK KGAA	1,750	72.070	126,122.500	
ADIDAS AG	5,570	49.435	275,352.950	
HENKEL KGAA	3,750	35.010	131,287.500	
METRO AG	3,850	35.600	137,060.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	76,100	9.269	705,370.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,950	49.620	295,239.000	
DAIMLER AG	24,800	31.880	790,624.000	
QIAGEN N.V.	6,800	10.595	72,046.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,200	5.890	171,988.000	
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	37.250	68,912.500	
DEUTSCHE POST AG	23,550	10.790	254,104.500	
DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	5,150	43.400	223,510.000	
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	26.385	30,342.750	
SUEDZUCKER AG	2,250	22.810	51,322.500	
LANXESS	2,450	38.865	95,219.250	
SALZGITTER AG	1,250	36.195	45,243.750	
WACKER CHEMIE AG	500	71.180	35,590.000	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	2,800	40.860	114,408.000	
PHILIPS ELECTRONICS NV	28,276	14.425	407,881.300	
ARCELORMITTAL	23,500	12.565	295,277.500	
UNILEVER NV-CVA	45,400	24.630	1,118,202.000	
HEINEKEN NV	7,200	33.475	241,020.000	
REED ELSEVIER NV	18,427	8.480	156,260.960	
AEGON NV	48,744	3.057	149,010.400	
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	31,260	9.370	292,906.200	
AKZO NOBEL	6,600	35.630	235,158.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	34.410	151,404.000	
WOLTERS KLUWER	8,150	12.485	101,752.750	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	24.170	50,757.000	
ING GROEP N.V.	101,050	5.411	546,781.550	
KONINKLIJKE KPN NV	41,500	8.763	363,664.500	
ASML HOLDING NV	12,038	28.055	337,726.090	
TNT EXPRESS NV-W/I	10,195	4.986	50,832.270	
VOPAK	2,000	39.105	78,210.000	
RANDSTAD HOLDING NV	3,250	22.030	71,597.500	
SBM OFFSHORE NV	5,407	15.120	81,753.840	
FUGRO NV-CVA	1,900	38.530	73,207.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	29.000	88,450.000	
TOTAL SA	57,250	37.260	2,133,135.000	
MICHELIN (CGDE) - B	4,900	44.980	220,402.000	
AIR LIQUIDE	7,660	89.870	688,404.200	
PPR	2,050	104.850	214,942.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	13,750	40.005	550,068.750	
BOUYGUES	6,900	23.385	161,356.500	
LAFARGE SA	5,450	25.205	137,367.250	

BNP PARIBAS	26,500	28.165	746,372.500	
PEUGEOT SA	4,750	13.200	62,700.000	
NATIXIS	24,150	1.949	47,068.350	
THALES SA	3,050	22.945	69,982.250	
GROUPE DANONE	15,800	48.060	759,348.000	
CARREFOUR	15,300	18.565	284,044.500	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	9.349	75,493.170	
VIVENDI SA	34,250	16.505	565,296.250	
L'OREAL	6,450	77.280	498,456.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,350	29.815	338,400.250	
LEGRAND SA	6,500	23.770	154,505.000	
ALCATEL-LUCENT	66,800	1.210	80,828.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	64.000	99,200.000	
PERNOD-RICARD	5,267	69.500	366,056.500	
EURAZEO	1,026	29.500	30,267.000	
SOCIETE GENERALE-A	18,650	17.280	322,272.000	
LVMH	6,800	112.000	761,600.000	
ACCOR SA	4,050	19.595	79,359.750	
CAP GEMINI SA	4,300	26.890	115,627.000	
PUBLICIS GROUPE	4,250	33.855	143,883.750	
VALLOUREC	3,050	45.945	140,132.250	
BUREAU VERITAS SA	1,550	53.610	83,095.500	
EIFFAGE	1,300	17.505	22,756.500	
SODEXO	2,550	52.040	132,702.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,400	52.040	281,016.000	
AXA	46,800	10.105	472,914.000	
TELEVISION FRANCAISE	4,200	7.522	31,592.400	
CHRISTIAN DIOR	1,600	93.250	149,200.000	
LAGARDERE S.C.A.	3,800	17.505	66,519.000	
TECHNIP S.A.	2,850	67.380	192,033.000	
EDENRED	4,600	18.810	86,526.000	
RENAULT	5,350	26.350	140,972.500	
STMICROELECTRONICS NV	19,150	4.514	86,443.100	
ATOS	1,600	35.070	56,112.000	
DASSAULT SYSTEMS SA	1,750	60.180	105,315.000	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	15.965	74,237.250	
FRANCE TELECOM SA	51,650	12.260	633,229.000	
ALSTOM	5,650	24.260	137,069.000	
CNP ASSURANCES	4,000	9.400	37,600.000	
NEOPOST SA	1,000	52.610	52,610.000	
SANOFI	30,475	50.420	1,536,549.500	
VINCI	11,950	31.590	377,500.500	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	11,700	21.400	250,380.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,000	9.002	99,022.000	
CREDIT AGRICOLE SA	29,200	4.387	128,100.400	
GDF SUEZ	32,823	19.640	644,643.720	
IMERYS SA	1,100	35.125	38,637.500	
ELECTRICITE DE FRANCE	6,850	19.425	133,061.250	
SES	8,700	17.765	154,555.500	
SAFRAN SA	4,850	21.710	105,293.500	
ILIAD SA	600	89.910	53,946.000	
ARKEMA	1,550	50.840	78,802.000	
ADP	950	53.370	50,701.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,800	28.520	79,856.000	
SCOR SE	5,900	17.980	106,082.000	
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	15,550	5.540	86,147.000	
UCB SA	3,350	29.800	99,830.000	

KBC GROUPE	4,000	8.319	33,276.000	
BEKAERT NV	1,100	27.870	30,657.000	
COLRUYT SA	2,500	27.215	68,037.500	
DELHAIZE GROUP	2,950	42.630	125,758.500	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,300	51.450	118,335.000	
SOLVAY SA	1,750	66.680	116,690.000	
UMICORE	2,850	29.850	85,072.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	20,600	44.000	906,400.000	
AGEAS	66,400	1.244	82,601.600	
BELGACOM SA	4,900	22.960	112,504.000	
MOBISTAR SA	1,050	40.150	42,157.500	
BANCO POPOLARE SCARL	50,150	0.827	41,474.050	
FIAT SPA	23,700	3.598	85,272.600	
PRYSMIAN SPA	5,700	9.575	54,577.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,143	12.010	374,027.430	
SAIPEM	7,550	31.260	236,013.000	
FIAT INDUSTRIAL	22,450	6.200	139,190.000	
MEDIOBANCA SPA	17,115	4.450	76,161.750	
TENARIS SA	13,400	13.110	175,674.000	
UNICREDIT SPA	356,699	0.750	267,524.250	
TELECOM ITALIA SPA	269,882	0.810	218,604.420	
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.676	115,562.200	
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	0.897	19,150.950	
INTESA SANPAOLO	288,097	1.157	333,328.220	
ATLANTIA SPA	9,150	10.940	100,101.000	
ENI SPA	66,200	15.120	1,000,944.000	
MEDIASET SPA	24,100	2.064	49,742.400	
A2A SPA	42,800	0.749	32,057.200	
FINMECCANICA SPA	11,225	2.992	33,585.200	
MONTE DEI PASCHI SIENA	131,900	0.241	31,787.900	
ENEL SPA	181,600	3.020	548,432.000	
SNAM RETE GAS	47,100	3.340	157,314.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	21.090	79,087.500	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	26,800	2.826	75,736.800	
TERNA SPA	37,300	2.568	95,786.400	
PIRELLI & C.	7,645	6.750	51,603.750	
TELEFONICA S.A.	113,177	13.500	1,527,889.500	
BANCO POPULAR ESPANOL	28,015	3.025	84,745.370	
BANCO BILBAO VIZCAYA	128,312	5.928	760,633.530	
ACERINOX SA	3,900	9.720	37,908.000	
IBERDROLA SA	106,184	4.804	510,107.930	
BANCO DE SABADELL SA	29,969	2.279	68,299.350	
BANKINTER SA	8,850	3.984	35,258.400	
REPSOL YPF SA	22,550	21.205	478,172.750	
GRIFOLS SA	4,400	11.390	50,116.000	
BANCO SANTANDER SA	230,250	5.488	1,263,612.000	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	10,800	11.420	123,336.000	
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,700	12.285	106,879.500	
GAS NATURAL SDG SA	9,100	12.600	114,660.000	
MAPFRE SA	17,100	2.406	41,142.600	
CAIXABANK	24,750	3.696	91,476.000	
ZARDOYA OTIS SA	3,700	9.970	36,889.000	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE	26,300	1.710	44,973.000	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	17.810	23,153.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,876	22.950	88,954.200	
ACCIONA SA	750	66.790	50,092.500	
INDRA SISTEMAS SA	2,400	10.180	24,432.000	

