【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27年2月20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　白川　真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山部　努 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【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27年2月21日から平成28年2月22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27年2月21日から平成28年2月22日まで（継続申込期間）
(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
・委託会社のホームページ
アドレス　http://www.daiwa-am.co.jp/

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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。一般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）

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 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）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル（含む日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　　） なし	日経225 TOPIX その他（合成インデックス）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

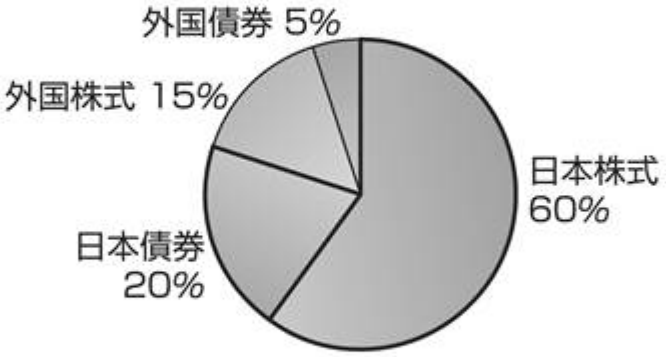
※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス http://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜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。

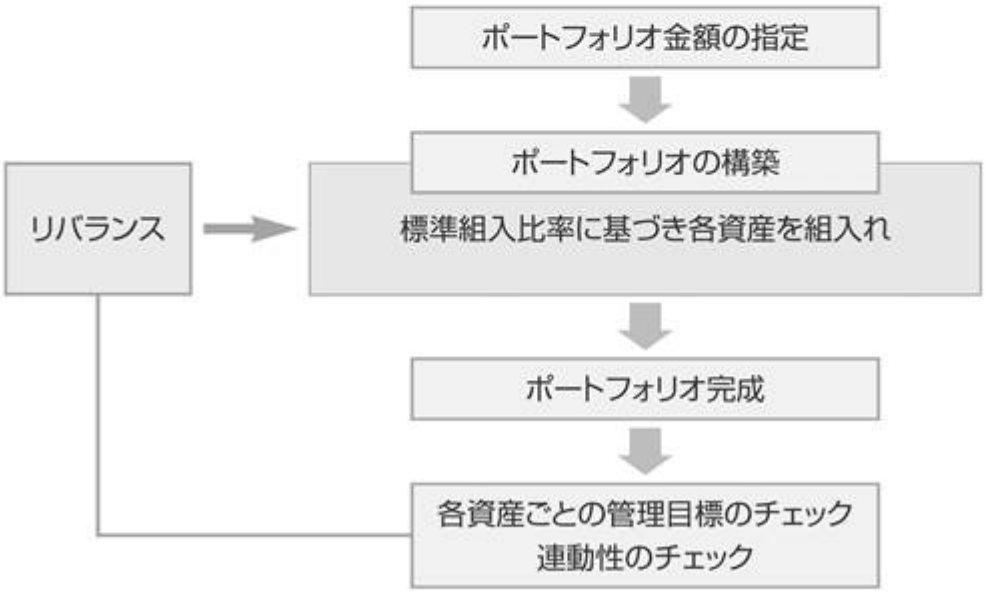
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

●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

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLC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	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、 わが国の公社債、外国の株式（預託証書を含みます。）、 外国の公社債　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社の概況（平成26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。

ヘ．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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(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、三井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

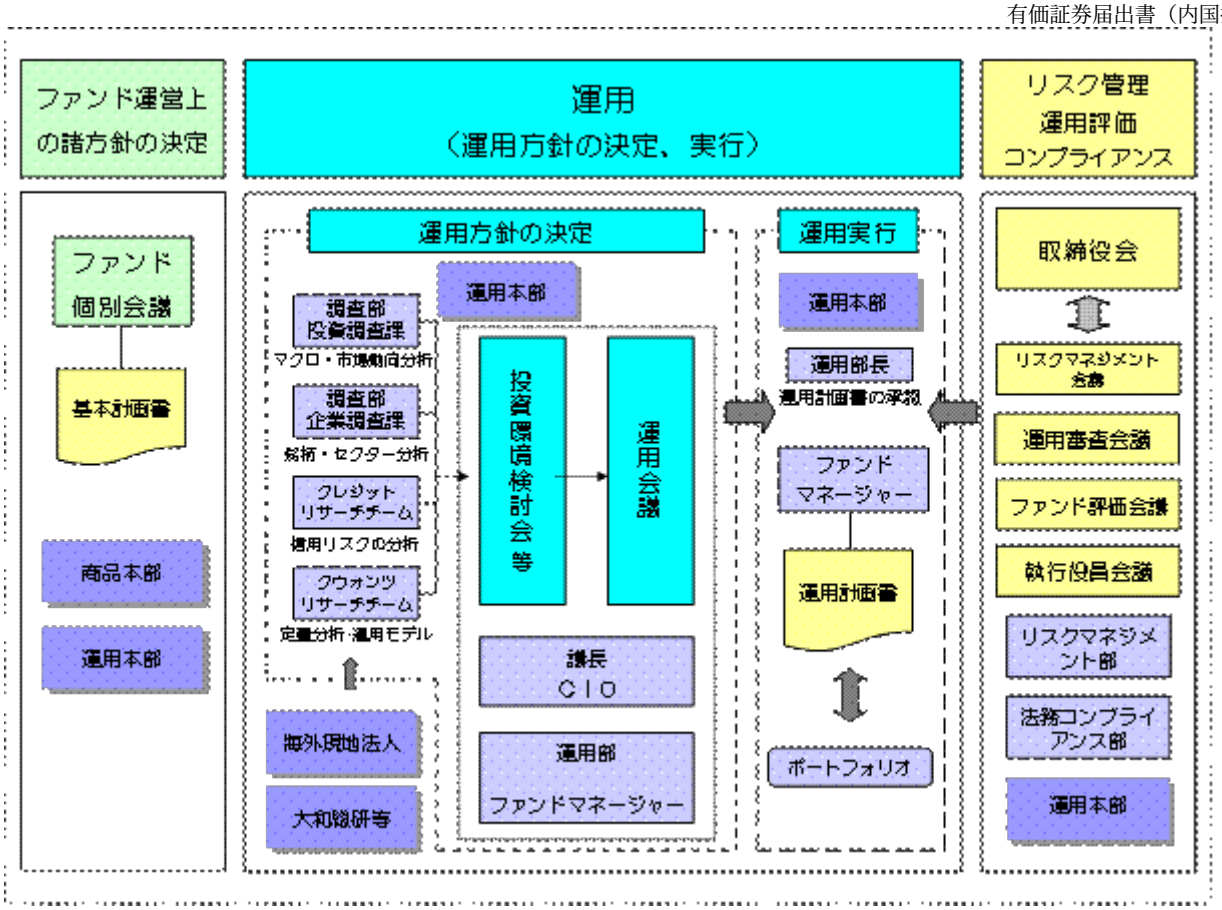
③ 前①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前② 1.から4.の金融商品により運用することの指図ができます。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(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CIO（Chief Investment Officer）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．CIO（Chief Investment Officer）（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．Deputy-CIO（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．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）
CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．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。

ホ．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、リスクマネジメント会議および執行役員会議
次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。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25～35名程度です。

イ．ファンド評価会議
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。

ロ．運用審査会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．リスクマネジメント会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ニ．執行役員会議
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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27年1月1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　デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

⑪　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。

⑫　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。

⑬　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。

⑭　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。

⑮　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。

⑯　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

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLC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

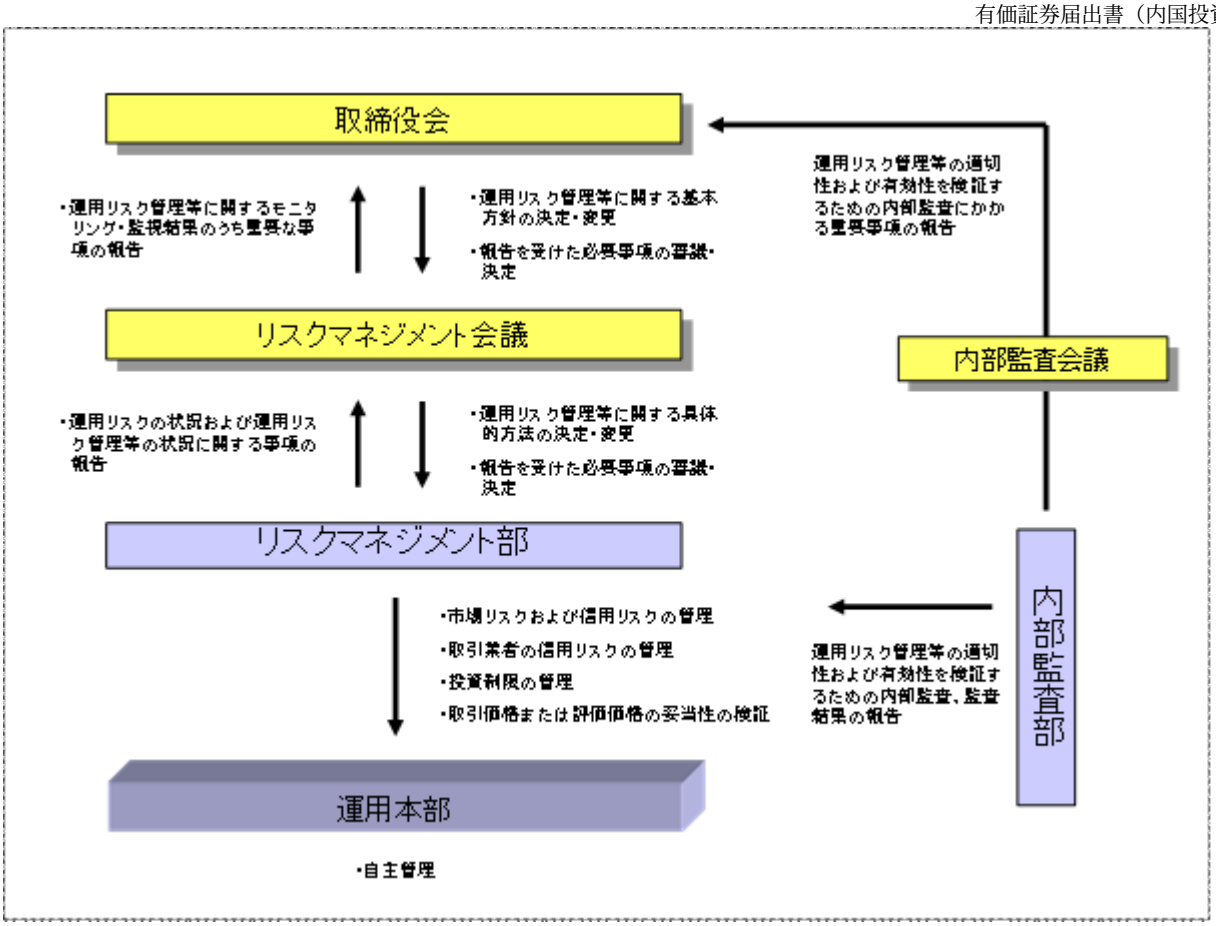
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドは、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。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが合成ベンチマークと完全に一致するものではありません。

・各資産の価格変動により、各資産の組入比率が標準組入比率と一致するとは限らないこと
・各資産の騰落率が各資産ごとのベンチマークの騰落率と一致するものではないこと
・信託報酬、売買委託手数料等の費用負担

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。

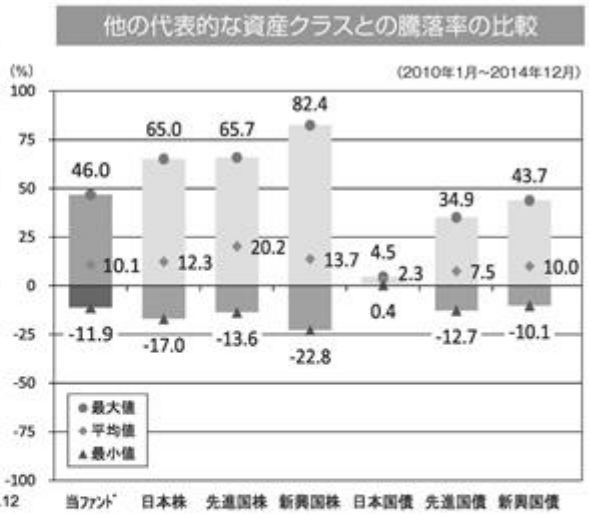


※ 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、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たものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて
日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について
●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有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。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。
Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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0.972%（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0.35% （税抜）	年率0.47% （税抜）	年率0.08% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(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、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成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、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。ＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしく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、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。

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26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26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	648,300,138	99.71
内 日本	648,300,138	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,870,800	0.29
純資産総額	650,170,938	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26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	470,437,503	0.8300 390,477,661	0.8227 387,028,933	59.53
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	97,206,213	1.3249 128,792,014	1.3378 130,042,471	20.00
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	48,551,304	2.0065 97,422,412	2.0305 98,583,422	15.16
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	11,072,964	2.9332 32,479,770	2.9482 32,645,312	5.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(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
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
第13計算期間末 (平成24年11月30日)	362,100,467	362,100,467	0.7401	0.7401
第14計算期間末 (平成25年12月2日)	537,151,204	537,151,204	1.0806	1.0806
平成25年12月末日	548,484,605	－	1.1108	－
平成26年1月末日	533,605,740	－	1.0605	－
2月末日	536,886,544	－	1.0618	－
3月末日	540,673,589	－	1.0645	－
4月末日	534,230,213	－	1.0449	－
5月末日	545,728,956	－	1.0675	－
6月末日	564,211,943	－	1.1024	－

7月末日	575,424,294	―	1.1188	―
8月末日	577,880,313	―	1.1164	―
9月末日	604,010,351	―	1.1519	―
10月末日	615,568,537	―	1.1555	―
11月末日	642,878,236	―	1.2212	―
第15計算期間末 (平成26年12月1日)	647,563,978	647,563,978	1.2277	1.2277
12月末日	650,170,938	―	1.2251	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第13計算期間	10.1
第14計算期間	46.0
第15計算期間	13.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
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
第13計算期間	68,276,957	43,805,781
第14計算期間	106,367,593	98,573,500
第15計算期間	88,503,723	58,126,096

（参考）マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成26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		126,183,238,990	99.18
	内　日本	126,183,238,990	99.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,037,576,660	0.82
純資産総額		127,220,815,650	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		928,950,000	0.73
	内　日本	928,950,000	0.73

(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26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	845,800	6,494.00 5,492,625,200	7,558.00 6,392,556,400	5.02
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,850,500	628.45 3,048,326,670	664.50 3,223,157,250	2.53
3	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	320,400	8,686.17 2,783,049,790	7,210.00 2,310,084,000	1.82
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	456,400	4,463.00 2,036,913,200	4,375.00 1,996,750,000	1.57
5	本田技研	日本	株式	輸送用機器	550,700	3,756.00 2,068,429,200	3,526.00 1,941,768,200	1.53
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,331,000	200.44 1,669,929,388	202.50 1,687,027,500	1.33
7	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報･通信業	205,100	6,663.09 1,366,600,444	7,637.00 1,566,348,700	1.23
8	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	236,800	6,836.00 1,618,764,800	6,211.00 1,470,764,800	1.16
9	キヤノン	日本	株式	電気機器	354,900	3,591.00 1,274,445,900	3,840.50 1,362,993,450	1.07
10	日 立	日本	株式	電気機器	1,470,000	830.90 1,221,423,000	900.70 1,324,029,000	1.04
11	ファナック	日本	株式	電気機器	63,800	19,320.00 1,232,616,000	19,945.00 1,272,491,000	1.00
12	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	378,000	3,614.50 1,366,281,000	3,328.00 1,257,984,000	0.99
13	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	730,800	1,600.50 1,169,645,400	1,686.50 1,232,494,200	0.97
14	武田薬品	日本	株式	医薬品	239,600	4,893.50 1,172,482,600	4,996.50 1,197,161,400	0.94
15	三菱地所	日本	株式	不動産業	450,000	2,387.52 1,074,388,160	2,555.50 1,149,975,000	0.90
16	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	252,200	4,115.00 1,037,803,000	4,358.50 1,099,213,700	0.86
17	パナソニック	日本	株式	電気機器	747,200	1,317.39 984,358,351	1,427.00 1,066,254,400	0.84

18	三井不動産	日本	株式	不動産業	320,000	3,350.50 1,072,160,000	3,255.00 1,041,600,000	0.82
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	461,300	2,312.50 1,066,756,250	2,217.00 1,022,702,100	0.80
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	111,700	8,109.00 905,775,300	9,123.00 1,019,039,100	0.80
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	54,800	14,535.00 796,518,000	18,140.00 994,072,000	0.78
22	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	248,400	3,370.27 837,177,219	3,933.50 977,081,400	0.77
23	ソニー	日本	株式	電気機器	394,800	1,937.64 764,980,552	2,472.50 976,143,000	0.77
24	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	859,200	1,076.50 924,928,800	1,057.00 908,174,400	0.71
25	信越化学	日本	株式	化学	115,000	7,150.00 822,250,000	7,866.00 904,590,000	0.71
26	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	208,900	3,371.00 704,201,900	4,300.00 898,270,000	0.71
27	三菱電機	日本	株式	電気機器	612,000	1,430.50 875,466,000	1,446.00 884,952,000	0.70
28	ＮＴＴドコモ	日本	株式	情報･通信業	497,600	1,909.50 950,167,200	1,768.00 879,756,800	0.69
29	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品先物取引業	1,235,900	689.00 851,535,100	690.20 853,018,180	0.67
30	デンソー	日本	株式	輸送用機器	150,900	4,879.00 736,241,100	5,652.00 852,886,800	0.67

(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	99.18%
合計	99.18%

(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	0.09%
鉱業	0.44%

建設業	2.70%
食料品	3.92%
繊維製品	0.79%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.00%
医薬品	4.43%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.94%
鉄鋼	1.57%
非鉄金属	0.97%
金属製品	0.65%
機械	5.26%
電気機器	12.96%
輸送用機器	11.88%
精密機器	1.45%
その他製品	1.37%
電気・ガス業	2.07%
陸運業	4.01%
海運業	0.33%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	6.66%
卸売業	4.08%
小売業	4.11%
銀行業	8.97%
証券、商品先物取引業	1.41%
保険業	2.42%
その他金融業	1.23%
不動産業	3.04%
サービス業	2.94%
合計	99.18%

(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 2015年3月	買建	66	917,027,467	928,950,000	0.73%

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成26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		41,845,603,220	73.93
	内 日本	41,845,603,220	73.93
地方債証券		4,572,996,692	8.08
	内 日本	4,572,996,692	8.08
特殊債券		4,835,504,828	8.54
	内 日本	4,835,504,828	8.54
社債券		4,986,822,212	8.81
	内 日本	4,986,822,212	8.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		364,061,714	0.64
純資産総額		56,604,988,666	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26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	117 5年国債	日本	国債証券	640,000,000	100.57 643,692,100	100.84 645,376,000	0.200000 2019/03/20	1.14
2	332 10年国債	日本	国債証券	565,000,000	102.10 576,876,300	103.15 582,825,750	0.600000 2023/12/20	1.03
3	116 5年国債	日本	国債証券	570,000,000	100.60 573,448,500	100.81 574,617,000	0.200000 2018/12/20	1.02
4	334 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	101.88 560,367,500	102.94 566,203,000	0.600000 2024/06/20	1.00
5	335 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.75 554,136,000	101.88 560,367,500	0.500000 2024/09/20	0.99
6	113 5年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.95 555,258,000	101.07 555,885,000	0.300000 2018/06/20	0.98
7	312 10年国債	日本	国債証券	495,000,000	106.45 526,932,450	106.95 529,417,350	1.200000 2020/12/20	0.94
8	119 5年国債	日本	国債証券	500,000,000	100.09 500,450,000	100.40 502,000,000	0.100000 2019/06/20	0.89
9	333 10年国債	日本	国債証券	461,000,000	101.97 470,100,140	103.05 475,078,940	0.600000 2024/03/20	0.84
10	115 5年国債	日本	国債証券	425,000,000	100.60 427,575,500	100.77 428,306,500	0.200000 2018/09/20	0.76
11	318 10年国債	日本	国債証券	380,000,000	105.57 401,192,600	106.20 403,579,000	1.000000 2021/09/20	0.71
12	346 2年国債	日本	国債証券	400,000,000	100.18 400,740,000	100.25 401,000,000	0.100000 2016/11/15	0.71
13	106 5年国債	日本	国債証券	370,000,000	100.53 371,964,700	100.59 372,201,500	0.200000 2017/09/20	0.66
14	305 10年国債	日本	国債証券	350,000,000	106.05 371,182,000	106.30 372,074,500	1.300000 2019/12/20	0.66
15	120 5年国債	日本	国債証券	350,000,000	100.53 351,872,300	100.84 352,957,500	0.200000 2019/09/20	0.62
16	314 10年国債	日本	国債証券	315,000,000	105.98 333,862,200	106.55 335,648,250	1.100000 2021/03/20	0.59
17	140 20年国債	日本	国債証券	280,000,000	110.74 310,080,400	113.25 317,111,200	1.700000 2032/09/20	0.56
18	329 10年国債	日本	国債証券	300,000,000	104.03 312,105,000	104.94 314,829,000	0.800000 2023/06/20	0.56
19	145 20年国債	日本	国債証券	278,000,000	110.17 306,286,500	112.65 313,192,020	1.700000 2033/06/20	0.55
20	300 10年国債	日本	国債証券	286,000,000	106.16 303,634,760	106.30 304,018,000	1.500000 2019/03/20	0.54

21	95 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.76 302,307,000	100.75 302,268,000	0.600000 2016/03/20	0.53
22	107 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.56 301,689,000	100.65 301,950,000	0.200000 2017/12/20	0.53
23	105 5年国債	日本	国債証券	300,000,000	100.48 301,449,000	100.55 301,656,000	0.200000 2017/06/20	0.53
24	150 20年国債	日本	国債証券	277,000,000	103.74 287,368,510	106.23 294,268,180	1.400000 2034/09/20	0.52
25	149 20年国債	日本	国債証券	270,000,000	105.75 285,535,800	108.31 292,458,600	1.500000 2034/06/20	0.52
26	343 2年国債	日本	国債証券	290,000,000	100.16 290,466,900	100.21 290,626,400	0.100000 2016/08/15	0.51
27	147 20年国債	日本	国債証券	255,000,000	107.95 275,292,900	110.52 281,846,400	1.600000 2033/12/20	0.50
28	146 20年国債	日本	国債証券	250,000,000	109.94 274,862,500	112.53 281,342,500	1.700000 2033/09/20	0.50
29	313 10年国債	日本	国債証券	260,000,000	107.23 278,813,600	107.79 280,259,200	1.300000 2021/03/20	0.50
30	306 10年国債	日本	国債証券	255,000,000	106.87 272,526,150	107.16 273,278,400	1.400000 2020/03/20	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	73.93%
地方債証券	8.08%
特殊債券	8.54%
社債券	8.81%
合計	99.36%

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

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。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成26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		79,887,619,837	96.33
	内 香港	1,011,348,931	1.22
	内 シンガポール	501,063,859	0.60
	内 イスラエル	200,839,122	0.24
	内 ノルウェー	222,463,302	0.27
	内 スウェーデン	1,043,357,989	1.26
	内 デンマーク	511,353,016	0.62
	内 イギリス	6,963,960,791	8.40
	内 アイルランド	109,346,478	0.13
	内 オランダ	917,973,204	1.11
	内 ベルギー	439,446,358	0.53
	内 フランス	3,170,680,058	3.82
	内 ドイツ	3,107,843,002	3.75
	内 スイス	3,142,869,287	3.79
	内 ポルトガル	48,940,462	0.06
	内 スペイン	1,181,019,348	1.42
	内 イタリア	770,427,280	0.93
	内 フィンランド	321,317,855	0.39
	内 オーストリア	71,447,080	0.09
	内 カナダ	3,531,181,846	4.26
	内 アメリカ	50,260,080,307	60.61
	内 オーストラリア	2,319,861,709	2.80
	内 ニュージーランド	40,798,553	0.05
投資証券		1,819,360,000	2.19
	内 香港	38,061,345	0.05
	内 シンガポール	25,264,957	0.03
	内 イギリス	116,327,246	0.14
	内 オランダ	11,940,994	0.01
	内 フランス	116,142,181	0.14

	内 アメリカ	1,320,341,345	1.59
	内 オーストラリア	191,281,932	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,221,278,371	1.47
純資産総額		82,928,258,208	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,194,355,153	1.44
	内 アメリカ	1,194,355,153	1.44

(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26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	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	130,300	14,337.01 1,868,112,598	13,731.85 1,789,260,120	2.16
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	92,655	10,914.59 1,011,291,985	11,219.58 1,039,550,972	1.25
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	171,000	5,763.49 985,557,731	5,720.09 978,136,673	1.18
4	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	61,500	13,049.53 802,546,556	12,697.53 780,898,187	0.94
5	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	107,972	6,567.56 709,113,020	6,715.84 725,122,730	0.87
6	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	217,900	3,193.36 695,835,214	3,098.13 675,083,617	0.81
7	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	59,237	10,901.33 645,762,470	11,167.75 661,544,125	0.80
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	71,650	8,836.59 633,141,674	8,921.85 639,250,553	0.77

9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	81,720	7,252.28 592,656,975	7,589.82 620,240,744	0.75
10	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	51,300	11,388.30 584,219,790	11,321.31 580,783,203	0.70
11	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	41,118	13,124.27 539,644,083	13,660.72 561,701,732	0.68
12	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	138,463	3,755.13 519,946,911	3,784.06 523,952,923	0.63
13	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	15,750	35,248.92 555,170,490	32,886.00 517,954,500	0.62
14	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	90,254	6,098.62 550,425,256	5,732.15 517,349,692	0.62
15	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	230,201	2,054.17 472,872,449	2,183.16 502,565,730	0.61
16	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	425,300	1,191.38 506,694,382	1,159.39 493,092,382	0.59
17	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,200	4,490.48 481,380,260	4,482.04 480,475,653	0.58
18	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	112,195	4,265.05 478,518,295	4,111.96 461,341,408	0.56
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	24,900	17,924.57 446,322,030	18,329.62 456,407,725	0.55
20	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	86,400	5,404.25 466,927,762	5,166.77 446,409,187	0.54
21	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	66,123	6,506.08 430,201,759	6,597.70 436,259,816	0.53
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,421	7,281.22 454,501,034	6,959.35 434,409,680	0.52
23	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	77,283	5,112.52 395,111,308	5,498.28 424,923,998	0.51
24	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	43,100	9,366.73 403,706,279	9,646.41 415,760,314	0.50
25	WALT DISNEY CO	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	35,600	11,152.08 397,014,066	11,512.52 409,845,890	0.49
26	GOOGLE INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	6,300	65,317.60 411,500,921	63,931.28 402,767,073	0.49

27	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,200	66,191.59 410,387,883	64,772.72 401,590,867	0.48
28	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	20,600	19,549.59 402,721,626	19,349.48 398,599,298	0.48
29	GILEAD SCIENCES INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,000	12,093.57 399,088,008	11,729.51 387,073,995	0.47
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	32,800	12,067.05 395,799,404	11,660.80 382,474,289	0.46

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	96.33%
投資証券	2.19%
合計	98.53%

(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	8.39%
素材	5.05%
資本財・サービス	10.08%
一般消費財・サービス	11.21%
生活必需品	10.06%
ヘルスケア	13.03%
金融	18.49%
情報技術	13.36%
電気通信サービス	3.11%
公益事業	3.47%
その他	0.09%
合計	96.33%

(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 2015年3月	買建	19	1,139,740,517	1,194,355,153	1.44%

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成26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		168,520,564,587	98.09
	内 ユーロ	72,057,941,400	41.94
	内 シンガポール	644,898,666	0.38
	内 マレーシア	850,426,837	0.49
	内 ノルウェー	471,492,142	0.27
	内 スウェーデン	834,772,879	0.49
	内 デンマーク	1,264,801,485	0.74
	内 イギリス	14,256,353,017	8.30
	内 スイス	482,129,023	0.28
	内 ポーランド	1,065,745,287	0.62
	内 カナダ	3,859,882,784	2.25
	内 アメリカ	67,302,198,002	39.17
	内 メキシコ	1,704,306,473	0.99
	内 南アフリカ	894,250,554	0.52
	内 オーストラリア	2,831,366,038	1.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,288,952,897	1.91
純資産総額		171,809,517,484	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）		1,038,251,849	0.60
	内 日本	1,038,251,849	0.60

(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26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	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,694,000	101.85 821,963,118	101.50 819,066,125	2.375000 2024/08/15	0.48
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,275,000	105.33 796,807,924	104.87 793,328,248	2.750000 2024/02/15	0.46
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,377,000	118.77 761,803,821	119.25 764,876,154	3.250000 2021/10/25	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,410,000	99.51 769,008,690	98.91 764,333,701	0.625000 2017/08/31	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,630,000	110.52 750,115,732	109.36 742,270,001	3.625000 2020/02/15	0.43
6	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	4,052,000	114.10 677,503,071	113.61 674,617,300	4.250000 2019/02/01	0.39
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,660,000	99.27 677,379,877	98.74 673,756,794	0.500000 2017/07/31	0.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,412,000	103.09 672,595,845	102.65 669,744,784	2.500000 2024/05/15	0.39
9	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,118,000	142.22 649,824,417	143.93 657,669,591	6.000000 2031/05/01	0.38
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,590,000	117.15 616,322,123	117.37 617,468,974	3.500000 2020/04/25	0.36
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	164.05 602,705,683	166.65 612,261,127	5.750000 2032/10/25	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,058,000	100.19 610,906,507	99.96 609,522,392	0.375000 2016/03/31	0.35
13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,222,000	100.69 606,768,673	100.91 608,094,417	1.250000 2018/07/22	0.35

14	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	3,598,000	115.25 607,693,592	114.81 605,368,416	4.250000 2019/09/01	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,774,000	105.42 606,703,863	104.90 603,740,009	2.750000 2023/11/15	0.35
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,123,000	129.94 594,663,159	130.99 599,468,425	4.250000 2023/10/25	0.35
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	153.20 588,896,205	155.28 596,868,130	5.500000 2029/04/25	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,635,000	106.10 592,860,891	105.44 589,150,796	3.250000 2017/03/31	0.34
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,146,000	124.84 575,530,926	126.39 582,699,707	3.500000 2026/04/25	0.34
20	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,722,000	143.73 573,344,836	144.87 577,876,134	6.500000 2027/11/01	0.34
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	121.14 573,408,602	121.40 574,639,245	3.750000 2021/04/25	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,509,000	105.08 571,199,973	104.10 565,851,343	2.625000 2020/11/15	0.33
23	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,922,000	102.15 558,251,445	102.41 559,672,350	1.750000 2019/07/22	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,468,000	103.46 557,253,562	102.86 554,059,560	2.500000 2023/08/15	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,685,000	97.62 551,363,302	97.03 548,053,710	1.750000 2023/05/15	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,502,000	101.10 548,713,112	100.67 546,357,725	1.000000 2016/08/31	0.32
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,365,000	153.00 530,278,854	156.69 543,067,180	4.500000 2041/04/25	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,076,000	110.97 545,293,671	109.84 539,726,541	3.625000 2021/02/15	0.31
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,522,000	104.55 539,602,222	104.33 538,477,094	3.250000 2016/04/25	0.31
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,075,000	117.90 531,278,791	117.91 531,341,877	4.250000 2019/04/25	0.31

(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	98.09%

合計	98.09%

(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	英ポンド買/円売 2015年1月	買建	810,000	149,713,813	151,470,000	0.09%
		米ドル買/円売 2015年1月	買建	2,865,000	337,619,078	345,318,450	0.20%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2015年1月	買建	255,000	4,286,550	4,120,800	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2015年1月	買建	280,000	9,886,800	9,550,800	0.01%
		豪ドル買/円売 2015年1月	買建	252,000	25,252,920	24,696,000	0.01%
		ユーロ買/円売 2015年1月	買建	2,642,000	387,601,634	387,132,260	0.23%
		シンガポール・ドル買/円売 2015年1月	買建	64,000	5,806,720	5,831,040	0.00%
		スイス・フラン買/円売 2015年1月	買建	42,000	5,159,280	5,115,600	0.00%
		メキシコ・ペソ買/円売 2015年1月	買建	2,037,000	17,334,869	16,621,919	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2015年1月	買建	564,000	11,201,040	11,099,520	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2015年1月	買建	784,000	8,333,920	8,122,240	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2015年1月	買建	482,000	7,663,800	7,427,620	0.00%

		カナダ・ドル買/円売 2015年1月	買建	596,000	60,930,445	61,745,600	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) 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。

（参考情報）運用実績

2014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	12,251円
純資産総額	6.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	6.4%
6カ月間	11.1%
1年間	10.3%
3年間	81.0%
5年間	59.1%
設定来	22.5%

※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。
※「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	第13期 12年11月	第14期 13年12月	第15期 14年12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

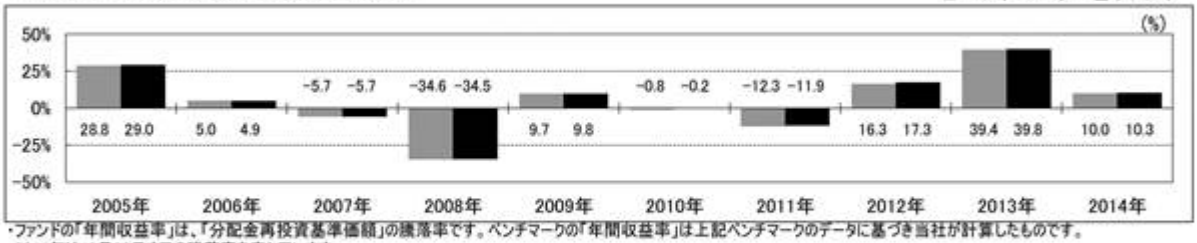
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
国内株式・先物	1,304	59.5%	日本円	79.8%	直接利回り(%)	1.5	トヨタ自動車	日本	3.0%
国内債券	402	19.9%	米ドル	11.6%	最終利回り(%)	0.5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.5%
外国株式・先物	1,203	14.8%	ユーロ	4.0%	修正デュレーション	7.8	ソフトバンク	日本	1.1%
外国債券	715	4.9%	英ポンド	1.7%	残存年数	9.0	三井住友フィナンシャルG	日本	0.9%
外国リート	53	0.3%	カナダ・ドル	0.8%	債券格付別構成	比率	本田技研	日本	0.9%
			スイス・フラン	0.6%	AAA	13.5%	みずほフィナンシャルG	日本	0.8%
			豪ドル	0.5%	AA	74.1%	KDDI	日本	0.7%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	A	5.6%	日本電信電話	日本	0.7%
			香港ドル	0.2%	BBB	3.4%	キヤノン	日本	0.6%
コール・ローン、その他		1.2%	その他	0.5%	BB以下・無格付	3.4%	日 立	日本	0.6%
合計	3,677	－	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		10.9%

