

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成23年2月21日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗

【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
連絡場所 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号

【電話番号】 03-5695-2111

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

**【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23年2月22日から平成24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】

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

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

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

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

(7) 【申込期間】

平成23年2月22日から平成24年2月22日まで(継続申込期間)

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、受益権の取得および換金の申込みの受付は行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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。

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

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

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。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	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
	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（債券 公債））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	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（シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

(注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
- ・「海外」...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、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「債券」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を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
- ・「債券 公債」...目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「その他の指数」...日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

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

< 信託金の限度額 >

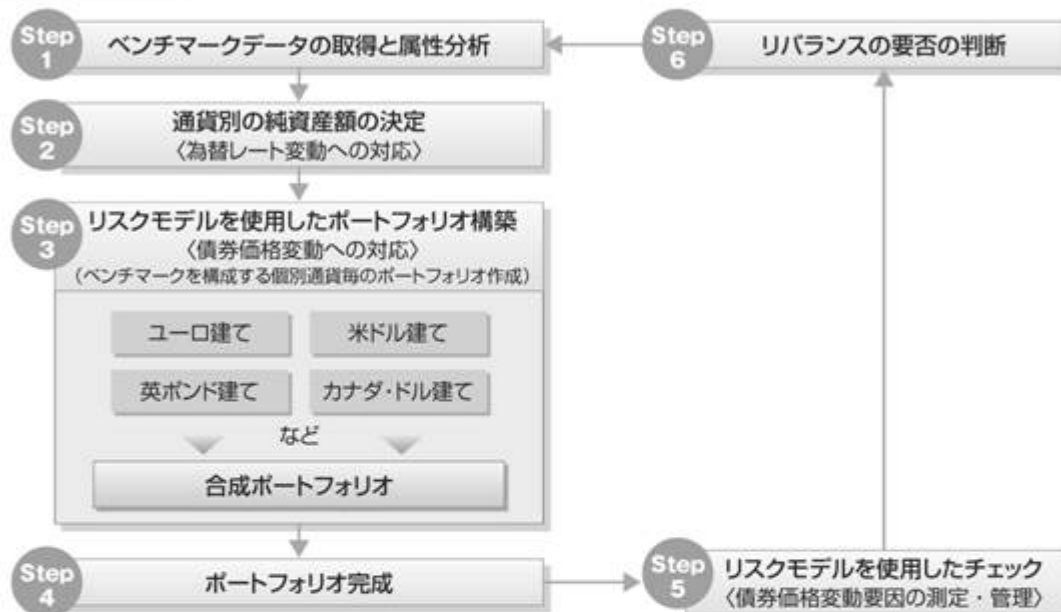
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

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

運用プロセス



ベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

①為替レート変動への対応（Step2）

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応（Step3）

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、リスクモデル^(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理（Step5）

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、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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っています。

（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しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、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を測定・管理することなどができます。

■ シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）について

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

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いません。

ファミリーファンド方式とは、投資家のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。なお、ベビーファンドから外国の公社債への直接投資を行なうことができるものとします。



- ・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。
- ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記1.の運用が行なわれないことがあります。

2 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、経費控除後の利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、利息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。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- ・ 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるわけではないこと
- ・ 基準価額の算出に使用する為替レートと、指数の算出に使用する為替レートの評価時点が異なること
- ・ 信託報酬等を負担することによる影響
- ・ 追加設定および解約に対応した公社債の約定価格と指数の算出に使用する価格の差
- ・ 債券先物取引等を利用した場合の指数との値動きの差、コストなど
- ・ 公社債および債券先物取引等の最低取引単位の影響
- ・ 公社債または債券先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年 4月28日 信託契約締結、当初自己設定、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「倶楽部外国債券インデックス」）

(注) 当ファンドの平成12年4月28日の当初自己設定および平成12年4月28日から平成13年2月28日までの継続申込期間に係る有価証券届出書は、<ワールド投信倶楽部「倶楽部外国株式インデックス」ワールド投信倶楽部「倶楽部外国債券インデックス」>有価証券届出書として平成12年4月12日に提出しております。