	INDITEX	6,050	60.290	364,754.500	
	ENAGAS	4,900	13.495	66,125.500	
	RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	32.200	98,210.000	
	FERROVIAL SA	9,800	8.833	86,563.400	
	DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	3.160	59,092.000	
	UPM-KYMMENE OYJ	15,050	8.300	124,915.000	
	NOKIA OYJ	97,650	4.190	409,153.500	
	WARTSILA OYJ	4,700	23.260	109,322.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,750	4.314	76,573.500	
	METSO OYJ	3,750	28.490	106,837.500	
	ELISA OYJ-A SHARES	4,550	15.690	71,389.500	
	SAMPO OYJ-A SHS	12,250	19.140	234,465.000	
	FORTUM OYJ	12,150	16.440	199,746.000	
	KESKO OYJ-B SHS	1,950	25.520	49,764.000	
	KONE OYJ-B	4,250	40.850	173,612.500	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	22.640	86,032.000	
	NESTE OIL OYJ	4,300	8.815	37,904.500	
	POHJOLA BANK PLC	4,800	7.120	34,176.000	
	VERBUND AG	2,100	18.860	39,606.000	
	IMMOFINANZ AG	24,000	2.184	52,416.000	
	OMV AG	4,850	22.985	111,477.250	
	ERSTE GROUP BANK AG	4,750	12.270	58,282.500	
	TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	8.390	92,290.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	20.085	57,242.250	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	16.465	31,283.500	
	VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	27.220	27,220.000	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	20,300	4.600	93,380.000	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	2.324	125,612.200	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	6,700	11.420	76,514.000	
	EDP RENOVAVEIS SA	7,700	4.166	32,078.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	3.070	23,332.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	23,813	1.910	45,482.830	
	ELAN CORPORATION PLC	14,200	7.710	109,482.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,600	26.440	121,624.000	
	CRH PLC	20,400	13.430	273,972.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	16,300	1.164	18,973.200	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	11.100	53,280.000	
	OPAP SA	6,100	6.460	39,406.000	
ユーロ 小計		株 4,936,637		ユーロ 52,566,385.060 (5,475,314,668)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	43,500	59.050	2,568,675.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT	35,000	14.560	509,600.000	
	MTR CORP	42,500	24.550	1,043,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,000	95.850	3,834,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	19.800	415,800.000	
	SINO LAND	88,000	9.710	854,480.000	
	CHEUNG KONG	36,000	87.050	3,133,800.000	
	WHARF HOLDINGS	43,000	37.750	1,623,250.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	92.950	1,859,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	69.000	3,622,500.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	13.160	539,560.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	55,300	66.150	3,658,095.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	38.200	1,375,200.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	41.950	1,048,750.000	

	HK & CHINA GAS	118,531	17.780	2,107,481.180	
	HANG SENG BANK	19,200	93.400	1,793,280.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	20.400	510,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	115,000	6.590	757,850.000	
	WING HANG BANK LIMITED	6,000	62.250	373,500.000	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	34.550	224,575.000	
	HONG KONG EX & CL	28,900	123.000	3,554,700.000	
	LI & FUNG LTD	150,000	15.560	2,334,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	23.250	1,464,750.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	83.200	540,800.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	22.850	479,850.000	
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	10.860	504,990.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	27.000	607,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	25.900	1,321,936.000	
	SJM HOLDINGS LTD	51,000	12.740	649,740.000	
	AIA GROUP LTD	232,000	23.700	5,498,400.000	
	SANDS CHINA LTD	68,000	21.850	1,485,800.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	5.010	280,560.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	13.840	581,280.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	106,500	17.160	1,827,540.000	
	WYNN MACAU LTD	40,000	21.100	844,000.000	
香港・ドル 小計		株 1,853,971		香港・ドル 53,828,617.180 (539,901,030)	
合計		株 32,591,225		40,763,409,216 [40,763,409,216]	

(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	2,547	302,609.070	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,887	939,972.660	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	359,840.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	11,200	151,648.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,527	321,869.700	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,000	423,200.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	19,493	257,307.600	
		KIMCO REALTY CORP	10,500	156,345.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,500	158,265.000	
		RAYONIER INC	3,300	128,931.000	
		VENTAS INC	7,300	367,409.000	
		PROLOGIS INC	12,262	319,547.720	
		DUKE REALTY CORP	8,000	87,200.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,700	145,112.000	
		HEALTH CARE REIT INC	5,300	256,944.000	
		HCP INC	11,200	411,712.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	94,083.000	
		MACERICH CO/THE	3,700	176,564.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	27,000	426,600.000	
		PUBLIC STORAGE	3,900	493,779.000	
		REGENCY CENTERS CORP	2,700	96,309.000	
	アメリカ・ドル 小計		162,316	アメリカ・ドル 6,075,247.750 (474,659,107)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		LAND SECURITIES PLC	21,700	145,173.000	

		SEGRO PLC	19,850	43,114.200	
		HAMMERSON PLC	20,400	76,948.800	
		BRITISH LAND CO PLC	23,400	111,688.200	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES	15,900	48,415.500	
	イギリス・ポンド 小計		101,250	イギリス・ポンド 425,339.700 (51,857,416)	
	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	81,396	203,490.000	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200	92,416.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	122,863.500	
		GPT GROUP	50,460	158,444.400	
		MIRVAC GROUP	93,400	117,217.000	
		STOCKLAND	63,500	210,820.000	
		WESTFIELD GROUP	61,796	498,075.760	
		GOODMAN GROUP	205,000	120,950.000	
	オーストラリア・ドル 小計		750,452	オーストラリア・ドル 1,524,276.660 (119,777,660)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITAMALL TRUST	79,000	138,645.000	
	シンガポール・ドル 小計		79,000	シンガポール・ドル 138,645.000 (8,375,544)	
	ユーロ			ユーロ	
		CORIO NV	1,700	53,482.000	
		ICADE	800	44,416.000	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	2,450	325,360.000	
		GECINA SA	650	39,149.500	
		KLEPIERRE	3,200	66,400.000	
		FONCIERE DES REGIONS	950	43,272.500	
	ユーロ 小計		9,750	ユーロ 572,080.000 (59,587,853)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	72,000	1,983,600.000	
	香港・ドル 小計		72,000	香港・ドル 1,983,600.000 (19,895,508)	
投資証券 合計				734,153,088 [734,153,088]	
合計				734,153,088 [734,153,088]	

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 557銘柄 投資証券 21銘柄	98.0%	2.0%	57.0%

イギリス・ポンド	株式 投資証券	98銘柄 5銘柄	98.9%	1.1%	11.0%
イスラエル・シュケル	株式	7銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 投資証券	58銘柄 8銘柄	93.2%	6.8%	4.2%
カナダ・ドル	株式	96銘柄	100%	-%	5.8%
シンガポール・ドル	株式 投資証券	23銘柄 1銘柄	97.5%	2.5%	0.8%
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	31銘柄	100%	-%	1.4%
デンマーク・クローネ	株式	11銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式	3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	227銘柄 6銘柄	98.9%	1.1%	13.3%
香港・ドル	株式 投資証券	35銘柄 1銘柄	96.4%	3.6%	1.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

次へ

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

貸借対照表

	平成22年11月30日現在 金 額（円）	平成23年11月30日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,067,283	147,885,520
コール・ローン	1,035,875,820	1,185,200,631
国債証券	100,914,823,952	102,921,636,500
派生商品評価勘定	22,295,448	6,712,729
未収入金	30,267,231	406,003,866
未収利息	1,213,506,152	1,212,914,212
前払費用	65,139,483	38,029,869
流動資産合計	103,303,975,369	105,918,383,327
資産合計	103,303,975,369	105,918,383,327
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,500,124	3,303,855
未払金	310,153	350,772,327
未払解約金	―	385,893,000
流動負債合計	5,810,277	739,969,182
負債合計	5,810,277	739,969,182
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	58,762,234,120	61,558,034,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	44,535,930,972	43,620,379,722
元本等合計	103,298,165,092	105,178,414,145
純資産合計	103,298,165,092	105,178,414,145
負債純資産合計	103,303,975,369	105,918,383,327