※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3.4%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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2014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。）を法令および一般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

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、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。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
   ・委託会社のホームページ
   アドレス　http://www.daiwa-am.co.jp/
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

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15期計算期間（平成25年12月3日から平成26年12月1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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成25年12月2日現在	第15期 平成26年12月1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,149,482	6,251,240
親投資信託受益証券	535,579,649	645,716,846
未収入金	108,000	―
流動資産合計	539,837,131	651,968,086
資産合計	539,837,131	651,968,086
負債の部		
流動負債		
未払解約金	296,516	1,544,083
未払受託者報酬	210,607	252,084
未払委託者報酬	2,159,149	2,584,397
その他未払費用	19,655	23,544
流動負債合計	2,685,927	4,404,108
負債合計	2,685,927	4,404,108
純資産の部		
元本等		
元本	※1 497,071,481	※1 527,449,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,079,723	120,114,870
（分配準備積立金）	107,369,543	171,763,335
元本等合計	537,151,204	647,563,978
純資産合計	537,151,204	647,563,978
負債純資産合計	539,837,131	651,968,086

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自 平成24年12月1日 至 平成25年12月2日	第15期 自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1日
営業収益		
受取利息	1,925	1,716
有価証券売買等損益	173,027,792	82,741,197
営業収益合計	173,029,717	82,742,913
営業費用		
受託者報酬	394,941	478,882
委託者報酬	4,049,099	4,909,511
その他費用	36,853	45,118
営業費用合計	4,480,893	5,433,511
営業利益	168,548,824	77,309,402
経常利益	168,548,824	77,309,402
当期純利益	168,548,824	77,309,402
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	22,163,383	1,408,636
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 127,176,921	40,079,723
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,774,915	8,834,396
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,774,915	―
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	―	8,834,396
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,903,712	4,700,015
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	―	4,700,015
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,903,712	―
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,079,723	120,114,870

(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15期 自　平成25年12月3日 至　平成26年12月1日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成25年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を平成25年12月2日としており、平成26年11月30日が休日のため、当計算期間末日を平成26年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第14期 平成25年12月2日現在	第15期 平成26年12月1日現在
1．※1　期首元本額	489,277,388円	497,071,481円
期中追加設定元本額	106,367,593円	88,503,723円
期中一部解約元本額	98,573,500円	58,126,096円
2．計算期間末日における受益権の総数	497,071,481口	527,449,108口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第14期 自　平成24年12月1日 至　平成25年12月2日	第15期 自　平成25年12月3日 至　平成26年12月1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（1,807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（86,226,813円）、投資信託約款に規定される収益調整金（104,664,938円）及び分配準備積立金（21,140,923円）より分配対象額は212,034,481円（1万口当たり4,265.67円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,716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（75,899,050円）、投資信託約款に規定される収益調整金（129,129,806円）及び分配準備積立金（95,862,569円）より分配対象額は300,893,141円（1万口当たり5,704.69円）であり、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15期 自　平成25年12月3日 至　平成26年12月1日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 なお、当ファンドは、親投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。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第15期 平成26年12月1日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第14期 平成25年12月2日現在	第15期 平成26年12月1日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	151,991,088	80,713,398
合計	151,991,088	80,713,398

（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14期 平成25年12月2日現在	第15期 平成26年12月1日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自　平成25年12月3日 至　平成26年12月1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。

（1口当たり情報）

	第14期 平成25年12月2日現在	第15期 平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額	1.0806円	1.2277円

（1万口当たり純資産額）	(10,806円)	(12,277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	468,369,062	388,793,158	
	日本債券インデックスマザーファンド	95,596,151	126,645,780	
	外国株式インデックスマザーファンド	48,770,173	97,876,860	
	外国債券インデックスマザーファンド	11,046,314	32,401,048	
親投資信託受益証券　合計			645,716,846	
合計			645,716,846	

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
	金　額（円）	金　額（円）

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,363,938,210	7,759,929,209
株式 ※3※4	123,025,728,030	128,429,278,710
派生商品評価勘定	25,111,446	72,039,299
未収入金	6,037,874	12,441,011
未収配当金	409,456,467	471,202,375
その他未収収益 ※5	―	11,002,355
流動資産合計	124,830,272,027	136,755,892,959
資産合計	124,830,272,027	136,755,892,959
負債の部		
流動負債		
前受金	34,160,000	61,605,000
未払金	―	309,731,152
未払解約金	233,274,000	170,291,500
未払利息	―	139,310
受入担保金	―	6,369,936,457
その他未払費用	―	49,744
流動負債合計	267,434,000	6,911,753,163
負債合計	267,434,000	6,911,753,163
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	172,799,217,116	156,429,196,684
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△48,236,379,089	△26,585,056,888
元本等合計	124,562,838,027	129,844,139,796
純資産合計	124,562,838,027	129,844,139,796
負債純資産合計	124,830,272,027	136,755,892,959

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25年12月3日 至　平成26年12月1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、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)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
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。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1．※1　期首	平成24年12月1日	平成25年12月3日
期首元本額	202,871,820,683円	172,799,217,116円
期中追加設定元本額	11,731,736,996円	13,085,758,738円
期中一部解約元本額	41,804,340,563円	29,455,779,170円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信１号	1,686,119,625円	1,649,409,274円
トピックス・インデックスファンド	7,975,314,119円	6,873,376,545円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	24,067,136,706円	20,854,254,321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	505,467,423円	281,828,838円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	287,060,542円	257,375,152円

ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	5,197,129,500円	4,407,636,350円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	245,653,219円	204,772,382円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	7,223,655,008円	6,079,456,236円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	－円	26,531,872円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	62,825,615,407円	61,223,159,280円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,057,211,137円	1,980,050,202円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,852,566,774円	2,046,507,975円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,548,202,543円	1,750,405,350円
年金ダイワ日本株式インデックス	2,499,769,782円	2,989,882,103円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	18,636,736円	22,554,312円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	31,761,839円	40,879,759円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	5,984,792円	7,231,848円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	319,467,877円	24,797,025円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	2,388,142,279円	80,684,863円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	1,314,872,463円	47,683,722円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	80,802,324円	71,973,936円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	561,017,283円	421,849,875円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	250,357,926円	222,221,290円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	2,697,967,975円	2,252,789,966円

	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	418,181,168円	329,991,054円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	23,204,449,945円	20,413,387,713円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	1,117,607,513円	631,978,000円
	ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	2,544,232,912円	1,382,469,239円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,911,577,263円	1,599,512,026円
	ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	354,884,564円	315,436,365円
	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	432,432,404円	374,256,369円
	ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,409,162円	395,865,319円
	ダイワライフスタイル２５	177,349,520円	183,009,725円
	ダイワライフスタイル５０	556,358,199円	607,535,054円
	ダイワライフスタイル７５	444,915,034円	468,369,062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）	15,995,906,153円	15,910,074,282円
計		172,799,217,116円	156,429,196,684円
2.	期末日における受益権の総数	172,799,217,116口	156,429,196,684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48,236,379,089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26,585,056,888円であります。
4. ※3	貸付有価証券	――――――	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　6,226,031,650円

5．※4　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　1,033,600,000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　742,900,000円
6．※5　その他未収収益	――――――	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分10,071,900円が含まれております。

（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25年12月3日 至　平成26年12月1日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、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。
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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成26年12月1日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	平成25年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成26年12月1日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	4,252,782,618	8,243,384,272
合計	4,252,782,618	8,243,384,272

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年9月20日から平成25年12月2日まで、及び平成26年9月20日から平成26年12月1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25年12月2日 現在				平成26年12月1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	1,424,185,000	－	1,449,575,000	25,390,000	1,137,140,000	－	1,209,550,000	72,410,000
合計	1,424,185,000	－	1,449,575,000	25,390,000	1,137,140,000	－	1,209,550,000	72,410,000

（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。
原則として期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、期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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7209円 (7,209円)	0.8301円 (8,301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	42,000	272.00	11,424,000	
日本水産	89,900	412.00	37,038,800	
マルハニチロ	16,200	1,695.00	27,459,000	
サカタのタネ	11,000	1,749.00	19,239,000	
ホクト	8,700	1,989.00	17,304,300	
ショーボンドＨＤ	6,200	4,415.00	27,373,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ミライト・ホールディングス	22,000	1,338.00	29,436,000	
日鉄鉱業	24,000	436.00	10,464,000	
三井松島	66,000	128.00	8,448,000	
国際石油開発帝石	364,200	1,219.00	443,959,800	
日本海洋掘削	2,400	3,830.00	9,192,000	貸付株式数 500株 (500株)
石油資源開発	9,900	3,625.00	35,887,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,000	1,428.00	8,568,000	
安藤・間	47,300	711.00	33,630,300	
東急建設	26,400	541.00	14,282,400	
コムシスホールディングス	31,600	1,755.00	55,458,000	
ミサワホーム	9,500	1,077.00	10,231,500	
高松コンストラクションＧＰ	5,800	2,277.00	13,206,600	
東建コーポレーション	2,900	5,060.00	14,674,000	
大成建設	351,000	619.00	217,269,000	

大　林　組	209,000	740.00	154,660,000		
清水建設	213,000	808.00	172,104,000	貸付株式数	61,000株 (61,000株)
飛島建設	48,400	297.00	14,374,800	貸付株式数	14,300株 (14,300株)
長谷工コーポレーシヨン	86,600	1,014.00	87,812,400		
松井建設	12,000	547.00	6,564,000		
鹿島建設	307,000	469.00	143,983,000		
不動テトラ	55,600	247.00	13,733,200		
鉄建建設	44,000	478.00	21,032,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
日鉄住金テックスエンジ	16,000	515.00	8,240,000		
西松建設	77,000	497.00	38,269,000		
三井住友建設	285,300	130.00	37,089,000		
大豊建設	21,000	486.00	10,206,000	貸付株式数	6,000株
前田建設	47,000	869.00	40,843,000	貸付株式数	13,000株 (4,000株)
奥　村　組	67,000	542.00	36,314,000		
東鉄工業	8,800	2,548.00	22,422,400		
戸田建設	88,000	491.00	43,208,000	貸付株式数	24,000株 (24,000株)
熊　谷　組	89,000	373.00	33,197,000	貸付株式数	22,000株
北野建設	21,000	387.00	8,127,000		
三井ホーム	17,000	480.00	8,160,000		
矢作建設	10,700	935.00	10,004,500		
東日本ハウス	14,400	472.00	6,796,800		
大東建託	26,100	13,600.00	354,960,000		
ＮＩＰＰＯ	16,000	1,836.00	29,376,000		
東亜道路	17,000	458.00	7,786,000		
前田道路	22,000	1,671.00	36,762,000		
日本道路	23,000	583.00	13,409,000		
東亜建設	59,000	196.00	11,564,000		
若築建設	44,000	207.00	9,108,000		
東洋建設	21,000	483.00	10,143,000		
五洋建設	79,500	374.00	29,733,000	貸付株式数	23,100株 (23,100株)
大林道路	9,000	769.00	6,921,000		
世紀東急	12,300	600.00	7,380,000		
福　田　組	11,000	1,008.00	11,088,000		
住友林業	51,300	1,186.00	60,841,800		

日成ビルド工業	24,000	288.00	6,912,000	貸付株式数	6,000株 (6,000株)
ヤマダ・エスバイエルホーム	52,000	104.00	5,408,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
巴コーポレーション	15,100	452.00	6,825,200		
パナホーム	27,000	763.00	20,601,000		
大和ハウス	202,600	2,282.50	462,434,500	貸付株式数	57,800株 (57,800株)
ライト工業	11,900	982.00	11,685,800		
積水ハウス	211,300	1,606.00	339,347,800	貸付株式数	50,000株 (50,000株)
日特建設	11,300	517.00	5,842,100		
ユアテック	13,000	666.00	8,658,000		
中電工	10,500	1,731.00	18,175,500		
関　電　工	33,000	623.00	20,559,000	貸付株式数	9,000株 (9,000株)
きんでん	46,000	1,131.00	52,026,000		
トーエネック	14,000	573.00	8,022,000		
住友電設	6,500	1,323.00	8,599,500		
日本電設工業	12,300	1,490.00	18,327,000		
協和エクシオ	29,600	1,353.00	40,048,800		
日本工営	25,000	435.00	10,875,000		
九電工	14,000	1,308.00	18,312,000		
三機工業	17,000	734.00	12,478,000		
日　揮	69,000	2,555.00	176,295,000		
中外炉工業	32,000	217.00	6,944,000		
太平電業	11,000	927.00	10,197,000		
高砂熱学	20,200	1,520.00	30,704,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	8,000	2,262.00	18,096,000		
明星工業	14,000	770.00	10,780,000		
大　氣　社	10,300	2,487.00	25,616,100		
ダイダン	14,000	675.00	9,450,000		
日比谷総合設備	9,800	1,604.00	15,719,200		
東芝プラントシステム	11,000	1,816.00	19,976,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
日本製粉	44,000	533.00	23,452,000		
日清製粉Ｇ本社	76,800	1,180.00	90,624,000		
昭和産業	33,000	473.00	15,609,000		
フィード・ワンＨＬＤＧＳ	76,400	110.00	8,404,000		
日本甜菜糖	55,000	203.00	11,165,000		

三井製糖	31,000	423.00	13,113,000	
ネクスト	9,600	841.00	8,073,600	
日本M&Aセンター	10,400	3,640.00	37,856,000	
アコーディア・ゴルフ	25,700	1,063.00	27,319,100	
タケエイ	8,400	983.00	8,257,200	
ＧＣＡサヴィアン	6,500	1,153.00	7,494,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
エス・エム・エス	4,000	2,638.00	10,552,000	
テンプホールディングス	12,900	3,625.00	46,762,500	
クックパッド	3,500	3,810.00	13,335,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
森永製菓	72,000	277.00	19,944,000	
中　村　屋	27,000	445.00	12,015,000	
江崎グリコ	16,000	4,400.00	70,400,000	
不　二　家	48,000	207.00	9,936,000	
山崎製パン	50,000	1,536.00	76,800,000	
モロゾフ	24,000	361.00	8,664,000	
亀田製菓	4,200	3,660.00	15,372,000	
寿スピリッツ	2,700	2,161.00	5,834,700	
カルビー	25,600	4,260.00	109,056,000	
森永乳業	65,000	393.00	25,545,000	
ヤクルト	36,900	6,440.00	237,636,000	貸付株式数 10,500株 (10,500株)
明治ホールディングス	20,600	10,980.00	226,188,000	貸付株式数 5,800株 (5,800株)
雪印メグミルク	16,300	1,457.00	23,749,100	
プリマハム	45,000	261.00	11,745,000	
日本ハム	51,000	2,393.00	122,043,000	
伊藤ハム	39,000	614.00	23,946,000	
丸大食品	40,000	428.00	17,120,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,000	2,293.00	11,465,000	
スタジオアリス	4,800	1,603.00	7,694,400	貸付株式数 1,300株
シミックホールディングス	3,600	1,741.00	6,267,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	10,400	846.00	8,798,400	
新日鉄住金ＳＯＬ	5,700	3,185.00	18,154,500	
綜合警備保障	21,800	2,427.00	52,908,600	
日本駐車場開発	84,400	122.00	10,296,800	
カカクコム	43,400	1,837.00	79,725,800	
ディップ	1,800	4,330.00	7,794,000	

ＳＢＳホールディングス	5,900	1,083.00	6,389,700		
新日本科学	7,900	874.00	6,904,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ツクイ	9,100	941.00	8,563,100		
エムスリー	56,100	2,083.00	116,856,300		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	6,600	746.00	4,923,600		
ディー・エヌ・エー	32,100	1,458.00	46,801,800	貸付株式数	10,400株
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	89,600	1,159.00	103,846,400		
ぐるなび	8,600	1,822.00	15,669,200	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
一休	6,300	1,480.00	9,324,000	貸付株式数	1,500株
ファンコミュニケーションズ	12,100	1,442.00	17,448,200		
ＰＧＭホールディングス	11,300	1,121.00	12,667,300		
サッポロホールディングス	118,000	546.00	64,428,000		
アサヒグループホールディン	138,700	3,739.00	518,599,300		
キリンＨＤ	294,400	1,542.50	454,112,000		
宝ホールディングス	56,200	788.00	44,285,600		
オエノンホールディングス	35,000	231.00	8,085,000		
コカ・コーラウエスト	22,900	1,642.00	37,601,800		
コカ・コーライーストジャパン	21,100	1,900.00	40,090,000		
サントリー食品インター	39,800	4,225.00	168,155,000		
ダイドードリンコ	3,600	4,790.00	17,244,000		
伊　藤　園	18,400	2,223.00	40,903,200	貸付株式数	5,500株 (5,500株)
キーコーヒー	7,100	1,630.00	11,573,000		
日清オイリオグループ	36,000	400.00	14,400,000		
不二製油	18,500	1,679.00	31,061,500		
Ｊ－オイルミルズ	35,000	375.00	13,125,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
ローソン	22,500	7,420.00	166,950,000		
サンエー	4,900	4,000.00	19,600,000		
カワチ薬品	5,600	1,772.00	9,923,200		
エービーシー・マート	8,600	5,890.00	50,654,000	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
アスクル	6,600	2,044.00	13,490,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ゲオホールディングス	13,000	936.00	12,168,000	貸付株式数	3,700株 (3,700株)

アダストリアホールディング	5,600	2,498.00	13,988,800	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
くらコーポレーション	4,000	3,010.00	12,040,000		
キャンドゥ	4,900	1,599.00	7,835,100	貸付株式数	1,200株
パル	3,800	3,305.00	12,559,000		
エディオン	29,200	779.00	22,746,800	貸付株式数	8,800株
あらた	21,000	318.00	6,678,000		
ＪＰホールディングス	21,100	365.00	7,701,500	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,400	3,860.00	5,404,000		
ひらまつ	11,800	642.00	7,575,600		
双日	423,000	169.00	71,487,000		
アルフレッサホールディングス	71,900	1,373.00	98,718,700		
ハニーズ	6,400	1,005.00	6,432,000		
キッコーマン	57,000	2,922.00	166,554,000		
味　の　素	160,000	2,232.50	357,200,000		
キユーピー	34,400	1,955.00	67,252,000	貸付株式数	9,900株 (9,900株)
ハウス食品Ｇ本社	24,800	2,102.00	52,129,600	貸付株式数	7,000株 (7,000株)
カ　ゴ　メ	25,500	1,780.00	45,390,000	貸付株式数	7,500株 (7,500株)
アリアケジャパン	6,700	2,809.00	18,820,300		
ニチレイ	80,000	513.00	41,040,000		
横浜冷凍	18,200	792.00	14,414,400		
東洋水産	35,800	4,095.00	146,601,000		
日清食品ＨＤ	28,700	5,990.00	171,913,000	貸付株式数	8,100株 (8,100株)
永　谷　園	9,000	1,062.00	9,558,000		
フジッコ	8,000	1,811.00	14,488,000		
ロックフィールド	5,700	1,924.00	10,966,800		
日本たばこ産業	382,300	3,798.00	1,451,975,400		
わらべや日洋	5,200	2,019.00	10,498,800		
片倉工業	9,700	1,245.00	12,076,500		
グ　ン　ゼ	58,000	307.00	17,806,000		
ヒューリック	102,500	1,243.00	127,407,500		
アルペン	5,800	1,697.00	9,842,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
クオール	9,400	782.00	7,350,800	貸付株式数	2,200株

アルコニックス	4,700	1,945.00	9,141,500	
神戸物産	1,300	6,750.00	8,775,000	
ジェイアイエヌ	4,500	2,787.00	12,541,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ビックカメラ	27,200	1,055.00	28,696,000	貸付株式数 8,100株
ＤＣＭホールディングス	30,100	759.00	22,845,900	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	12,200	2,813.00	34,318,600	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
あい　ホールディングス	10,500	2,444.00	25,662,000	
Ｊ．　フロント　リテイリング	77,900	1,555.00	121,134,500	
ドトール・日レスＨＤ	11,300	1,646.00	18,599,800	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	13,600	3,330.00	45,288,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
スタートトゥデイ	19,100	2,600.00	49,660,000	
物語コーポレーション	1,800	3,540.00	6,372,000	
ココカラファイン	6,800	2,874.00	19,543,200	
三越伊勢丹ＨＤ	121,700	1,595.00	194,111,500	
東洋紡	273,000	167.00	45,591,000	
ユニチカ	239,000	62.00	14,818,000	
富士紡ホールディングス	36,000	320.00	11,520,000	
日清紡ホールディングス	43,000	1,214.00	52,202,000	
倉敷紡績	83,000	186.00	15,438,000	
ダイワボウＨＤ	67,000	221.00	14,807,000	
シキボウ	69,000	129.00	8,901,000	
日東紡績	52,000	425.00	22,100,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
トヨタ紡織	22,100	1,520.00	33,592,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ウエルシアＨＤ	5,700	3,745.00	21,346,500	
クリエイトＳＤＨ	2,900	3,845.00	11,150,500	
バイタルＫＳＫＨＤ	13,800	874.00	12,061,200	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
ＵＫＣホールディングス	5,000	1,728.00	8,640,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	32,100	544.00	17,462,400	
三洋貿易	6,000	1,302.00	7,812,000	
ジョイフル本田	3,400	4,135.00	14,059,000	
すかいらーく	21,000	1,224.00	25,704,000	
日本毛織	22,000	769.00	16,918,000	

ダイドーリミテツド	15,600	502.00	7,831,200	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
野村不動産ＨＬＤＧＳ	35,900	2,186.00	78,477,400		
プレサンスコーポレーション	2,600	3,755.00	9,763,000		
常和ホールディングス	2,600	3,635.00	9,451,000	貸付株式数	700株 (700株)
オープンハウス	4,200	2,323.00	9,756,600		
東急不動産ＨＤ	161,000	863.00	138,943,000		
飯田ＧＨＤ	38,900	1,353.00	52,631,700		
帝国繊維	7,300	2,671.00	19,498,300		
日本コークス工業	82,900	114.00	9,450,600		
あさひ	5,100	1,186.00	6,048,600	貸付株式数	1,300株
コスモス薬品	3,500	16,370.00	57,295,000	貸付株式数	900株 (900株)
シップヘルスケアＨＤ	11,500	2,795.00	32,142,500		
セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	254,500	4,456.00	1,134,052,000		
クリエイト・レストランツ・ホール	5,200	1,622.00	8,434,400		
ツルハホールディングス	12,000	6,750.00	81,000,000		
サンマルクホールディングス	2,400	6,700.00	16,080,000		
トリドール	6,800	1,390.00	9,452,000	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキ	2,900	6,000.00	17,400,000		
帝　人	271,000	326.00	88,346,000		
東　レ	499,000	933.00	465,567,000	貸付株式数	138,000株 (138,000株)
ク　ラ　レ	109,900	1,472.00	161,772,800		
旭　化　成	403,000	1,038.50	418,515,500	貸付株式数	119,000株 (119,000株)
トーカロ	5,100	1,947.00	9,929,700		
ＳＵＭＣＯ	45,800	1,503.00	68,837,400	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
川田テクノロジーズ	1,500	4,720.00	7,080,000		
住江織物	24,000	300.00	7,200,000		
日本バイリーン	15,000	622.00	9,330,000		
アツギ	90,000	115.00	10,350,000		
セーレン	18,900	965.00	18,238,500		
小松精練	16,800	543.00	9,122,400		
ワコールホールディングス	38,000	1,226.00	46,588,000		
ホギメディカル	4,300	5,730.00	24,639,000		
ＴＳＩホールディングス	30,800	696.00	21,436,800		

ＩＴホールディングス	21,100	1,889.00	39,857,900	
グリー	37,800	795.00	30,051,000	貸付株式数 10,600株 (10,000株)
コーエーテクモＨＤ	14,500	1,751.00	25,389,500	
三菱総合研究所	3,300	2,733.00	9,018,900	
ＫＬａｂ	7,000	1,415.00	9,905,000	貸付株式数 1,900株
ネクソン	57,700	1,138.00	65,662,600	
コロプラ	10,800	3,020.00	32,616,000	貸付株式数 2,900株
ブロードリーフ	6,300	1,638.00	10,319,400	
特種東海製紙	43,000	245.00	10,535,000	
ティーガイア	7,200	1,166.00	8,395,200	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	6,000	2,130.00	12,780,000	
インターネットイニシアティブ	10,500	2,603.00	27,331,500	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
朝日ネット	14,300	506.00	7,235,800	
王子ホールディングス	265,000	420.00	111,300,000	
日本製紙	31,500	1,721.00	54,211,500	
三菱製紙	122,000	87.00	10,614,000	
北越紀州製紙	45,100	492.00	22,189,200	
中越パルプ	38,000	190.00	7,220,000	
大王製紙	29,000	1,064.00	30,856,000	
レンゴー	55,000	486.00	26,730,000	
トーモク	27,000	277.00	7,479,000	
ザ・パック	5,400	2,291.00	12,371,400	
昭和電工	441,000	165.00	72,765,000	
住友化学	476,000	467.00	222,292,000	
住友精化	15,000	812.00	12,180,000	
日産化学	43,900	2,214.00	97,194,600	
クレハ	47,000	568.00	26,696,000	貸付株式数 14,000株
テイカ	15,000	446.00	6,690,000	
石原産業	124,000	106.00	13,144,000	
日本曹達	44,000	617.00	27,148,000	
東ソー	163,000	565.00	92,095,000	
トクヤマ	109,000	264.00	28,776,000	
セントラル硝子	68,000	401.00	27,268,000	
東亜合成	81,000	491.00	39,771,000	
ダイソー	31,000	379.00	11,749,000	
関東電化	19,000	672.00	12,768,000	
電気化学	139,000	406.00	56,434,000	

イビデン	40,700	1,777.00	72,323,900	
信越化学	115,800	8,118.00	940,064,400	
日本カーバイド	27,000	240.00	6,480,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
堺　化　学	31,000	370.00	11,470,000	
エア・ウォーター	56,000	1,932.00	108,192,000	
大陽日酸	82,000	1,397.00	114,554,000	
日本パーカライジング	15,500	2,562.00	39,711,000	
高圧ガス	13,000	573.00	7,449,000	
四国化成	12,000	791.00	9,492,000	
戸田工業	16,000	482.00	7,712,000	貸付株式数 4,000株
ステラ　ケミファ	4,900	1,370.00	6,713,000	
保土谷化学	31,000	197.00	6,107,000	
日本触媒	50,000	1,485.00	74,250,000	
大日精化	30,000	666.00	19,980,000	
カネカ	83,000	630.00	52,290,000	
協和発酵キリン	78,000	1,299.00	101,322,000	
三菱瓦斯化学	110,000	661.00	72,710,000	
三井化学	298,000	340.00	101,320,000	
ＪＳＲ	63,000	2,107.00	132,741,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
東京応化工業	13,600	3,500.00	47,600,000	
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	403,900	626.80	253,164,520	
日本合成化学	17,000	756.00	12,852,000	
ダイセル	91,000	1,376.00	125,216,000	
住友ベークライト	63,000	452.00	28,476,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
積水化学	152,000	1,495.00	227,240,000	
日本ゼオン	55,000	1,154.00	63,470,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
アイカ工業	19,600	2,463.00	48,274,800	
宇部興産	338,000	172.00	58,136,000	
積水樹脂	11,200	1,567.00	17,550,400	
タキロン	17,000	488.00	8,296,000	
旭有機材	31,000	298.00	9,238,000	
日立化成	31,500	2,220.00	69,930,000	
リケンテクノス	12,800	442.00	5,657,600	
大倉工業	21,000	346.00	7,266,000	
積水化成品	25,000	410.00	10,250,000	
群栄化学	21,000	340.00	7,140,000	

日本化薬	43,000	1,462.00	62,866,000	
イーピーエス	9,100	1,181.00	10,747,100	
パナソニック　インフォシス	2,500	3,100.00	7,750,000	
プレステージ・インター	6,900	1,036.00	7,148,400	
アミューズ	2,400	3,385.00	8,124,000	
野村総合研究所	34,400	3,720.00	127,968,000	
ケネディクス	93,600	622.00	58,219,200	
電通	72,000	4,465.00	321,480,000	貸付株式数 18,200株 (18,200株)
インテージホールディングス	5,400	1,760.00	9,504,000	
日本精化	8,200	870.00	7,134,000	
ＡＤＥＫＡ	29,900	1,432.00	42,816,800	
日油	54,000	750.00	40,500,000	
ミヨシ油脂	48,000	140.00	6,720,000	
花　王	177,700	4,440.00	788,988,000	
第一工業製薬	16,000	378.00	6,048,000	貸付株式数 4,000株
三洋化成	22,000	776.00	17,072,000	
武田薬品	241,700	5,015.00	1,212,125,500	
アステラス製薬	737,400	1,713.50	1,263,534,900	
大日本住友製薬	47,000	1,234.00	57,998,000	
塩野義製薬	101,400	3,050.00	309,270,000	
田辺三菱製薬	73,700	1,820.00	134,134,000	
あすか製薬	9,100	1,367.00	12,439,700	
日本新薬	15,000	3,505.00	52,575,000	
中外製薬	64,500	3,265.00	210,592,500	
科研製薬	23,000	2,539.00	58,397,000	
エーザイ	85,200	4,282.00	364,826,400	
ロート製薬	29,800	1,576.00	46,964,800	
小野薬品	29,400	10,190.00	299,586,000	
久光製薬	18,200	3,630.00	66,066,000	
持田製薬	4,900	6,540.00	32,046,000	
参天製薬	23,800	6,740.00	160,412,000	
扶桑薬品	32,000	304.00	9,728,000	
日本ケミファ	13,000	543.00	7,059,000	
ツムラ	20,400	2,682.00	54,712,800	貸付株式数 5,600株
日医工	15,500	1,852.00	28,706,000	
テ　ル　モ	94,900	2,708.00	256,989,200	
みらかホールディングス	16,900	4,580.00	77,402,000	
キッセイ薬品工業	12,500	3,095.00	38,687,500	
生化学工業	13,000	2,144.00	27,872,000	

栄研化学	6,700	1,868.00	12,515,600	
鳥居薬品	5,000	2,982.00	14,910,000	
ＪＣＲファーマ	5,700	2,467.00	14,061,900	
東和薬品	3,600	5,360.00	19,296,000	
沢井製薬	10,200	7,110.00	72,522,000	
ゼリア新薬工業	13,800	1,972.00	27,213,600	
第一三共	216,900	1,780.50	386,190,450	
キョーリン製薬ＨＤ	17,600	2,336.00	41,113,600	
大幸薬品	3,400	2,443.00	8,306,200	
ダイト	3,500	1,952.00	6,832,000	
大塚ホールディングス	127,700	3,785.50	483,408,350	
大正製薬ＨＤ	15,300	7,460.00	114,138,000	
大日本塗料	51,000	162.00	8,262,000	
日本ペイントＨＯＬＤ	56,000	3,200.00	179,200,000	
関西ペイント	78,000	1,983.00	154,674,000	
中国塗料	20,000	998.00	19,960,000	
藤倉化成	13,400	568.00	7,611,200	
太陽ホールディングス	5,600	4,235.00	23,716,000	
ＤＩＣ	259,000	272.00	70,448,000	
サカタインクス	14,100	1,344.00	18,950,400	
東洋インキＳＣホールディン	64,000	579.00	37,056,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	3,000	2,359.00	7,077,000	
オリエンタルランド	17,400	26,190.00	455,706,000	
ダスキン	18,900	1,736.00	32,810,400	
パーク２４	30,900	1,846.00	57,041,400	
明光ネットワークジャパン	8,500	1,217.00	10,344,500	貸付株式数　2,500株
ファルコホールディングス	5,200	1,248.00	6,489,600	
フジ・メディア・ＨＤ	63,600	1,519.00	96,608,400	
ラウンドワン	20,300	699.00	14,189,700	
リゾートトラスト	24,000	2,462.00	59,088,000	貸付株式数　6,800株
オービック	21,200	3,830.00	81,196,000	
ジャストシステム	10,300	816.00	8,404,800	
ヤフー	438,000	437.00	191,406,000	貸付株式数　126,100株
ビー・エム・エル	4,300	3,415.00	14,684,500	
トレンドマイクロ	32,900	3,640.00	119,756,000	
もしもしホットライン	13,600	1,139.00	15,490,400	
日本オラクル	9,700	4,535.00	43,989,500	
フューチャーアーキテクト	10,700	643.00	6,880,100	
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	1,205.00	7,953,000	
ユー・エス・エス	78,100	1,722.00	134,488,200	

オービックビジネスＣ	4,300	3,470.00	14,921,000	
伊藤忠テクノソリュー	7,200	4,560.00	32,832,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
アイティフォー	14,800	423.00	6,260,400	
サイバーエージェント	12,000	4,710.00	56,520,000	
楽天	279,800	1,634.50	457,333,100	
大塚商会	16,400	4,105.00	67,322,000	
総合メディカル	1,900	5,780.00	10,982,000	
セントラルスポーツ	4,700	1,816.00	8,535,200	
電通国際情報Ｓ	5,800	1,230.00	7,134,000	
ウェザーニューズ	2,900	2,835.00	8,221,500	
ＷＯＷＯＷ	1,800	5,120.00	9,216,000	貸付株式数 600株 (600株)
富士フイルムＨＬＤＧＳ	148,200	3,980.50	589,910,100	
コニカミノルタ	148,000	1,420.00	210,160,000	
資　生　堂	114,900	1,764.50	202,741,050	貸付株式数 32,700株
ライオン	75,000	663.00	49,725,000	貸付株式数 21,000株
高砂香料	23,000	556.00	12,788,000	
マンダム	6,900	3,850.00	26,565,000	
ミルボン	4,500	3,580.00	16,110,000	
ファンケル	16,100	1,554.00	25,019,400	
コーセー	10,400	4,300.00	44,720,000	
ドクターシーラボ	4,800	3,600.00	17,280,000	
ポーラ・オルビスＨＤ	7,600	4,495.00	34,162,000	
ノエビアホールディングス	5,500	2,034.00	11,187,000	
エステー	8,700	1,020.00	8,874,000	
コ　ニ　シ	5,800	1,869.00	10,840,200	
長谷川香料	9,100	1,661.00	15,115,100	
小林製薬	10,400	6,990.00	72,696,000	
荒川化学工業	6,800	1,227.00	8,343,600	
メック	6,400	1,113.00	7,123,200	
日本高純度化学	3,500	2,408.00	8,428,000	
ＪＣＵ	2,000	6,200.00	12,400,000	
新田ゼラチン	6,700	806.00	5,400,200	
アース製薬	5,000	4,155.00	20,775,000	貸付株式数 1,400株
イハラケミカル	11,000	1,236.00	13,596,000	貸付株式数 3,000株
大成ラミック	3,500	2,716.00	9,506,000	
クミアイ化学	15,000	687.00	10,305,000	貸付株式数 4,000株
日本農薬	15,500	1,370.00	21,235,000	
昭和シエル石油	58,700	979.00	57,467,300	

コスモ石油	182,000	162.00	29,484,000	
ニチレキ	10,000	831.00	8,310,000	
東燃ゼネラル石油	93,000	1,000.00	93,000,000	
ユシロ化学	5,200	1,498.00	7,789,600	
富士石油	19,400	311.00	6,033,400	
出光興産	29,900	2,000.00	59,800,000	
ＪＸホールディングス	712,200	437.10	311,302,620	
横浜ゴム	74,000	1,119.00	82,806,000	
東洋ゴム	29,600	2,519.00	74,562,400	
ブリヂストン	202,000	4,122.00	832,644,000	貸付株式数 59,800株 (59,800株)
住友ゴム	49,200	1,866.00	91,807,200	
藤倉ゴム	7,100	889.00	6,311,900	
オカモト	26,000	419.00	10,894,000	
アキレス	73,000	151.00	11,023,000	
ニッタ	6,900	2,674.00	18,450,600	
住友理工	12,300	989.00	12,164,700	
三ツ星ベルト	18,000	854.00	15,372,000	
バンドー化学	28,000	417.00	11,676,000	
鬼怒川ゴム	17,000	483.00	8,211,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
旭　硝　子	318,000	580.00	184,440,000	
日本板硝子	330,000	119.00	39,270,000	
有沢製作所	12,300	915.00	11,254,500	
日本山村硝子	42,000	167.00	7,014,000	
日本電気硝子	127,000	546.00	69,342,000	
住友大阪セメント	124,000	343.00	42,532,000	
太平洋セメント	405,000	379.00	153,495,000	
日本ヒユーム	8,500	979.00	8,321,500	
日本コンクリート	12,900	593.00	7,649,700	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
ジャパンパイル	10,500	777.00	8,158,500	
東海カーボン	64,000	336.00	21,504,000	
日本カーボン	46,000	201.00	9,246,000	
東洋炭素	4,100	2,050.00	8,405,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	44,000	266.00	11,704,000	
ＴＯＴＯ	96,000	1,419.00	136,224,000	
日本碍子	82,000	2,638.00	216,316,000	
日本特殊陶業	55,700	3,660.00	203,862,000	

ＭＡＲＵＷＡ	2,200	3,395.00	7,469,000	貸付株式数	500株 (500株)
品川リフラクトリーズ	22,000	263.00	5,786,000		
フジミインコーポレーテッド	7,400	1,794.00	13,275,600		
ニチアス	32,000	667.00	21,344,000		
新日鐵住金	2,731,000	308.40	842,240,400		
神戸製鋼所	1,119,000	191.00	213,729,000		
合同製鐵	47,000	179.00	8,413,000		
ＪＦＥホールディングス	164,600	2,588.00	425,984,800		
日新製鋼	27,600	1,111.00	30,663,600		
東京製鐵	34,000	649.00	22,066,000	貸付株式数	10,100株
共英製鋼	7,500	2,015.00	15,112,500		
大和工業	14,600	3,320.00	48,472,000		
東京鐵鋼	16,000	518.00	8,288,000		
大阪製鐵	4,800	2,071.00	9,940,800		
淀川製鋼所	49,000	436.00	21,364,000		
東洋鋼鈑	17,000	616.00	10,472,000		
丸一鋼管	19,200	2,572.00	49,382,400		
大同特殊鋼	107,000	430.00	46,010,000	貸付株式数	31,000株 (31,000株)
日本冶金工	53,500	282.00	15,087,000	貸付株式数	15,600株 (15,600株)
山陽特殊製鋼	41,000	365.00	14,965,000		
愛知製鋼	40,000	407.00	16,280,000		
日立金属	65,000	2,067.00	134,355,000		
大平洋金属	46,000	343.00	15,778,000		
新日本電工	43,600	298.00	12,992,800	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
栗本鉄工所	39,000	224.00	8,736,000		
日本製鋼所	97,000	418.00	40,546,000	貸付株式数	28,000株 (26,000株)
三菱製鋼	48,000	249.00	11,952,000		
日本軽金属ＨＤ	169,700	178.00	30,206,600		
三井金属	181,000	299.00	54,119,000		
東邦亜鉛	42,000	392.00	16,464,000		
三菱マテリアル	405,000	372.00	150,660,000		
住友鉱山	178,000	1,739.50	309,631,000		
ＤＯＷＡホールディングス	79,000	976.00	77,104,000		
古河機金	112,000	216.00	24,192,000		

大阪チタニウム	6,900	2,094.00	14,448,600	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	12,400	744.00	9,225,600	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
ＵＡＣＪ	75,000	342.00	25,650,000		
古河電工	199,000	200.00	39,800,000		
住友電工	243,300	1,579.00	384,170,700		
フジクラ	96,000	453.00	43,488,000		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	87,000	105.00	9,135,000		
タツタ電線	14,200	503.00	7,142,600	貸付株式数	3,200株 (3,200株)
リョービ	43,000	319.00	13,717,000		
アーレステイ	8,200	678.00	5,559,600		
アサヒＨＤ	10,500	1,734.00	18,207,000		
東洋製罐グループＨＤ	46,700	1,470.00	68,649,000		
ホッカンホールディングス	24,000	285.00	6,840,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	13,300	1,324.00	17,609,200		
三和ホールディングス	63,800	846.00	53,974,800		
文化シヤツター	20,000	982.00	19,640,000		
三協立山	8,600	2,074.00	17,836,400		
ＬＩＸＩＬグループ	95,700	2,577.00	246,618,900		
ノーリツ	13,200	1,921.00	25,357,200		
長府製作所	7,300	3,025.00	22,082,500		
リンナイ	12,000	9,070.00	108,840,000		
ユニプレス	12,200	2,097.00	25,583,400		
岡　部	14,300	1,181.00	16,888,300		
東　プ　レ	13,000	1,555.00	20,215,000	貸付株式数	3,700株 (3,700株)
高周波熱錬	13,100	802.00	10,506,200		
東京製綱	54,000	202.00	10,908,000	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
パイオラックス	3,600	4,915.00	17,694,000		
日本発条	56,200	1,036.00	58,223,200		
三浦工業	29,500	1,244.00	36,698,000		
タ　ク　マ	23,000	826.00	18,998,000		
リクルートホールディングス	72,000	3,875.00	279,000,000		
ツ　ガ　ミ	21,000	622.00	13,062,000	貸付株式数	6,000株 (6,000株)
オークマ	44,000	920.00	40,480,000		
東芝機械	38,000	467.00	17,746,000		

ア　マ　ダ	97,400	1,070.00	104,218,000		
アイダエンジニア	15,300	1,077.00	16,478,100		
滝澤鉄工所	29,000	230.00	6,670,000		
富士機械製造	22,000	1,105.00	24,310,000		
牧野フライス	33,000	859.00	28,347,000		
オーエスジー	29,900	1,899.00	56,780,100		
旭ダイヤモンド	18,600	1,282.00	23,845,200		
ＤＭＧ森精機	41,300	1,435.00	59,265,500		
ディスコ	7,400	9,420.00	69,708,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
日東工器	4,700	2,244.00	10,546,800		
豊田自動織機	55,600	6,120.00	340,272,000		
島精機製作所	9,800	2,061.00	20,197,800	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
日阪製作所	10,300	960.00	9,888,000		
やまびこ	2,800	4,915.00	13,762,000		
ナブテスコ	39,300	2,896.00	113,812,800		
三井海洋開発	6,500	1,964.00	12,766,000	貸付株式数	1,900株
ＳＭＣ	19,800	32,610.00	645,678,000		
ホソカワミクロン	15,000	677.00	10,155,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
ユニオンツール	4,000	2,795.00	11,180,000		
オイレス工業	8,500	2,002.00	17,017,000		
日精エーエスビー	2,700	2,749.00	7,422,300		
サトーホールディングス	8,300	2,814.00	23,356,200		
日精樹脂工業	6,400	1,110.00	7,104,000		
小松製作所	320,400	2,789.00	893,595,600	貸付株式数	89,900株 (89,900株)
住友重機械	179,000	652.00	116,708,000		
日立建機	29,200	2,557.00	74,664,400		
巴工業	3,800	1,706.00	6,482,800		
井関農機	71,000	228.00	16,188,000	貸付株式数	20,000株
北川鉄工所	39,000	240.00	9,360,000		
クボタ	312,000	1,874.00	584,688,000	貸付株式数	89,000株 (89,000株)
東洋エンジニア	34,000	437.00	14,858,000	貸付株式数	9,000株 (9,000株)
三菱化工機	24,000	478.00	11,472,000	貸付株式数	6,000株
月島機械	12,500	1,233.00	15,412,500		
帝国電機製作所	5,700	1,335.00	7,609,500		

新東工業	17,400	802.00	13,954,800	
渋谷工業	5,700	2,648.00	15,093,600	
アイチ　コーポレーション	12,400	588.00	7,291,200	
小森コーポレーション	17,000	1,194.00	20,298,000	
鶴見製作所	5,500	1,988.00	10,934,000	
住友精密	15,000	470.00	7,050,000	
荏原製作所	137,000	507.00	69,459,000	
西島製作所	8,600	841.00	7,232,600	貸付株式数　2,400株
北越工業	6,000	1,235.00	7,410,000	
千代田化工建	50,000	1,021.00	51,050,000	
ダイキン工業	89,900	8,090.00	727,291,000	貸付株式数　25,200株 (25,200株)
オルガノ	17,000	479.00	8,143,000	
トーヨーカネツ	44,000	253.00	11,132,000	
栗田工業	35,600	2,485.00	88,466,000	貸付株式数　10,900株 (10,900株)
椿本チエイン	33,000	992.00	32,736,000	
日本コンベヤ	25,000	265.00	6,625,000	貸付株式数　6,000株 (6,000株)
日　機　装	21,200	1,161.00	24,613,200	貸付株式数　6,200株
新興プランテック	15,800	806.00	12,734,800	
アネスト岩田	12,200	802.00	9,784,400	
ダイフク	31,100	1,292.00	40,181,200	
加藤製作所	15,000	939.00	14,085,000	
タダノ	30,000	1,703.00	51,090,000	
フジテック	18,600	1,174.00	21,836,400	
ＣＫＤ	18,300	1,035.00	18,940,500	
キトー	7,800	1,221.00	9,523,800	
平和	13,700	2,256.00	30,907,200	
理想科学工業	4,100	3,660.00	15,006,000	
ＳＡＮＫＹＯ	18,700	3,845.00	71,901,500	
日本金銭機械	6,400	1,755.00	11,232,000	貸付株式数　1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	4,700	2,007.00	9,432,900	
福島工業	3,900	2,066.00	8,057,400	
ダイコク電機	3,500	1,740.00	6,090,000	
ア　マ　ノ	21,200	1,261.00	26,733,200	
ＪＵＫＩ	50,000	407.00	20,350,000	
サンデン	40,000	698.00	27,920,000	
蛇の目ミシン	69,000	160.00	11,040,000	貸付株式数　19,000株

ブラザー工業	79,800	2,251.00	179,629,800	
マックス	11,000	1,215.00	13,365,000	
モリタホールディングス	12,200	1,149.00	14,017,800	
グローリー	19,800	3,150.00	62,370,000	
新晃工業	5,600	1,012.00	5,667,200	
大和冷機工業	11,000	799.00	8,789,000	
セガサミーホールディングス	66,400	1,634.00	108,497,600	
日本ピストンリング	35,000	246.00	8,610,000	
リ　ケ　ン	31,000	458.00	14,198,000	
ＴＰＲ	7,200	3,190.00	22,968,000	
ホシザキ電機	13,400	6,130.00	82,142,000	
大豊工業	7,600	1,188.00	9,028,800	
日本精工	128,000	1,515.00	193,920,000	貸付株式数 41,000株 (41,000株)
Ｎ　Ｔ　Ｎ	145,000	555.00	80,475,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
ジェイテクト	66,300	1,974.00	130,876,200	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
不　二　越	58,000	701.00	40,658,000	
ミネベア	93,000	1,499.00	139,407,000	
日本トムソン	24,000	588.00	14,112,000	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	40,800	2,898.00	118,238,400	
ユーシン精機	3,400	2,417.00	8,217,800	
イーグル工業	9,100	2,231.00	20,302,100	
日本ピラー工業	9,000	853.00	7,677,000	
キッツ	30,300	496.00	15,028,800	
日　立	1,483,000	920.10	1,364,508,300	
東　芝	1,300,000	531.00	690,300,000	
三菱電機	618,000	1,438.50	888,993,000	
富士電機	173,000	524.00	90,652,000	
東洋電機製造	19,000	406.00	7,714,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
安川電機	73,500	1,550.00	113,925,000	
シンフォニア　テクノロジー	53,000	175.00	9,275,000	
明　電　舎	62,000	389.00	24,118,000	
山洋電気	15,000	841.00	12,615,000	
デンヨー	6,400	1,664.00	10,649,600	
日立工機	18,300	992.00	18,153,600	
三桜工業	13,200	756.00	9,979,200	
マキタ	40,100	5,970.00	239,397,000	

東芝テック	45,000	848.00	38,160,000		
マブチモーター	9,400	9,490.00	89,206,000		
日本電産	66,500	7,949.00	528,608,500	貸付株式数	19,900株 (19,900株)
東光高岳	3,500	1,648.00	5,768,000		
ダイヘン	36,000	498.00	17,928,000		
ＪＶＣケンウッド	50,600	276.00	13,965,600	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
第一精工	3,000	2,655.00	7,965,000		
日新電機	16,000	642.00	10,272,000		
大崎電気	11,000	781.00	8,591,000	貸付株式数	3,000株
オムロン	69,600	5,440.00	378,624,000		
日東工業	10,200	2,312.00	23,582,400	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
ＩＤＥＣ	9,300	916.00	8,518,800		
ジーエス・ユアサ　コーポ	123,000	569.00	69,987,000		
メルコホールディングス	4,400	1,841.00	8,100,400		
日本電気	803,000	379.00	304,337,000		
富　士　通	597,000	684.80	408,825,600		
沖　電　気	219,000	239.00	52,341,000		
電気興業	21,000	520.00	10,920,000		
サンケン電気	33,000	1,021.00	33,693,000		
アイホン	4,500	1,920.00	8,640,000		
ルネサスエレクトロニクス	32,900	847.00	27,866,300	貸付株式数	9,600株
セイコーエプソン	42,200	5,840.00	246,448,000		
ワコム	52,600	457.00	24,038,200	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	11,800	1,638.00	19,328,400		
アクセル	4,800	1,501.00	7,204,800		
ＥＩＺＯ	6,200	2,210.00	13,702,000		
ジャパンディスプレイ	96,500	395.00	38,117,500	貸付株式数	30,800株 (30,800株)
日本信号	17,700	1,169.00	20,691,300		
京三製作所	20,000	367.00	7,340,000		
能美防災	8,700	1,630.00	14,181,000		
エレコム	2,500	2,623.00	6,557,500		
日本無線	17,000	347.00	5,899,000		
パナソニック	752,600	1,554.00	1,169,540,400		
シャープ	525,000	287.00	150,675,000	貸付株式数	150,000株 (132,000株)

アンリツ	39,400	827.00	32,583,800	
富士通ゼネラル	19,000	1,271.00	24,149,000	
日立国際電気	17,000	1,799.00	30,583,000	
ソ　ニ　ー	397,500	2,640.00	1,049,400,000	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	37,400	7,200.00	269,280,000	
ミツミ電機	23,700	985.00	23,344,500	
タムラ製作所	28,000	458.00	12,824,000	
アルプス電気	49,200	2,411.00	118,621,200	
パイオニア	98,200	256.00	25,139,200	
日本電波工業	7,700	995.00	7,661,500	
ローランド　ディー．ジー．	2,800	4,175.00	11,690,000	
フオスター電機	6,900	2,140.00	14,766,000	
クラリオン	35,000	418.00	14,630,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
Ｓ　Ｍ　Ｋ	21,000	505.00	10,605,000	
東　光	19,000	327.00	6,213,000	貸付株式数 5,000株
ホシデン	21,800	746.00	16,262,800	
ヒロセ電機	9,800	14,980.00	146,804,000	
日本航空電子	18,000	2,674.00	48,132,000	
Ｔ　Ｏ　Ａ	7,700	1,175.00	9,047,500	
日立マクセル	9,700	1,788.00	17,343,600	
古野電気	9,100	939.00	8,544,900	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
ユニデン	26,000	232.00	6,032,000	
アルパイン	15,300	1,939.00	29,666,700	
スミダコーポレーション	8,400	880.00	7,392,000	
アイコム	4,300	2,832.00	12,177,600	
船井電機	7,400	1,569.00	11,610,600	
横河電機	62,800	1,457.00	91,499,600	
新電元工業	25,000	751.00	18,775,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
アズビル	19,700	2,823.00	55,613,100	
日本光電工業	13,200	6,030.00	79,596,000	
堀場製作所	11,700	4,165.00	48,730,500	
アドバンテスト	43,900	1,421.00	62,381,900	
エスペック	9,100	1,113.00	10,128,300	
キーエンス	14,000	55,520.00	777,280,000	
日置電機	4,500	1,724.00	7,758,000	
シスメックス	47,900	5,250.00	251,475,000	

メガチップス	8,400	1,423.00	11,953,200	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,300	4,990.00	21,457,000		
デンソー	152,200	5,683.00	864,952,600		
コーセル	10,100	1,319.00	13,321,900	貸付株式数	2,900株
オプテックス	4,900	1,982.00	9,711,800		
千代田インテグレ	3,400	1,975.00	6,715,000		
レーザーテック	7,700	1,242.00	9,563,400		
スタンレー電気	44,100	2,616.00	115,365,600		
岩崎電気	27,000	250.00	6,750,000		
ウシオ電機	37,400	1,224.00	45,777,600	貸付株式数	11,000株 (11,000株)
日本セラミック	4,400	1,757.00	7,730,800	貸付株式数	1,300株
日本デジタル研究所	6,600	1,695.00	11,187,000		
古河電池	6,000	1,139.00	6,834,000		
山一電機	8,300	809.00	6,714,700		
図　研	6,700	1,048.00	7,021,600		
日本電子	29,000	591.00	17,139,000		
カ　シ　オ	62,700	1,814.00	113,737,800	貸付株式数	19,200株
ファナック	64,300	20,260.00	1,302,718,000		
日本シイエムケイ	22,800	298.00	6,794,400		
エンプラス	3,000	3,900.00	11,700,000		
大真空	17,000	319.00	5,423,000		
ロ　ー　ム	30,400	7,760.00	235,904,000		
浜松ホトニクス	25,600	6,170.00	157,952,000		
三井ハイテック	11,600	699.00	8,108,400		
新光電気工業	26,100	784.00	20,462,400		
京　セ　ラ	101,200	5,824.00	589,388,800		
太陽誘電	33,600	1,357.00	45,595,200		
村田製作所	64,800	12,980.00	841,104,000	貸付株式数	18,400株 (18,400株)
ユーシン	11,300	716.00	8,090,800	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
双葉電子工業	11,200	1,623.00	18,177,600		
日東電工	50,000	6,272.00	313,600,000		
北陸電気工業	39,000	183.00	7,137,000		
東海理化電機	16,700	2,450.00	40,915,000	貸付株式数	4,900株 (4,900株)
ニチコン	21,200	957.00	20,288,400		
日本ケミコン	53,000	346.00	18,338,000		

Ｋ　Ｏ　Ａ	9,900	1,144.00	11,325,600	
三井造船	245,000	224.00	54,880,000	貸付株式数 73,000株 (73,000株)
日立造船	51,400	655.00	33,667,000	
三菱重工業	1,035,000	695.10	719,428,500	
川崎重工業	450,000	527.00	237,150,000	
ＩＨＩ	447,000	608.00	271,776,000	
名村造船所	17,900	1,368.00	24,487,200	
日本車輌	26,000	355.00	9,230,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
ニチユ三菱フォークリフト	8,200	770.00	6,314,000	
ＦＰＧ	6,400	1,472.00	9,420,800	貸付株式数 1,700株 (1,500株)
じもとホールディングス	49,600	231.00	11,457,600	貸付株式数 14,800株 (14,800株)
全国保証	16,300	3,590.00	58,517,000	
足利ホールディングス	37,900	476.00	18,040,400	
東京ＴＹフィナンシャルＧ	8,100	3,325.00	26,932,500	
日産自動車	864,300	1,105.00	955,051,500	
いすゞ自動車	195,700	1,528.50	299,127,450	
トヨタ自動車 ※	852,100	7,429.00	6,330,250,900	貸付株式数 243,100株 (243,100株)
日野自動車	88,500	1,606.00	142,131,000	
三菱自動車工業	227,000	1,236.00	280,572,000	
エフテック	6,000	1,220.00	7,320,000	
武蔵精密工業	7,300	2,315.00	16,899,500	
日産車体	27,900	1,494.00	41,682,600	
新明和工業	26,000	1,155.00	30,030,000	
極東開発工業	12,100	1,472.00	17,811,200	
日信工業	12,000	1,873.00	22,476,000	
トピー工業	61,000	221.00	13,481,000	
ティラド	33,000	254.00	8,382,000	
曙ブレーキ	30,700	429.00	13,170,300	貸付株式数 9,800株
タチエス	11,000	1,611.00	17,721,000	
Ｎ　Ｏ　Ｋ	30,000	3,065.00	91,950,000	
フタバ産業	22,000	618.00	13,596,000	
カヤバ工業	72,000	505.00	36,360,000	
大同メタル工業	10,000	1,351.00	13,510,000	
プレス工業	36,000	427.00	15,372,000	
カルソニックカンセイ	48,000	653.00	31,344,000	

太平洋工業	15,200	877.00	13,330,400	貸付株式数 4,300株
ケーヒン	14,900	1,681.00	25,046,900	
河西工業	9,300	945.00	8,788,500	
アイシン精機	55,600	4,475.00	248,810,000	
マ　ツ　ダ	184,400	3,147.00	580,306,800	
ダイハツ	71,600	1,642.00	117,567,200	
今仙電機製作所	6,100	1,577.00	9,619,700	貸付株式数 1,800株
本田技研	555,300	3,595.50	1,996,581,150	
スズキ	129,100	3,853.00	497,422,300	
富士重工業	210,500	4,381.00	922,200,500	
ヤマハ発動機	94,000	2,551.00	239,794,000	
ショーワ	15,900	1,183.00	18,809,700	
小糸製作所	37,100	3,805.00	141,165,500	
ＴＢＫ	11,300	658.00	7,435,400	
エクセディ	8,600	2,976.00	25,593,600	
ミツバ	12,400	1,975.00	24,490,000	
豊田合成	19,900	2,355.00	46,864,500	
愛三工業	11,900	947.00	11,269,300	
ヨ　ロ　ズ	6,400	2,030.00	12,992,000	
エフ・シー・シー	9,800	1,990.00	19,502,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
シマノ	26,700	16,530.00	441,351,000	
タカタ	3,300	1,297.00	4,280,100	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
テイ・エス　テック	13,300	2,815.00	37,439,500	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
小　野　建	6,800	980.00	6,664,000	
カッパ・クリエイトＨＤ	11,700	1,060.00	12,402,000	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
ナガイレーベン	9,700	1,957.00	18,982,900	
三菱食品	6,800	2,635.00	17,918,000	
良品計画	7,500	13,840.00	103,800,000	
松田産業	7,200	1,301.00	9,367,200	
メディパルＨＤ	60,500	1,321.00	79,920,500	
アズワン	4,900	3,005.00	14,724,500	
シモジマ	7,200	1,005.00	7,236,000	
ドウシシャ	9,000	1,668.00	15,012,000	
コナカ	9,300	643.00	5,979,900	
コーナン商事	10,600	1,310.00	13,886,000	
黒田電気	11,000	1,502.00	16,522,000	

ネットワンシステムズ	27,100	680.00	18,428,000	貸付株式数	7,500株 (7,500株)
ワタミ	8,600	1,203.00	10,345,800	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	21,000	7,550.00	158,550,000		
西松屋チェーン	13,100	1,099.00	14,396,900		
ゼンショーホールディングス	31,200	955.00	29,796,000	貸付株式数	8,900株
ハピネット	4,400	1,644.00	7,233,600	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
幸楽苑	6,700	1,410.00	9,447,000		
サイゼリヤ	9,600	1,586.00	15,225,600		
ガリバーインターナショナル	19,900	937.00	18,646,300		
ユナイテッドアローズ	8,100	3,175.00	25,717,500		
ハイデイ日高	4,300	3,970.00	17,071,000		
シークス	4,600	2,131.00	9,802,600		
京都きもの友禅	9,200	1,001.00	9,209,200		
コロワイド	20,900	1,397.00	29,197,300	貸付株式数	6,200株
壱番屋	2,800	5,260.00	14,728,000	貸付株式数	700株
マクニカ	3,700	3,315.00	12,265,500		
スギホールディングス	10,900	4,965.00	54,118,500		
島津製作所	74,000	1,190.00	88,060,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	24,000	289.00	6,936,000		
スター精密	12,800	1,733.00	22,182,400		
東京計器	30,000	263.00	7,890,000		
東京精密	12,000	2,346.00	28,152,000		
マニー	1,900	6,790.00	12,901,000		
ニコン	116,000	1,701.00	197,316,000	貸付株式数	33,400株
トプコン	19,000	2,686.00	51,034,000		
オリンパス	92,300	4,440.00	409,812,000		
理研計器	8,200	1,097.00	8,995,400		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	61,000	798.00	48,678,000		
キヤノン電子	6,100	2,009.00	12,254,900		
タムロン	5,300	2,285.00	12,110,500		
ＨＯＹＡ	146,900	4,293.00	630,641,700		
ノーリツ鋼機	9,000	618.00	5,562,000		
キヤノン	357,400	3,906.00	1,396,004,400		
リ　コ　ー	185,600	1,279.50	237,475,200		
シチズンホールディングス	78,300	951.00	74,463,300		
リズム時計	39,000	165.00	6,435,000		

大研医器	5,500	1,208.00	6,644,000	
パラマウントベッドＨＤ	6,800	3,410.00	23,188,000	
前田工繊	7,300	1,255.00	9,161,500	貸付株式数 2,000株 (400株)
永大産業	14,000	443.00	6,202,000	
アートネイチャー	5,600	1,348.00	7,548,800	
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	68,200	2,633.00	179,570,600	
フランスベッドＨＬＤＧＳ	55,000	184.00	10,120,000	
マーベラス	11,100	1,790.00	19,869,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	5,600	6,140.00	34,384,000	
エイベックス・グループＨＤ	12,800	1,718.00	21,990,400	貸付株式数 3,600株
トッパン・フォームズ	12,800	1,172.00	15,001,600	
フジシールインターナショナル	7,800	3,525.00	27,495,000	
タカラトミー	24,900	619.00	15,413,100	貸付株式数 7,100株 (7,100株)
大建工業	34,000	263.00	8,942,000	
凸版印刷	176,000	770.00	135,520,000	
大日本印刷	188,000	1,055.00	198,340,000	
図書印刷	15,000	341.00	5,115,000	
共同印刷	26,000	381.00	9,906,000	
日本写真印刷	11,100	1,831.00	20,324,100	貸付株式数 3,200株
藤森工業	5,800	3,440.00	19,952,000	
宝印刷	9,000	784.00	7,056,000	
前澤化成工業	7,500	1,173.00	8,797,500	
アシックス	61,500	3,080.00	189,420,000	
ツ　ツ　ミ	3,700	2,466.00	9,124,200	
ジェイ　エス　ピー	5,700	1,826.00	10,408,200	
ニ　チ　ハ	10,600	1,095.00	11,607,000	
エフピコ	5,800	3,560.00	20,648,000	貸付株式数 1,800株
小松ウオール工業	2,700	2,772.00	7,484,400	
ヤマハ	46,300	1,807.00	83,664,100	
河合楽器	3,400	2,497.00	8,489,800	
クリナップ	8,300	839.00	6,963,700	
ピジョン	11,800	7,460.00	88,028,000	
天馬	6,100	1,631.00	9,949,100	
リンテック	14,400	2,584.00	37,209,600	
信越ポリマー	16,000	514.00	8,224,000	
東　リ	31,000	246.00	7,626,000	

イトーキ	15,400	565.00	8,701,000	
任　天　堂	38,000	14,130.00	536,940,000	
三菱鉛筆	5,500	3,880.00	21,340,000	
松　風	4,800	1,440.00	6,912,000	
タカラスタンダード	27,000	839.00	22,653,000	
コ　ク　ヨ	33,300	894.00	29,770,200	
ニ　フ　コ	14,500	4,110.00	59,595,000	
岡村製作所	25,500	795.00	20,272,500	
日本バルカー	37,000	316.00	11,692,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	10,000	500.00	5,000,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
伊　藤　忠	507,600	1,370.50	695,665,800	
丸　紅	529,500	745.70	394,848,150	
ヨンドシーホールディングス	5,400	2,050.00	11,070,000	
三陽商会	40,000	314.00	12,560,000	
長瀬産業	36,700	1,434.00	52,627,800	
蝶　理	5,200	1,667.00	8,668,400	
豊田通商	67,800	2,836.00	192,280,800	
オンワードホールディングス	47,000	732.00	34,404,000	
三共生興	19,000	445.00	8,455,000	
兼　松	131,000	176.00	23,056,000	
美　津　濃	36,000	598.00	21,528,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
ファミリーマート	20,100	4,460.00	89,646,000	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
三井物産	514,300	1,612.00	829,051,600	
日本紙パルプ	35,000	313.00	10,955,000	
東京エレクトロン	52,100	8,294.00	432,117,400	
日立ハイテクノロジーズ	21,100	3,520.00	74,272,000	
カメイ	10,300	790.00	8,137,000	
スターゼン	34,000	394.00	13,396,000	
セイコーＨＤ	45,000	685.00	30,825,000	貸付株式数 12,000株
山　善	25,300	822.00	20,796,600	
住友商事	358,000	1,260.50	451,259,000	
日本ユニシス	18,700	1,098.00	20,532,600	
内田洋行	20,000	374.00	7,480,000	
三菱商事	465,600	2,222.00	1,034,563,200	
第一実業	19,000	576.00	10,944,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	17,600	2,170.00	38,192,000	

西華産業	29,000	274.00	7,946,000	
菱洋エレクトロ	9,800	1,192.00	11,681,600	
ユアサ商事	6,500	2,295.00	14,917,500	
神鋼商事	30,000	267.00	8,010,000	
阪和興業	66,000	426.00	28,116,000	
カナデン	11,000	793.00	8,723,000	
菱電商事	15,000	811.00	12,165,000	
ニプロ	40,200	1,050.00	42,210,000	貸付株式数 9,900株
岩谷産業	68,000	864.00	58,752,000	貸付株式数 19,000株
すてきナイスグループ	37,000	196.00	7,252,000	
昭光通商	48,000	183.00	8,784,000	
兼松エレクトロニクス	7,300	1,650.00	12,045,000	
三愛石油	18,000	733.00	13,194,000	
稲畑産業	16,700	1,033.00	17,251,100	
ゴールドウイン	17,000	629.00	10,693,000	
ユニ・チャーム	130,200	2,762.00	359,612,400	
デサント	16,000	1,149.00	18,384,000	
ワ　キ　タ	14,000	1,150.00	16,100,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
東邦ホールディングス	21,900	1,513.00	33,134,700	
サンゲツ	11,900	2,899.00	34,498,100	
ミツウロコグループ	14,200	534.00	7,582,800	
シナネン	21,000	431.00	9,051,000	
伊藤忠エネクス	15,500	770.00	11,935,000	
サンリオ	17,300	3,225.00	55,792,500	貸付株式数 4,900株 (4,600株)
サンワ　テクノス	5,600	1,152.00	6,451,200	
リョーサン	11,300	2,536.00	28,656,800	
新光商事	9,200	1,164.00	10,708,800	
トーホー	24,000	430.00	10,320,000	
三信電気	10,400	809.00	8,413,600	
東陽テクニカ	11,700	1,047.00	12,249,900	
モスフード　サービス	8,600	2,108.00	18,128,800	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
加賀電子	6,700	1,477.00	9,895,900	
三益半導体	9,500	1,023.00	9,718,500	
木曽路	8,500	1,913.00	16,260,500	貸付株式数 2,400株
千　趣　会	13,800	866.00	11,950,800	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
ケーヨー	17,000	526.00	8,942,000	貸付株式数 3,200株

アデランス	9,200	1,186.00	10,911,200	
上新電機	15,000	909.00	13,635,000	
日本瓦斯	10,100	2,470.00	24,947,000	
マルエツ	19,000	549.00	10,431,000	
ロイヤルホールディングス	11,000	1,732.00	19,052,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
いなげや	8,600	1,177.00	10,122,200	
島　忠	14,900	2,972.00	44,282,800	
チヨダ	7,600	2,120.00	16,112,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ライフコーポレーション	4,600	1,694.00	7,792,400	
カ　ス　ミ	14,200	1,048.00	14,881,600	
リンガーハツト	7,100	1,733.00	12,304,300	貸付株式数 2,300株
ＡＯＫＩホールディングス	14,700	1,181.00	17,360,700	
オークワ	12,000	949.00	11,388,000	
コメリ	10,500	2,596.00	27,258,000	
青山商事	15,200	2,566.00	39,003,200	
しまむら	6,900	9,970.00	68,793,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
高　島　屋	86,000	1,006.00	86,516,000	
松　屋	13,100	1,803.00	23,619,300	
エイチ・ツー・オーリテイリング	28,800	1,877.00	54,057,600	
近鉄百貨店	28,000	312.00	8,736,000	貸付株式数 7,000株
ニッセンＨＤ	17,900	355.00	6,354,500	
パ　ル　コ	8,300	975.00	8,092,500	
丸井グループ	75,200	1,041.00	78,283,200	
クレディセゾン	50,400	2,206.00	111,182,400	
アクシアル　リテイリング	5,400	2,670.00	14,418,000	
ダイエー	81,400	136.00	11,070,400	
イオン	242,800	1,200.00	291,360,000	貸付株式数 72,000株
ユニーグループ・ＨＤ	65,300	601.00	39,245,300	
イ　ズ　ミ	13,700	3,755.00	51,443,500	
東武ストア	28,000	289.00	8,092,000	
平　和　堂	12,900	2,185.00	28,186,500	
フ　ジ	7,600	2,184.00	16,598,400	
ヤオコー	3,600	7,160.00	25,776,000	
ゼビオ	8,500	1,921.00	16,328,500	
ケーズホールディングス	14,000	2,895.00	40,530,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)