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21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ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、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	同左
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成22年11月30日現在	平成23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	54,257,278,019円	58,762,234,120円
同期中における追加設定元本額	6,701,378,651円	7,489,141,247円
同期中における一部解約元本額	2,196,422,550円	4,693,340,944円
同期末における元本の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	3,311,430,139円	3,161,788,562円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	101,809,977円	98,900,765円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	740,675,120円	718,180,433円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	240,619,691円	221,741,973円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,239,754,053円	2,280,488,768円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	24,170,405,109円	28,173,951,568円
ダイワ・ライフ・バランス３０	355,179,920円	421,205,575円
ダイワ・ライフ・バランス５０	18,942,122円	77,684,872円

ダイワ・ライフ・バランス７０	10,561,784円	39,460,255円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	87,901,955円	126,668,617円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	62,288,888円	80,431,958円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	13,165,507円	17,430,860円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	4,547,046円	5,184,356円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	1,387,417円	1,824,178円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	24,118円	39,354円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	3,738,312,581円	3,424,002,876円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	390,499,413円	355,056,611円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	13,782,880,123円	12,861,875,090円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	2,531,346,833円	2,407,885,153円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	2,187,663,969円	1,870,887,358円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	787,018,884円	748,220,750円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	3,923,477,100円	4,396,104,530円
ダイワライフスタイル２５	21,967,550円	24,688,071円
ダイワライフスタイル５０	31,550,258円	35,132,732円
ダイワライフスタイル７５	8,824,563円	9,199,158円
計	58,762,234,120円	61,558,034,423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	58,762,234,120口	61,558,034,423口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　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	自　平成22年12月1日 至　平成23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。	同左

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、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	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、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．　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。	同左
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。 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。	同左

Ⅱ　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	平成23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。	同左
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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (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。	同左

（追加情報）

自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日	自 平成22年12月1日 至 平成23年11月30日
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。	―――――――

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成22年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成23年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	168,132,335	910,347,311
合計	168,132,335	910,347,311

（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12月1日から平成22年11月30日まで、及び平成22年12月1日から平成23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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成22年11月30日 現在				平成23年11月30日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,506,999,665	－	1,523,794,989	16,795,324	895,851,824	－	899,260,698	3,408,874
アメリカ・ドル	603,315,452	－	620,814,260	17,498,808	483,243,089	－	488,813,668	5,570,579
イギリス・ポンド	140,851,609	－	142,694,040	1,842,431	84,658,724	－	84,914,870	256,146
オーストラリア・ドル	17,562,233	－	18,047,240	485,007	13,684,669	－	13,552,670	△131,999
カナダ・ドル	49,568,293	－	51,306,609	1,738,316	28,401,607	－	28,143,560	△258,047
スイス・フラン	3,369,241	－	3,371,600	2,359	6,644,186	－	6,367,500	△276,686
スウェーデン・クローナ	6,433,030	－	6,441,400	8,370	6,073,624	－	5,956,260	△117,364
デンマーク・クローネ	9,075,369	－	9,096,920	21,551	9,514,842	－	9,324,000	△190,842
ポーランド・ズロチ	7,707,726	－	7,727,720	19,994	6,990,101	－	6,693,200	△296,901
メキシコ・ペソ	24,265,121	－	24,890,200	625,079	8,766,691	－	8,672,380	△94,311
ユーロ	644,851,591	－	639,405,000	△5,446,591	247,874,291	－	246,822,590	△1,051,701
合計	1,506,999,665	－	1,523,794,989	16,795,324	895,851,824	－	899,260,698	3,408,874

（注） 1． 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成22年11月30日現在	平成23年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7579円 (17,579円)	1.7086円 (17,086円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,795,581.720	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,608,131.880	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,853,734.880	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,811,039.330	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,296,776.070	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,103,692.240	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,028,667.880	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,871,063.320	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,107,946.240	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,952,150.360	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,168,867.320	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,455,695.920	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,104,046.280	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,113,156.760	

		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,311,471.200	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,372,872.970	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,756,830.400	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,417,316.060	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,123,556.800	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,887,946.810	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,115,912.590	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,987,237.620	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,032,300.000	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,310,501.430	
		2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,360,825.490	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,357,265.000	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,548,330.000	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,948,249.800	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,492,186.960	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,434,280.800	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,534,061.980	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,426,470.200	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,534,227.360	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,713,647.470	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,626,950.000	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,759,100.490	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,272,901.400	
		3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	8,085,454.770	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,550,460.500	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,219,546.740	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,526,832.000	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	7,541,246.380	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,846,060.000	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,370,248.800	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,419,259.630	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,635,212.960	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,512,026.920	

		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,162,940.930	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	6,144,000.000	6,829,424.640	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,163,780.600	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	689,210.640	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	5,267,000.000	5,574,961.490	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,356,112.850	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,432,150.480	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	2,037,049.560	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,706,382.320	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,173,671.420	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,736,974.160	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,192,780.350	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,749,674.690	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,317,327.300	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,565,556.080	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	7,436,000.000	8,403,200.520	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,776,503.320	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,515,564.150	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20121215	3,851,000.000	3,889,355.960	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,734,722.700	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,465,646.850	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130115	4,644,000.000	4,706,554.680	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,446,746.650	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,195,818.080	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130215	4,445,000.000	4,509,763.650	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,473,148.800	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	2,275,000.000	2,414,343.750	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	4,687,000.000	5,165,917.660	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130315	2,898,000.000	2,942,803.080	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,317,000.000	2,471,659.750	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	5,170,527.900	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20130415	2,877,000.000	2,938,682.880	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,367,781.540	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,833,920.850	

		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130515	2,259,000.000	2,297,290.050	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	5,993,577.120	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,718,761.920	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	3,088,137.150	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20130615	3,097,000.000	3,139,924.420	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,876,134.140	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,734,585.160	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20130715	2,440,000.000	2,470,500.000	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,488,049.220	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,896,400.800	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130815	3,043,000.000	3,069,626.250	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	4,929,000.000	5,258,602.230	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,582,151.330	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	3,020,919.860	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130915	1,878,000.000	1,894,789.320	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,630,376.720	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,944,013.520	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131015	1,937,000.000	1,945,697.130	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,258,000.000	1,260,641.800	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20151031	1,265,000.000	1,294,790.750	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20171031	382,000.000	397,127.200	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131115	885,000.000	888,938.250	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20201115	4,509,000.000	4,800,281.400	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,256,000.000	1,260,308.080	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20151130	3,151,000.000	3,240,835.010	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20171130	883,000.000	936,598.100	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20131215	3,091,000.000	3,120,673.600	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	2,088,000.000	2,097,938.880	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	2,515,000.000	2,663,737.100	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	253,000.000	276,045.770	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20140115	2,967,000.000	3,011,386.320	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,264,000.000	1,270,610.720	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20160131	635,000.000	668,953.450	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180131	255,000.000	276,254.250	

		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140215	631,000.000	644,137.420	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20210215	4,076,000.000	4,682,590.320	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,101,000.000	1,107,187.620	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,590,000.000	2,743,457.500	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	1,234,000.000	1,346,108.900	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140315	2,588,000.000	2,643,590.240	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130331	2,621,000.000	2,640,840.970	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20160331	1,300,000.000	1,384,851.000	
		2.875% U.S. TREASURY NOTE 20180331	1,300,000.000	1,427,660.000	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140415	1,439,000.000	1,470,586.050	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20130430	3,349,000.000	3,369,529.370	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20160430	260,000.000	274,105.000	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	260,000.000	281,244.600	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20140515	263,000.000	267,281.640	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20210515	4,417,000.000	4,877,648.930	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	659,000.000	661,827.110	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,832,000.000	3,995,741.360	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180531	1,322,000.000	1,407,612.720	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20140615	4,416,000.000	4,460,469.120	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	5,180,000.000	5,192,742.800	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160630	3,406,000.000	3,510,291.720	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180630	3,782,000.000	4,023,972.360	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20140715	4,093,000.000	4,121,610.070	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,307,000.000	2,312,398.380	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160731	2,053,000.000	2,114,507.880	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20180731	1,341,000.000	1,414,848.870	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,097,000.000	2,104,360.470	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20210815	1,418,000.000	1,436,831.040	
		0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,249,000.000	2,244,412.040	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,108,000.000	2,121,744.160	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20180831	2,730,000.000	2,744,714.700	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140915	3,109,000.000	3,098,305.040	
		0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	4,193,000.000	4,183,481.890	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,793,000.000	2,808,808.380	