Ｐａｌｔａｃ	10,600	1,340.00	14,204,000	
新生銀行	597,000	225.00	134,325,000	
あおぞら銀行	426,000	388.00	165,288,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	4,891,500	690.00	3,375,135,000	
りそなホールディングス	718,600	639.30	459,400,980	
三井住友トラストＨＤ	1,351,000	494.00	667,394,000	
三井住友フィナンシャルＧ	460,800	4,477.50	2,063,232,000	
第四銀行	76,000	407.00	30,932,000	
北越銀行	73,000	222.00	16,206,000	
西日本シティ銀行	211,000	341.00	71,951,000	
千葉銀行	233,000	788.00	183,604,000	
横浜銀行	420,000	669.30	281,106,000	
常陽銀行	218,000	599.00	130,582,000	
群馬銀行	143,000	707.00	101,101,000	
武蔵野銀行	9,800	3,900.00	38,220,000	
千葉興業銀行	14,400	869.00	12,513,600	
筑波銀行	28,600	391.00	11,182,600	
七十七銀行	101,000	624.00	63,024,000	
青森銀行	52,000	349.00	18,148,000	
秋田銀行	45,000	340.00	15,300,000	
山形銀行	39,000	531.00	20,709,000	貸付株式数　11,000株
岩手銀行	4,300	5,270.00	22,661,000	
東邦銀行	55,000	415.00	22,825,000	
みちのく銀行	38,000	231.00	8,778,000	貸付株式数　10,000株
ふくおかフィナンシャルＧ	248,000	643.00	159,464,000	
静岡銀行	178,000	1,145.00	203,810,000	貸付株式数　15,000株 (15,000株)
十六銀行	76,000	441.00	33,516,000	
スルガ銀行	63,800	2,270.00	144,826,000	
八十二銀行	108,000	726.00	78,408,000	
山梨中央銀行	40,000	499.00	19,960,000	
大垣共立銀行	77,000	355.00	27,335,000	
福井銀行	58,000	269.00	15,602,000	
北國銀行	68,000	377.00	25,636,000	
清水銀行	2,600	2,965.00	7,709,000	
滋賀銀行	60,000	635.00	38,100,000	
南都銀行	59,000	426.00	25,134,000	
百五銀行	58,000	491.00	28,478,000	
京都銀行	114,000	1,011.00	115,254,000	
紀陽銀行	24,200	1,520.00	36,784,000	

三重銀行	40,000	274.00	10,960,000	
ほくほくフィナンシャルG	402,000	243.00	97,686,000	
広島銀行	177,000	577.00	102,129,000	
山陰合同銀行	38,000	873.00	33,174,000	
中国銀行	42,400	1,664.00	70,553,600	
伊予銀行	63,700	1,229.00	78,287,300	
百十四銀行	67,000	393.00	26,331,000	
四国銀行	52,000	252.00	13,104,000	
阿波銀行	50,000	649.00	32,450,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
鹿児島銀行	42,000	761.00	31,962,000	
大分銀行	39,000	455.00	17,745,000	
宮崎銀行	44,000	368.00	16,192,000	
肥後銀行	50,000	650.00	32,500,000	
佐賀銀行	46,000	264.00	12,144,000	
十八銀行	42,000	346.00	14,532,000	
沖縄銀行	5,100	4,990.00	25,449,000	
琉球銀行	13,300	1,726.00	22,955,800	
セブン銀行	202,100	519.00	104,889,900	
みずほフィナンシャルG	8,407,300	204.30	1,717,611,390	
山口フィナンシャルG	58,000	1,186.00	68,788,000	
芙蓉総合リース	6,700	4,245.00	28,441,500	
興銀リース	12,300	2,348.00	28,880,400	
東京センチュリーリース	14,500	2,953.00	42,818,500	
ＳＢＩホールディングス	73,700	1,381.00	101,779,700	
日本証券金融	32,100	615.00	19,741,500	
アイフル	103,900	451.00	46,858,900	貸付株式数 33,200株 (33,200株)
名古屋銀行	58,000	454.00	26,332,000	
北洋銀行	90,700	471.00	42,719,700	
愛知銀行	2,500	5,810.00	14,525,000	
第三銀行	48,000	193.00	9,264,000	
東日本銀行	31,000	347.00	10,757,000	
大光銀行	34,000	223.00	7,582,000	
愛媛銀行	42,000	251.00	10,542,000	貸付株式数 14,000株
トマト銀行	46,000	179.00	8,234,000	
みなと銀行	59,000	226.00	13,334,000	
京葉銀行	49,000	659.00	32,291,000	
関西アーバン銀行	7,500	1,325.00	9,937,500	
栃木銀行	33,000	529.00	17,457,000	

北日本銀行	2,800	2,832.00	7,929,600	
東和銀行	93,000	106.00	9,858,000	
福島銀行	105,000	96.00	10,080,000	
大東銀行	56,000	150.00	8,400,000	
リコーリース	5,700	3,180.00	18,126,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
イオンフィナンシャルサービス	40,000	2,567.00	102,680,000	貸付株式数 11,400株 (11,400株)
ア　コ　ム	124,600	353.00	43,983,800	貸付株式数 36,500株 (36,500株)
ジャックス	36,000	588.00	21,168,000	
オ　リ　コ	144,100	210.00	30,261,000	
日立キャピタル	12,400	2,665.00	33,046,000	
オリックス	430,000	1,565.50	673,165,000	
三菱ＵＦＪリース	155,200	557.00	86,446,400	
ジャフコ	8,700	4,650.00	40,455,000	
トモニホールディングス	48,500	516.00	25,026,000	
大和証券Ｇ本社	569,000	959.30	545,841,700	
野村ホールディングス	1,245,500	718.80	895,265,400	
岡三証券グループ	53,000	956.00	50,668,000	
丸三証券	22,100	827.00	18,276,700	
東洋証券	32,000	358.00	11,456,000	
東海東京ＨＤ	70,700	857.00	60,589,900	
水戸証券	24,800	425.00	10,540,000	
いちよし証券	14,500	1,298.00	18,821,000	
松井証券	33,800	1,118.00	37,788,400	
損保ジャパン興亜ＨＤ	135,700	3,027.50	410,831,750	
日本取引所グループ	89,900	3,010.00	270,599,000	
マネックスＧ	75,400	287.00	21,639,800	
カブドットコム証券	28,900	592.00	17,108,800	
極東証券	9,400	1,955.00	18,377,000	
岩井コスモホールディング	7,700	1,234.00	9,501,800	
フィデアホール	40,900	242.00	9,897,800	貸付株式数 11,600株
池田泉州ＨＤ	47,900	573.00	27,446,700	
ＭＳ＆ＡＤ	194,000	2,830.00	549,020,000	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	59,500	1,828.00	108,766,000	
第一生命	390,600	1,744.00	681,206,400	
東京海上ＨＤ	250,600	3,970.50	995,007,300	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,600	2,014.00	7,250,400	

Ｔ＆Ｄホールディングス	223,400	1,458.00	325,717,200	
三井不動産	323,000	3,430.00	1,107,890,000	貸付株式数 95,000株 (95,000株)
三菱地所	454,000	2,685.00	1,218,990,000	
平和不動産	13,400	1,843.00	24,696,200	
東京建物	134,000	963.00	129,042,000	
ダイビル	16,600	1,263.00	20,965,800	
京阪神ビルディング	16,100	645.00	10,384,500	
住友不動産	146,000	4,156.50	606,849,000	
大京	100,000	207.00	20,700,000	
テーオーシー	22,700	728.00	16,525,600	
東京楽天地	18,000	512.00	9,216,000	
レオパレス２１	67,600	706.00	47,725,600	
スターツコーポレーション	7,900	1,604.00	12,671,600	
フジ住宅	13,000	656.00	8,528,000	貸付株式数 3,200株
空港施設	10,900	733.00	7,989,700	
住友不動産販売	4,600	2,693.00	12,387,800	
ゴールドクレスト	6,100	2,176.00	13,273,600	
リロ・ホールディング	2,300	7,880.00	18,124,000	
タカラレーベン	29,500	530.00	15,635,000	貸付株式数 6,800株 (6,800株)
サンヨーハウジ　名古屋	5,900	1,175.00	6,932,500	
イオンモール	39,000	2,027.00	79,053,000	
トーセイ	10,500	727.00	7,633,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	38,200	1,238.00	47,291,600	
サンフロンティア不動産	7,800	1,236.00	9,640,800	貸付株式数 2,200株
東武鉄道	333,000	532.00	177,156,000	
相鉄ホールディングス	108,000	469.00	50,652,000	
東京急行	337,000	717.00	241,629,000	
京浜急行	168,000	911.00	153,048,000	
小田急電鉄	199,000	1,090.00	216,910,000	
京王電鉄	174,000	873.00	151,902,000	
京成電鉄	94,000	1,382.00	129,908,000	
富士急行	18,000	1,097.00	19,746,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
新京成電鉄	23,000	387.00	8,901,000	
東日本旅客鉄道	112,900	8,954.00	1,010,906,600	
西日本旅客鉄道	59,500	5,712.00	339,864,000	
東海旅客鉄道	55,300	17,515.00	968,579,500	
西武ホールディングス	48,900	2,275.00	111,247,500	貸付株式数 14,600株

鴻池運輸	4,100	2,287.00	9,376,700	
西日本鉄道	82,000	496.00	40,672,000	
ハマキョウレックス	2,400	3,895.00	9,348,000	
サカイ引越センター	1,500	3,455.00	5,182,500	
近畿日本鉄道	616,000	399.00	245,784,000	貸付株式数 181,000株
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	411,000	658.00	270,438,000	
南海電鉄	130,000	552.00	71,760,000	
京阪電鉄	140,000	597.00	83,580,000	
神戸電鉄	28,000	358.00	10,024,000	
名古屋鉄道	221,000	461.00	101,881,000	貸付株式数 63,000株 (63,000株)
山陽電鉄	30,000	443.00	13,290,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
トランコム	2,100	5,010.00	10,521,000	
日本通運	244,000	576.00	140,544,000	
ヤマトホールディングス	113,400	2,588.00	293,479,200	
山　九	76,000	490.00	37,240,000	
日　新	33,000	277.00	9,141,000	
丸全昭和運輸	27,000	352.00	9,504,000	
センコー	27,000	553.00	14,931,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
日本梱包運輸	20,200	1,861.00	37,592,200	
福山通運	36,000	630.00	22,680,000	貸付株式数 10,000株
セイノーホールディングス	48,000	1,143.00	54,864,000	
神奈川中央交通	18,000	575.00	10,350,000	
日立物流	12,300	1,503.00	18,486,900	
日本郵船	522,000	341.00	178,002,000	
商船三井	325,000	376.00	122,200,000	貸付株式数 103,000株
川崎汽船	274,000	312.00	85,488,000	
ＮＳユナイテッド海運	31,000	343.00	10,633,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
飯野海運	34,300	698.00	23,941,400	
日本航空	116,500	3,635.00	423,477,500	
ＡＮＡホールディングス	1,215,000	303.80	369,117,000	
三菱倉庫	41,000	1,871.00	76,711,000	
三井倉庫ＨＯＬＤ	41,000	448.00	18,368,000	
住友倉庫	46,000	676.00	31,096,000	
渋沢倉庫	21,000	357.00	7,497,000	
ヤマタネ	49,000	182.00	8,918,000	
東陽倉庫	27,000	302.00	8,154,000	

日本トランスシティ	21,000	374.00	7,854,000	
安田倉庫	7,300	1,071.00	7,818,300	
東洋埠頭	33,000	212.00	6,996,000	
上　組	72,000	1,095.00	78,840,000	
郵船ロジスティクス	6,900	1,316.00	9,080,400	
近鉄エクスプレス	5,500	4,260.00	23,430,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東京放送ＨＤ	37,400	1,430.00	53,482,000	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
日本テレビＨＬＤＳ	55,600	1,761.00	97,911,600	
テレビ朝日ＨＤ	17,100	1,945.00	33,259,500	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	49,900	714.00	35,628,600	
テレビ東京ＨＤ	5,600	2,387.00	13,367,200	
コネクシオ	6,700	1,115.00	7,470,500	
日本電信電話	238,700	6,230.00	1,487,101,000	
ＫＤＤＩ	206,800	7,544.00	1,560,099,200	
光通信	5,500	7,770.00	42,735,000	貸付株式数 1,600株
ＮＴＴドコモ	502,100	1,866.00	936,918,600	
ＧＭＯインターネット	21,200	1,107.00	23,468,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ・ＤＷＡＮＧＯ	16,400	2,040.00	33,456,000	貸付株式数 4,700株
学研ホールディングス	32,000	258.00	8,256,000	
ゼンリン	9,800	1,374.00	13,465,200	
東京電力	525,000	433.00	227,325,000	
中部電力	188,800	1,416.00	267,340,800	
関西電力	252,500	1,209.50	305,398,750	
中国電力	84,400	1,536.00	129,638,400	
北陸電力	60,100	1,522.00	91,472,200	
東北電力	154,100	1,397.00	215,277,700	
四国電力	55,700	1,498.00	83,438,600	
九州電力	136,100	1,238.00	168,491,800	
北海道電力	58,000	983.00	57,014,000	
沖縄電力	4,400	3,730.00	16,412,000	
電源開発	41,300	4,150.00	171,395,000	
東京瓦斯	749,000	649.70	486,625,300	
大阪瓦斯	636,000	455.90	289,952,400	
東邦瓦斯	156,000	623.00	97,188,000	
北海道瓦斯	28,000	289.00	8,092,000	貸付株式数 7,000株 (2,000株)
西部瓦斯	74,000	270.00	19,980,000	

静岡瓦斯	19,500	756.00	14,742,000	
松　竹	41,000	1,064.00	43,624,000	
東　宝	44,000	2,662.00	117,128,000	
エイチ・アイ・エス	10,700	2,873.00	30,741,100	
東　映	25,000	621.00	15,525,000	
ＮＴＴデータ	38,000	4,575.00	173,850,000	
共立メンテナンス	3,600	5,160.00	18,576,000	貸付株式数　1,000株
イチネンホールディングス	10,200	958.00	9,771,600	貸付株式数　2,900株 (2,900株)
建設技術研究所	4,800	1,645.00	7,896,000	貸付株式数　1,300株
アインファーマシーズ	7,200	3,280.00	23,616,000	
東京テアトル	47,000	147.00	6,909,000	
よみうりランド	17,000	512.00	8,704,000	貸付株式数　4,000株 (4,000株)
東京都競馬	49,000	320.00	15,680,000	貸付株式数　15,000株 (15,000株)
常磐興産	46,000	153.00	7,038,000	
カナモト	9,200	3,790.00	34,868,000	
東京ドーム	50,000	478.00	23,900,000	
ＤＴＳ	7,500	2,407.00	18,052,500	
スクウェア・エニックス・ＨＤ	22,600	2,400.00	54,240,000	貸付株式数　6,600株 (6,600株)
シーイーシー	6,200	1,036.00	6,423,200	
カプコン	16,400	1,740.00	28,536,000	貸付株式数　4,800株 (4,800株)
西尾レントオール	5,400	4,005.00	21,627,000	貸付株式数　1,500株 (1,500株)
日本空港ビルデング	21,200	4,850.00	102,820,000	
トランス・コスモス	9,500	2,101.00	19,959,500	
乃村工藝社	14,100	998.00	14,071,800	
ジャステック	8,700	819.00	7,125,300	貸付株式数　2,400株
ＳＣＳＫ	14,800	3,015.00	44,622,000	
藤田観光	31,000	356.00	11,036,000	貸付株式数　8,000株 (8,000株)
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	38,000	169.00	6,422,000	
日本管財	4,000	2,778.00	11,112,000	
トーカイ	3,400	3,545.00	12,053,000	
セコム	62,600	6,873.00	430,249,800	
アイネス	11,200	900.00	10,080,000	

丹青社	8,500	964.00	8,194,000	
メイテツク	9,200	3,390.00	31,188,000	
ＴＫＣ	6,400	1,977.00	12,652,800	
アサツー　ディ・ケイ	12,700	3,120.00	39,624,000	
富士ソフト	9,400	2,527.00	23,753,800	
応用地質	7,600	1,811.00	13,763,600	
船井総研ホールディン	11,300	1,002.00	11,322,600	
ＮＳＤ	14,800	1,686.00	24,952,800	
コナミ	25,700	2,253.00	57,902,100	
ベネッセホールディングス	23,400	3,655.00	85,527,000	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
イオンディライト	6,800	2,696.00	18,332,800	
ナック	5,700	1,047.00	5,967,900	
ニチイ学館	14,900	911.00	13,573,900	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ダイセキ	11,300	2,029.00	22,927,700	
日鉄住金物産	41,000	426.00	17,466,000	
トラスコ中山	8,100	3,355.00	27,175,500	
ヤマダ電機	239,600	393.00	94,162,800	貸付株式数 71,100株 (71,100株)
オートバックスセブン	22,400	1,669.00	37,385,600	貸付株式数 6,200株 (6,200株)
アークランドサカモト	5,000	2,474.00	12,370,000	
ニトリホールディングス	26,200	6,580.00	172,396,000	
吉野家ホールディングス	18,000	1,309.00	23,562,000	
加藤産業	9,200	2,273.00	20,911,600	
イエローハット	6,300	2,308.00	14,540,400	
富士エレクトロニクス	5,900	1,371.00	8,088,900	
松屋フーズ	4,000	2,091.00	8,364,000	
ＪＢＣＣホールディングス	10,400	754.00	7,841,600	
サガミチェーン	10,000	1,055.00	10,550,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
日　伝	3,100	2,400.00	7,440,000	
因幡電機産業	9,000	3,970.00	35,730,000	
王将フードサービス	4,800	4,230.00	20,304,000	貸付株式数 1,300株
プレナス	7,400	2,034.00	15,051,600	
ミニストップ	6,200	1,573.00	9,752,600	
アークス	10,900	2,461.00	26,824,900	
バ　ロ　ー	13,800	2,050.00	28,290,000	
ミスミグループ本社	22,700	3,855.00	87,508,500	

江守グループＨＤ	3,800	1,083.00	4,115,400	
ベ　ル　ク	3,200	3,670.00	11,744,000	
ファーストリテイリング	12,200	43,425.00	529,785,000	貸付株式数　3,500株
ソフトバンク	322,900	7,966.00	2,572,221,400	
スズケン	25,100	3,095.00	77,684,500	
サンドラッグ	12,800	4,830.00	61,824,000	
サックスバーホールディング	5,300	1,576.00	8,352,800	貸付株式数　1,500株 (1,500株)
ジェコス	4,900	1,818.00	8,908,200	
ベルーナ	18,000	490.00	8,820,000	
合計			128,429,278,710	

（注）1．※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

2．貸付株式数のうち（括弧書）の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する貸付であります。

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	251,924,163	282,577,606
国債証券	39,982,122,270	41,307,987,410
地方債証券	4,650,498,190	4,454,870,968

特殊債券	4,748,120,012	4,825,769,573
社債券	5,165,224,042	4,981,866,720
未収入金	1,288,860,800	1,311,659,240
未収利息	199,279,819	194,741,505
前払費用	6,084,702	4,057,412
流動資産合計	56,292,113,998	57,363,530,434
資産合計	56,292,113,998	57,363,530,434
負債の部		
流動負債		
未払金	1,382,713,310	1,411,132,120
未払解約金	2,215,512	1,312,304
流動負債合計	1,384,928,822	1,412,444,424
負債合計	1,384,928,822	1,412,444,424
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	42,573,047,799	42,232,877,887
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	12,334,137,377	13,718,208,123
元本等合計	54,907,185,176	55,951,086,010
純資産合計	54,907,185,176	55,951,086,010
負債純資産合計	56,292,113,998	57,363,530,434

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25年12月3日 至　平成26年12月1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。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1．※1　期首	平成24年12月1日	平成25年12月3日

期首元本額	37,912,817,584円	42,573,047,799円
期中追加設定元本額	6,333,923,428円	1,969,786,496円
期中一部解約元本額	1,673,693,213円	2,309,956,408円
期末元本額の内訳		
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)	384,941,951円	382,037,783円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,753,420,696円	2,620,201,706円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	311,533,401円	293,365,466円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	3,781,045,351円	3,710,996,850円
Ｄ－Ｉ'ｓ 日本債券インデックス	－円	772,826円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	3,352,209,678円	3,672,713,156円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	21,661,577,591円	20,764,426,177円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,436,592,951円	3,183,424,694円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	578,946,246円	532,713,021円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	539,656,486円	513,994,155円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	775,787円	204,060,513円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,059,284,867円	5,546,060,674円
ダイワライフスタイル２５	319,231,248円	359,343,128円
ダイワライフスタイル５０	311,026,434円	353,171,587円
ダイワライフスタイル７５	82,805,112円	95,596,151円
計	42,573,047,799円	42,232,877,887円

2.　期末日における受益権の総数	42,573,047,799口	42,232,877,887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25年12月3日 至　平成26年12月1日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成26年12月1日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成25年12月2日現在	平成26年12月1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）
国債証券	494,060,000	798,605,210
地方債証券	△28,374,750	6,703,578
特殊債券	△30,345,458	218,097
社債券	△6,810,638	△7,033,722
合計	428,529,154	798,493,163

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成25年12月2日まで、及び平成25年12月3日から平成26年12月1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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2897円 (12,897円)	1.3248円 (13,248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	３３８　２年国債	100,000,000	100,121,000	
	３３９　２年国債	150,000,000	150,193,500	
	３４０　２年国債	255,000,000	255,349,350	
	３４１　２年国債	105,000,000	105,152,250	
	３４３　２年国債	290,000,000	290,466,900	
	３４４　２年国債	75,000,000	75,126,750	
	３４５　２年国債	105,000,000	105,185,850	
	３４６　２年国債	400,000,000	400,740,000	
	９５　５年国債	300,000,000	302,307,000	
	９６　５年国債	222,000,000	223,420,800	

９７　５年国債	160,000,000	160,976,000	
９８　５年国債	250,000,000	251,137,500	
９９　５年国債	45,000,000	45,319,050	
１００　５年国債	190,000,000	191,007,000	
１０１　５年国債	210,000,000	211,675,800	
１０２　５年国債	235,000,000	236,393,550	
１０３　５年国債	170,000,000	171,128,800	
１０４　５年国債	254,000,000	255,104,900	
１０５　５年国債	300,000,000	301,449,000	
１０６　５年国債	370,000,000	371,964,700	
１０７　５年国債	300,000,000	301,689,000	
１０８　５年国債	155,000,000	155,399,900	
１０９　５年国債	250,000,000	250,657,500	
１１０　５年国債	180,000,000	181,657,800	
１１１　５年国債	220,000,000	222,750,000	
１１２　５年国債	150,000,000	151,965,000	
１１３　５年国債	550,000,000	555,258,000	
１１４　５年国債	140,000,000	141,379,000	
１１５　５年国債	425,000,000	427,575,500	
１１６　５年国債	570,000,000	573,448,500	
１１７　５年国債	665,000,000	668,837,050	
１１８　５年国債	140,000,000	140,760,200	
１１９　５年国債	500,000,000	500,450,000	
１２０　５年国債	310,000,000	311,553,100	
１２１　５年国債	163,000,000	163,037,490	
１　４０年国債	85,000,000	106,477,800	
２　４０年国債	116,000,000	139,111,840	
３　４０年国債	74,000,000	88,717,120	
４　４０年国債	82,000,000	98,378,680	
５　４０年国債	125,000,000	142,850,000	
６　４０年国債	105,000,000	116,776,800	
７　４０年国債	75,000,000	78,805,500	
２７７　１０年国債	133,000,000	135,742,460	
２７８　１０年国債	104,000,000	106,413,840	
２７９　１０年国債	106,000,000	108,733,740	
２８０　１０年国債	237,000,000	243,936,990	
２８１　１０年国債	138,000,000	142,253,160	
２８２　１０年国債	100,000,000	103,046,000	
２８３　１０年国債	10,000,000	10,322,500	

２８４　１０年国債	211,000,000	218,317,480	
２８５　１０年国債	123,000,000	127,779,780	
２８６　１０年国債	220,000,000	230,049,600	
２８７　１０年国債	90,000,000	94,339,800	
２８８　１０年国債	254,000,000	266,039,600	
２８９　１０年国債	48,000,000	50,170,560	
２９０　１０年国債	132,000,000	137,994,120	
２９１　１０年国債	179,000,000	186,539,480	
２９２　１０年国債	155,000,000	163,568,400	
２９３　１０年国債	238,000,000	252,917,840	
２９４　１０年国債	147,000,000	155,693,580	
２９５　１０年国債	175,000,000	184,108,750	
２９６　１０年国債	25,000,000	26,378,750	
２９７　１０年国債	70,000,000	73,815,700	
２９８　１０年国債	125,000,000	131,310,000	
２９９　１０年国債	270,000,000	284,334,300	
３００　１０年国債	286,000,000	303,634,760	
３０１　１０年国債	120,000,000	127,744,800	
３０２　１０年国債	100,000,000	106,001,000	
３０３　１０年国債	10,000,000	10,625,700	
３０４　１０年国債	100,000,000	105,779,000	
３０５　１０年国債	350,000,000	371,182,000	
３０６　１０年国債	255,000,000	272,526,150	
３０７　１０年国債	250,000,000	265,865,000	
３０８　１０年国債	150,000,000	159,882,000	
３０９　１０年国債	220,000,000	232,067,000	
３１０　１０年国債	30,000,000	31,528,800	
３１１　１０年国債	110,000,000	114,338,400	
３１２　１０年国債	495,000,000	526,932,450	
３１３　１０年国債	260,000,000	278,813,600	
３１４　１０年国債	315,000,000	333,862,200	
３１５　１０年国債	221,000,000	235,963,910	
３１６　１０年国債	175,000,000	185,715,250	
３１７　１０年国債	214,000,000	227,372,860	
３１８　１０年国債	380,000,000	401,192,600	
３１９　１０年国債	100,000,000	106,290,000	
３２０　１０年国債	210,000,000	221,749,500	
３２１　１０年国債	175,000,000	184,796,500	
３２２　１０年国債	180,000,000	188,785,800	

３２３　１０年国債	40,000,000	41,956,400	
３２４　１０年国債	70,000,000	72,905,000	
３２５　１０年国債	60,000,000	62,475,600	
３２６　１０年国債	8,000,000	8,264,400	
３２８　１０年国債	153,000,000	156,713,310	
３２９　１０年国債	300,000,000	312,105,000	
３３０　１０年国債	242,000,000	251,614,660	
３３１　１０年国債	223,000,000	227,950,600	
３３２　１０年国債	565,000,000	576,876,300	
３３３　１０年国債	461,000,000	470,100,140	
３３４　１０年国債	550,000,000	560,367,500	
３３５　１０年国債	550,000,000	554,136,000	
１　３０年国債	16,000,000	20,477,760	
２　３０年国債	24,000,000	29,368,320	
３　３０年国債	30,000,000	36,266,100	
４　３０年国債	36,000,000	46,735,200	
５　３０年国債	28,000,000	33,385,800	
６　３０年国債	24,000,000	29,363,040	
７　３０年国債	55,000,000	66,317,900	
８　３０年国債	27,000,000	30,336,390	
９　３０年国債	43,000,000	45,455,730	
１０　３０年国債	45,000,000	45,206,100	
１１　３０年国債	40,000,000	44,070,000	
１２　３０年国債	60,000,000	70,054,800	
１３　３０年国債	65,000,000	74,623,250	
１４　３０年国債	82,000,000	99,759,560	
１５　３０年国債	100,000,000	123,314,000	
１６　３０年国債	60,000,000	73,896,000	
１７　３０年国債	65,000,000	78,813,800	
１８　３０年国債	80,000,000	95,529,600	
１９　３０年国債	57,000,000	68,063,130	
２０　３０年国債	60,000,000	73,842,000	
２１　３０年国債	60,000,000	71,631,000	
２２　３０年国債	70,000,000	86,163,700	
２３　３０年国債	75,000,000	92,403,000	
２４　３０年国債	57,000,000	70,288,410	
２５　３０年国債	68,000,000	81,323,920	
２６　３０年国債	135,000,000	164,214,000	
２７　３０年国債	115,000,000	142,397,600	

２８　３０年国債	136,000,000	168,799,120	
２９　３０年国債	155,000,000	189,430,150	
３０　３０年国債	165,000,000	198,392,700	
３１　３０年国債	155,000,000	183,394,450	
３２　３０年国債	180,000,000	217,153,800	
３３　３０年国債	223,000,000	254,877,850	
３４　３０年国債	191,000,000	226,906,090	
３５　３０年国債	213,000,000	243,599,580	
３６　３０年国債	210,000,000	240,097,200	
３７　３０年国債	223,000,000	249,809,060	
３８　３０年国債	140,000,000	153,525,400	
３９　３０年国債	136,000,000	152,354,000	
４０　３０年国債	119,000,000	130,509,680	
４１　３０年国債	115,000,000	123,268,500	
４２　３０年国債	135,000,000	144,614,700	
４３　３０年国債	160,000,000	171,284,800	
４４　３０年国債	138,000,000	147,635,160	
３１　利付国債２０年	18,000,000	18,813,960	
３２　利付国債２０年	16,000,000	16,764,960	
３３　利付国債２０年	22,000,000	23,498,200	
３４　利付国債２０年	9,000,000	9,720,090	
３５　利付国債２０年	22,000,000	23,659,240	
３６　利付国債２０年	21,000,000	22,752,660	
３７利付国債２０年	23,000,000	24,980,300	
３８利付国債２０年	60,000,000	65,280,600	
３９　２０年国債	90,000,000	97,624,800	
４０　２０年国債	57,000,000	61,860,390	
４１　２０年国債	136,000,000	144,293,280	
４２　２０年国債	87,000,000	96,400,350	
４３　２０年国債	100,000,000	113,422,000	
４４　２０年国債	85,000,000	95,766,100	
４５　２０年国債	78,000,000	87,468,420	
４６　２０年国債	73,000,000	81,484,060	
４７　２０年国債	89,000,000	99,748,530	
４８　２０年国債	54,000,000	61,718,220	
４９　２０年国債	64,000,000	71,854,080	
５０　２０年国債	107,000,000	118,794,610	
５１　２０年国債	82,000,000	91,866,240	
５２　２０年国債	52,000,000	58,766,240	

５３　２０年国債	66,000,000	74,791,200	
５４　２０年国債	65,000,000	74,110,400	
５５　２０年国債	140,000,000	158,006,800	
５６　２０年国債	58,000,000	65,613,660	
５７　２０年国債	85,000,000	95,527,250	
５８　２０年国債	112,000,000	126,133,280	
５９　２０年国債	110,000,000	122,387,100	
６０　２０年国債	100,000,000	108,856,000	
６１　２０年国債	186,000,000	196,615,020	
６２　２０年国債	95,000,000	98,833,250	
６３　２０年国債	130,000,000	146,246,100	
６４　２０年国債	90,000,000	102,167,100	
６５　２０年国債	85,000,000	96,679,850	
６６　２０年国債	135,000,000	152,297,550	
６７　２０年国債	55,000,000	62,616,400	
６８　２０年国債	120,000,000	139,917,600	
６９　２０年国債	110,000,000	127,267,800	
７０　２０年国債	83,000,000	98,579,100	
７１　２０年国債	125,000,000	146,088,750	
７２　２０年国債	175,000,000	203,141,750	
７３　２０年国債	120,000,000	138,410,400	
７４　２０年国債	73,000,000	84,904,110	
７５　２０年国債	70,000,000	81,562,600	
７６　２０年国債	51,000,000	58,389,390	
７７　２０年国債	55,000,000	63,511,250	
７８　２０年国債	61,000,000	69,939,550	
７９　２０年国債	50,000,000	57,860,500	
８０　２０年国債	63,000,000	73,502,100	
８１　２０年国債	76,000,000	88,038,400	
８２　２０年国債	87,000,000	101,728,230	
８３　２０年国債	93,000,000	108,918,810	
８４　２０年国債	100,000,000	116,006,000	
８５　２０年国債	58,000,000	67,992,240	
８６　２０年国債	80,000,000	95,545,600	
８７　２０年国債	72,000,000	85,174,560	
８８　２０年国債	100,000,000	119,647,000	
８９　２０年国債	98,000,000	116,121,180	
９０　２０年国債	120,000,000	142,328,400	
９１　２０年国債	85,000,000	101,817,250	

９２　２０年国債	190,000,000	223,523,600	
９３　２０年国債	100,000,000	116,561,000	
９４　２０年国債	106,000,000	124,845,740	
９５　２０年国債	103,000,000	123,861,620	
９６　２０年国債	97,000,000	114,308,680	
９７　２０年国債	81,000,000	96,574,680	
９８　２０年国債	130,000,000	153,357,100	
９９　２０年国債	205,000,000	242,057,850	
１００　２０年国債	142,000,000	169,448,600	
１０１　２０年国債	70,000,000	85,354,500	
１０２　２０年国債	80,000,000	97,610,400	
１０３　２０年国債	70,000,000	84,483,700	
１０４　２０年国債	95,000,000	112,288,100	
１０５　２０年国債	126,000,000	148,943,340	
１０６　２０年国債	105,000,000	125,526,450	
１０７　２０年国債	107,000,000	126,561,740	
１０８　２０年国債	138,000,000	159,585,960	
１０９　２０年国債	110,000,000	127,067,600	
１１０　２０年国債	120,000,000	141,920,400	
１１１　２０年国債	100,000,000	119,643,000	
１１２　２０年国債	162,000,000	191,560,140	
１１３　２０年国債	163,000,000	192,692,080	
１１４　２０年国債	140,000,000	165,442,200	
１１５　２０年国債	124,000,000	148,310,200	
１１６　２０年国債	89,000,000	106,412,850	
１１７　２０年国債	195,000,000	230,168,250	
１１８　２０年国債	59,000,000	68,788,100	
１１９　２０年国債	93,000,000	105,711,240	
１２０　２０年国債	133,000,000	147,302,820	
１２１　２０年国債	175,000,000	201,292,000	
１２２　２０年国債	95,000,000	107,869,650	
１２３　２０年国債	140,000,000	165,060,000	
１２４　２０年国債	140,000,000	162,964,200	
１２５　２０年国債	85,000,000	101,494,250	
１２６　２０年国債	70,000,000	81,461,800	
１２７　２０年国債	111,000,000	127,496,820	
１２８　２０年国債	119,000,000	136,529,890	
１２９　２０年国債	130,000,000	147,166,500	
１３０　２０年国債	110,000,000	124,353,900	

	１３１　２０年国債	150,000,000	167,265,000	
	１３２　２０年国債	72,000,000	80,156,880	
	１３３　２０年国債	194,000,000	218,994,960	
	１３４　２０年国債	50,000,000	56,354,000	
	１３５　２０年国債	92,000,000	102,247,880	
	１３６　２０年国債	128,000,000	140,253,440	
	１３７　２０年国債	85,000,000	94,303,250	
	１３８　２０年国債	102,000,000	109,858,080	
	１３９　２０年国債	85,000,000	92,958,550	
	１４０　２０年国債	280,000,000	310,080,400	
	１４１　２０年国債	170,000,000	187,904,400	
	１４２　２０年国債	111,000,000	124,575,300	
	１４３　２０年国債	180,000,000	195,642,000	
	１４４　２０年国債	113,000,000	120,987,970	
	１４５　２０年国債	278,000,000	306,286,500	
	１４６　２０年国債	250,000,000	274,862,500	
	１４７　２０年国債	255,000,000	275,292,900	
	１４８　２０年国債	276,000,000	292,405,440	
	１４９　２０年国債	270,000,000	285,535,800	
	１５０　２０年国債	270,000,000	279,981,900	
国債証券　合計			41,307,987,410	
地方債証券	６３５　東京都公債	100,000,000	103,016,700	
	６３９　東京都公債	100,000,000	103,196,600	
	６５１　東京都公債	100,000,000	104,402,900	
	６５４　東京都公債	104,000,000	108,829,032	
	６６５　東京都公債	100,000,000	105,431,300	
	６８８　東京都公債	100,000,000	104,546,300	
	７１３　東京都公債	100,000,000	103,591,300	
	２４－１　北海道公債	100,000,000	104,981,700	
	２４－６　北海道公債	100,000,000	103,852,900	
	１３９　神奈川県公債	100,000,000	102,429,600	
	１６３　神奈川県公債	100,000,000	105,812,300	
	３０８　大阪府公債	112,000,000	117,513,536	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	104,466,900	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	103,940,800	
	１７－７　静岡県公債	100,000,000	102,159,900	
	２０－６　愛知県公債	100,000,000	106,449,800	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	103,371,100	
	１７－２　広島県公債	100,000,000	101,669,800	

	２１－３　埼玉県公債	100,000,000	106,910,700	
	１９－８　福岡県公債	100,000,000	104,752,500	
	２１－２　千葉県公債	100,000,000	106,497,800	
	２１－６　千葉県公債	100,000,000	106,143,900	
	４１　共同発行地方	100,000,000	103,355,600	
	５１　共同発行地方	100,000,000	104,722,500	
	５４　共同発行地方	100,000,000	104,631,700	
	５７　共同発行地方	100,000,000	104,863,300	
	６１　共同発行地方	100,000,000	105,040,900	
	７６　共同発行地方	50,000,000	52,954,600	
	８１　共同発行地方	100,000,000	105,958,400	
	９０　共同発行地方	100,000,000	105,532,200	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	105,366,800	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	103,093,400	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	103,631,900	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	102,159,700	
	２３－２　島根県公債	100,000,000	105,450,600	
	１９－２　大阪市公債	100,000,000	104,363,300	
	２１－５　京都市公債	100,000,000	106,807,600	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	103,694,000	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	103,172,100	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	104,051,500	
	２１－３　広島市公債	100,000,000	106,037,600	
	２４－４　福井県公債	100,000,000	100,810,400	
	２２－１　岡山県公債	100,000,000	105,205,500	
地方債証券　合計			4,454,870,968	
特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	102,742,300	
	２７　日本政策投資Ｂ	100,000,000	103,435,100	
	１３　道路機構	100,000,000	102,887,700	
	１５　道路機構	100,000,000	103,525,700	
	２８　道路機構	100,000,000	104,693,800	
	３２　道路機構	100,000,000	104,961,100	
	６１　道路機構	100,000,000	105,707,100	
	８１　道路機構	100,000,000	105,048,500	
	３　政保道路機構	100,000,000	101,688,700	
	２３　政保道路機構	100,000,000	103,435,600	
	２７　政保道路機構	100,000,000	103,945,600	
	３０　政保道路機構	112,000,000	116,307,632	
	３３　政保道路機構	100,000,000	103,975,600	

	４７　政保道路機構	100,000,000	104,444,500	
	６４　政保道路機構	219,000,000	231,491,541	
	６６　政保道路機構	100,000,000	105,434,100	
	８６　政保道路機構	100,000,000	116,202,700	
	１１０　政保道路機構	100,000,000	106,444,000	
	１７３　政保道路機構	100,000,000	104,042,200	
	１７５　政保道路機構	100,000,000	103,812,200	
	１８６　政保道路機構	100,000,000	102,744,100	
	１９０　政保道路機構	100,000,000	102,136,700	
	８６８　政保公営企業	100,000,000	103,315,800	
	３　公営企業１５年	100,000,000	112,964,300	
	２　政保地方公営機	100,000,000	106,016,100	
	２９　地方公共団体	100,000,000	105,183,300	
	３３　地方公共団体	100,000,000	105,263,200	
	３９政保地方公共団	100,000,000	103,921,200	
	４８　地方公共団体	100,000,000	103,490,900	
	５１　地方公共団体	100,000,000	103,659,200	
	１９　公営企業	100,000,000	102,547,300	
	２４　公営企業	100,000,000	103,814,800	
	４　政保首都高速	100,000,000	104,664,100	
	２５　日本政策金融	100,000,000	104,987,300	
	２５　政保日本政策	100,000,000	103,945,600	
	２７　国際協力銀行	100,000,000	103,885,000	
	２　住宅支援機構	100,000,000	103,934,600	
	い７３６　利付商工債	100,000,000	100,579,800	
	い７４２　利付商工債	100,000,000	100,607,600	
	い７３６　利付農林債	100,000,000	100,628,600	
	い７４９　利付農林債	100,000,000	100,384,300	
	２５７　信金中金	100,000,000	100,829,100	
	２７２　信金中金	100,000,000	100,515,700	
	２４　政保中日本道	100,000,000	105,047,500	
	５　中日本高速道路	100,000,000	106,477,800	
特殊債券　合計			4,825,769,573	
社債券	１０　首都高速道路	100,000,000	100,634,200	
	２６　ＧＥキヤピタル	100,000,000	100,168,700	
	１７　シテイグループ・インク	100,000,000	107,632,300	
	８ドイツ銀行ＡＧロンドン	100,000,000	100,145,400	
	８　ウエストパツクＢＫ	100,000,000	101,326,400	
	１４　武田薬品	100,000,000	101,506,200	

１　富士フイルムホールデイ	100,000,000	100,605,300	
４　ＪＸホールデイングス	100,000,000	105,145,200	
２４　太平洋セメント	100,000,000	100,213,800	
１５　ダイキン工業	100,000,000	102,152,200	
５９　東芝	100,000,000	101,122,000	
１　明治安田２０１１基	100,000,000	101,256,300	
１フコク生命２０１１基金	100,000,000	101,127,200	
１　明治安田２０１３基	100,000,000	101,559,800	
５２　日産自動車	100,000,000	102,481,600	
２３　丸井グループ	100,000,000	100,290,500	
１　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後	100,000,000	101,928,900	
２９　みずほコーポレート	100,000,000	100,686,800	
２０　東京三菱銀行	100,000,000	113,125,500	
４　りそな銀行劣後	100,000,000	111,030,900	
９三菱ＵＦＪ信託ＢＫ劣	100,000,000	108,128,500	
１１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ	100,000,000	106,404,600	
２０　三井住友ＢＫ劣	100,000,000	108,866,500	
４６　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	100,171,200	
１９　ホンダファイナンス	100,000,000	100,666,400	
１５　トヨタファイナンス	100,000,000	108,956,900	
１４８　オリックス	100,000,000	102,369,900	
１６４　オリックス	100,000,000	103,909,100	
１５　三菱ＵＦＪリース	100,000,000	101,086,200	
９９　三菱地所	100,000,000	100,709,300	
８１　住友不動産	100,000,000	100,745,300	
９　ジヤパンリアルエステイト	100,000,000	100,995,900	
６　日本リテールファンド	100,000,000	104,772,300	
６２東日本旅客鉄道	100,000,000	105,952,900	
７２東日本旅客鉄道	100,000,000	106,356,800	
１８　西日本旅客鉄	100,000,000	106,277,300	
２８　東海旅客鉄道	100,000,000	103,696,100	
１５　ＮＴＴドコモ	100,000,000	106,498,000	
４７４　中部電力	100,000,000	102,000,900	
４４０　関西電力	100,000,000	102,649,000	
４７２　関西電力	100,000,000	105,550,300	
３０６　中国電力	100,000,000	106,513,500	
２６０　北陸電力	100,000,000	110,874,600	
４２３　九州電力	100,000,000	102,949,900	
２６１　北海道電力	6,000,000	6,440,820	

	１６　電源開発	100,000,000	102,808,400	
	２２　大阪瓦斯	100,000,000	103,467,200	
	３０　大阪瓦斯	100,000,000	103,019,500	
	２１　ＮＴＴデータ	100,000,000	104,890,200	
社債券　合計			4,981,866,720	
合計			55,570,494,671	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	375,670,412	367,768,273
コール・ローン	88,717,185	174,358,106
株式	68,704,604,857	79,586,702,051
投資証券	1,285,490,167	1,770,589,177
派生商品評価勘定	56,032,119	55,099,570
未収入金	113,068,410	181,218,640
未収配当金	145,166,997	166,780,182
差入委託証拠金	366,524,021	467,893,794
流動資産合計	71,135,274,168	82,770,409,793
資産合計	71,135,274,168	82,770,409,793
負債の部		
流動負債		
未払金	131,434,776	124,072,094
未払解約金	76,013,000	98,009,000
流動負債合計	207,447,776	222,081,094
負債合計	207,447,776	222,081,094
純資産の部		

元本等		
元本 ※1	45,154,967,328	41,132,911,173
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	25,772,859,064	41,415,417,526
元本等合計	70,927,826,392	82,548,328,699
純資産合計	70,927,826,392	82,548,328,699
負債純資産合計	71,135,274,168	82,770,409,793

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25年12月3日 至　平成26年12月1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)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。 (3)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。
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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．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。
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 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1．※1　期首	平成24年12月1日	平成25年12月3日
期首元本額	52,149,765,179円	45,154,967,328円
期中追加設定元本額	3,253,018,981円	4,725,445,886円
期中一部解約元本額	10,247,816,832円	8,747,502,041円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	1,605,006,432円	1,383,886,041円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	66,995,414円	54,756,014円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,033,816,510円	788,475,397円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	113,584,754円	84,782,895円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	3,393,678,544円	2,517,272,111円
Ｄ－Ｉ'ｓ 外国株式インデックス	－円	1,016,437円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	18,257,075,654円	19,723,084,767円
ダイワ・ライフ・バランス３０	472,066,159円	416,195,911円
ダイワ・ライフ・バランス５０	570,470,732円	576,945,877円
ダイワ・ライフ・バランス７０	397,841,571円	408,822,495円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,486,936,648円	1,483,061,731円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	6,057,627円	6,387,347円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,826,407円	9,042,059円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,816,460円	1,975,715円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	73,963,497円	5,292,603円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	1,095,520,546円	33,254,133円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	26,193,381円	20,450,186円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	263,796,998円	180,456,110円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	3,743,890,317円	2,753,767,299円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	967,150,564円	672,292,970円

ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	8,065,624,155円	6,477,886,541円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	378,415,789円	285,356,632円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	656,443円	119,574,236円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,990,153,059円	2,997,102,584円
ダイワライフスタイル２５	20,421,767円	19,135,198円
ダイワライフスタイル５０	64,401,059円	63,867,711円
ダイワライフスタイル７５	51,606,841円	48,770,173円
計	45,154,967,328円	41,132,911,173円
2. 期末日における受益権の総数	45,154,967,328口	41,132,911,173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25年12月3日 至 平成26年12月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、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。

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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成26年12月1日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	平成25年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成26年12月1日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	12,981,968,983	7,309,939,986
投資証券	△5,699,776	310,108,267
合計	12,976,269,207	7,620,048,253

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成25年12月2日まで、及び平成25年12月3日から平成26年12月1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25年12月2日 現在				平成26年12月1日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち	(円)	(円)	(円)	うち	(円)	(円)

		1年超				1年超		
市場取引 株価指数 先物取引 買　建	868,027,901	－	924,060,020	56,032,119	1,111,796,862	－	1,166,896,432	55,099,570
合計	868,027,901	－	924,060,020	56,032,119	1,111,796,862	－	1,166,896,432	55,099,570

（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。
原則として期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、期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期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。

（1口当たり情報）

	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5708円 (15,708円)	2.0069円 (20,069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	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,200	177.090	212,508.000	
	AVON PRODUCTS	10,700	9.780	104,646.000	
	ABBOTT LABS	32,900	44.510	1,464,379.000	
	ALCOA	25,700	17.290	444,353.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	3,300	61.980	204,534.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	9,200	63.690	585,948.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,900	53.630	370,047.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,329	61.190	387,271.510	
	AFLAC INC	10,100	59.730	603,273.000	

DARDEN RESTAURANTS INC	2,900	56.990	165,271.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	3,200	112.150	358,880.000	
ADOBE SYSTEMS	10,400	73.680	766,272.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,100	268.150	294,965.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	48.190	120,475.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,800	14.780	100,504.000	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	29.370	58,740.000	
GARMIN LTD	2,600	57.300	148,980.000	
AETNA INC	7,979	87.240	696,087.960	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	4,700	143.830	676,001.000	
ALTERA CORPORATION	7,200	37.620	270,864.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL	16,500	99.070	1,634,655.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,751	32.990	123,745.490	
WR BERKLEY CORP	2,400	52.240	125,376.000	
AUTOZONE INC	700	577.710	404,397.000	
DOLLAR TREE INC	4,700	68.360	321,292.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,400	63.230	151,752.000	
CELANESE CORP-SERIES A	3,600	60.070	216,252.000	
D.R.HORTON INC	6,566	25.490	167,367.340	
CONTINENTAL RESOURCES	2,100	40.980	86,058.000	
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,300	54.980	181,434.000	
AUTODESK INC	5,200	62.000	322,400.000	
MOODY'S CORP	4,400	101.010	444,444.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	8,500	58.970	501,245.000	
ALBEMARLE CORP	2,200	59.040	129,888.000	
CONSOL ENERGY INC	5,400	39.130	211,302.000	
ALLIANT ENERGY CORP	2,500	62.870	157,175.000	
CITIGROUP INC	66,123	53.970	3,568,658.310	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,600	85.640	907,784.000	
AMERICAN ELEC POWER	11,100	57.550	638,805.000	
NETSUITE INC	600	105.750	63,450.000	
ALLEGHANY CORP	400	456.540	182,616.000	
DUN&BRADSTREET CORP	900	126.950	114,255.000	
HESS CORP	6,400	72.930	466,752.000	
COVIDIEN PLC	9,925	101.000	1,002,425.000	
DAVITA HEALTHCAR	3,800	76.530	290,814.000	
DANAHER CORP	14,000	83.560	1,169,840.000	
AVNET INC	3,400	43.790	148,886.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE	2,570	225.990	580,794.300	

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,800	72.490	275,462.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,300	52.680	753,324.000	
BUNGE LIMITED	3,300	90.770	299,541.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,325	64.200	598,665.000	
APPLE INC	131,100	118.930	15,591,723.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	10,200	65.550	668,610.000	
BOEING CO	14,900	134.360	2,001,964.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,515	50.950	179,089.250	
MEADWESTVACO CORP	3,800	44.800	170,240.000	
SPECTRA ENERGY CORP	14,696	37.880	556,684.480	
BECTON DICKINSON & CO	4,300	140.330	603,419.000	
NISOURCE INC	7,100	41.840	297,064.000	
JOY GLOBAL INC	2,700	49.040	132,408.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	3,400	73.740	250,716.000	
BARD(C.R.) INC	1,700	167.350	284,495.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	25,071	40.030	1,003,592.130	
VERIZON COMMUNICATIONS	90,254	50.590	4,565,949.860	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,900	148.690	3,702,381.000	
ANSYS INC	2,100	83.520	175,392.000	
H&R BLOCK INC	6,200	33.640	208,568.000	
BB&T CORPORATION	16,200	37.590	608,958.000	
HOSPIRA INC	3,620	59.640	215,896.800	
BROADCOM CORP-CL A	11,650	43.130	502,464.500	
BAKER HUGHES INC	9,723	57.000	554,211.000	
BRISTOL MYERS SQUIBB	36,400	59.050	2,149,420.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,400	130.020	182,028.000	
JPMORGAN CHASE & CO	82,720	60.160	4,976,435.200	
LEGG MASON INC	2,650	56.750	150,387.500	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,900	83.470	492,473.000	
CIGNA CORP	5,900	102.890	607,051.000	
LKQ CORP	6,800	29.050	197,540.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	3,400	63.380	215,492.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,300	97.920	127,296.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS	22,142	7.050	156,101.100	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,700	97.050	262,035.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,160	131.770	548,163.200	
DOLLAR GENERAL CORP	7,000	66.740	467,180.000	
SERVICENOW INC	3,000	63.960	191,880.000	
CATERPILLAR INC DEL	13,300	100.600	1,337,980.000	

GENWORTH FINANCIAL INC-A	11,400	9.090	103,626.000	
CMS ENERGY CORP	6,000	33.100	198,600.000	
HERBALIFE LTD	2,200	43.250	95,150.000	
MOSAIC CO/THE	7,300	45.770	334,121.000	
DELTA AIR LINES INC	4,400	46.670	205,348.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4,600	103.840	477,664.000	
CORNING INC	29,400	21.020	617,988.000	
CISCO SYSTEMS	113,100	27.640	3,126,084.000	
DU PONT	19,700	71.400	1,406,580.000	
MORGAN STANLEY	31,700	35.180	1,115,206.000	
DOW CHEMICAL	25,700	48.670	1,250,819.000	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	5,600	93.400	523,040.000	
ENSCO PLC-CL A	5,500	33.800	185,900.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,300	50.610	116,403.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,000	81.460	325,840.000	
AGCO CORP	2,500	42.190	105,475.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	12,800	72.550	928,640.000	
DENBURY RESOURCES INC	8,700	8.260	71,862.000	
DEERE & CO	7,700	86.620	666,974.000	
AIRGAS INC	1,500	115.630	173,445.000	
QUANTA SERVICES INC	4,900	30.500	149,450.000	
TIME WARNER INC	18,433	85.120	1,569,016.960	
VMWARE INC-CLASS A	1,900	87.960	167,124.000	
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	32.320	119,584.000	
NASDAQ OMX GROUP	2,700	44.910	121,257.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,200	63.600	76,320.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	6,600	63.150	416,790.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,900	83.360	241,744.000	
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,100	82.530	173,313.000	
COLGATE PALMOLIVE CO	20,100	69.590	1,398,759.000	
AMETEK INC	5,625	50.960	286,650.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,100	76.710	237,801.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,600	78.860	757,056.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	9,800	142.120	1,392,776.000	
SCANA CORP	3,100	57.030	176,793.000	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	2,800	142.140	397,992.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,200	203.590	244,308.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	700	663.620	464,534.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,300	23.130	168,849.000	

CUMMINS INC	3,900	145.620	567,918.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,900	21.650	235,985.000	
HANESBRANDS INC	2,100	115.720	243,012.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS	7,000	26.220	183,540.000	
LORILLARD INC	8,200	63.140	517,748.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	197.790	217,569.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	2,800	121.670	340,676.000	
NIELSEN NV	7,000	41.770	292,390.000	
KINDER MORGAN INC	21,081	41.350	871,699.350	
HCA HOLDINGS INC	6,800	69.690	473,892.000	
CABOT OIL & GAS CORP	9,600	33.040	317,184.000	
T-MOBILE US INC	5,650	29.190	164,923.500	
COCA COLA CO	86,400	44.830	3,873,312.000	
COCA-COLA ENTERPRISES	5,600	43.940	246,064.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,400	46.820	206,008.000	
EATON VANCE CORP	3,700	41.790	154,623.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	5,300	47.770	253,181.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,300	56.860	528,798.000	
CSX CORP	22,700	36.490	828,323.000	
FLUOR CORP	3,700	61.990	229,363.000	
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,000	104.640	209,280.000	
EXPEDIA INC	2,375	87.110	206,886.250	
AUTOLIV INC	2,200	98.960	217,712.000	
AMAZON.COM INC	8,700	338.640	2,946,168.000	
FLOWSERVE CORP	3,200	58.870	188,384.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,300	129.680	298,264.000	
EXXON MOBIL CORP	93,255	90.540	8,443,307.700	
EQUINIX INC	1,128	227.170	256,247.760	
FLIR SYSTEMS INC	3,100	31.730	98,363.000	
AES CORP	15,700	13.870	217,759.000	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,000	124.600	249,200.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,100	175.390	192,929.000	
EOG RESOURCES INC	12,000	86.720	1,040,640.000	
EQUITABLE RESOURCES INC	3,500	90.980	318,430.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	3,900	64.610	251,979.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,900	91.050	446,145.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,290	42.740	311,574.600	
FORD MOTOR CO	80,823	15.730	1,271,345.790	
MACY'S INC	7,898	64.910	512,659.180	

DISCOVERY COMMUNICATION-A	3,440	34.900	120,056.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	51.990	254,075.130	
LIBERTY MEDIA CORP	2,100	36.770	77,217.000	
DISCOVERY COMMUNICATION-C	6,620	34.010	225,146.200	
FOSSIL INC	1,300	111.720	145,236.000	
NEXTERA ENERGY INC	9,600	104.390	1,002,144.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	23,508	26.850	631,189.800	
US BANCORP	40,100	44.200	1,772,420.000	
UNITED RENTALS INC	2,200	113.310	249,282.000	
FAMILY DOLLAR STORES	2,300	79.050	181,815.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	129.190	206,704.000	
FASTENAL CO	6,400	45.200	289,280.000	
FISERV INC	5,600	71.490	400,344.000	
GENERAL ELECTRIC CO	220,200	26.490	5,833,098.000	
GENERAL MOTORS CO	28,200	33.430	942,726.000	
TRIPADVISOR INC	2,700	73.650	198,855.000	
LINKEDIN CORP-A	2,400	226.270	543,048.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,200	145.360	901,232.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,600	188.410	1,620,326.000	
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,000	37.810	113,430.000	
GOOGLE INC-CL A	6,200	549.080	3,404,296.000	
GOOGLE INC-CL C	6,300	541.830	3,413,529.000	
GENERAL MILLS INC	13,800	52.750	727,950.000	
FIRSTENERGY CORP	9,368	36.880	345,491.840	
GENUINE PARTS CO	3,500	102.780	359,730.000	
FIFTH THIRD BANCORP	18,600	20.120	374,232.000	
HARRIS CORP	2,400	71.670	172,008.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP	4,200	48.530	203,826.000	
HALLIBURTON CO	18,600	42.200	784,920.000	
HOME DEPOT INC	29,400	99.400	2,922,360.000	
ASSURANT INC	1,600	67.590	108,144.000	
HERSHEY CO/THE	3,500	100.280	350,980.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,800	69.680	334,464.000	
HUMANA INC	3,400	137.970	469,098.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	4,300	79.000	339,700.000	
HELMERICH & PAYNE	2,500	69.550	173,875.000	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	13,600	10.110	137,496.000	
HENRY SCHEIN INC	2,000	137.200	274,400.000	
HEWLETT-PACKARD CO	40,200	39.060	1,570,212.000	

DIRECTV	10,682	87.710	936,918.220	
HOLLYFRONTIER CORP	4,300	40.820	175,526.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,200	57.320	183,424.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	20,600	162.170	3,340,702.000	
INTERNATIONAL PAPER	9,100	53.820	489,762.000	
ZOETIS INC	10,900	44.930	489,737.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	6,229	63.060	392,800.740	
CHENIERE ENERGY INC	5,000	65.990	329,950.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,100	42.090	130,479.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	11,923	49.920	595,196.160	
JUNIPER NETWORKS INC	9,500	22.160	210,520.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	2,400	102.570	246,168.000	
JOHNSON & JOHNSON	62,100	108.250	6,722,325.000	
ABBVIE INC	35,000	69.200	2,422,000.000	
HOLOGIC INC	5,100	26.800	136,680.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	8,300	116.590	967,697.000	
KROGER CO	10,600	59.840	634,304.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	3,600	69.440	249,984.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	5,900	191.560	1,130,204.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,700	151.890	258,213.000	
L BRANDS INC	5,700	80.900	461,130.000	
LOWE'S COS INC	21,600	63.830	1,378,728.000	
ELI LILLY & CO	21,700	68.120	1,478,204.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	4,100	50.000	205,000.000	
LAM RESEARCH CORP	3,600	82.640	297,504.000	
RANGE RESOURCES CORP	3,700	65.650	242,905.000	
LOEWS CORP	8,000	41.640	333,120.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,749	56.630	325,565.870	
MCDONALD'S CORP	21,700	96.810	2,100,777.000	
3M CO	13,300	160.090	2,129,197.000	
FACEBOOK INC-A	43,100	77.700	3,348,870.000	
MANPOWER INC	2,000	66.860	133,720.000	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,000	93.460	560,760.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	120.040	156,052.000	
CONCHO RESOURCES INC	2,400	95.250	228,600.000	
PHILLIPS 66	12,400	73.020	905,448.000	
MURPHY OIL CORP	4,000	48.420	193,680.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	8,900	22.810	203,009.000	
MATTEL INC	7,900	31.550	249,245.000	

MCCORMICK & CO-NON VTG SH	2,800	74.330	208,124.000	
MYLAN INC	8,100	58.610	474,741.000	
METLIFE INC	21,000	55.610	1,167,810.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	8,400	14.320	120,288.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,028	65.720	330,440.160	
MONSANTO CO	11,506	119.910	1,379,684.460	
METTLER-TOLEDO INTER	700	293.260	205,282.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,000	115.410	346,230.000	
MERCK & CO INC	63,321	60.400	3,824,588.400	
MASCO CORP	8,100	24.200	196,020.000	
M & T BANK CORP	2,700	126.020	340,254.000	
MARSH & MCLENNAN COS	12,000	56.590	679,080.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	5,382	78.790	424,047.780	
WORKDAY INC-CLASS A	2,200	87.050	191,510.000	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4,700	76.710	360,537.000	
TOWERS WATSON & CO-CL A	1,500	112.960	169,440.000	
VANTIV INC - CL A	3,300	33.740	111,342.000	
FIREEYE INC	1,200	30.290	36,348.000	
REALOGY HOLDINGS CORP	3,600	46.020	165,672.000	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	1,200	102.690	123,228.000	
NETAPP INC	7,300	42.550	310,615.000	
NIKE INC -CL B	15,400	99.290	1,529,066.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,000	111.640	781,480.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,500	45.150	203,175.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL	3,000	56.300	168,900.000	
ALLY FINANCIAL INC	6,000	23.780	142,680.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,300	140.930	605,999.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	6,800	72.950	496,060.000	
NEWMONT MINIG CORP	11,200	18.400	206,080.000	
KRAFT FOODS GROUP INC	13,303	60.170	800,441.510	
ADT CORP/THE	3,962	34.940	138,432.280	
MCKESSON CORP	5,200	210.760	1,095,952.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,600	29.570	195,162.000	
XYLEM INC	4,200	38.340	161,028.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	34,200	86.930	2,973,006.000	
NUCOR CORP	7,200	53.630	386,136.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	6,000	13.120	78,720.000	
WESTERN UNION CO	12,546	18.580	233,104.680	
NEWELL RUBBERMAID INC	6,000	36.310	217,860.000	

OCCIDENTAL PETROLEUM	17,400	79.770	1,387,998.000	
OMNICARE INC	2,200	70.320	154,704.000	
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,500	36.530	164,385.000	
PAYCHEX INC	7,200	47.410	341,352.000	
PATTERSON COS INC	2,300	48.180	110,814.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,400	182.740	438,576.000	
ALTRIA GROUP INC	43,700	50.260	2,196,362.000	
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	25.640	117,944.000	
PG & E CORPORATION	10,200	50.500	515,100.000	
PFIZER INC	138,463	31.150	4,313,122.450	
XCEL ENERGY INC	11,200	33.940	380,128.000	
STRYKER CORP	7,500	92.910	696,825.000	
PARKER HANNIFIN CORP	3,400	129.030	438,702.000	
PALL CORP	2,400	96.110	230,664.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	143.230	458,336.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,400	156.710	219,394.000	
PROCTER & GAMBLE CO	59,237	90.430	5,356,801.910	
EXELON CORP	18,822	36.170	680,791.740	
ALEXION PHARMACEUTICALS	4,300	194.900	838,070.000	
CONOCOPHILLIPS	27,000	66.070	1,783,890.000	
PEPSICO INC	32,800	100.100	3,283,280.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,200	84.980	866,796.000	
AMERICAN WATER WORKS CO	4,100	53.050	217,505.000	
ACCENTURE LTD-CL A	13,900	86.330	1,199,987.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,700	50.050	135,135.000	
PENTAIR PLC	4,305	64.710	278,576.550	
QUALCOMM INC	36,500	72.900	2,660,850.000	
PARTNERRE LTD	1,000	116.510	116,510.000	
INVESCO LTD	9,550	40.360	385,438.000	
ADVANCE AUTO PARTS	1,650	147.080	242,682.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,600	53.270	351,582.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	4,200	24.520	102,984.000	
ENERGEN CORP	2,000	59.720	119,440.000	
RAYTHEON CO	6,900	106.700	736,230.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	1,800	78.170	140,706.000	
RED HAT INC	4,200	62.150	261,030.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,700	416.110	707,387.000	
REPUBLIC SERVICES INC	6,600	39.610	261,426.000	
PRICELINE.COM INC	1,100	1,160.190	1,276,209.000	

ROSS STORES INC	4,900	91.480	448,252.000	
QEP RESOURCES INC	4,400	20.440	89,936.000	
RESMED INC	3,200	53.200	170,240.000	
QUEST DIAGNOSTICS	3,300	65.310	215,523.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,100	56.790	176,049.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	7,200	65.910	474,552.000	
RALPH LAUREN CORP	1,400	184.900	258,860.000	
AUTONATION INC	1,700	59.440	101,048.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	2,700	85.530	230,931.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,635	10.070	308,494.450	
CHEVRON CORP	41,618	108.870	4,530,951.660	
EDISON INTERNATIONAL	7,100	63.560	451,276.000	
TESLA MOTORS INC	1,900	244.520	464,588.000	
SYMANTEC CORP	15,700	26.090	409,613.000	
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,300	73.170	241,461.000	
STANLEY BLACK & DECKER IN	3,322	94.440	313,729.680	
SYNOPSYS INC	3,400	43.390	147,526.000	
CHARTER COMMUNICATION-A	1,700	169.700	288,490.000	
CBRE GROUP INC	7,000	33.740	236,180.000	
TWITTER INC	7,100	41.740	296,354.000	
COBALT INT'L ENERGY	7,200	9.000	64,800.000	
NAVIENT CORP	9,800	20.960	205,408.000	
SANDISK CORP	5,100	103.460	527,646.000	
SOUTHERN CO	19,800	47.430	939,114.000	
SYSCO CORP	13,200	40.260	531,432.000	
PHARMACYCLICS INC	1,500	139.390	209,085.000	
TRAVELERS COS INC	7,323	104.450	764,887.350	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7,900	32.180	254,222.000	
SPX CORP	1,100	89.690	98,659.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,200	39.630	126,816.000	
STERICYCLE INC	1,900	128.920	244,948.000	
SCHLUMBERGER LTD	28,167	85.950	2,420,953.650	
SENSATA TECHNOLOGIES	3,500	49.570	173,495.000	
RACKSPACE HOSTING INC	2,700	45.910	123,957.000	
AT&T INC	113,795	35.380	4,026,067.100	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,800	41.820	158,916.000	
SIGMA-ALDRICH	2,600	136.600	355,160.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,900	244.860	465,234.000	
SEMPRA ENERGY	5,300	111.730	592,169.000	

TIFFANY & CO	3,000	107.920	323,760.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,400	66.110	489,214.000	
TEXAS INSTRUMENT INC	23,000	54.420	1,251,660.000	
SALESFORCE.COM INC	12,800	59.870	766,336.000	
SUPERIOR ENERGY SERVICES	4,200	19.310	81,102.000	
TRW AUTOMOTIVE	2,500	103.400	258,500.000	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	3,400	56.810	193,154.000	
TIME WARNER CABLE	6,053	149.280	903,591.840	
TYCO INTERNATIONAL PLC	9,525	42.900	408,622.500	
TESORO CORP	2,800	76.620	214,536.000	
UNION PACIFIC CORP	19,500	116.770	2,277,015.000	
MARATHON OIL CORP	15,100	28.920	436,692.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	6,500	90.090	585,585.000	
UNITED TECHNOLOGIES	19,200	110.080	2,113,536.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	15,300	109.920	1,681,776.000	
UNUM GROUP	5,900	33.220	195,998.000	
SPRINT CORP	17,765	5.120	90,956.800	
QUINTILES TRANSNATIONAL	1,200	57.820	69,384.000	
VOYA FINANCIAL INC	4,000	41.880	167,520.000	
AMEREN CORPORATION	5,500	43.110	237,105.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,526	98.630	2,123,109.380	
VERISIGN INC	2,800	60.100	168,280.000	
VALERO ENERGY CORP	11,692	48.610	568,348.120	
ULTA SALON COSME	1,400	126.490	177,086.000	
FNF GROUP	5,638	32.400	182,671.200	
UNIVERSAL HEALTH SVC-B	2,000	104.620	209,240.000	
WEYERHAEUSER CO	11,894	35.310	419,977.140	
WELLPOINT INC	5,900	127.910	754,669.000	
THE WALT DISNEY CO.	35,600	92.510	3,293,356.000	
WELLS FARGO & CO	109,172	54.480	5,947,690.560	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	1,800	72.840	131,112.000	
WASTE MANAGEMENT INC	9,700	48.730	472,681.000	
WILLIAMS COMPANY	15,700	51.750	812,475.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	76.930	246,176.000	
WHITING PETROLEUM CORP	2,700	41.770	112,779.000	
WHIRLPOOL CORP	1,800	186.170	335,106.000	
WAL-MART STORES	35,600	87.540	3,116,424.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	3,700	112.290	415,473.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	16,800	13.100	220,080.000	