		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20180930	2,835,000.000	2,824,141.950	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20141015	2,784,000.000	2,792,797.440	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131031	4,295,000.000	4,294,828.200	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,261,781.250	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,377,823.500	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,050,083.360	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,155,085.640	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,081,945.200	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,367,010.720	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,345,188.440	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,165,620.200	
		8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,696,524.250	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,153,497.600	
		7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,404,746.180	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,365,586.720	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,253,299.950	
		7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,102,360.200	
		6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,248,408.680	
		6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,222,111.350	
		6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	947,898.000	
		6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	1,050,163.200	
		6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,150,781.850	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,402,476.680	
		5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,136,923.590	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,280,735.820	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	2,032,907.440	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	995,222.670	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	2,062,903.560	
		5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,867,250.440	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,943,875.950	
		4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,467,634.600	
		5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	4,011,142.170	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,795,537.760	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	3,607,033.530	

		3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,794,151.200	
		4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	3,405,483.900	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	4,621,302.720	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	4,554,000.000	5,841,552.420	
		4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	4,202,000.000	5,601,770.240	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,784,280.230	
		3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	4,952,140.560	
		4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	3,269,000.000	4,117,632.400	
		4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	3,086,000.000	4,202,237.060	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20410515	3,356,000.000	4,317,963.840	
		3.75% U.S. TREASURY BOND 20410815	1,367,000.000	1,587,210.030	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 490,934,000.000 (38,356,673,420)	アメリカ・ドル 546,187,211.390 (42,673,606,826)	
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	1,221,102.400	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	673,222.400	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,003,853.400	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	942,000.000	1,413,376.800	
		6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,513,000.000	2,204,894.900	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	2,197,602.000	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	2,873,000.000	3,225,517.100	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	2,128,357.200	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,546,224.500	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,635,206.900	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,721,796.400	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	2,154,580.400	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,848,000.000	2,400,367.200	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,813,085.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,601,394.200	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,895,000.000	2,288,591.500	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	1,604,000.000	1,940,358.800	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,317,452.500	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,806,000.000	2,320,168.200	

		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,129,490.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,194,000.000	2,796,691.800	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,159,430.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	364,000.000	447,319.600	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,949,000.000	2,254,798.100	
		2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	2,468,000.000	2,567,954.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	1,300,000.000	1,633,060.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	2,483,000.000	2,815,722.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	1,011,000.000	1,265,165.400	
		2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,693,132.100	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	2,316,000.000	2,625,880.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	2,133,000.000	2,623,163.400	
		2% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160122	3,780,000.000	3,941,784.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210907	2,008,000.000	2,273,056.000	
		1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170122	1,316,000.000	1,351,268.800	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20520722	375,000.000	436,612.500	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 63,566,000.000 (7,749,966,720)	イギリス・ポンド 75,821,680.300 (9,244,179,262)	
	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	1,488,984.510	
		6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,521,228.600	
		6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,411,000.000	1,584,242.580	
		5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,148,000.000	1,259,229.720	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,463,000.000	1,667,015.350	
		6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	1,621,000.000	1,744,114.950	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	2,013,757.440	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	793,000.000	907,334.740	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	790,000.000	827,090.500	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,221,000.000	1,295,249.010	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	1,385,000.000	1,436,660.500	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	1,441,000.000	1,591,454.810	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	356,000.000	399,777.320	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20151021	368,000.000	387,919.840	

		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	451,000.000	467,930.540	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	399,000.000	417,437.790	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 17,583,000.000 (1,381,672,140)	オーストラリア・ドル 19,009,428.200 (1,493,760,868)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	669,907.280	
		9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	656,397.720	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	532,000.000	910,959.560	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,864,978.800	
		5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	907,310.510	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	2,064,438.750	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,317,138.560	
		4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,152,218.480	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	2,262,139.650	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,094,973.530	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,972,799.750	
		4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	2,018,000.000	2,335,572.660	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,418,412.870	
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,041,000.000	2,312,024.390	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,684,991.040	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	724,000.000	919,870.960	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,698,822.680	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,461,000.000	1,629,453.300	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,394,000.000	1,455,057.200	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130301	794,000.000	801,717.680	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,037,120.700	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	1,087,000.000	1,115,609.840	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,378,765.590	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20121201	449,000.000	451,442.560	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	645,743.980	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140301	1,501,000.000	1,533,511.660	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130801	376,000.000	382,343.120	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	807,070.940	

	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140801	268,000.000	276,171.320	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20131101	606,000.000	611,841.840	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,359,000.000	1,424,802.780	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	379,000.000	447,636.900	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140201	283,000.000	282,909.440	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	272,000.000	271,736.160	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150201	803,000.000	798,607.590	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 36,384,000.000 (2,755,724,160)	カナダ・ドル 41,594,499.790 (3,150,367,414)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	501,338.160	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	592,462.500	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	508,000.000	551,286.680	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	572,335.680	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	789,584.160	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	370,198.400	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	335,140.740	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	558,000.000	568,791.720	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	329,906.880	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	255,182.080	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	184,183.840	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	340,000.000	376,250.800	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	439,000.000	476,012.090	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	266,978.880	
	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	474,000.000	485,385.480	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	117,000.000	123,000.930	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 6,201,000.000 (374,602,410)	シンガポール・ドル 6,778,039.020 (409,461,337)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	948,000.000	994,262.400	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	487,000.000	639,348.210	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	726,000.000	1,024,356.960	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,254,000.000	1,377,506.460	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	1,215,000.000	1,471,996.800	

	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	152,000.000	177,426.560	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 4,782,000.000 (405,991,800)	スイス・フラン 5,684,897.390 (482,647,788)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,275,000.000	8,293,500.000	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	9,005,000.000	10,118,918.500	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	8,390,000.000	10,687,517.600	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,593,102.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,821,719.750	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	7,950,000.000	9,400,795.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	5,848,642.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	2,060,000.000	2,399,158.400	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 48,785,000.000 (553,709,750)	スウェーデン・クローナ 57,163,355.050 (648,804,080)	
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	3,320,000.000	4,999,422.000	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	10,238,000.000	11,138,022.580	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	8,732,000.000	9,747,095.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,535,000.000	9,765,661.650	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	13,787,441.580	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	9,530,000.000	11,004,672.200	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	4,450,000.000	4,771,512.500	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20141115	1,395,000.000	1,448,470.350	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 56,089,000.000 (785,246,000)	デンマーク・クローネ 66,662,297.860 (933,272,170)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	6,036,000.000	6,485,923.440	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	5,939,000.000	6,644,790.760	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,639,492.240	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	2,431,000.000	2,799,977.180	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	2,843,000.000	3,132,189.960	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 21,381,000.000 (285,863,970)	ノルウェー・クローネ 23,702,373.580 (316,900,735)	
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	2,388,886.010	
		6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,330,803.890	
		5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,295,630.890	
		5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,808,520.600	
		5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	2,660,000.000	2,676,305.800	
		5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,090,000.000	3,143,024.400	
		5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,407,979.700	
		5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	1,586,000.000	1,528,904.000	
		5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20150425	1,964,000.000	1,986,664.560	
		5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,012,000.000	1,938,038.880	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	945,000.000	938,318.850	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20130125	2,445,000.000	2,317,419.900	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20130725	2,383,000.000	2,208,040.140	
		5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	739,000.000	724,811.200	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20140125	484,000.000	436,142.080	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	1,623,000.000	1,578,821.940	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,157,000.000 (761,947,860)	ポーランド・ズロチ 32,708,312.840 (751,637,029)	
	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	2,614,000.000	2,719,004.380	
		3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,283,285.420	
		4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	700,000.000	736,988.000	
		5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,992,000.000	2,085,783.360	
		4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,192,277.840	
		5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,070,098.540	
		3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,034,975.200	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	540,648.420	
		3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	769,279.490	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	621,695.680	
		4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,149,147.410	
		3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,073,635.200	
		3.21% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130531	1,617,000.000	1,623,403.320	
		3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	375,687.520	

	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,466,941.730	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,311,000.000	1,356,085.290	
	3.434% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140815	192,000.000	193,570.560	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	946,000.000	991,644.500	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	738,000.000	738,686.340	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 22,255,000.000 (546,805,350)	マレーシア・リンギット 23,022,838.200 (565,671,135)	
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	9,807,111.600	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	2,787,878.960	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	6,720,000.000	7,140,134.400	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	10,585,948.800	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	9,403,000.000	10,602,540.710	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	15,233,000.000	16,712,276.630	
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	8,742,615.840	
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	10,474,000.000	11,299,770.160	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20130620	7,121,000.000	7,577,669.730	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,749,540.650	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	8,475,023.340	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	5,579,000.000	6,131,599.950	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	6,960,000.000	7,977,204.000	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	9,694,000.000	10,398,269.100	
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,719,119.020	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	8,453,000.000	9,378,349.910	
	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	2,511,000.000	2,586,229.560	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20210610	812,000.000	811,504.680	
	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	9,996,000.000	10,329,866.400	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20310529	8,456,000.000	8,548,931.440	
メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 147,585,000.000 (836,806,950)	メキシコ・ペソ 161,361,584.880 (914,920,186)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	349,178.470	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,223,000.000	1,675,155.330	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,538,059.160	

		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,163,841.300	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,175,785.260	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,370,980.620	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,294,060.450	
		4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	2,907,679.060	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,012,105.090	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,725,887.000	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,363,907.900	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,972,153.470	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,276,875.260	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,989,372.620	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,165,660.000	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,754,850.500	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,944,594.080	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,442,436.700	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,600,308.060	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,408,266.660	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,043,319.120	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,141,218.290	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,466,433.200	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,014,433.900	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,609,178.320	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,264,136.250	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,639,000.000	2,828,216.300	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	836,000.000	882,381.280	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,093,155.120	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,616,303.870	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,238,129.600	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	650,000.000	646,574.500	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121214	1,114,000.000	1,123,747.500	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130315	1,377,000.000	1,399,045.770	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130614	559,000.000	570,733.410	
		0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130913	1,157,000.000	1,164,022.990	

		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	1,996,723.080	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,181,690.720	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,495,276.820	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,478,872.980	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,527,916.860	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	2,471,000.000	2,585,950.920	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	2,786,000.000	2,863,422.940	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	1,926,000.000	1,998,610.200	
		2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	732,000.000	781,109.880	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	993,191.460	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	904,436.400	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	886,649.930	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,852,661.600	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,418,081.600	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,094,169.490	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,243,093.750	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,870,000.000	2,292,021.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,762,237.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,118,225.720	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,140,077.870	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,616,471.670	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,878,759.260	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,648,285.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,725,580.810	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	3,042,000.000	3,175,848.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,846,100.160	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,284,748.500	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,984,000.000	3,082,263.120	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,558,000.000	2,516,534.820	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,310,563.400	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,585,000.000	3,769,197.300	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,007,682.560	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,384,676.700	

		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,897,000.000	2,023,605.780	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,710,000.000	1,821,526.200	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,354,000.000	2,427,680.200	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	2,546,000.000	2,564,331.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	905,000.000	881,035.600	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	2,504,000.000	2,396,528.320	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,841,000.000	3,557,380.560	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	1,956,000.000	1,904,831.040	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,840,290.630	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	1,920,000.000	2,013,657.600	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,322,419.400	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	1,388,000.000	1,427,793.960	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,207,076.300	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	2,614,000.000	2,596,041.820	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,411,729.810	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130925	617,000.000	621,923.660	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	930,000.000	928,149.300	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,005,914.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,091,000.000	1,408,742.840	
		4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,104,847.160	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,957,577.030	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	1,536,000.000	1,628,006.400	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	972,331.400	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,530,572.340	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,132,000.000	1,230,948.120	
		4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,576,662.900	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,308,579.000	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,568,023.860	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,569,432.720	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130115	2,210,000.000	2,242,884.800	
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,848,000.000	1,966,807.920	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,095,000.000	1,246,077.150	
		1% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140115	1,133,000.000	1,137,203.430	

		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,031,000.000	1,075,405.170	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,615,000.000	1,650,368.500	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,400,511.200	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,712,000.000	1,652,833.280	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	2,539,642.680	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,064,307.740	
		6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	2,598,478.840	
		5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,532,952.000	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	2,794,494.160	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,270,396.800	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	2,899,613.920	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,502,164.920	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,404,813.730	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,589,838.810	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,019,928.950	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,213,485.750	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	1,915,247.880	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,271,117.520	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	2,456,637.360	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	3,378,576.390	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	1,945,273.200	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	1,675,397.760	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,253,725.680	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	1,625,561.480	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	2,928,000.000	2,471,319.840	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,633,744.420	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	2,347,000.000	1,946,155.870	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	2,615,000.000	2,449,025.950	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,430,211.600	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,559,754.180	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	2,403,000.000	1,908,702.900	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,436,000.000	1,081,264.920	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	2,560,000.000	2,102,400.000	

		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121215	2,778,000.000	2,649,684.180	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,508,838.710	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	2,000,000.000	1,595,820.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130601	2,000,000.000	1,863,040.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	718,704.070	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,361,000.000	1,794,525.270	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	2,144,000.000	1,670,819.200	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131101	1,206,000.000	1,102,838.760	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151101	186,000.000	159,176.940	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,737,000.000	1,451,055.060	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140401	1,389,000.000	1,271,185.020	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160415	2,034,000.000	1,756,603.080	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140701	383,000.000	356,481.080	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160915	986,000.000	879,216.200	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,089,000.000	908,520.030	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,367,064.250	
		8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	422,579.220	
		8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	825,622.070	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	826,394.400	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,249,550.610	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	2,025,000.000	2,032,674.750	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,492,345.050	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,084,809.040	
		3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,135,351.000	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,542,000.000	1,379,504.040	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,005,854.300	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,345,264.380	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,433,473.470	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,561,013.790	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,450,682.310	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,817,543.840	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,792,000.000	1,610,470.400	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	480,034.800	

		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	435,000.000	354,407.550	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	736,000.000	674,779.520	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,127,187.520	
		4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	737,104.230	
		5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	579,685.000	
		4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	554,647.350	
		4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	423,835.500	
		4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	603,200.000	
		4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,047,688.550	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000	742,465.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000	574,789.600	
		5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000	678,310.200	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,031,332.500	
		6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	724,707.960	
		4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,893,339.250	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,413,796.750	
		3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,432,439.050	
		3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	2,340,000.000	2,418,366.600	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	996,000.000	1,022,463.720	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,594,000.000	1,572,640.400	
		4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	951,650.280	
		4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	843,000.000	849,398.370	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	532,658.320	
		4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,356,827.220	
		3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,762,000.000	1,805,486.160	
		4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,001,127.560	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,133,702.700	
		3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	543,324.420	
		5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	777,569.750	
		4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	1,280,000.000	1,401,510.400	
		3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	423,503.830	
		4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	608,828.000	
		3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	687,000.000	725,705.580	
		4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	391,000.000	417,826.510	
		3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	880,000.000	909,726.400	
		1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	839,671.200	

		3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	459,000.000	478,392.750	
		1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170415	252,000.000	248,270.400	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,006,000.000	1,819,100.980	
		6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,260,271.000	
		4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	974,547.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,230,645.420	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,612,997.340	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,000,253.600	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,187,622.400	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	1,910,715.500	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,691,583.300	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	911,047.200	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	876,824.980	
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,333,846.200	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	1,490,334.360	
		4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,304,000.000	1,266,992.480	
		4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,383,382.640	
		4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,565,905.000	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,108,159.890	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	664,722.410	
		2.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130430	1,704,000.000	1,620,248.400	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	1,725,000.000	1,490,779.500	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	914,469.500	
		3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,661,195.650	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20131031	1,748,000.000	1,656,527.160	
		4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,510,210.400	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	863,000.000	780,600.760	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	1,932,000.000	1,797,726.000	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,074,000.000	974,214.660	
		3.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140430	1,196,000.000	1,131,416.000	
		4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	411,000.000	379,180.380	
		5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,018,704.600	
		4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	452,214.800	