WYNN RESORTS LTD	1,800	178.610	321,498.000	
XEROX CORP	24,644	13.960	344,030.240	
TJX COMPANIES INC	15,000	66.160	992,400.000	
WATERS CORP	2,000	115.900	231,800.000	
UNITED CONTINENTAL HLDS	2,200	61.230	134,706.000	
ACTAVIS INC	5,750	270.610	1,556,007.500	
WHOLE FOODS MARKET INC	8,500	49.030	416,755.000	
WALGREEN CO	20,300	68.610	1,392,783.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	3,800	42.710	162,298.000	
WESTERN DIGITAL CORP	4,900	103.270	506,023.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	5,100	49.400	251,940.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	11,500	41.780	480,470.000	
VISA INC-CLASS A SHS	10,800	258.190	2,788,452.000	
PPL CORPORATION	14,300	35.530	508,079.000	
PEPCO HOLDINGS INC	5,600	27.500	154,000.000	
PULTE GROUP INC	8,200	21.630	177,366.000	
PPG INDUSTRIES INC	3,100	218.820	678,342.000	
NORTHERN TRUST CORP	4,900	67.730	331,877.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	3,200	237.900	761,280.000	
NVIDIA CORP	12,750	20.970	267,367.500	
PNC FINANCIAL SERVICES	11,893	87.470	1,040,280.710	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	10,350	29.150	301,702.500	
TERADATA CORP	3,500	45.140	157,990.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,000	42.340	296,380.000	
NETFLIX.COM INC	1,300	346.590	450,567.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	8,600	129.290	1,111,894.000	
NRG ENERGY INC	7,700	31.260	240,702.000	
TORCHMARK CORP	2,975	53.750	159,906.250	
FIRST REPUBLIC BANK	3,000	51.530	154,590.000	
TEXTRON INC	6,300	43.320	272,916.000	
TWENTY-FIRST CENTURY-A	30,450	36.800	1,120,560.000	
TWENTY-FIRST CENTURY-B	9,600	35.360	339,456.000	
NEWS CORP - CLASS A	8,337	15.520	129,390.240	
OGE ENERGY CORP	4,700	35.690	167,743.000	
OMNICOM GROUP	5,700	77.270	440,439.000	
ORACLE CORPORATION	78,883	42.410	3,345,428.030	
MASTERCARD INC-CLASS A	22,200	87.290	1,937,838.000	
ONEOK INC	4,600	54.160	249,136.000	
OCEANEERING INTL INC	2,500	62.710	156,775.000	

CENTURYLINK INC	12,695	40.770	517,575.150	
ROPER INDUSTRIES INC	2,300	157.820	362,986.000	
YUM! BRANDS INC	10,000	77.250	772,500.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,200	285.870	343,044.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	3,500	77.350	270,725.000	
NOBLE ENERGY INC	8,200	49.180	403,276.000	
BANK OF AMERICA CORP	230,201	17.040	3,922,625.040	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL	3,400	89.720	305,048.000	
NORDSTROM INC	3,200	76.360	244,352.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,900	92.420	1,931,578.000	
ANALOG DEVICES INC	7,000	54.640	382,480.000	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,000	34.610	207,660.000	
AMERICAN INTL GROUP	30,972	54.800	1,697,265.600	
ASHLAND INC	1,600	114.050	182,480.000	
ANADARKO PETROLEUM CORP	11,300	79.150	894,395.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,900	67.470	263,133.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,600	73.740	265,464.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	14,800	9.790	144,892.000	
MALLINCKRODT PLC	2,500	92.220	230,550.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	49.510	148,530.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	13,300	53.990	718,067.000	
EMERSON ELECTRIC CO	15,500	63.750	988,125.000	
AON CORP	6,200	92.490	573,438.000	
AMGEN	16,700	165.310	2,760,677.000	
CORE LABORATORIES N.V.	1,000	128.830	128,830.000	
ALLERGAN INC	6,600	213.890	1,411,674.000	
COACH INC	6,400	37.120	237,568.000	
EATON CORP PLC	10,486	67.830	711,265.380	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,500	83.090	623,175.000	
CELGENE CORP	17,600	113.690	2,000,944.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	3,700	96.400	356,680.000	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	24.050	654,160.000	
CIT GROUP INC	4,300	48.800	209,840.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,000	104.950	209,900.000	
CME GROUP INC	7,000	84.640	592,480.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	9,344	67.040	626,421.760	
ECOLAB INC	6,100	108.950	664,595.000	
EQUIFAX INC	2,800	79.550	222,740.000	
GAP INC	5,400	39.600	213,840.000	

GILEAD SCIENCES INC	33,000	100.320	3,310,560.000	
ST JUDE MEDICAL INC	6,200	67.960	421,352.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	4,548	74.000	336,552.000	
HORMEL FOODS CORP	3,200	53.080	169,856.000	
SAFEWAY INC	5,100	34.840	177,684.000	
STATE STREET CORP	9,443	76.730	724,561.390	
STAPLES INC	14,700	14.060	206,682.000	
SUNTRUST BANKS INC	11,648	39.290	457,649.920	
SCHWAB(CHARLES) CORP	26,400	28.320	747,648.000	
IHS INC-CLASS A	1,500	122.460	183,690.000	
BAXTER INTL INC	12,100	73.000	883,300.000	
B/E AEROSPACE INC	2,300	77.870	179,101.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,600	45.280	208,288.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,100	49.500	153,450.000	
CHUBB CORP	5,500	103.050	566,775.000	
CARDINAL HEALTH INC	7,500	82.190	616,425.000	
CAREFUSION CORP	4,750	59.170	281,057.500	
FEDEX CORP	5,900	178.180	1,051,262.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,554	83.200	1,044,492.800	
FMC CORP	3,100	54.400	168,640.000	
FLEXTRONICS INTL LTD	13,300	11.090	147,497.000	
CERNER CORP	7,000	64.400	450,800.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,800	101.170	182,106.000	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	66.310	245,347.000	
INTEL CORP	108,700	37.250	4,049,075.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	4,500	51.280	230,760.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	9,600	20.290	194,784.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	9,900	41.300	408,870.000	
CREE INC	2,800	36.340	101,752.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	8,300	94.930	787,919.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	55,300	3.630	200,739.000	
ILLUMINA INC	2,900	190.890	553,581.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,900	20.260	241,094.000	
SEALED AIR CORP	4,400	39.530	173,932.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	800	517.770	414,216.000	
CALPINE CORP	8,200	22.960	188,272.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	20.320	123,952.000	
CARMAX INC	4,900	56.980	279,202.000	
COMERICA INC	4,000	46.610	186,440.000	

CHICAGO BRIDGE & IRON CO	2,300	50.030	115,069.000	
DUKE ENERGY CORP	15,828	80.900	1,280,485.200	
TARGET CORP	13,600	74.000	1,006,400.000	
DOVER CORP	3,700	76.990	284,863.000	
WW GRAINGER INC	1,400	245.680	343,952.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,000	46.450	139,350.000	
JOHNSON CONTROLS INC	14,800	50.000	740,000.000	
CINTAS CORP	2,300	73.150	168,245.000	
CA INC	7,605	31.150	236,895.750	
CONAGRA INC	9,600	36.520	350,592.000	
CLOROX COMPANY	2,800	101.620	284,536.000	
ENTERGY CORP	4,000	83.900	335,600.000	
MICROSOFT CORP	171,000	47.810	8,175,510.000	
CVS HEALTH CORP	25,074	91.360	2,290,760.640	
MEDTRONIC INC	21,100	73.870	1,558,657.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	24,200	35.950	869,990.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	2,900	359.080	1,041,332.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,100	23.940	217,854.000	
HASBRO INC	2,600	59.200	153,920.000	
KELLOGG CO	5,900	66.250	390,875.000	
KEYCORP	20,200	13.500	272,700.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,400	118.940	285,456.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL IN	36,411	39.200	1,427,311.200	
KOHLS CORP	4,600	59.620	274,252.000	
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	10,000	15.890	158,900.000	
APACHE CORP	8,610	64.090	551,814.900	
ACE LTD	7,400	114.340	846,116.000	
ARROW ELECTRONICS INC	2,300	58.440	134,412.000	
ALLSTATE CORP	9,700	68.150	661,055.000	
EBAY INC	24,500	54.880	1,344,560.000	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,500	82.920	290,220.000	
XILINX INC	6,200	45.440	281,728.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	16,310	83.150	1,356,176.500	
DISH NETWORK CORP	5,000	79.410	397,050.000	
YAHOO! INC	21,000	51.740	1,086,540.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	5,200	74.140	385,528.000	
TOLL BROTHERS INC	3,800	34.990	132,962.000	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,000	28.125	168,750.000	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,300	46.030	243,959.000	

	LENNAR CORP	3,900	47.240	184,236.000	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,800	23.740	232,652.000	
	NOBLE CORP PLC	6,000	17.990	107,940.000	
	PROGRESSIVE CORP	13,000	27.240	354,120.000	
	PRAXAIR INC	6,400	128.380	821,632.000	
	PACCAR INC	8,037	67.020	538,639.740	
	PETSMART INC	2,100	78.760	165,396.000	
	PVH CORP	1,900	127.140	241,566.000	
	EMC CORP/MASS	43,800	30.350	1,329,330.000	
	BIOGEN IDEC INC	5,230	307.690	1,609,218.700	
	STARBUCKS CORP	16,500	81.210	1,339,965.000	
	PERRIGO CO PLC	2,900	160.190	464,551.000	
	NORTHEAST UTILITIES	7,180	50.640	363,595.200	
	INTUIT INC	5,900	93.870	553,833.000	
	BORG-WARNER AUTOMOTIVE	5,200	56.560	294,112.000	
	BEST BUY COMPANY INC	6,500	39.410	256,165.000	
	BALL CORP	3,100	67.070	207,917.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,947	12.870	372,547.890	
	BED BATH & BEYOND INC	4,600	73.370	337,502.000	
	XL GROUP PLC	6,400	35.520	227,328.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	6,900	43.930	303,117.000	
	VULCAN MATERIALS CO	2,900	66.100	191,690.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,200	117.880	612,976.000	
	VF CORP	7,500	75.170	563,775.000	
	CBS CORP-CL B	10,971	54.880	602,088.480	
	VIACOM INC-CLASS B	8,471	75.630	640,661.730	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,400	153.590	215,026.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,000	15.130	90,780.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	2,400	88.510	212,424.000	
	CARNIVAL CORP	8,600	44.160	379,776.000	
	COMCAST CORP -CL A	46,670	57.040	2,662,056.800	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	9,300	56.810	528,333.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 415,371,866.570 (49,383,561,217)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	412,500	4.202	1,733,325.000	
	UNILEVER PLC	28,960	27.060	783,657.600	

BARCLAYS PLC	369,800	2.451	906,379.800	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	42,100	8.425	354,692.500	
TUI TRAVEL PLC	12,900	4.447	57,366.300	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	37,100	4.885	181,233.500	
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,100	42.530	89,313.000	
REXAM PLC	16,960	4.524	76,727.040	
PRUDENTIAL PLC	57,700	15.480	893,196.000	
INMARSAT PLC	12,800	7.945	101,696.000	
ROLLS-ROYCE PLC C SHARE	3,897,000	0.001	3,897.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	56,191	3.953	222,123.020	
JOHNSON MATTHEY PLC	4,609	33.260	153,295.340	
BAE SYSTEMS PLC	70,000	4.811	336,770.000	
AVIVA PLC	65,200	5.080	331,216.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	108,102	14.850	1,605,314.700	
MELROSE INDUSTRI	25,892	2.587	66,982.600	
ROYAL MAIL PLC	15,300	4.178	63,923.400	
REED ELSEVIER PLC	25,846	11.130	287,665.980	
BG GROUP PLC	76,300	9.002	686,852.600	
DIAGEO PLC	55,500	19.810	1,099,455.000	
RIO TINTO PLC-REG	28,000	29.925	837,900.000	
STANDARD CHARTERED PLC	55,600	9.371	521,027.600	
TESCO PLC	182,300	1.864	339,807.200	
FRESNILLO PLC	5,000	7.120	35,600.000	
SMITH & NEPHEW PLC	20,400	11.100	226,440.000	
GLENCORE PLC	233,625	3.204	748,534.500	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,700	9.755	55,603.500	
SMITHS GROUP PLC	9,133	11.570	105,668.810	
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,100	11.370	69,357.000	
DIRECT LINE INSURANCE	35,200	2.945	103,664.000	
DIXONS CARPHONE PLC	23,100	4.233	97,782.300	
PEARSON PLC	18,163	12.310	223,586.530	
SAINSBURY (J) PLC	28,525	2.334	66,577.350	
NEXT PLC	3,500	67.750	237,125.000	
WHITBREAD PLC	4,011	45.870	183,984.570	
IMI PLC	6,650	11.810	78,536.500	
BUNZL PLC	7,655	17.860	136,718.300	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	20,600	4.499	92,679.400	
GKN PLC	36,500	3.453	126,034.500	
SPORTS DIRECT INTERNATION	5,500	6.605	36,327.500	

VODAFONE GROUP PLC	584,683	2.339	1,367,573.530	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,100	24.540	76,074.000	
KINGFISHER PLC	51,911	3.120	161,962.320	
WPP PLC	29,400	13.400	393,960.000	
UNITED UTILITIES GROUP PL	15,627	9.055	141,502.480	
SEVERN TRENT PLC	5,533	20.430	113,039.190	
RECKITT BENCKISER PLC	14,600	52.550	767,230.000	
SCHRODERS PLC	3,200	26.950	86,240.000	
TATE&LYLE PLC	11,600	6.035	70,006.000	
AMEC FOSTER WHEE	7,900	9.345	73,825.500	
SSE PLC	21,600	16.400	354,240.000	
WEIR GROUP PLC (THE)	4,800	18.760	90,048.000	
ASTRAZENECA PLC	27,900	47.800	1,333,620.000	
WOLSELEY PLC	6,015	35.900	215,938.500	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	134,800	2.467	332,551.600	
3I GROUP PLC	22,791	4.440	101,192.040	
SKY PLC	23,200	9.320	216,224.000	
SAGE GROUP PLC (THE)	24,114	4.071	98,168.090	
NATIONAL GRID PLC	84,428	9.300	785,180.400	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,260,765	0.803	1,012,394.290	
RSA INSURANCE GROUP PLC	23,660	4.682	110,776.120	
IMPERIAL TOBACCO GROUP	21,500	29.600	636,400.000	
CENTRICA PLC	111,260	2.846	316,645.960	
ARM HOLDINGS PLC	31,700	9.145	289,896.500	
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	41,660	37.945	1,580,788.700	
ICAP PLC	16,900	4.168	70,439.200	
SABMILLER PLC	21,300	35.640	759,132.000	
BHP BILLITON PLC	47,577	15.170	721,743.090	
ASSOCIATED BRITISH FOODS	8,000	32.030	256,240.000	
HSBC HOLDINGS PLC	430,300	6.370	2,741,011.000	
SHIRE PLC	13,200	45.570	601,524.000	
OLD MUTUAL PLC	108,525	2.003	217,375.570	
ANGLO AMERICAN PLC	30,883	13.215	408,118.840	
MORRISON SUPERMARKETS	50,900	1.785	90,856.500	
CARNIVAL PLC	4,161	28.200	117,340.200	
EASYJET PLC	4,100	16.530	67,773.000	
COMPASS GROUP PLC	37,741	10.900	411,376.900	
PERSIMMON PLC	6,800	15.330	104,244.000	
BT GROUP PLC	179,800	4.102	737,539.600	

	COCA-COLA HBC AG-CDI	5,100	14.520	74,052.000	
	WILLIAM HILL PLC	23,200	3.350	77,720.000	
	BURBERRY GROUP PLC	10,089	16.500	166,468.500	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	5,373	27.100	145,608.300	
	AGGREKO PLC	5,968	15.330	91,489.440	
	CAPITA PLC	15,090	10.700	161,463.000	
	TRAVIS PERKINS PLC	5,700	18.070	102,999.000	
	INTERTEK GROUP PLC	3,800	23.350	88,730.000	
	ITV PLC	86,000	2.142	184,212.000	
	TULLOW OIL PLC	21,100	4.260	89,886.000	
	PETROFAC LTD	7,000	8.250	57,750.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,949	22.550	111,599.950	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	88,300	21.325	1,882,997.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	54,081	22.230	1,202,220.630	
	MEGGITT PLC	19,800	5.030	99,594.000	
	G4S PLC	34,600	2.764	95,634.400	
	COBHAM PLC	25,600	3.016	77,209.600	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,700	12.400	70,680.000	
	INVESTEC PLC	12,300	5.920	72,816.000	
	ANTOFAGASTA PLC	10,800	7.370	79,596.000	
	STANDARD LIFE PLC	54,700	4.240	231,928.000	
	EXPERIAN PLC	21,954	10.130	222,394.020	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	31,576	3.692	116,578.590	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 37,891,854.990 (7,028,939,101)	
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	7.015	395,646.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	26.400	369,600.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	19,700	223.100	4,395,070.000	
	BANK HAPOALIM BM	26,500	19.250	510,125.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	13.660	513,616.000	
	NICE SYSTEMS LTD	1,700	184.000	312,800.000	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 6,496,857.000 (198,284,076)	
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	
	HARVEY NORMAN-R	636	1.800	1,144.800	

BHP BILLITON LTD	71,200	30.920	2,201,504.000	
LEND LEASE	12,100	15.330	185,493.000	
ASCIANO LTD	28,600	5.880	168,168.000	
ALUMINA LTD	69,900	1.670	116,733.000	
WOODSIDE PETROLEUM	16,900	35.750	604,175.000	
FORTESCUE METALS GROUP	39,700	2.940	116,718.000	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	12.770	150,686.000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	53,300	32.600	1,737,580.000	
WESTPAC BANKING	69,198	32.550	2,252,394.900	
SANTOS LIMITED	22,000	10.100	222,200.000	
AUSTRALIA & NZLAND BK	61,700	31.920	1,969,464.000	
RIO TINTO LTD	9,700	59.100	573,270.000	
ORIGIN ENERGY LIMITED	24,400	12.250	298,900.000	
AMCOR	26,700	12.160	324,672.000	
METCASH LTD	23,500	2.610	61,335.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	4.610	215,748.000	
SEEK LTD	6,500	17.090	111,085.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	14,600	4.740	69,204.000	
NEWCREST MINING	17,600	10.340	181,984.000	
INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.850	129,960.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	36,600	80.720	2,954,352.000	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,800	30.250	114,950.000	
ORICA LIMITED	8,300	18.200	151,060.000	
QBE INSURANCE	28,800	10.860	312,768.000	
LEIGHTON HOLDINGS	2,900	20.130	58,377.000	
WOOLWORTHS	28,300	31.120	880,696.000	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	13,700	9.140	125,218.000	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	4.080	83,640.000	
CROWN LTD	10,600	14.380	152,428.000	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	15,500	1.920	29,760.000	
TELSTRA CORPORATION	98,400	5.690	559,896.000	
AMP LIMITED	66,500	5.640	375,060.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES	11,400	12.100	137,940.000	
MACQUARIE GROUP LIMITED	6,484	58.430	378,860.120	
CSL LIMITED	10,800	82.570	891,756.000	
WESFARMERS LTD	25,245	41.420	1,045,647.900	
COCHLEAR LIMITED	1,700	69.550	118,235.000	
SUNCORP GROUP LTD	28,700	14.340	411,558.000	
BORAL LIMITED	22,700	4.890	111,003.000	

	ASX LTD	5,000	36.000	180,000.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	11.550	160,545.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	3.690	51,660.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	49,800	6.370	317,226.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	17.450	165,775.000	
	TRANSURBAN GROUP	41,800	8.310	347,358.000	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,000	6.850	82,200.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	5.640	106,032.000	
	SYDNEY AIRPORT	25,100	4.440	111,444.000	
	WORLEYPARSONS LTD	6,100	11.120	67,832.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	3.410	125,829.000	
	AGL ENERGY LTD	14,000	13.110	183,540.000	
	BRAMBLES LTD	34,900	9.720	339,228.000	
	APA GROUP	21,700	7.870	170,779.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,900	54.150	157,035.000	
	ALS LTD	9,500	5.040	47,880.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 23,199,986.720 (2,332,758,665)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	6,600	49.580	327,228.000	
	SILVER WHEATON CORP	7,900	22.580	178,382.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,900	79.380	230,202.000	
	BCE INC	6,230	53.340	332,308.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,500	57.210	200,235.000	
	SUNCOR ENERGY INC	33,080	36.110	1,194,518.800	
	METRO INC-A	2,000	89.310	178,620.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,400	53.130	393,162.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	27,300	70.500	1,924,650.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	8,800	106.490	937,112.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	40,700	57.620	2,345,134.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	6,700	33.870	226,929.000	
	MEG ENERGY CORP	3,800	18.570	70,566.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	31,900	83.160	2,652,804.000	
	TOURMALINE OIL CORP	3,800	38.000	144,400.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,500	53.280	133,200.000	
	TRANSCANADA CORP	16,000	54.450	871,200.000	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,800	24.190	91,922.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,500	38.960	292,200.000	

BOMBARDIER INC 'B'	36,600	4.360	159,576.000	
BARRICK GOLD CORP	26,100	13.540	353,394.000	
CAE INC	9,200	15.140	139,288.000	
THOMSON REUTERS CORP	8,304	45.600	378,662.400	
POTASH CORP OF SASKATCHEW	18,500	39.310	727,235.000	
EMPIRE CO LTD'A'	1,100	83.170	91,487.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,160	61.510	317,391.600	
CANADIAN UTILITIES LTD A	3,600	39.960	143,856.000	
ROGERS COMMUNICATIONS-B	8,100	45.770	370,737.000	
AGNICO-EAGLE MINES	4,800	26.680	128,064.000	
KINROSS GOLD CORP	29,500	3.170	93,515.000	
BANK OF MONTREAL	14,500	83.860	1,215,970.000	
POWER CORP OF CANADA	8,500	32.430	275,655.000	
METHANEX CORP	2,200	57.520	126,544.000	
CAMECO CORP	9,200	21.260	195,592.000	
TELUS CORP	6,400	43.280	276,992.000	
POWER FINANCIAL CORP	5,600	35.750	200,200.000	
NEW GOLD INC	14,000	4.560	63,840.000	
TECK RESOURECES LIMITED-B	13,100	17.640	231,084.000	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,700	128.310	218,127.000	
TALISMAN ENERGY INC	23,200	5.450	126,440.000	
TURQUOISE HILL RESOURCES	16,800	3.720	62,496.000	
AGRIUM INC	3,300	110.380	364,254.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCE	24,700	37.960	937,612.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	500	581.000	290,500.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,700	122.300	574,810.000	
TRANSALTA CORP	6,700	11.140	74,638.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	100.750	141,050.000	
BLACKBERRY LTD	11,900	11.850	141,015.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	13,800	42.430	585,534.000	
ENBRIDGE INC	19,000	52.500	997,500.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	12,400	57.490	712,876.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	41,900	22.770	954,063.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,200	166.400	1,198,080.000	
GOLDCORP INC	18,659	22.400	417,961.600	
ENCANA CORP	16,600	18.020	299,132.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	3,900	220.560	860,184.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	47.410	132,748.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,600	66.120	171,912.000	

	CANADIAN NATL RAILWAY CO	18,100	81.230	1,470,263.000	
	CGI GROUP INC - CL A	5,200	41.680	216,736.000	
	HUSKY ENERGY INC	8,000	24.180	193,440.000	
	ONEX CORPORATION	2,000	64.890	129,780.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,800	30.870	271,656.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	25.370	131,924.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	3,400	43.220	146,948.000	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	17,200	7.130	122,636.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	47.520	147,312.000	
	OPEN TEXT CORP	2,800	67.700	189,560.000	
	CI FINANCIAL CORP	5,300	33.870	179,511.000	
	SAPUTO INC	5,800	33.150	192,270.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,200	18.600	245,520.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD	9,600	40.500	388,800.000	
	YAMANA GOLD INC	20,100	4.130	83,013.000	
	FORTIS INC	6,100	40.610	247,721.000	
	CRESCENT POINT ENERGY COR	9,300	29.680	276,024.000	
	CENOVUS ENERGY INC	16,700	25.670	428,689.000	
	TIM HORTONS INC	3,100	95.310	295,461.000	
	DOLLARAMA INC	3,000	53.580	160,740.000	
	CATAMARAN CORP	4,600	57.770	265,742.000	
	ALTAGAS LTD	3,100	42.380	131,378.000	
	KEYERA CORP	2,000	84.990	169,980.000	
	PEYTO EXPLORATION & DEV	3,400	33.580	114,172.000	
	INTER PIPELINE LTD	7,400	32.620	241,388.000	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,200	14.540	162,848.000	
	ENERPLUS CORP	6,000	14.840	89,040.000	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	4.070	55,352.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,000	27.040	189,280.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	8,100	11.050	89,505.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 34,501,477.600 (3,581,943,404)	
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	29,000	24.000	696,000.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	39,000	19.830	773,370.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.780	177,546.600	
	KEPPEL CORP	31,500	9.000	283,500.000	

	UOL GROUP LIMITED	16,400	6.730	110,372.000	
	CITY DEVELOPMENT	14,000	10.060	140,840.000	
	CAPITALAND LIMITED	59,000	3.320	195,880.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	25,000	3.130	78,250.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	41,000	4.290	175,890.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	42.590	127,770.000	
	O.C.B.C.	65,000	10.480	681,200.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	153,000	1.140	174,420.000	
	SINGAPORE TELECOM LTD	178,450	3.900	695,955.000	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.225	141,096.720	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	3.370	161,760.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	29,000	4.570	132,530.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.460	100,924.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	19,000	7.320	139,080.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	41,000	2.600	106,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.210	179,760.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIE	69,000	2.620	180,780.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 5,453,524.320 (495,398,149)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG	83,450	17.350	1,447,857.500	
	ADECCO SA-REG	4,100	67.850	278,185.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	15,750	289.400	4,558,050.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	76.900	61,520.000	
	SIKA AG-BR	54	3,678.000	198,612.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	2	57,720.000	115,440.000	
	ABB LTD	49,600	21.690	1,075,824.000	
	ARYZTA AG	1,950	77.100	150,345.000	
	TRANSOCEAN LTD	8,450	20.460	172,887.000	
	SWISS RE LTD	7,900	82.600	652,540.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	72,550	72.550	5,263,502.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	450	277.500	124,875.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,000	137.800	137,800.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	34,070	25.820	879,687.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,650	43.780	247,357.000	
	SULZER AG-REG	800	107.900	86,320.000	
	SGS SA	130	2,090.000	271,700.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	750	477.500	358,125.000	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,382	302.800	1,024,069.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,200	126.200	151,440.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	51,300	93.500	4,796,550.000	
	CIE FINANC RICHEMON-REG	11,950	90.850	1,085,657.500	
	SWISSCOM AG-REG	550	586.500	322,575.000	
	GEBERIT AG-REG	850	336.600	286,110.000	
	GIVAUDAN REG	220	1,722.000	378,840.000	
	ACTELION LTD-REG	2,450	114.900	281,505.000	
	SYNGENTA AG	2,112	318.300	672,249.600	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,300	146.200	190,060.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,300	113.600	147,680.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	88.950	133,425.000	
	HOLCIM LTD-REG	5,500	71.350	392,425.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	800	221.400	177,120.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,350	130.100	175,635.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 26,295,969.100 (3,230,722,764)	
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	68,430	93.900	6,425,577.000	
	VOLVO AB-B SHS	34,200	81.600	2,790,720.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	1,500	620.500	930,750.000	
	S.K.F. AB-B SHS	9,250	153.600	1,420,800.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	5,450	221.600	1,207,720.000	
	NORDEA AB	67,250	93.150	6,264,337.500	
	ELEKTA AB-B SHS	8,800	76.000	668,800.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,550	257.500	1,171,625.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	96.550	864,122.500	
	GETINGE AB-B SHS	4,700	172.600	811,220.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	33,900	98.500	3,339,150.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	11,200	364.200	4,079,040.000	
	SWEDBANK AB	20,650	195.600	4,039,140.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	21,500	319.400	6,867,100.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	13,100	175.900	2,304,290.000	
	SKANSKA AB-B	8,850	160.600	1,421,310.000	
	SANDVIK AB	23,750	78.100	1,854,875.000	
	INVESTOR AB-B SHS	10,400	280.100	2,913,040.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,100	215.000	3,246,500.000	

	SECURITAS AB-B SHS	9,200	90.050	828,460.000	
	TELIASONERA AB	54,050	53.200	2,875,460.000	
	ALFA LAVAL AB	7,000	148.400	1,038,800.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,900	198.100	1,763,090.000	
	ASSA ABLOY AB-B	7,400	405.200	2,998,480.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	105.100	672,640.000	
	BOLIDEN AB	7,900	126.000	995,400.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	54.900	688,995.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,300	258.700	1,371,110.000	
	HEXAGON AB-B SHS	5,550	237.000	1,315,350.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 67,167,902.000 (1,068,641,321)	
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	44,700	272.900	12,198,630.000	
	DANSKE BANK A/S	15,050	170.000	2,558,500.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	95	12,230.000	1,161,850.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,200	220.400	1,146,080.000	
	TDC A/S	19,300	48.500	936,050.000	
	CARLSBERG AS-B	2,450	533.000	1,305,850.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,500	262.900	1,445,950.000	
	COLOPLAST-B	2,500	518.500	1,296,250.000	
	DSV A/S	4,200	187.400	787,080.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	675	429.200	289,710.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	160	12,480.000	1,996,800.000	
	PANDORA A/S	2,750	531.000	1,460,250.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 26,583,000.000 (527,938,380)	
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	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.060	161,228.340	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	23,400	3.870	90,558.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	8.190	164,619.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 416,405.340 (38,600,775)	

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	29,900	41.080	1,228,292.000	
	DNB ASA	21,950	116.500	2,557,175.000	
	ORKLA ASA	19,050	52.200	994,410.000	
	TELENOR ASA	16,750	148.100	2,480,675.000	
	STATOIL ASA	25,073	132.500	3,322,172.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,060	298.300	1,211,098.000	
	SEADRILL LTD	8,750	100.500	879,375.000	
	SUBSEA 7 SA	6,600	69.900	461,340.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	3,950	120.300	475,185.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 13,609,722.500 (229,323,824)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	18,350	120.950	2,219,432.500	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	31,100	26.285	817,463.500	
	COMMERZBANK AG	21,685	12.305	266,833.920	
	VOLKSWAGEN AG	750	181.900	136,425.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,650	185.200	675,980.000	
	M.A.N.	1,050	91.650	96,232.500	
	SIEMENS AG	17,950	95.160	1,708,122.000	
	E.ON SE	44,900	14.255	640,049.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	7,500	91.950	689,625.000	
	GEA GROUP AG	4,400	38.430	169,092.000	
	OSRAM LICHT AG	2,410	33.400	80,494.000	
	CONTINENTAL AG	2,550	169.200	431,460.000	
	BASF SE	20,750	73.010	1,514,957.500	
	LINDE	4,200	151.750	637,350.000	
	K+S AG	4,400	24.135	106,194.000	
	ALLIANZ SE-REG	10,150	138.450	1,405,267.500	
	THYSSENKRUPP AG	10,750	21.275	228,706.250	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,100	89.220	365,802.000	
	R.W.E. AG	10,800	29.130	314,604.000	
	LUFTHANSA	6,750	14.355	96,896.250	
	FRAPORT AG	1,100	49.115	54,026.500	
	BRENNTAG AG	3,750	44.290	166,087.500	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	8,600	43.595	374,917.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SH	3,300	35.425	116,902.500	
	SAP SE	21,042	56.680	1,192,660.560	

MUENCHENER RUE-R	3,900	165.650	646,035.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	3,400	60.970	207,298.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	3,400	70.040	238,136.000	
BEIERSDORF AG	2,450	71.580	175,371.000	
CELESIO AG	1,450	26.800	38,860.000	
MERCK KGAA	2,900	80.080	232,232.000	
ADIDAS AG	4,870	64.500	314,115.000	
HENKEL KGAA	2,650	79.640	211,046.000	
METRO AG	3,700	27.310	101,047.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	71,350	13.700	977,495.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	4,850	59.390	288,041.500	
DAIMLER AG	21,800	67.800	1,478,040.000	
QIAGEN N.V.	5,350	19.215	102,800.250	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	26,900	7.878	211,918.200	
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,400	71.760	100,464.000	
DEUTSCHE POST AG	22,150	26.715	591,737.250	
DEUTSCHE BOERSE AG	4,250	58.750	249,687.500	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-	5,200	34.350	178,620.000	
LANXESS	2,250	39.935	89,853.750	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,050	19.305	136,100.250	
SYMRISE AG	2,800	48.065	134,582.000	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	650	111.550	72,507.500	
HUGO BOSS AG -ORD	800	105.900	84,720.000	
RTL GROUP	1,000	77.440	77,440.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,876	24.255	530,602.380	
ARCELORMITTAL	22,400	9.865	220,976.000	
UNILEVER NV-CVA	36,650	32.755	1,200,470.750	
HEINEKEN NV	5,250	63.250	332,062.500	
REED ELSEVIER NV	15,927	19.770	314,876.790	
AEGON NV	40,744	6.313	257,216.870	
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	21,243	14.205	301,756.810	
AKZO NOBEL	5,500	55.560	305,580.000	
KONINKLIJKE DSM NV	4,050	52.870	214,123.500	
WOLTERS KLUWER	6,900	23.565	162,598.500	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	45.125	94,762.500	
ING GROEP N.V.	86,750	11.780	1,021,915.000	
KONINKLIJKE KPN NV	73,550	2.670	196,378.500	
ASML HOLDING NV	7,880	84.930	669,248.400	
TNT EXPRESS NV	10,195	5.420	55,256.900	

VOPAK	2,000	40.400	80,800.000	
RANDSTAD HOLDING NV	2,950	39.685	117,070.750	
HEINEKEN HOLDING NV	2,300	54.990	126,477.000	
GEMALTO	1,900	68.320	129,808.000	
OCI NV	2,300	28.835	66,320.500	
DELTA LLOYD NV	4,400	18.485	81,334.000	
ALTICE SA	2,050	54.100	110,905.000	
TOTAL SA	47,800	44.990	2,150,522.000	
MICHELIN (CGDE) - B	4,150	73.950	306,892.500	
AIR LIQUIDE	7,748	101.200	784,097.600	
KERING	1,900	166.100	315,590.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,700	65.600	767,520.000	
BOUYGUES	3,750	30.255	113,456.250	
LAFARGE SA	4,200	57.180	240,156.000	
BNP PARIBAS	23,550	51.560	1,214,238.000	
PEUGEOT SA	9,250	10.300	95,275.000	
NATIXIS	21,550	5.682	122,447.100	
THALES SA	2,250	42.670	96,007.500	
GROUPE DANONE	12,900	56.750	732,075.000	
CARREFOUR	14,050	25.445	357,502.250	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	14.260	115,149.500	
VIVENDI SA	27,241	20.480	557,895.680	
L'OREAL	5,650	137.200	775,180.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,000	36.940	369,400.000	
LEGRAND SA	5,917	42.165	249,490.300	
ALCATEL-LUCENT	63,000	2.863	180,369.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,300	77.490	100,737.000	
PERNOD-RICARD	4,667	95.310	444,811.770	
EURAZEO	976	55.950	54,607.200	
REXEL SA	6,050	14.890	90,084.500	
SOCIETE GENERALE-A	16,200	39.890	646,218.000	
LVMH	6,200	144.500	895,900.000	
ACCOR SA	3,800	37.935	144,153.000	
CAP GEMINI SA	3,250	58.930	191,522.500	
VALEO	1,650	98.950	163,267.500	
PUBLICIS GROUPE	4,100	59.060	242,146.000	
VALLOUREC	2,650	26.665	70,662.250	
BUREAU VERITAS SA	5,600	19.185	107,436.000	
SODEXO	2,200	81.120	178,464.000	

ZODIAC AEROSPACE	4,200	26.650	111,930.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	4,600	90.300	415,380.000	
AXA	40,650	19.415	789,219.750	
CHRISTIAN DIOR	1,200	154.000	184,800.000	
LAGARDERE S.C.A.	3,800	22.800	86,640.000	
TECHNIP S.A.	2,350	52.300	122,905.000	
EDENRED	4,750	23.190	110,152.500	
RENAULT	4,300	64.520	277,436.000	
STMICROELECTRONICS NV	15,950	6.027	96,130.650	
ATOS	1,800	57.130	102,834.000	
DASSAULT SYSTEMS SA	2,800	52.570	147,196.000	
WENDEL	1,100	94.750	104,225.000	
ORANGE	41,900	14.165	593,513.500	
ALSTOM	4,950	28.125	139,218.750	
CNP ASSURANCES	5,150	14.890	76,683.500	
SANOFI	26,425	77.860	2,057,450.500	
VINCI	10,950	43.475	476,051.250	
AIRBUS GROUP NV	13,150	48.995	644,284.250	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,350	14.665	137,117.750	
CREDIT AGRICOLE SA	23,000	11.305	260,015.000	
GDF SUEZ	31,973	19.815	633,544.990	
IMERYS SA	1,100	60.800	66,880.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	5,550	24.075	133,616.250	
SES	6,850	29.920	204,952.000	
SAFRAN SA	6,100	52.030	317,383.000	
ILIAD SA	600	197.500	118,500.000	
ARKEMA	1,550	54.720	84,816.000	
ADP	950	98.690	93,755.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	26.595	107,709.750	
SCOR SE	4,550	25.090	114,159.500	
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	10,450	10.395	108,627.750	
UCB SA	2,800	63.080	176,624.000	
KBC GROUPE	5,550	46.000	255,300.000	
COLRUYT SA	2,500	37.400	93,500.000	
DELHAIZE GROUP	2,300	58.790	135,217.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	1,850	72.750	134,587.500	
SOLVAY SA	1,350	110.500	149,175.000	
UMICORE	2,950	32.700	96,465.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	17,850	94.460	1,686,111.000	

AGEAS	5,190	28.760	149,264.400	
BELGACOM SA	3,500	31.745	111,107.500	
UNIPOLSAI SPA	21,750	2.300	50,025.000	
BANCO POPOLARE SCARL	8,300	11.090	92,047.000	
PRYSMIAN SPA	5,700	14.450	82,365.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	26,243	17.390	456,365.770	
SAIPEM	6,100	11.510	70,211.000	
MEDIOBANCA SPA	14,615	7.200	105,228.000	
TENARIS SA	10,550	13.300	140,315.000	
UNICREDIT SPA	97,569	5.945	580,047.700	
TELECOM ITALIA SPA	229,982	0.906	208,363.690	
TELECOM ITALIA-RNC	134,950	0.712	96,084.400	
INTESA SANPAOLO	259,797	2.478	643,776.960	
ATLANTIA SPA	9,407	20.280	190,773.960	
ENI SPA	57,250	16.070	920,007.500	
FINMECCANICA SPA	11,225	7.800	87,555.000	
MONTE DEI PASCHI SIENA	96,319	0.649	62,511.030	
ENEL SPA	148,300	3.880	575,404.000	
SNAM SPA	46,700	4.264	199,128.800	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,700	43.000	159,100.000	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	19,600	6.180	121,128.000	
TERNA SPA	34,700	3.884	134,774.800	
PIRELLI & C.	7,645	11.410	87,229.450	
ENEL GREEN POWER SPA	55,400	1.935	107,199.000	
EXOR SPA	2,100	35.800	75,180.000	
CNH INDUSTRIAL NV	20,900	6.295	131,565.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES	19,350	10.030	194,080.500	
TELEFONICA S.A.	92,177	12.880	1,187,239.760	
CAIXABANK SA-RTS	40,200	0.054	2,170.800	
BANCO POPULAR ESPANOL	40,473	4.420	178,890.660	
BANCO BILBAO VIZCAYA	131,712	8.638	1,137,728.250	
IBERDROLA SA	114,834	5.946	682,802.960	
BANCO DE SABADELL SA	80,572	2.281	183,784.730	
REPSOL SA	22,950	18.050	414,247.500	
GRIFOLS SA	3,350	35.825	120,013.750	
BANCO SANTANDER SA	276,550	7.249	2,004,710.950	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	9,300	17.210	160,053.000	
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,550	32.015	273,728.250	
GAS NATURAL SDG SA	8,000	22.780	182,240.000	

	MAPFRE SA	21,450	2.951	63,298.950	
	CAIXABANK	40,200	4.441	178,528.200	
	ZARDOYA OTIS SA	4,550	8.570	38,993.500	
	INTL CONSOLIDATED AIRLINE	22,800	5.747	131,031.600	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,276	28.415	121,502.540	
	INDITEX	24,000	23.415	561,960.000	
	ENAGAS	4,700	26.930	126,571.000	
	RED ELECTRICA DE ESPANA	2,500	73.670	184,175.000	
	FERROVIAL SA	9,800	16.480	161,504.000	
	DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	5.590	104,533.000	
	BANKIA SA	108,422	1.410	152,875.020	
	UPM-KYMMENE OYJ	11,850	13.350	158,197.500	
	NOKIA OYJ	84,150	6.690	562,963.500	
	WARTSILA OYJ	3,450	36.020	124,269.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	13,100	7.125	93,337.500	
	METSO OYJ	3,750	24.930	93,487.500	
	ELISA OYJ-A SHARES	4,550	23.320	106,106.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	9,950	39.670	394,716.500	
	FORTUM OYJ	9,950	20.180	200,791.000	
	KONE OYJ-B	6,950	37.000	257,150.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,000	22.710	68,130.000	
	NESTE OIL OYJ	4,300	19.080	82,044.000	
	ORION OYJ-CLASS B	2,050	27.580	56,539.000	
	IMMOFINANZ AG	31,200	2.411	75,223.200	
	OMV AG	3,550	23.260	82,573.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	5,550	21.780	120,879.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	33.400	95,190.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATI	2,400	16.640	39,936.000	
	ANDRITZ AG	1,600	43.460	69,536.000	
	VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	40.005	40,005.000	
	BANK OF IRELAND	661,800	0.330	218,394.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	8.170	49,020.000	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	59,000	3.299	194,641.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	10,350	9.800	101,430.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,600	59.690	214,884.000	
	CRH PLC	16,600	19.000	315,400.000	
ユーロ　小計				ユーロ 70,549,915.450 (10,428,688,502)	

香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	32,000	74.050	2,369,600.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT	52,000	52.950	2,753,400.000	
	MTR CORP	37,500	31.150	1,168,125.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	37,000	113.400	4,195,800.000	
	SINO LAND	88,000	12.720	1,119,360.000	
	CHEUNG KONG	31,000	142.300	4,411,300.000	
	WHARF HOLDINGS	34,000	55.950	1,902,300.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	14,500	106.600	1,545,700.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	42,500	67.450	2,866,625.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	17.080	700,280.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	48,300	97.200	4,694,760.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	23,460	52.000	1,219,920.000	
	HK & CHINA GAS	143,903	18.380	2,644,937.140	
	HANG SENG BANK	16,900	129.200	2,183,480.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	39.000	975,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	113,000	9.260	1,046,380.000	
	HONG KONG EX & CL	24,400	168.900	4,121,160.000	
	LI & FUNG LTD	132,000	8.620	1,137,840.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	52,000	23.300	1,211,600.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	78.950	513,175.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	27.800	583,800.000	
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	14.360	667,740.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	27.950	628,875.000	
	BANK OF EAST ASIA	29,040	32.500	943,800.000	
	SJM HOLDINGS LTD	47,000	15.400	723,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	24.100	723,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	15,000	57.400	861,000.000	
	AIA GROUP LTD	270,000	44.800	12,096,000.000	
	SANDS CHINA LTD	54,000	46.450	2,508,300.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	10.740	451,080.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	31,500	24.800	781,200.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	20,000	23.450	469,000.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	81,500	27.400	2,233,100.000	
	SHANGRI-LA ASI-R	6,000	0.335	2,010.000	
	WYNN MACAU LTD	38,000	25.300	961,400.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD	57,000	9.650	550,050.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 67,964,897.140	

			(1,041,901,873)	
合計			79,586,702,051 [79,586,702,051]	

(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	2,847	457,769.130	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,887	1,245,169.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,400	440,776.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	12,300	329,148.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,827	426,940.120	
		EQUITY RESIDENTIAL	7,700	545,468.000	
		AMERICAN TOWER CORP	8,700	913,587.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	17,093	397,241.320	
		KIMCO REALTY CORP	9,400	239,230.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,000	166,720.000	
		RAYONIER INC	3,000	81,840.000	
		VENTAS INC	6,600	472,230.000	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY	7,800	179,985.000	
		IRON MOUNTAIN INC	3,910	148,619.100	
		AMERICAN REALTY CAP PROP	20,400	191,760.000	
		PROLOGIS INC	11,162	471,929.360	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,000	153,360.000	
		DUKE REALTY CORP	8,000	155,520.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	283,374.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,500	198,990.000	
		HEALTH CARE REIT INC	7,100	522,986.000	
		HCP INC	10,200	456,960.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	116,754.000	
		MACERICH CO/THE	3,200	253,056.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	21,400	246,528.000	
		REALTY INCOME CORP	5,200	241,592.000	
		PUBLIC STORAGE	3,300	619,179.000	
		REGENCY CENTERS CORP	2,100	129,108.000	
		SL GREEN REALTY CORP	2,100	243,894.000	
		UDR INC	5,700	175,446.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,100	217,837.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 10,722,996.630	

			(1,274,857,069)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES PLC	18,000	213,840.000	
	SEGRO PLC	16,750	65,710.250	
	HAMMERSON PLC	17,400	108,402.000	
	BRITISH LAND CO PLC	22,000	168,960.000	
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	75,305.900	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 632,218.150 (117,276,467)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	SCENTRE GROUP	117,222	406,760.340	
	NOVION PROPERTY GROUP	65,500	139,515.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	23,950	170,284.500	
	GPT GROUP	35,960	148,874.400	
	MIRVAC GROUP	93,400	163,917.000	
	STOCKLAND	51,500	212,180.000	
	WESTFIELD CORP	45,596	377,990.840	
	GOODMAN GROUP	40,900	222,905.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 1,842,427.080 (185,256,043)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	48,000	112,320.000	
	CAPITAMALL TRUST	79,000	156,420.000	
シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 268,740.000 (24,412,342)	
ユーロ			ユーロ	
	CORIO NV	2,024	82,346.440	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,150	456,875.000	
	ICADE	950	61,113.500	
	GECINA SA	750	81,562.500	
	KLEPIERRE	3,200	115,488.000	
	FONCIERE DES REGIONS	950	72,931.500	
ユーロ　小計			ユーロ 870,316.940 (128,650,250)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	53,000	2,618,200.000	

	香港・ドル　小計		香港・ドル 2,618,200.000 (40,137,006)	
投資証券　合計			1,770,589,177 [1,770,589,177]	
合計			1,770,589,177 [1,770,589,177]	

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　587銘柄 投資証券　31銘柄	97.5%	2.5%	62.4%
イギリス・ポンド	株式　103銘柄 投資証券　5銘柄	98.4%	1.6%	8.8%
イスラエル・シュケル	株式　6銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式　56銘柄 投資証券　8銘柄	92.6%	7.4%	3.1%
カナダ・ドル	株式　88銘柄	100%	-%	4.4%
シンガポール・ドル	株式　21銘柄 投資証券　2銘柄	95.3%	4.7%	0.6%
スイス・フラン	株式　33銘柄	100%	-%	4.0%
スウェーデン・クローナ	株式　29銘柄	100%	-%	1.3%
デンマーク・クローネ	株式　12銘柄	100%	-%	0.6%
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%	-%	0.3%
ユーロ	株式　217銘柄 投資証券　6銘柄	98.8%	1.2%	13.0%
香港・ドル	株式　36銘柄 投資証券　1銘柄	96.3%	3.7%	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。

「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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	73,031,289	64,493,142
コール・ローン	688,407,345	949,466,688
国債証券	145,208,333,500	169,019,024,965
派生商品評価勘定	5,369,039	9,091,885
未収入金	3,081,502,184	2,413,443,236
未収利息	1,495,172,774	1,587,127,867
前払費用	44,781,455	35,206,343
流動資産合計	150,596,597,586	174,077,854,126
資産合計	150,596,597,586	174,077,854,126
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,274,289	634,842
未払金	2,367,245,164	1,859,286,882
未払解約金	103,110,000	210,003,000
流動負債合計	2,471,629,453	2,069,924,724
負債合計	2,471,629,453	2,069,924,724
純資産の部		
元本等		
元本　※1	60,271,757,086	58,642,095,234
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	87,853,211,047	113,365,834,168
元本等合計	148,124,968,133	172,007,929,402
純資産合計	148,124,968,133	172,007,929,402
負債純資産合計	150,596,597,586	174,077,854,126

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25年12月3日 至　平成26年12月1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。
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 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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基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。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1．※1　期首	平成24年12月1日	平成25年12月3日
期首元本額	62,720,404,518円	60,271,757,086円
期中追加設定元本額	4,273,708,529円	4,730,279,405円
期中一部解約元本額	6,722,355,961円	6,359,941,257円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワ外国債券インデックスＶＡ	2,562,714,235円	2,290,419,243円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	84,164,616円	73,485,615円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	646,942,651円	537,277,899円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	168,813,034円	135,056,068円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,062,093,708円	1,722,206,915円
ワールドアセット（安定コース）	128,133円	－円
ワールドアセット（分散コース）	85,567円	－円
Ｄ－Ｉ'ｓ 外国債券インデックス	－円	445,454円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	32,320,590,700円	34,465,553,414円
ダイワ・ライフ・バランス３０	449,898,390円	422,054,516円
ダイワ・ライフ・バランス５０	181,884,120円	191,757,096円
ダイワ・ライフ・バランス７０	101,735,692円	110,025,498円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	176,738,888円	187,063,304円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	125,987,239円	148,457,365円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	29,707,678円	36,267,690円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	7,425,218円	8,855,272円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	4,655,563円	6,361,098円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	280,231円	327,294円

ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	2,793,004,729円	2,209,328,440円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	309,148,987円	231,160,596円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	10,204,101,350円	8,707,192,168円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	1,322,773,858円	708,262,308円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	1,121,674,357円	582,345,067円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	562,382,193円	454,402,000円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	414,192円	39,180,811円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,955,933,335円	5,295,256,154円
ダイワライフスタイル２５	26,255,997円	25,935,134円
ダイワライフスタイル５０	41,243,167円	42,372,501円
ダイワライフスタイル７５	10,979,258円	11,046,314円
計	60,271,757,086円	58,642,095,234円
2.　期末日における受益権の総数	60,271,757,086口	58,642,095,234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25年12月3日 至　平成26年12月1日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、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こと、および外貨建資産の売買代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。
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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成26年12月1日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	平成25年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成26年12月1日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,372,105,042	8,345,849,135
合計	△3,372,105,042	8,345,849,135

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成25年12月2日まで、及び平成25年12月3日から平成26年12月1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25年12月2日 現在				平成26年12月1日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	1,008,445,198	－	1,007,870,641	574,557	762,492,839	－	761,446,060	1,046,779
アメリカ・ドル	484,674,511	－	484,985,114	△310,603	－	－	－	－
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	30,486,595	－	30,257,836	228,759
カナダ・ドル	33,768,516	－	33,662,722	105,794	－	－	－	－
スイス・フラン	－	－	－	－	20,374,257	－	20,319,491	54,766
スウェーデン・クローナ	1,477,643	－	1,475,634	2,009	1,522,393	－	1,517,801	4,592
デンマーク・クローネ	107,168,814	－	106,966,925	201,889	168,148,908	－	167,941,222	207,686
ポーランド・ズロチ	3,060,790	－	3,060,080	710	25,750,631	－	25,754,612	△3,981
ユーロ	369,147,134	－	368,579,010	568,124	504,256,011	－	503,748,037	507,974
南アフリカ・ランド	9,147,790	－	9,141,156	6,634	11,954,044	－	11,907,061	46,983
買　建	1,661,590,033	－	1,665,110,226	3,520,193	1,590,254,841	－	1,597,665,105	7,410,264
アメリカ・ドル	553,376,937	－	553,779,180	402,243	592,178,995	－	595,867,332	3,688,337
イギリス・ポンド	238,377,879	－	241,893,168	3,515,289	206,852,103	－	207,699,286	847,183
オーストラリア・ドル	91,751,979	－	91,697,961	△54,018	25,305,249	－	25,252,920	△52,329
カナダ・ドル	35,244,644	－	35,138,550	△106,094	45,009,250	－	45,013,505	4,255
シンガポール・ドル	5,137,492	－	5,139,540	2,048	5,798,086	－	5,806,720	8,634
スイス・フラン	5,426,472	－	5,425,440	△1,032	5,141,486	－	5,159,280	17,794
スウェーデン・クローナ	7,946,711	－	7,950,580	3,869	7,651,852	－	7,663,800	11,948

デンマーク・クローネ	11,264,160	－	11,251,980	△12,180	11,140,187	－	11,201,040	60,853
ノルウェー・クローネ	4,737,858	－	4,737,120	△738	4,300,598	－	4,286,550	△14,048
ポーランド・ズロチ	11,944,496	－	11,941,880	△2,616	9,829,685	－	9,886,800	57,115
マレーシア・リンギット	29,413,830	－	29,432,370	18,540	990,817	－	982,906	△7,911
メキシコ・ペソ	39,646,573	－	40,075,628	429,055	23,911,151	－	24,061,046	149,895
ユーロ	620,166,090	－	619,456,829	△709,261	643,806,196	－	646,450,000	2,643,804
南アフリカ・ランド	7,154,912	－	7,190,000	35,088	8,339,186	－	8,333,920	△5,266
合計	2,670,035,231	－	2,672,980,867	4,094,750	2,352,747,680	－	2,359,111,165	8,457,043

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 期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 期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 期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。

・ 期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。

・ 期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) 期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、期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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4576円 (24,576円)	2.9332円 (29,332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	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20160215	1,826,000.000	1,920,294.640	
		5.125% United States Treasury Note/Bond 20160515	1,940,000.000	2,076,614.800	
		4.875% United States Treasury Note/Bond 20160815	1,999,000.000	2,151,803.560	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	2,336,000.000	2,524,959.040	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,039,000.000	2,220,674.900	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,795,000.000	1,961,665.750	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20170815	2,401,000.000	2,656,370.360	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,686,000.000	1,851,093.120	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20180215	3,839,000.000	4,144,891.520	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,960,000.000	3,243,716.000	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	3,173,000.000	3,502,674.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20181115	2,488,000.000	2,731,724.480	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	3,161,000.000	3,348,162.810	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20160229	2,195,000.000	2,260,674.400	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20160331	2,463,000.000	2,532,752.160	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20160430	2,001,000.000	2,067,813.390	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,096,000.000	3,329,624.160	
		3.25% United States Treasury Note/Bond 20160531	621,000.000	648,870.480	
		3.25% United States Treasury Note/Bond 20160630	2,121,000.000	2,219,987.070	
		3.25% United States Treasury Note/Bond 20160731	1,833,000.000	1,921,992.150	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	3,116,000.000	3,427,600.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20160831	2,488,000.000	2,602,000.160	
		3% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,499,000.000	2,616,627.930	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20161031	2,319,000.000	2,437,384.950	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115	4,020,000.000	4,383,046.200	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20161130	4,149,000.000	4,336,493.310	
		3.25% United States Treasury Note/Bond 20161231	4,011,000.000	4,237,059.960	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,884,000.000	3,043,831.280	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	5,630,000.000	6,222,444.900	
		3% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,687,000.000	2,831,936.780	
		3.25% United States Treasury Note/Bond 20170331	4,635,000.000	4,917,966.750	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20170430	1,653,000.000	1,751,072.490	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	3,073,000.000	3,379,562.480	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,835,000.000	2,980,605.600	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,468,000.000	3,624,996.360	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20170731	1,773,000.000	1,848,547.530	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	2,854,000.000	3,003,150.040
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20170831	2,903,000.000	2,987,680.510
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20170930	2,831,000.000	2,913,155.620
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20171031	382,000.000	393,142.940
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,738,282.650
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20151130	1,731,000.000	1,751,754.690
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20171130	883,000.000	918,452.450
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20151231	2,515,000.000	2,567,060.500
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	924,000.000	975,318.960
		2% United States Treasury Note/Bond 20160131	635,000.000	648,220.700
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20180131	255,000.000	268,086.600
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,523,381.760
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20160229	200,000.000	204,742.000
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	1,234,000.000	1,303,017.620
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20160331	2,649,000.000	2,719,860.750
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20180331	1,300,000.000	1,379,105.000
		2% United States Treasury Note/Bond 20160430	2,295,000.000	2,352,283.200
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	260,000.000	273,769.600
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,417,000.000	3,690,599.190
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20160531	3,832,000.000	3,917,453.600

		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180531	1,322,000.000	1,380,762.900	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20160630	3,406,000.000	3,471,054.600	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,065,000.000	1,112,424.450	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20160731	2,053,000.000	2,092,848.730	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,341,000.000	1,394,532.720	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,575,177.500	
		1% United States Treasury Note/Bond 20160831	4,502,000.000	4,551,747.100	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20180831	3,444,000.000	3,487,291.080	
		1% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,793,000.000	2,823,220.260	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180930	2,835,000.000	2,854,930.050	
		1% United States Treasury Note/Bond 20161031	2,718,000.000	2,747,300.040	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20181031	1,320,000.000	1,345,977.600	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	1,353,000.000	1,364,730.510	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20161130	3,027,000.000	3,050,761.950	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181130	2,165,000.000	2,174,959.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20161231	3,410,000.000	3,434,893.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20181231	1,861,000.000	1,867,234.350	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170131	2,970,000.000	2,990,997.900	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190131	1,426,000.000	1,421,978.680	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,247,922.080	

		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170228	2,408,000.000	2,423,603.840
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20190228	1,843,000.000	1,846,870.300
		1% United States Treasury Note/Bond 20170331	3,856,000.000	3,888,968.800
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190331	300,000.000	301,803.000
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170430	2,375,000.000	2,387,516.250
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20190430	559,000.000	556,378.290
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,429,393.640
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20170531	2,125,000.000	2,120,665.000
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,385,000.000	2,360,029.050
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20170630	3,906,000.000	3,907,054.620
		1% United States Treasury Note/Bond 20190630	1,368,000.000	1,343,731.680
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20170731	5,660,000.000	5,619,078.200
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20190731	2,784,000.000	2,716,571.520
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,481,205.100
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20170831	6,410,000.000	6,379,167.900
		1% United States Treasury Note/Bond 20190831	2,562,000.000	2,509,555.860
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20170930	1,913,000.000	1,901,713.300
		1% United States Treasury Note/Bond 20190930	2,215,000.000	2,167,399.650
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	2,648,000.000	2,639,711.760
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031	884,000.000	875,160.000

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,081,101.760	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20171130	2,336,000.000	2,317,545.600	
		1% United States Treasury Note/Bond 20191130	1,353,000.000	1,321,393.920	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20151215	2,822,000.000	2,823,636.760	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20171231	1,913,000.000	1,902,669.800	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231	894,000.000	876,951.420	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160115	2,425,000.000	2,429,825.750	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20180131	2,153,000.000	2,146,928.540	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131	664,000.000	658,966.880	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160215	143,000.000	143,306.020	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	3,850,000.000	3,845,457.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180228	3,447,000.000	3,420,044.460	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229	1,968,000.000	1,938,243.840	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160315	3,155,000.000	3,161,751.700	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20180331	2,315,000.000	2,294,743.750	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331	1,160,000.000	1,133,853.600	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20160415	2,037,000.000	2,037,855.540	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,573,731.250	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20160515	2,512,000.000	2,512,075.360	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20180430	4,218,000.000	4,158,652.740	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430	1,451,000.000	1,416,538.750	
		1% United States Treasury Note/Bond 20180531	3,407,000.000	3,397,664.820	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,430,803.530	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20160615	3,186,000.000	3,197,565.180	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180630	1,693,000.000	1,709,320.520	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,159,619.330	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20160715	3,108,000.000	3,123,633.240	
		2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,885,292.740	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20180731	1,697,000.000	1,711,967.540	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,468,000.000	4,622,592.800	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20160815	2,989,000.000	3,003,108.080	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	2,042,346.680	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20160915	1,816,000.000	1,832,089.760	
		2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,917,836.700	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20161015	2,870,000.000	2,881,078.200	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181031	3,611,000.000	3,615,513.750	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,349,197.550	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	4,774,000.000	5,032,798.540	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20161115	719,000.000	721,214.520	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20181130	3,359,000.000	3,359,772.570	

		0.25% United States Treasury Note/Bond 20151130	2,299,000.000	2,301,046.110
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,538,890.150
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20161215	144,000.000	144,398.880
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20181231	2,026,000.000	2,043,241.260
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20151231	1,438,000.000	1,438,949.080
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,079,640.260
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20170115	2,168,000.000	2,177,907.760
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	6,275,000.000	6,609,771.250
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190131	2,185,000.000	2,202,917.000
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160131	3,057,000.000	3,063,664.260
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	2,769,000.000	2,827,619.730
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20170215	2,190,000.000	2,192,474.700
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190228	2,373,000.000	2,391,343.290
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20160229	3,101,000.000	3,102,550.500
		2% United States Treasury Note/Bond 20210228	2,689,000.000	2,724,279.680
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20170315	1,182,000.000	1,186,196.100
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160331	5,058,000.000	5,067,660.780
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190331	2,383,000.000	2,411,286.210
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,899,000.650
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170415	1,485,000.000	1,493,523.900

		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160430	3,122,000.000	3,127,713.260	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,412,000.000	5,579,393.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190430	2,975,000.000	3,008,915.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170515	2,237,000.000	2,247,916.560	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,804,000.000	2,879,988.400	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20190531	2,241,000.000	2,253,415.140	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,761,450.960	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20160531	3,013,000.000	3,018,272.750	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170615	753,000.000	756,027.060	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20160630	2,858,000.000	2,867,031.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190630	2,885,000.000	2,914,744.350	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,548,705.800	
		7.25% United States Treasury Note/Bond 20160515	1,850,000.000	2,036,073.000	
		7.5% United States Treasury Note/Bond 20161115	1,552,000.000	1,763,149.600	
		8.75% United States Treasury Note/Bond 20170515	1,527,000.000	1,827,559.410	
		8.875% United States Treasury Note/Bond 20190215	904,000.000	1,186,210.720	
		8.125% United States Treasury Note/Bond 20190815	1,582,000.000	2,066,487.500	
		8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	891,423.420	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,954,149.380	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	874,770.780	

		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,171,683.450
		6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	906,261.300
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	1,006,113.540
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	951,342.000
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	938,000.000	1,250,175.780
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	215,000.000	287,108.850
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,347,000.000	1,998,611.250
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,436,000.000	1,980,775.320
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,606,000.000	2,090,433.840
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	547,000.000	761,566.220
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	108,000.000	138,003.480
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	1,019,000.000	1,325,729.190
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	255,000.000	285,997.800
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	694,000.000	873,135.280
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	353,000.000	460,552.040
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	810,000.000	1,039,076.100
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,517,000.000	2,018,080.270
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,903,841.360
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,898,619.850
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,992,000.000	2,521,115.040

		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,130,000.000	2,910,112.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,807,000.000	2,343,733.210	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,607,824.390	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	2,492,000.000	2,621,060.680	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,865,000.000	3,009,138.150	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	2,990,000.000	3,062,627.100	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,731,000.000	1,684,609.200	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	3,984,000.000	3,872,846.400	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,026,000.000	2,118,426.120	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,998,000.000	3,978,289.860	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,314,000.000	3,796,054.440	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,192,276.700	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,144,828.810	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,993,000.000	3,278,502.270	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170715	2,583,000.000	2,591,963.010	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190731	3,326,000.000	3,356,898.540	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20160731	2,719,000.000	2,727,592.040	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,907,060.520	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,694,000.000	6,818,441.460	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,729,000.000	3,899,415.300	

		0.875% United States Treasury Note/Bond 20170815	1,818,000.000	1,822,472.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20190831	1,189,000.000	1,199,165.950	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20160831	2,219,000.000	2,224,281.220	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,312,787.060	
		1% United States Treasury Note/Bond 20170915	148,000.000	148,849.520	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20190930	3,404,000.000	3,450,532.680	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20160930	2,222,000.000	2,226,599.540	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,686,987.500	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20171015	1,466,000.000	1,467,993.760	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	3,190,000.000	3,193,732.300	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,181,061.050	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	1,448,000.000	1,459,077.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	1,436,000.000	1,467,850.480	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20171115	1,593,000.000	1,594,178.820	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20161031	145,000.000	144,818.750	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 562,751,137.150 (66,905,482,696)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		2% United Kingdom Gilt 20200722	271,000.000	279,075.800	
		8.75% United Kingdom Gilt 20170825	868,000.000	1,057,310.800	

		8% United Kingdom Gilt 20151207	186,000.000	200,377.800	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,213,000.000	1,702,688.100	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,388,861.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,114,000.000	2,669,136.400	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,662,000.000	2,137,830.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,932,000.000	2,469,096.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,021,587.500	
		4.75% United Kingdom Gilt 20200307	1,724,000.000	2,022,424.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,395,299.200	
		4% United Kingdom Gilt 20160907	2,475,000.000	2,626,222.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,831,000.000	2,460,497.800	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,525,339.200	
		5% United Kingdom Gilt 20180307	1,604,000.000	1,815,407.200	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,793,000.000	2,454,437.700	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,765,000.000	2,335,977.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,773,000.000	2,420,322.300	
		4.5% United Kingdom Gilt 20190307	1,820,000.000	2,074,618.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,178,000.000	1,530,104.200	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,391,000.000	1,620,236.800	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,870,000.000	2,453,253.000	

		3.75% United Kingdom Gilt 20190907	1,428,000.000	1,593,076.800	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,144,000.000	1,549,891.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20200907	2,155,000.000	2,432,779.500	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,657,000.000	2,160,562.300	
		2% United Kingdom Gilt 20160122	828,000.000	842,407.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,843,000.000	2,103,968.800	
		1.75% United Kingdom Gilt 20170122	1,533,000.000	1,570,405.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,182,000.000	1,484,946.600	
		1% United Kingdom Gilt 20170907	2,737,000.000	2,752,327.200	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,416,000.000	2,424,939.200	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,012,000.000	2,245,794.400	
		1.25% United Kingdom Gilt 20180722	3,222,000.000	3,244,231.800	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,393,000.000	2,476,037.100	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	963,000.000	1,190,364.300	
		1.75% United Kingdom Gilt 20190722	2,922,000.000	2,984,823.000	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	2,259,000.000	2,423,229.300	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	576,000.000	673,286.400	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 75,813,174.600 (14,063,343,888)	
	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% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,737,000.000	1,870,679.520	

		5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,506,000.000	2,786,646.940	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,755,000.000	2,066,038.650	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	2,619,000.000	2,864,452.680	
		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,882,000.000	2,251,342.500	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,636,000.000	1,692,769.200	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	2,063,000.000	2,255,581.050	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,527,000.000	3,004,552.460	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	1,385,000.000	1,450,621.300	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,023,000.000	1,184,879.520	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,617,000.000	1,580,730.690	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	649,000.000	643,574.360	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,360,000.000	1,378,849.600	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	783,000.000	891,860.490	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20181021	671,000.000	690,740.820	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	857,000.000	947,490.630	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20191021	162,000.000	163,391.580	
		3.75% Australia Government Bond 20370421	763,000.000	777,519.890	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 28,501,721.880 (2,865,848,135)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 285,000.000	カナダ・ドル 313,004.100	

		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	639,459.180
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,093,000.000	1,579,975.220
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,017,000.000	1,542,860.190
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,470,000.000	2,133,705.000
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	571,000.000	596,786.360
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,877,029.210
		4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	969,000.000	1,071,432.990
		3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,199,000.000	2,434,468.920
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,413,000.000	1,845,971.460
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,637,046.360
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	1,322,000.000	1,348,572.200
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,390,279.710
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	638,755.790
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	784,674.710
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,572,000.000	1,693,295.520
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,595,000.000	1,968,230.000
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,327,000.000	1,342,233.960
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	216,000.000	218,529.360
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,199,000.000	1,175,115.920
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160201	1,438,000.000	1,442,788.540

		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,268,959.450	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160801	1,585,000.000	1,586,188.750	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	1,021,000.000	1,022,551.920	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,105,000.000	1,166,603.750	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170201	455,000.000	459,936.750	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190301	853,000.000	869,113.170	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160501	1,166,000.000	1,166,641.300	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190901	295,000.000	300,029.750	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170801	341,000.000	342,664.080	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	263,000.000	282,354.170	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	700,000.000	718,564.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20161101	1,014,000.000	1,014,861.900	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301	166,000.000	166,386.780	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180201	98,000.000	98,320.460	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 38,137,390.930 (3,959,423,926)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	546,935.480	
		4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	391,000.000	433,411.770	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	758,876.640	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	494,686.400	

		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	475,177.440	
		2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	788,000.000	831,568.520	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	768,000.000	823,403.520	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	323,000.000	336,643.520	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	279,000.000	289,694.070	
		1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	686,000.000	691,817.280	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	197,000.000	202,726.790	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	227,000.000	222,957.130	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	272,000.000	268,673.440	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	333,000.000	351,048.600	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	173,000.000	190,256.750	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	336,000.000	349,698.720	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20191001	70,000.000	70,713.300	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 7,338,289.370 (666,610,206)	
	スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
		4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	660,000.000	863,359.200	
		4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	589,000.000	850,486.550	
		2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,025,000.000	1,060,321.500	
		4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	203,000.000	225,746.150	
		3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	673,000.000	738,005.070	

	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	514,000.000	583,724.100	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	37,000.000	41,643.500	
	2% SWISS GOVERNMENT BOND 20210428	295,000.000	331,255.500	
スイス・フラン　小計			スイス・フラン 4,694,541.570 (576,771,377)	
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	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,680,000.000	7,197,468.800	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,600,000.000	4,824,572.000	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,697,364.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	9,420,000.000	11,058,043.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,350,000.000	5,921,872.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	7,555,000.000	9,112,614.350	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	6,290,000.000	6,621,420.100	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,160,000.000	3,625,468.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 54,058,824.050 (860,075,891)	
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	3,957,000.000	6,388,893.060	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,385,000.000	9,368,392.800	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,932,000.000	19,243,333.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	10,234,759.950	