		3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	1,596,000.000	788,583.600	
		3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	214,893.850	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	208,552.880	
		4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	389,481.250	
		4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	320,290.700	
		4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	247,148.000	
		4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	349,992.890	
		4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	1,520,000.000	828,400.000	
		3.6% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20141015	711,000.000	500,188.500	
		4.8% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20200615	416,000.000	222,543.360	
		6.4% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20160215	661,000.000	482,007.810	
	ユーロ 小計		ユーロ 404,472,000.000 (42,129,803,520)	ユーロ 396,854,912.350 (41,336,407,670)	
国債証券 合計			96,924,814,050 [96,924,814,050]	102,921,636,500 [102,921,636,500]	
合計			96,924,814,050 [96,924,814,050]	102,921,636,500 [102,921,636,500]	

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

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	194銘柄	100%	41.4%
イギリス・ポンド	国債証券	35銘柄	100%	9.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	16銘柄	100%	1.5%
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	100%	3.1%
シンガポール・ドル	国債証券	16銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	6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	5銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券	19銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	20銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	248銘柄	100%	40.2%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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23年12月30日

Ⅰ 資産総額	315,059,120円
Ⅱ 負債総額	244,324円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	314,814,796円
Ⅳ 発行済数量	464,983,110口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6770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23年12月30日

Ⅰ 資産総額	82,875,459,760円
Ⅱ 負債総額	92,187,866円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,783,271,894円
Ⅳ 発行済数量	206,802,808,185口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.4003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23年12月30日

Ⅰ 資産総額	48,658,724,290円
Ⅱ 負債総額	151,408,365円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,507,315,925円
Ⅳ 発行済数量	39,201,006,009口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2374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23年12月30日

Ⅰ 資産総額	44,771,396,851円
Ⅱ 負債総額	562,605,882円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	44,208,790,969円
Ⅳ 発行済数量	53,967,978,781口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8192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23年12月30日

Ⅰ	資産総額	107,817,980,279円
Ⅱ	負債総額	1,058,658,493円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	106,759,321,786円
Ⅳ	発行済数量	62,125,789,937口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7184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

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 【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23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

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

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

ロ．投資環境検討会

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「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23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	2	2,103
追加型株式投資信託	396	6,432,105
株式投資信託　合計	398	6,434,208
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,465,639
公社債投資信託 合計	17	2,465,639
総合計	415	8,899,847

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）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、第52期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）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は、あずさ監査法人により監査を受け、第52期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31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。

また、第53期事業年度に係る中間会計期間（平成23年４月１日から平成23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）

	前事業年度 （平成22年３月31日現在）		当事業年度 （平成23年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,783,803		1,820,358
有価証券		26,970,072		18,987,155
前払金		136		579
前払費用		77,248		24,840
未収入金		3,858		6,925
未収委託者報酬		7,030,430		6,933,076
未収収益		90,787		41,963
貯蔵品		30,324		23,337
繰延税金資産		566,334		286,080
その他		256,955		501,484
流動資産計		39,809,953		28,625,803
固定資産				
有形固定資産	※1	1,186,818	※1	967,190
建物（純額）		318,162		332,407

器具備品（純額）		757,333		634,782
建設仮勘定		111,322		―
無形固定資産		1,751,209		2,414,530
ソフトウェア		1,558,342		1,364,617
ソフトウェア仮勘定		179,630		1,037,069
電話加入権		11,850		11,850
商標権		660		396
その他		725		596
投資その他の資産		10,657,920		18,825,476
投資有価証券		10,018,677		12,339,547
関係会社株式		737,012		5,141,069
出資金		178,806		142,215
従業員に対する長期貸付金		104,419		99,889
差入保証金		617,615		609,781
長期前払費用		8,402		7,607
投資不動産（純額）	※1	489,861	※1	490,114
貸倒引当金	※3	△1,496,873		△4,750
固定資産計		13,595,948		22,207,196
資産合計		53,405,901		50,833,000

（単位：千円）

		前事業年度 （平成22年３月31日現在）		当事業年度 （平成23年３月31日現在）
負債の部				
流動負債				
預り金		46,289		46,454
未払金		7,304,929		6,501,119
未払収益分配金		31,110		27,599
未払償還金		261,645		119,838
未払手数料		3,847,895		3,725,807
その他未払金	※2	3,164,277	※2	2,627,872
未払費用		2,212,051		2,395,029
未払法人税等		692,446		895,379
未払消費税等		104,897		383,973
賞与引当金		838,400		263,000
その他		168,621		―
流動負債計		11,367,635		10,484,955
固定負債				
退職給付引当金		1,179,482		1,410,635
役員退職慰労引当金		39,300		59,160
繰延税金負債		1,963,856		1,977,913
固定負債計		3,182,638		3,447,708
負債合計		14,550,274		13,932,663
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174,272		15,174,272
資本剰余金				

資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	―
繰越利益剰余金	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計	12,259,401	10,248,473
株主資本合計	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△18,061	△104,040
繰延ヘッジ損益	△55,712	85,902
評価・換算差額等合計	△73,774	△18,137
純資産合計	38,855,627	36,900,336
負債・純資産合計	53,405,901	50,833,000

(2) 【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	63,362,142	72,303,483
その他営業収益	432,889	345,390
営業収益計	63,795,032	72,648,873
営業費用		
支払手数料	37,293,022	41,437,322
広告宣伝費	917,652	967,991
公告費	257	1,256
受益証券発行費	131	3
調査費	4,336,342	6,192,360
調査費	771,298	831,159
委託調査費	3,565,043	5,361,200
委託計算費	601,778	718,414
営業雑経費	1,793,369	1,806,147
通信費	284,273	287,454
印刷費	837,408	674,758
協会費	45,168	47,465
諸会費	11,118	10,778
その他営業雑経費	615,400	785,691
営業費用計	44,942,552	51,123,496
一般管理費		
給料	4,847,709	4,192,794
役員報酬	217,200	157,200
給料・手当	3,478,553	3,545,655
賞与	313,555	226,939
賞与引当金繰入額	838,400	263,000
福利厚生費	680,311	619,459
交際費	80,019	68,476
寄付金	―	638
旅費交通費	178,718	266,082
租税公課	166,974	169,305
不動産賃借料	731,728	680,147
退職給付費用	303,972	334,864
役員退職慰労引当金繰入額	37,500	28,500
固定資産減価償却費	941,172	897,352
諸経費	990,534	1,170,318
一般管理費計	8,958,640	8,427,939
営業利益	9,893,838	13,097,437

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）		当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）	
営業外収益				
受取配当金		61,884	※1	573,514
有価証券利息		87,447		23,029
受取利息		3,425		2,673
時効成立分配金・償還金		40,507		149,120
投資有価証券売却益		213,196		38,591
有価証券償還益		33,090		―
その他		82,595		45,094
営業外収益計		522,147		832,022
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		101,945		98,613
貯蔵品廃棄損		44,214		25,533
投資有価証券売却損		263,840		7,515
為替差損		7,870		―
投資不動産管理費用		―		20,028
その他		68,406		36,603
営業外費用計		486,276		188,294
経常利益		9,929,709		13,741,165
特別利益				
貸倒引当金戻入額		159,959		614,232
特別利益計		159,959		614,232
特別損失				
固定資産除却損	※2	16,233	※2	1,067
ゴルフ会員権評価損		―		21,290
減損損失	※3	76,450	※3	35,468
その他		―		768
特別損失計		92,683		58,595
税引前当期純利益		9,996,985		14,296,802
法人税、住民税及び事業税		4,592,433		4,834,931
法人税等調整額		△516,225		256,140
法人税等合計		4,076,208		5,091,072
当期純利益		5,920,777		9,205,730

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	－	－
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	－	－
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	－	－
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	－	－
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
別途積立金の取崩	－	△2,800,000
当期変動額合計	－	△2,800,000
当期末残高	2,800,000	－
繰越利益剰余金		
前期末残高	9,659,553	9,085,103
当期変動額		
別途積立金の取崩	－	2,800,000
剰余金の配当	△6,495,227	△11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	△574,450	789,072
当期末残高	9,085,103	9,874,176
利益剰余金合計		
前期末残高	12,833,851	12,259,401
当期変動額		
剰余金の配当	△6,495,227	△11,216,657

当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	△574,450	△2,010,927
当期末残高	12,259,401	10,248,473

（単位:千円）

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
株主資本合計		
前期末残高	39,503,851	38,929,401
当期変動額		
剰余金の配当	△6,495,227	△11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
当期変動額合計	△574,450	△2,010,927
当期末残高	38,929,401	36,918,473
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	△618,549	△18,061
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	600,487	△85,978
当期変動額合計	600,487	△85,978
当期末残高	△18,061	△104,040
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	―	△55,712
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△55,712	141,615
当期変動額合計	△55,712	141,615
当期末残高	△55,712	85,902
評価・換算差額等合計		
前期末残高	△618,549	△73,774
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	544,775	55,636
当期末残高	△73,774	△18,137
純資産合計		
前期末残高	38,885,301	38,855,627
当期変動額		
剰余金の配当	△6,495,227	△11,216,657
当期純利益	5,920,777	9,205,730
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	544,775	55,636
当期変動額合計	△29,674	△1,955,290
当期末残高	38,855,627	36,900,336

重要な会計方針

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23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 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 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 債権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、支給見込額を計上しております。	(2) 賞与引当金 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。

	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。	(3) 退職給付引当金 同左
	(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。	(4) 役員退職慰労引当金 同左
5．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。	(1) ヘッジ会計の方法 同左
	(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	(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 同左
	(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。	(3) ヘッジ方針 同左
	(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。	(4) ヘッジ有効性評価の方法 同左
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。	―――――――
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。	(1) 消費税等の会計処理 同左
	(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。	(2) 連結納税制度の適用 同左

会計方針の変更

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

――――――――	（資産除去債務に関する会計基準の適用） 当事業年度より、「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。

表示方法の変更

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
――――――――	（損益計算書） １．「有価証券償還益」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外収益に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。 なお、当事業年度の、営業外収益の「その他」に含まれている「有価証券償還益」の金額は、3,185千円であります。 ２．「投資不動産管理費用」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりましたが、重要性が増したため、当事業年度より、営業外費用の「投資不動産管理費用」として区分掲記しております。 なお、前事業年度の営業外費用の「その他」に含まれている「投資不動産管理費用」の金額は、17,078千円であります。 ３．「為替差損」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。なお、当事業年度の、営業外費用の「その他」に含まれている「為替差損」の金額は、8,906千円であります。

追加情報

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23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 （平成22年３月31日現在）	当事業年度 （平成23年３月31日現在）
※１　有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物　815,365千円 器具備品　1,938,369千円 投資建物　688,305千円 投資器具備品　27,339千円 ※２　関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金　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。 ４　保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。	※１　有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 建物　854,118千円 器具備品　2,129,756千円 投資建物　700,991千円 投資器具備品　28,141千円 ※２　関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金　2,591,913千円 ―――――――――― ４　保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

前事業年度 （自　平成21年４月１日 至　平成22年３月31日）	当事業年度 （自　平成22年４月１日 至　平成23年３月31日）
―――――――― ※２　固定資産除却損の内容は次のとおりであります。 器具備品　1,439千円 ソフトウェア　14,793千円	※１　関係会社項目 関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 受取配当金　460,584千円 ※２　固定資産除却損の内容は次のとおりであります。 器具備品　1,067千円

※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。	※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（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円であります。 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。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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。

① 剰余金の配当の総額　11,216百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,300円
④ 基準日　平成22年３月31日
⑤ 効力発生日　平成22年６月28日

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23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

(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23年６月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

① 剰余金の配当の総額　　9,182百万円
② 配当の原資　　利益剰余金
③ １株当たり配当額　　3,520円
④ 基準日　　平成23年３月31日
⑤ 効力発生日　　平成23年６月27日

（リース取引関係）

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
（借主側） リース取引開始日が平成20年３月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (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 該当事項はありません。 (2)未経過リース料期末残高相当額 該当事項はありません。 (3)支払リース料及び減価償却費相当額	――――――

支払リース料　　985千円 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 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	

（金融商品関係）

前事業年度（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

①市場リスクの管理

（ｉ）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。

（ii）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。

（iii）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。

②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）

	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）			
①ヘッジ会計が適用されていないもの	(7,985)	(7,985)	―
②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。

デリバティブ取引

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	
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があるもの	-	746,330	1,547,596	-
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31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。

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23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

①市場リスクの管理

（ｉ）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。

（ii）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。

（iii）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。

②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。

（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23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）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,820,358	1,820,358	－
(2) 未収委託者報酬	6,933,076	6,933,076	－
(3) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	30,154,565	30,154,565	－
資産計	38,908,001	38,908,001	－
(1) 未払手数料	3,725,807	3,725,807	－
(2) その他未払金	2,627,872	2,627,872	－
(3) 未払費用（*1）	1,951,710	1,951,710	－
負債計	8,305,391	8,305,391	－
デリバティブ取引（*2）	183,430	183,430	－

（*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。

デリバティブ取引

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	
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	5,141,069
(3) 長期差入保証金	609,781

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）

	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	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

（有価証券関係）

前事業年度（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

当事業年度（平成23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 5,141,069千円）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			
その他			
証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
(1)株式	54,283	55,101	△818
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	25,277,982	25,890,888	△612,906
小計	25,332,266	25,945,990	△613,724

合計	30,154,565	30,329,983	△175,417

（注）非上場株式（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。

３．当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成22年４月１日 至 平成23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	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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	デリバティブ取引の種類等	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 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）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	うち1年超	時価	当該時価の算定方法
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	2,303,784	－	△159,516	東京証券取引所から公表された価格によっている。
合計			2,303,784	－	△159,516	

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

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）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等		時価	当該時価の算定方法
				うち1年超		
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	2,435,030	―	183,430	東京証券取引所から公表された価格によっている。
合計			2,435,030	―	183,430	

（退職給付関係）

前事業年度 （平成22年３月31日現在）	当事業年度 （平成23年３月31日現在）
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。	１．採用している退職給付制度の概要 同左
２．退職給付債務に関する事項 退職給付債務　1,179,482千円 退職給付引当金　1,179,482千円	２．退職給付債務に関する事項 退職給付債務　1,410,635千円 退職給付引当金　1,410,635千円
３．退職給付費用に関する事項 勤務費用　175,249千円 その他　128,723千円 退職給付費用　303,972千円 なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。	３．退職給付費用に関する事項 勤務費用　191,300千円 その他　143,564千円 退職給付費用　334,864千円 なお、「その他」の143,564千円は、確定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22年３月31日現在）		当事業年度 （平成23年３月31日現在）	
１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳		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	915,392	減損損失	928,499
貸倒引当金	609,077	退職給付引当金	573,987
退職給付引当金	479,931	連結法人間取引（譲渡損）	294,850
賞与引当金	302,163	投資有価証券評価損	216,468
株式譲渡損繰延	287,965	未払事業税	212,062
投資有価証券評価損	225,062	出資金評価損	128,238
外貨建有価証券換算差額	176,654	その他有価証券評価差額金	125,395
未払事業税	163,956	賞与引当金	107,014
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	24,072
未払社会保険料	44,836	未払社会保険料	11,722

繰延ヘッジ損益	38,221
器具備品	38,093
役員退職慰労引当金	15,991
その他	27,316
繰延税金資産小計	3,516,480
評価性引当額	△ 2,139,543
繰延税金資産合計	1,376,937
繰延税金負債	
株式譲渡益繰延	△ 2,772,301
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

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。

その他	28,763
繰延税金資産小計	2,689,169
評価性引当額	△ 1,547,609
繰延税金資産合計	1,141,560
繰延税金負債	
連結法人間取引（譲渡益）	△ 2,772,301
繰延ヘッジ損益	△ 58,934
その他	△ 2,156
繰延税金負債合計	△ 2,833,392
繰延税金負債の純額	△ 1,691,832

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

法定実効税率	40.69%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△ 1.25
住民税均等割	0.02
評価性引当額	△ 4.14
その他	0.07
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60

（関連当事者情報）

前事業年度（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）
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	所在地	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㈱	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
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケッツ㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	676,687	未払手数料	64,597
							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㈱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㈱に商号変更しております。

２.親会社に関する注記

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

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23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）
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	1,384,110	－	－
子会社	Daiwa Asset Management (India)Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	－	－

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

（１）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。

（２）インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を１株につき72円86銭で引き受けております。

（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㈱	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	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケッツ㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	－	－
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,085,626	未払費用	129,623

（注）１．上記の金額のうち、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。

２.親会社に関する注記

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

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

前事業年度（自　平成21年４月１日　至　平成22年３月31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。

当事業年度（自　平成22年４月１日　至　平成23年３月31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］

当事業年度（自　平成22年４月１日　至　平成23年３月31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、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、記載はありません。