	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	6,150,000.000	7,267,393.500	
	2.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20161115	5,392,000.000	5,655,453.120	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	5,846,000.000	6,278,662.460	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	1,682,000.000	1,825,676.440	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 66,262,564.330 (1,315,974,528)	
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	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	6,185,000.000	6,635,948.350	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	5,075,000.000	5,761,393.750	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	5,808,000.000	6,579,825.120	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,149,000.000	5,249,405.500	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,496,146.200	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 28,722,718.920 (483,977,814)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,894,146.780	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,029,000.000	2,225,285.460	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	1,912,000.000	2,224,153.120	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	627,000.000	866,702.100	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,470,000.000	2,907,980.400	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	2,871,000.000	2,997,955.620	

		5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	1,950,000.000	2,403,531.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	2,615,000.000	2,760,315.550	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,177,000.000	1,258,530.790	
		4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	3,083,000.000	3,514,496.680	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	1,720,000.000	1,825,625.200	
		2.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20180725	1,376,000.000	1,405,350.080	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20160125	1,936,000.000	1,897,531.680	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20160725	577,000.000	560,768.990	
		3.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20190725	1,061,000.000	1,121,264.800	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	558,000.000	603,672.300	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 31,467,310.550 (1,113,942,793)	
	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	2,137,000.000	2,165,208.400	
		4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,230,279.600	
		5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	1,417,000.000	1,539,032.040	
		3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,021,536.600	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	537,542.760	
		5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	818,397.720	
		4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,603,000.000	1,651,106.030	
		4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,440,813.360	

		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	238,000.000	247,232.020	
		4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	2,461,000.000	2,518,907.330	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,567,353.360	
		3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	1,595,000.000	1,589,592.950	
		3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	852,101.250	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	719,157.800	
		4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	606,431.040	
		3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	399,000.000	395,213.490	
		3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	439,710.960	
		3.172% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160715	953,000.000	947,777.560	
		3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	525,548.660	
		3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	401,000.000	390,882.770	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	477,000.000	453,760.560	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	586,000.000	563,497.600	
		3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	660,224.640	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	233,000.000	245,672.870	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	488,000.000	500,526.960	
		3.394% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170315	340,000.000	338,677.400	
		4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	870,677.720	
		3.654% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191031	192,000.000	191,349.120	
	マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット	

			25,028,212.570 (870,731,515)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5% Mexican Bonos 20191211	769,000.000	771,191.650	
	8% Mexican Bonos 20231207	8,233,000.000	9,525,169.350	
	10% Mexican Bonos 20241205	15,850,000.000	20,917,086.500	
	8% Mexican Bonos 20151217	12,987,000.000	13,618,947.420	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	8,568,000.000	9,603,871.200	
	7.25% Mexican Bonos 20161215	10,474,000.000	11,228,337.480	
	7.75% Mexican Bonos 20171214	13,756,000.000	15,165,027.080	
	10% Mexican Bonos 20361120	6,874,000.000	9,544,067.820	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	8,844,000.000	10,716,805.440	
	8.5% Mexican Bonos 20181213	6,960,000.000	7,962,031.200	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	9,694,000.000	11,809,521.620	
	8% Mexican Bonos 20200611	12,728,000.000	14,515,011.200	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,441,000.000	14,311,170.340	
	6.25% Mexican Bonos 20160616	11,839,000.000	12,353,878.110	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	14,891,000.000	16,871,503.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	14,299,000.000	15,132,917.680	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	6,878,000.000	7,784,589.180	
	5% Mexican Bonos 20170615	9,290,000.000	9,552,535.400	
	4.75% Mexican Bonos 20180614	9,384,000.000	9,477,370.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	2,101,000.000	2,384,887.120	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 223,245,919.590 (1,906,520,153)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.375% Finland Government Bond 20200915	232,000.000	233,389.680	
	0.25% Austria Government Bond 20191018	347,000.000	348,172.860	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	316,027.280	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	774,000.000	1,167,617.700	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,774,890.480	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,137,958.640	

		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,113,000.000	1,637,890.800	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,628,967.900	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,769,772.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,857,000.000	2,927,894.760	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,911,000.000	2,824,553.550	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	1,733,000.000	1,799,807.150	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	1,552,000.000	1,650,924.480	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,357,527.600	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	1,910,240.500	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,331,044.450	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,021,886.960	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,549,172.450	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,745,000.000	2,934,549.050	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,091,675.500	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,872,973.190	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,406,688.750	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,247,000.000	2,602,924.800	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	1,902,165.600	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,319,852.640	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,902,102.740	

		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,470,999.650
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,603,095.950
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,707,000.000	1,908,699.120
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,922,000.000	3,222,761.460
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,376,000.000	1,679,352.960
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	2,426,000.000	2,627,236.700
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,850,000.000	2,004,179.000
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,967,720.150
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,707,000.000	1,919,197.170
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,105,000.000	1,216,251.400
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	285,000.000	348,871.350
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,705,000.000	1,835,944.000
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,654,000.000	1,700,312.000
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20151211	428,000.000	428,145.520
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160311	1,103,000.000	1,107,048.010
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160610	655,000.000	657,757.550
		Bundesschatzanweisungen 20160916	1,030,000.000	1,030,597.400
		Bundesschatzanweisungen 20161216	35,000.000	35,024.500
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	927,000.000	950,230.620
		2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	1,642,000.000	1,703,098.820

		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,020,569.080	
		0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	1,717,000.000	1,746,498.060	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	1,848,000.000	1,870,527.120	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	149,000.000	151,261.820	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	890,000.000	904,765.100	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	1,392,000.000	1,403,484.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20181012	1,209,000.000	1,255,099.170	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190222	523,000.000	544,050.750	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190412	1,113,000.000	1,134,291.690	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20191011	1,151,000.000	1,158,815.290	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	917,177.680	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,111,653.350	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,141,000.000	3,226,722.510	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	4,018,672.070	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,202,845.750	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	4,112,908.990	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,113,000.000	3,197,560.640	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,075,000.000	3,625,486.500	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,800,000.000	2,736,720.000	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,912,983.500	

		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	3,522,000.000	3,682,286.220	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,222,000.000	3,119,887.980	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,582,243.120	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,123,000.000	4,058,026.200	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	2,396,000.000	2,689,246.440	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,563,431.360	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	2,218,000.000	2,574,809.660	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,618,662.850	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,610,000.000	3,058,345.800	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,590,000.000	4,205,828.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,095,000.000	1,686,913.200	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,927,466.400	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,502,436.300	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,377,000.000	5,198,606.670	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	2,988,000.000	3,516,278.400	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,653,000.000	3,098,332.580	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	1,940,000.000	2,180,501.800	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	2,114,000.000	2,180,908.100	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	378,000.000	481,583.340	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,747,000.000	2,979,368.730	

		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181125	984,000.000	1,017,642.960
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,623,000.000	2,948,855.290
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190525	1,764,000.000	1,827,292.320
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161125	1,401,000.000	1,407,934.950
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,291,000.000	1,461,515.280
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,014,000.000	2,162,713.760
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125	1,470,000.000	1,487,698.800
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,496,841.970
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	2,838,000.000	2,955,152.640
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,404,891.450
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,916,474.600
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,084,783.000
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,901,716.320
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,195,000.000	1,762,111.150
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,488,534.480
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,291,000.000	1,612,936.670
		4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,569,890.800
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,392,194.350
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,347,000.000	1,585,944.330
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,354,021.920

		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,739,000.000	2,582,084.590
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,775,000.000	2,108,380.500
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,465,000.000	1,542,498.500
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,623,056.220
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	600,000.000	706,776.000
		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	1,477,000.000	1,533,170.310
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160415	1,185,000.000	1,185,260.700
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,105,000.000	1,204,427.900
		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115	1,170,000.000	1,225,727.100
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170415	317,000.000	320,683.540
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	466,000.000	594,569.400
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	900,000.000	998,388.000
		0.25% Netherlands Government Bond 20200115	348,000.000	348,887.400
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	2,135,336.720
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,672,004.100
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,722,000.000	3,912,548.360
		2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20241201	454,000.000	472,927.260
		0.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180115	1,743,000.000	1,744,812.720
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,654,000.000	3,471,697.400
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	3,118,000.000	4,434,450.780

		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,880,000.000	2,626,660.800	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170801	2,528,000.000	2,837,755.840	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190201	4,052,000.000	4,623,332.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201	1,921,000.000	2,257,405.520	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,368,000.000	3,052,280.960	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,589,000.000	2,907,938.910	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	3,134,476.320	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160801	3,007,000.000	3,170,971.710	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170201	2,280,000.000	2,451,661.200	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180201	2,480,000.000	2,773,805.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,674,000.000	2,156,195.700	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,341,000.000	2,894,178.300	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180801	2,928,000.000	3,317,951.040	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190301	2,708,000.000	3,119,886.800	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190901	3,598,000.000	4,146,946.860	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,403,000.000	3,044,841.300	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,022,000.000	2,591,132.340	
		4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301	2,560,000.000	2,980,300.800	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,000,000.000	2,314,500.000	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,361,000.000	2,882,474.070	

		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,460,604.480	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,687,000.000	3,258,041.240	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160415	2,034,000.000	2,126,608.020	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160915	986,000.000	1,060,906.420	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	1,089,000.000	1,344,043.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170501	2,315,000.000	2,548,629.800	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,088,000.000	1,390,083.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170601	2,626,000.000	2,895,611.420	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	659,000.000	842,781.920	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20171101	1,295,000.000	1,401,837.500	
		2.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20151201	549,000.000	562,241.880	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	791,000.000	983,568.950	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,594,000.000	1,930,604.980	
		2.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20160515	1,027,000.000	1,054,081.990	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20180601	2,341,000.000	2,560,585.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,585,000.000	1,968,934.550	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,674,968.680	
		2.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161115	421,000.000	439,342.970	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20181201	2,111,000.000	2,330,522.890	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	553,000.000	632,897.440	

		1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20161215	318,000.000	324,426.780	
		2.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190501	1,100,000.000	1,175,328.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,376,000.000	1,586,761.920	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	653,000.000	716,047.150	
		1.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20170515	547,000.000	554,548.600	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,027,000.000	1,068,696.200	
		1.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20190801	446,000.000	456,953.760	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,706,000.000	2,573,654.540	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	936,497.700	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,791,000.000	2,784,252.780	
		3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,277,854.300	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,377,000.000	1,721,043.450	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,142,028.250	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,704,567.700	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,799,060.850	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,218,000.000	1,459,017.840	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	735,000.000	761,849.550	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,174,000.000	1,732,882.700	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	2,079,455.760	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,309,855.460	

		4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	1,085,202.810	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	1,070,000.000	1,367,288.800	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	864,000.000	1,174,132.800	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	1,123,000.000	1,273,414.620	
		2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20230622	1,338,000.000	1,503,350.040	
		1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180622	1,052,000.000	1,096,026.200	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20450622	571,000.000	790,983.460	
		2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20240622	1,692,000.000	1,949,657.760	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20340622	394,000.000	475,164.000	
		4.6% IRISH TREASURY 20160418	1,018,000.000	1,082,001.660	
		4.5% IRISH TREASURY 20181018	759,000.000	879,802.440	
		4.4% IRISH TREASURY 20190618	684,000.000	806,914.800	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	570,000.000	720,708.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,262,000.000	1,719,626.440	
		5% IRISH TREASURY 20201018	859,000.000	1,076,713.550	
		5.5% IRISH TREASURY 20171018	579,000.000	665,925.270	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	611,966.880	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	622,000.000	730,905.980	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	313,000.000	326,659.320	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,239,000.000	1,496,959.800	
		6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	1,095,000.000	1,765,534.200	
		4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,580,000.000	1,809,100.000	
		3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,248,000.000	1,502,092.800	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,212,000.000	1,464,859.560	
		4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	994,000.000	1,066,760.800	

		4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	933,000.000	1,386,447.330	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	796,227.570	
		4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,540,552.440	
		4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,317,368.450	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,219,648.530	
		3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	680,627.780	
		3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	872,000.000	1,064,589.920	
		3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20620126	546,000.000	907,588.500	
		1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	738,000.000	799,327.800	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	290,000.000	387,933.000	
		1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20231020	675,000.000	736,404.750	
		2.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340523	220,000.000	253,864.600	
		1.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20181019	307,000.000	320,191.790	
		1.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20241021	383,000.000	412,471.850	
		3.875% Finland Government Bond 20170915	474,000.000	524,978.700	
		4.375% Finland Government Bond 20190704	550,000.000	656,392.000	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	873,549.890	
		3.375% Finland Government Bond 20200415	738,000.000	861,659.280	
		1.75% Finland Government Bond 20160415	625,000.000	640,143.750	
		3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	549,624.960	

		1.875% Finland Government Bond 20170415	799,000.000	834,555.500
		2.75% Finland Government Bond 20280704	270,000.000	321,872.400
		1.625% Finland Government Bond 20220915	725,000.000	784,334.000
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	477,893.460
		2.625% Finland Government Bond 20420704	293,000.000	359,918.270
		1.125% Finland Government Bond 20180915	425,000.000	442,276.250
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	587,422.760
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,108,000.000	2,967,579.160
		0.5% Spain Government Bond 20171031	382,000.000	380,449.080
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,989,577.680
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,868,904.220
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,963,000.000	2,338,580.790
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,942,452.270
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	2,135,000.000	2,289,040.250
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,492,101.390
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	2,206,000.000	2,475,330.540
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	2,234,932.900
		4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,788,202.460
		4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	2,065,674.000
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	1,130,743.390

		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,101,000.000	2,430,394.780	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	1,416,911.300	
		4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	2,037,372.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	1,609,000.000	1,674,502.390	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	3,180,368.400	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,265,000.000	1,734,315.000	
		4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,932,000.000	2,073,364.440	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,583,841.620	
		4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	2,000,000.000	2,240,600.000	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,758,000.000	2,269,595.580	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160730	1,689,000.000	1,770,747.600	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,089,000.000	1,328,057.280	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	806,000.000	1,048,968.700	
		3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20181031	1,564,000.000	1,744,657.640	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	795,000.000	1,069,084.200	
		2.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170430	1,488,000.000	1,543,889.280	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190430	1,836,000.000	1,987,488.360	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,219,000.000	2,600,623.620	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,411,000.000	1,517,474.060	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131	448,000.000	457,945.600	
	ユーロ　小計			ユーロ	

				490,421,051.490 (72,494,039,831)	
	南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	7,233,000.000	7,570,853.430	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	6,869,000.000	7,183,737.580	
		7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	9,010,000.000	9,140,915.300	
		10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	13,703,000.000	16,718,893.270	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	7,612,000.000	6,083,967.120	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	9,910,000.000	9,739,548.000	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,393,000.000	7,535,722.110	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,999,000.000	8,139,415.520	
		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,839,000.000	2,911,508.060	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	4,547,000.000	4,676,589.500	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	2,777,000.000	2,812,573.370	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	1,365,000.000	1,363,785.150	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,348,000.000	2,424,239.560	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	1,115,000.000	1,119,560.350	
	南アフリカ・ランド　小計			南アフリカ・ランド 87,421,308.320 (936,282,212)	
国債証券　合計				169,019,024,965 [169,019,024,965]	
合計				169,019,024,965 [169,019,024,965]	

（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	231銘柄	100%	39.6%
イギリス・ポンド	国債証券	39銘柄	100%	8.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	100%	1.7%
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	100%	2.3%
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.8%
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	28銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	20銘柄	100%	1.1%
ユーロ	国債証券	271銘柄	100%	42.9%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	100%	0.6%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２　【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年12月30日

Ⅰ	資産総額	651,539,909円
Ⅱ	負債総額	1,368,971円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	650,170,938円
Ⅳ	発行済数量	530,708,973口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2251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26年12月30日

Ⅰ	資産総額	134,422,933,430円
Ⅱ	負債総額	7,202,117,780円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	127,220,815,650円
Ⅳ	発行済数量	154,630,316,965口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8227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26年12月30日

Ⅰ	資産総額	56,655,407,014円
Ⅱ	負債総額	50,418,348円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	56,604,988,666円
Ⅳ	発行済数量	42,311,233,724口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3378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26年12月30日

Ⅰ	資産総額	83,021,217,824円
Ⅱ	負債総額	92,959,616円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,928,258,208円
Ⅳ	発行済数量	40,841,740,455口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0305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26年12月30日

Ⅰ	資産総額	171,940,384,606円
Ⅱ	負債総額	130,867,122円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	171,809,517,484円
Ⅳ	発行済数量	58,275,809,928口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9482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簡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26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CIO（Chief Investment Officer）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、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

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。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、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26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	21	184,914
追加型株式投資信託	538	11,205,522
株式投資信託　　合計	559	11,390,437
単位型公社債投資信託	1	9,185
追加型公社債投資信託	17	3,265,047
公社債投資信託　合計	18	3,274,233
総合計	577	14,664,670

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。
　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８月６日内閣府令第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55期事業年度（平成25年４月１日から平成26年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
　また、第56期事業年度に係る中間会計期間（平成26年４月１日から平成26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。

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25年３月31日現在）		当事業年度 （平成26年３月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		14,380,327		15,186,222
有価証券		9,427,636		15,003,765
前払金		207		453
前払費用		142,919		157,453
未収入金		521,825		―
未収委託者報酬		7,183,011		8,265,950
未収収益		106,914		103,432
貯蔵品		9,551		14,492
繰延税金資産		491,727		674,141
その他		8,445		597
流動資産計		32,272,567		39,406,511
固定資産				
有形固定資産	※1	254,258	※1	252,417
建物（純額）		26,257		23,555
器具備品（純額）		222,274		224,362
リース資産（純額）		5,726		4,499
無形固定資産		3,194,512		2,991,462
ソフトウェア		3,132,238		2,910,918

ソフトウェア仮勘定		50,423		68,693
電話加入権		11,850		11,850
投資その他の資産		15,113,434		15,077,046
投資有価証券		8,342,934		8,338,733
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		129,405
従業員に対する長期貸付金		92,527		68,396
差入保証金		1,000,820		997,594
長期前払費用		7,376		6,484
投資不動産（純額）	※1	402,340	※1	398,402
貸倒引当金		△9,950		△3,040
固定資産計		18,562,205		18,320,926
資産合計		50,834,773		57,727,438

（単位:千円）

		前事業年度 （平成25年３月31日現在）		当事業年度 （平成26年３月31日現在）
負債の部				
流動負債				
リース債務		1,227		1,227
預り金		56,491		53,677
未払金		6,795,899		8,998,456
未払収益分配金		10,333		7,931
未払償還金		113,002		77,698
未払手数料		3,764,501		4,277,412
その他未払金	※2	2,908,061	※2	4,635,414
未払費用		3,383,551		3,463,796
未払法人税等		588,040		1,530,565
未払消費税等		189,139		530,831
賞与引当金		841,300		955,600
流動負債計		11,855,648		15,534,154
固定負債				
リース債務		4,494		3,272
退職給付引当金		1,935,442		1,959,451
役員退職慰労引当金		67,410		80,280
繰延税金負債		1,740,407		1,789,543
固定負債計		3,747,753		3,832,547
負債合計		15,603,402		19,366,702
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		
繰越利益剰余金	7,722,723	10,821,849
利益剰余金合計	8,097,020	11,196,146
株主資本合計	34,767,020	37,866,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	464,350	494,589
評価・換算差額等合計	464,350	494,589
純資産合計	35,231,371	38,360,735
負債・純資産合計	50,834,773	57,727,438

(2) 【損益計算書】

（単位:千円）

	前事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）	当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	73,498,726	84,771,977
その他営業収益	526,465	788,473
営業収益計	74,025,191	85,560,451
営業費用		
支払手数料	41,213,272	47,520,063
広告宣伝費	604,864	668,841
公告費	949	533
受益証券発行費	―	25
調査費	8,116,701	8,246,807
調査費	824,915	741,792
委託調査費	7,291,786	7,505,015
委託計算費	807,090	735,588
営業雑経費	1,280,599	1,322,711
通信費	206,564	249,081
印刷費	404,023	477,092
協会費	53,643	54,190
諸会費	11,281	11,711
その他営業雑経費	605,086	530,634
営業費用計	52,023,478	58,494,570
一般管理費		

給料	5,264,128	5,708,541
役員報酬	249,180	243,000
給料・手当	3,782,533	3,785,717
賞与	391,114	724,223
賞与引当金繰入額	841,300	955,600
福利厚生費	809,254	793,740
交際費	55,806	37,951
寄付金	636	―
旅費交通費	196,147	191,623
租税公課	206,178	222,767
不動産賃借料	887,968	1,182,703
退職給付費用	469,713	373,920
役員退職慰労引当金繰入額	38,970	33,750
固定資産減価償却費	1,181,438	963,183
諸経費	1,094,627	1,354,169
一般管理費計	10,204,869	10,862,351
営業利益	11,796,843	16,203,530

（単位:千円）

	前事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）		当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）	
営業外収益				
受取配当金	※1	257,704	※1	144,660
有価証券利息		11,102		13,966
受取利息		10,598		9,117
時効成立分配金・償還金		21,305		44,877
投資有価証券売却益		279,443		64,122
有価証券償還益		101,052		63,228
その他		44,912		34,445
営業外収益計		726,118		374,418
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		19,392		16,985
投資有価証券売却損		36,469		3,171
有価証券償還損		33,338		18,848
投資不動産管理費用		16,271		16,864
貯蔵品廃棄損		9,990		9,503
その他		13,120		9,343
営業外費用計		128,584		74,716
経常利益		12,394,377		16,503,232
特別利益				

投資有価証券売却益		39,827		―
固定資産売却益		31		―
その他		16,466		―
特別利益計		56,325		―
特別損失				
固定資産除却損	※2	129,816	※2	888
本社移転関連費用		1,099,913		―
その他		14,428		―
特別損失計		1,244,158		888
税引前当期純利益		11,206,544		16,502,343
法人税、住民税及び事業税		4,286,691		6,525,874
法人税等調整額		△109,902		△150,022
法人税等合計		4,176,789		6,375,851
当期純利益		7,029,755		10,126,492

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,715,116	8,089,414	34,759,414
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149	△7,022,149	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755	7,029,755	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	7,606	7,606	7,606
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33,879	53,783	87,663	34,847,077
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	430,470	△53,783	376,686	376,686
当期変動額合計	430,470	△53,783	376,686	384,293
当期末残高	464,350	-	464,350	35,231,371

当事業年度（自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366	△7,027,366	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492	10,126,492	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099,125	3,099,125	3,099,125
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350	-	464,350	35,231,371
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	30,238	-	30,238	30,238
当期変動額合計	30,238	-	30,238	3,129,364
当期末残高	494,589	-	494,589	38,360,735

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　８～47年
器具備品　　４～20年
（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）
当社は、当事業年度より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。
この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。
この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微です。

（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年間）に基づく定額法によっております。

（３）長期前払費用
定額法によっております。

（４）リース資産
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準
（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
役員及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。

（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。

（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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
（１）消費税等の会計処理
消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用
連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成25年３月31日現在）	当事業年度 （平成26年３月31日現在）
建物	15,528千円	18,230千円
器具備品	250,072千円	249,761千円
リース資産	409千円	1,636千円
投資建物	724,130千円	729,348千円
投資器具備品	23,691千円	24,180千円

※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。

	前事業年度 （平成25年３月31日現在）	当事業年度 （平成26年３月31日現在）
未払金	2,883,398千円	4,508,988千円

３　保証債務

前事業年度（平成25年３月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成26年３月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719,900千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

※１　関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）	当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）
受取配当金	185,280千円	－

※２　固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）	当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）
建物	546千円	－
器具備品	128,892千円	888千円
無形固定資産（その他）	377千円	－
計	129,816千円	888千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25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）

	当事業年度期首 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24年６月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 ３月31日	平成24年 ６月26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25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とおり提案しております。

①　剰余金の配当の総額　　7,027百万円
②　配当の原資　　利益剰余金
③　１株当たり配当額　　2,694円
④　基準日　　平成25年３月31日
⑤　効力発生日　　平成25年６月25日

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26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）

	当事業年度期首株式数	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25年６月24日定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年３月31日	平成25年６月25日

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

平成26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とおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　10,126百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,882円
④ 基準日　平成26年３月31日
⑤ 効力発生日　平成26年６月26日

（金融商品関係）

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。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券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、「証券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、証券投資信託、株式であります。証券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。

未払手数料は証券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。

（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、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、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。

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。

２．金融商品の時価等に関する事項

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）。

前事業年度（平成25年３月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	14,380,327	14,380,327	―
（２）未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	―
（３）未収入金	521,825	521,825	―
（４）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	16,711,401	16,711,401	―
資産計	38,796,567	38,796,567	―
（１）未払手数料	3,764,501	3,764,501	―
（２）その他未払金	2,908,061	2,908,061	―
（３）未払費用（*）	2,782,587	2,782,587	―
負債計	9,455,149	9,455,149	―

（*）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。

当事業年度（平成26年３月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（１）現金・預金	15,186,222	15,186,222	―
（２）未収委託者報酬	8,265,950	8,265,950	―
（３）未収入金	―	―	―
（４）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	22,283,329	22,283,329	―
資産計	45,735,503	45,735,503	―
（１）未払手数料	4,277,412	4,277,412	―
（２）その他未払金	4,635,414	4,635,414	―
（３）未払費用（*）	2,678,610	2,678,610	―
負債計	11,591,437	11,591,437	―

（*）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。

<注１>金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、（２）未収委託者報酬、並びに（３）未収入金

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。

（４）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。

<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	前事業年度 （平成25年３月31日現在）	当事業年度 （平成26年３月31日現在）
（１）その他有価証券		
非上場株式	1,059,169	1,059,169
（２）子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	5,141,069	5,141,069
（３）差入保証金	1,000,820	997,594

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

前事業年度（平成25年３月31日現在）

（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	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
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	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

当事業年度（平成26年３月31日現在）

（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	15,186,222	-	-	-
未収委託者報酬	8,265,950	-	-	-
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	-	1,498,464	3,978,251	97,038
合計	23,452,173	1,498,464	3,978,251	97,038

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成25年３月31日現在）
　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。

当事業年度（平成26年３月31日現在）
　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

前事業年度（平成25年３月31日現在）

	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	93,459	55,101	38,357
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
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	10,393,629	10,493,953	△100,323
小計	10,393,629	10,493,953	△100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　1,059,169千円）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。

当事業年度（平成26年３月31日現在）

	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	113,247	55,101	58,145
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	5,625,179	4,873,552	751,626
小計	5,738,426	4,928,653	809,772

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	16,544,903	16,586,202	△41,299
小計	16,544,903	16,586,202	△41,299
合計	22,283,329	21,514,856	768,472

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　1,059,169千円）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．売却したその他有価証券

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25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）
（１）株式	141,128	39,827	-
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469
合計	28,255,753	319,271	36,469

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26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	24,501,921	64,122	3,171
合計	24,501,921	64,122	3,171

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、その他有価証券（非上場株式）について3,220千円の減損処理を行っております。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25年３月31日）

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。

２．退職給付債務に関する事項

退職給付債務	1,935,442千円
退職給付引当金	1,935,442千円

３．退職給付費用に関する事項

勤務費用	301,777千円
その他	167,935千円
退職給付費用	469,713千円

(注)　「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26年３月31日）

１．採用している退職給付制度の概要
　当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

２．確定給付制度
(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

期首における退職給付債務	1,935,442千円
勤務費用	201,327千円
退職給付の支払額	△177,317千円
期末における退職給付債務	1,959,451千円

(2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

積立型制度の退職給付債務	－
年金資産	－
	－
非積立型制度の退職給付債務	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

退職給付引当金	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	201,327千円
確定給付制度に係る退職給付費用	201,327千円

３．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

（表示方法の変更）
　「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号　平成24年５月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号　平成24年５月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。
　退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

（税効果会計関係）

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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年３月31日現在）	当事業年度 （平成26年３月31日現在）
繰延税金資産		
減損損失	837,121	833,243
退職給付引当金	693,199	698,348
未払事業税	154,219	335,386
賞与引当金	280,855	287,721
連結法人間取引（譲渡損）	264,269	141,925
投資有価証券評価損	128,953	128,953
繰延資産	157,330	121,437
出資金評価損	114,425	116,888
未払社会保険料	43,411	38,787
器具備品	33,316	33,316
役員退職慰労引当金	24,920	28,611
その他	29,627	24,709
繰延税金資産小計	2,761,651	2,789,330
評価性引当額	△ 1,323,069	△ 1,200,725
繰延税金資産合計	1,438,582	1,588,604
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,428,233	2,428,233
その他有価証券評価差額金	257,138	273,883
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,687,261	2,704,006
繰延税金負債の純額	1,248,679	1,115,401

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。

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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］

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]

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26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のれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

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]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,591,590	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 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。

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,719,900	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 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

前事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25年３月31日）

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	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	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	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ（株）	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

(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）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。

（３）差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26年３月31日）

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	25,994,992	未払手数料	3,216,077
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	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	678,054	未払費用	393,881

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	―	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978,984	長期差入保証金	971,157

(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）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。

（3）差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、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、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）		当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）	
１株当たり純資産額	13,506.24円	１株当たり純資産額	14,705.91円
１株当たり当期純利益	2,694.91円	１株当たり当期純利益	3,882.07円

（注）1．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。

（注）2．１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24年４月１日 至　平成25年３月31日）	当事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）
当期純利益（千円）	7,029,755	10,126,492
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）

該当事項はありません。

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 （平成26年9月30日）
資産の部	

流動資産		
現金・預金		20,257,586
有価証券		5,207,068
未収委託者報酬		9,365,956
貯蔵品		15,509
繰延税金資産		495,241
その他		296,277
流動資産計		35,637,638
固定資産		
有形固定資産	※１	283,555
無形固定資産		
ソフトウエア		2,634,889
その他		90,103
無形固定資産合計		2,724,992
投資その他の資産		
投資有価証券		6,866,175
関係会社株式		5,129,895
その他	※１	1,589,226
投資その他の資産合計		13,585,297
固定資産計		16,593,845
資産合計		52,231,483

（単位:千円）

		当中間会計期間 （平成26年9月30日）
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,227
未払金		6,923,613
未払費用		3,196,727
未払法人税等		1,144,931
賞与引当金		796,000
その他	※３	848,229
流動負債計		12,910,729
固定負債		
リース債務		2,658

退職給付引当金		1,996,246
役員退職慰労引当金		92,730
繰延税金負債		1,845,611
固定負債計		3,937,247
負債合計		16,847,976
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		7,668,191
利益剰余金合計		8,042,489
株主資本合計		34,712,489
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		671,018
評価・換算差額等合計		671,018
純資産合計		35,383,507
負債・純資産合計		52,231,483

（２）中間損益計算書

（単位:千円）

		当中間会計期間 （自　平成26年4月１日 至　平成26年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		44,022,288
その他営業収益		472,415
営業収益計		44,494,704
営業費用		
支払手数料		24,490,036
その他営業費用		5,489,326
営業費用計		29,979,363
一般管理費	※１	5,507,021
営業利益		9,008,319
営業外収益	※２	1,299,244

営業外費用	※１,※３	34,669
経常利益		10,272,894
特別利益		―
特別損失	※４	12,947
税引前中間純利益		10,259,946
法人税、住民税及び事業税		3,150,039
法人税等調整額		137,269
中間純利益		6,972,636

（３）中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,349	11,196,146	37,366,146
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,126,294	△ 10,126,294	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	-	6,972,636	6,972,636	6,972,636
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 3,153,657	△ 3,153,657	△ 3,153,657
当中間期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,667,691	8,042,439	34,212,489

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494,589	494,589	38,360,735
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	6,972,636
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	176,428	176,428	176,428
当中間期変動額合計	176,428	176,428	△ 2,977,228
当中間期末残高	671,018	671,018	35,383,507

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	５～47年
器具備品	３～20年

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年）に基づいております。

（３）長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

（２）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（３）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

（４）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．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。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （平成26年９月30日現在）
有形固定資産	279,523千円
投資その他の資産	756,255千円

２　保証債務

当中間会計期間（平成26年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,805,580千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）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）
有形固定資産	16,065千円
無形固定資産	490,092千円
投資その他の資産	2,726千円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）
受取配当金	1,177,840千円
投資有価証券売却益	73,930千円
時効成立分配金・償還金	14,749千円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）
時効成立後支払分配金・償還金	12,351千円
貯蔵品廃棄損	7,356千円
投資不動産管理費用	6,818千円

※４　特別損失の主要項目

	当中間会計期間 （自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）
関係会社株式評価損	11,174千円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　平成26年４月１日　至　平成26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26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年　3 月31日	平成26年 6月26日

（金融商品関係）
当中間会計期間（自　平成26年４月１日　至　平成26年９月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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	20,257,586	20,257,586	－
（２）未収委託者報酬	9,365,956	9,365,956	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,047,833	11,047,833	－
資産計	40,671,376	40,671,376	－
（１）未払金	6,923,613	6,923,613	－
（２）未払費用（*）	2,760,751	2,760,751	－
負債計	9,684,365	9,684,365	－

（*）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。

<注１>金融商品の時価の算定方法

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。

<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	1,025,409
子会社株式	5,129,895
差入保証金	997,068

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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（自　平成26年４月１日　至　平成26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　5,129,895千円）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。

当中間会計期間において、子会社株式について11,174千円減損処理を行っております。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	105,492	55,101	50,390
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	5,646,254	4,624,425	1,021,828
小計	5,751,746	4,679,527	1,072,219
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	5,296,087	5,325,705	△29,618
小計	5,296,087	5,325,705	△29,618
合計	11,047,833	10,005,232	1,042,601

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　1,025,409千円）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。

（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26年４月１日　至　平成26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26年４月１日　至　平成26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26年４月１日　至　平成26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26年４月１日　至　平成26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26年４月１日　至　平成26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26年４月１日 至　平成26年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,564.56円
１株当たり中間純利益金額	2,673.01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。

（注）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。

当中間会計期間 （自　平成26年４月１日 至　平成26年９月30日）	
中間純利益(千円)	6,972,636
普通株式に係る中間純利益(千円)	6,972,636
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すことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に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　三井住友信託銀行株式会社

②　資本金の額　342,037百万円（平成26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26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）
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	（注2）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（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）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（注3）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】

該当事項はありません。

＜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26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26年５月26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	髙波　博之	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25年４月１日から平成26年３月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

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26年３月31日現在の財政状態並びに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。

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)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．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年1月9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	貞廣　篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之	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25年12月3日から平成26年12月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

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26年12月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年11月25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	髙波　博之	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26年４月１日から平成27年３月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年４月１日から平成26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26年９月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成26年４月１日から平成26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) １．　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。

(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。