［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］

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

［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］

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31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］

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度より、「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）

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
１株当たり純資産額　14,895.63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。	１株当たり純資産額　14,146.05円 １株当たり当期純利益　3,529.09円 同左

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
当期純利益（千円）	5,920,777	9,205,730
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

前事業年度 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	当事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
該当事項はありません。	同左

（追加情報）

前事業年度（自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

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、インド共和国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いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited（以下、「DAMI」）及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited（以下、「DTC」）として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年１月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

（単位：千円）

	DAMI	DTC
取得原価	1,059,552	2,717
増資の引受	3,204,985	9,944
貸借対照表計上額（注） 関係会社株式	4,391,020	13,037
出資比率	91.0%	99.9%

（注）取得付随費用を算入した後の金額になります。

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23年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		5,608,473
有価証券		9,013,133
未収委託者報酬		6,773,690
貯蔵品		12,758
繰延税金資産		197,087
その他		472,852
流動資産計		22,077,996
固定資産		
有形固定資産	※１	870,049
無形固定資産		
ソフトウエア		2,237,473
その他		321,718
無形固定資産合計		2,559,192
投資その他の資産		
投資有価証券		17,664,932
その他	※１	1,296,211
貸倒引当金		△4,750
投資その他の資産合計		18,956,394
固定資産計		22,385,635
資産合計		44,463,632

（単位：千円）

		当中間会計期間末 （平成23年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		5,629,444
未払費用		2,988,680
未払法人税等		981,739
賞与引当金		277,000
その他	※３	306,598
流動負債計		10,183,463
固定負債		
繰延税金負債		1,436,117
退職給付引当金		1,566,148
役員退職慰労引当金		66,370
固定負債計		3,068,636
負債合計		13,252,099

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	4,745,092
利益剰余金合計	5,119,390
株主資本合計	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△817,480
繰延ヘッジ損益	239,622
評価・換算差額等合計	△577,857
純資産合計	31,211,532
負債・純資産合計	44,463,632

（２）中間損益計算書

（単位:千円）

		当中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		37,977,881
その他営業収益		178,035
営業収益計		38,155,917
営業費用		
支払手数料		21,394,608
その他営業費用		5,556,258
営業費用計		26,950,866
一般管理費	※１	4,367,716
営業利益		6,837,334
営業外収益	※２	165,615
営業外費用	※１，※３	123,075
経常利益		6,879,874
特別損失		4,756
税引前中間純利益		6,875,117
法人税、住民税及び事業税		2,890,995
法人税等調整額		△68,802
中間純利益		4,052,924

（３）中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自　平成23年４月１日 至　平成23年９月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
繰越利益剰余金	
当期首残高	9,874,176
当中間期変動額	
剰余金の配当	△9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	△5,129,083
当中間期末残高	4,745,092

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自　平成23年４月１日 至　平成23年９月30日）
利益剰余金合計	
当期首残高	10,248,473
当中間期変動額	
剰余金の配当	△9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	△5,129,083
当中間期末残高	5,119,390

株主資本合計	
当期首残高	36,918,473
当中間期変動額	
剰余金の配当	△9,182,008
中間純利益	4,052,924
当中間期変動額合計	△5,129,083
当中間期末残高	31,789,390
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	△104,040
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）	△713,440
当中間期変動額合計	△713,440
当中間期末残高	△817,480
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	85,902
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）	153,719
当中間期変動額合計	153,719
当中間期末残高	239,622
評価・換算差額等合計	
当期首残高	△18,137
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）	△559,720
当中間期変動額合計	△559,720
当中間期末残高	△577,857
純資産合計	
当期首残高	36,900,336
当中間期変動額	
剰余金の配当	△9,182,008
中間純利益	4,052,924
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△559,720
当中間期変動額合計	△5,688,804
当中間期末残高	31,211,532

重要な会計方針

	当中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）

１．資産の評価基準及び評価方法	（１）有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。 （２）デリバティブ 時価法により計上しております。
２．固定資産の減価償却の方法	（１）有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　６～47年 器具備品　３～20年 （２）無形固定資産 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 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。

追加情報

当中間会計期間 （自　平成23年４月１日 至　平成23年９月30日）
（会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用） 当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号　平成21年12月４日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号　平成21年12月４日）を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

当中間会計期間末 （平成23年９月30日）
※１．減価償却累計額 有形固定資産　3,036,275千円 投資その他の資産　727,880千円 ２．債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,240,890千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23年４月１日 至　平成23年９月30日）
※１．減価償却実施額

有形固定資産	131,539千円
無形固定資産	363,595千円
投資その他の資産	7,309千円
※２．　営業外収益の主要項目	
受取配当金	46,562千円
投資有価証券売却益	44,885千円
時効成立分配金・償還金	33,386千円
法人税還付加算金	20,450千円
※３．　営業外費用の主要項目	
投資有価証券償還損	67,771千円
為替差損	13,127千円
貯蔵品廃棄損	13,042千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　平成23年４月１日　至　平成23年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首株式数（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23年６月24日定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年３月31日	平成23年６月27日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自　平成23年４月１日　至　平成23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「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

①市場リスクの管理

（ｉ）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投資有価証券の一部について為替予約を利用してヘッジしております。

（ii）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。

（iii）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。

②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23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	5,608,473	5,608,473	―
（２）未収委託者報酬	6,773,690	6,773,690	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	20,364,859	20,364,859	―
資産計	32,747,023	32,747,023	―
（１）未払金	5,629,444	5,629,444	―
（２）未払費用（*１）	2,636,853	2,636,853	―
負債計	8,266,298	8,266,298	―
デリバティブ取引（*２）			
①ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,773)	(1,773)	―
②ヘッジ会計が適用されているもの	(30,798)	(30,798)	―
デリバティブ取引計	(32,572)	(32,572)	―

（*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）未払金、及び（２）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。

デリバティブ取引

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
非上場株式	1,172,137
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	540,246

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）

	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	5,608,473	-	-	-
未収委託者報酬	6,773,690	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,496,072	6,195,633	-
合計	12,382,163	1,496,072	6,195,633	-

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成23年４月１日 至 平成23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 5,141,069千円）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			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,556,521	3,405,918	150,602
小計	3,556,521	3,405,918	150,602
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
(１)株式	42,785	55,101	△12,316
(２)その他			
証券投資信託の受益証券	16,765,553	18,282,157	△1,516,604
小計	16,808,338	18,337,259	△1,528,920
合計	20,364,859	21,743,177	△1,378,317

（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23年４月１日 至 平成23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

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	デリバティブ取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	971,384	－	△1,773	△1,773
合計		971,384	－	△1,773	△1,773

（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）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等		時価	当該時価の算定方法
				うち1年超		
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	1,946,277	－	△30,798	東京証券取引所から公表された価格によっている。
合計			1,946,277	－	△30,798	

（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23年４月１日　至　平成23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23年４月１日　至　平成23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、記載はありません。

［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23年４月１日 至 平成23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23年４月１日 至 平成23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23年４月１日 至 平成23年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）	
１株当たり純資産額	11,965.20円
１株当たり中間純利益金額	1,553.72円

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

２．１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

中間純利益(千円)	4,052,924
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,052,924
普通株主に帰属しない金額(千円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４ 【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行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。)。

② 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。)。

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

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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。

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

５ 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

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

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

第２ 【その他の関係法人の概況】

１ 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称 住友信託銀行株式会社

※ 関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

② 資本金の額 342,037百万円（平成23年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 （平成23年 3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
住友信託銀行株式会社	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23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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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

⑤ 使用開始日を記載することがあります。

⑥ 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

⑦ 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

⑧ 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。

⑨ ファンドの形態等を記載することがあります。

⑩ 図案を採用することがあります。

⑪ 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24年1月13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 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22年12月1日から平成23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23年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成23年６月２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	森　公 高 ㊞
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井　淳 ㊞
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津　広 ㊞

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23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23年11月29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	森　公高　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男　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、「委託会社等の経理の状況」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23年４月１日から平成24年３月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年４月１日から平成23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、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、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中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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、我が国において一般に公正妥当と認められ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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、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が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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23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23年４月１日から平成23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。

利害関係

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 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

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

委託会社の監査報告書（前期）へ

独立監査人の監査報告書

平成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 業務執行社員	公認会計士	堀 内　　巧　印
指 定 社 員 業務執行社員	公認会計士	小 澤 陽 一　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成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。