(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せん。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
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せん。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図 2	損益 信託金（ 3 ）	
受託会社	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないません。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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など

損益 投資

投資対象

外国の公社債 など
(ファミリーファンド方式で運用を行いません。)

(注) 「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

< 委託会社の概況（平成22年12月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券および外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

- ロ．保有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。
- ハ．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。
- ニ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

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

1. 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券
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. 預託証券（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券
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

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.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2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

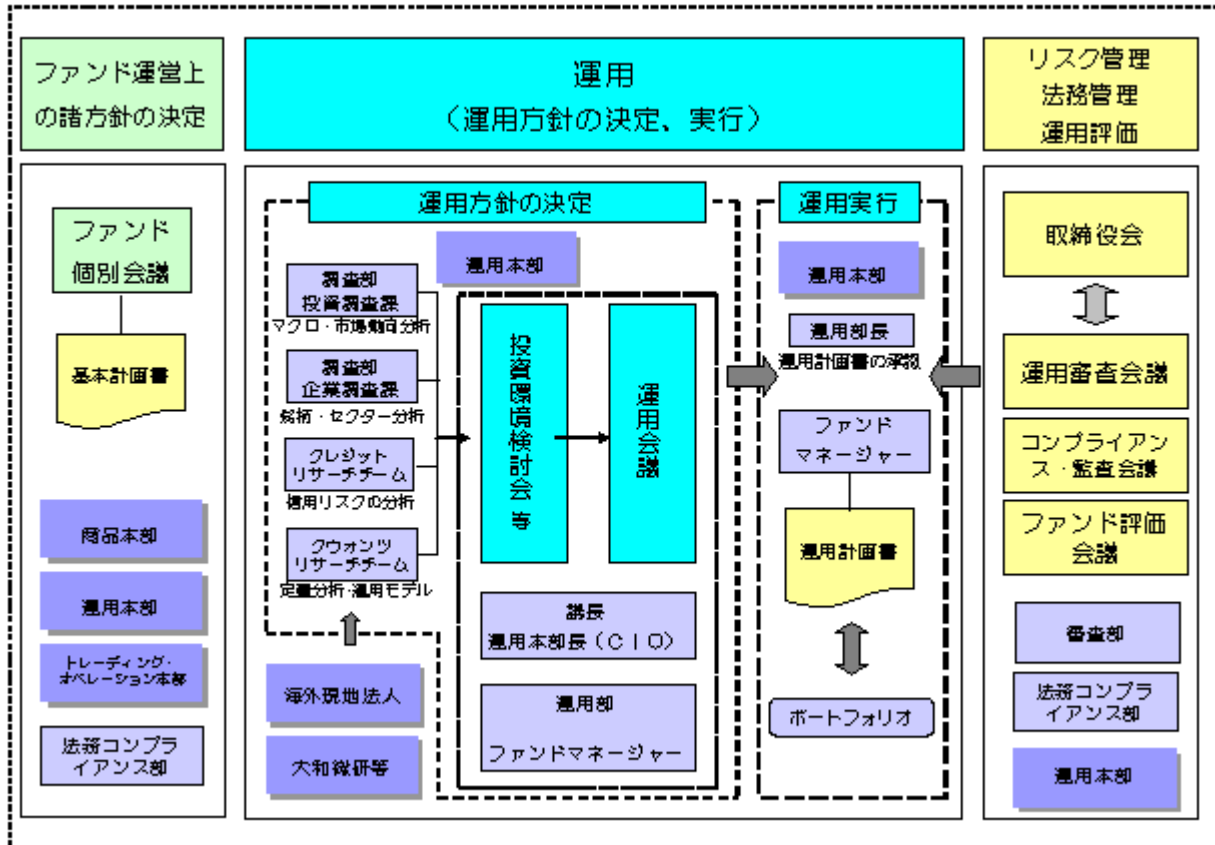
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．運用本部長（CIO）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成22年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配を行ないます。

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

原則として、利息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、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

イ．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せん。）の行使等により取得したものに限りません。

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券（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株式および株式を組入可能な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30を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．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株式および株式を組入可能な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。

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。

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。

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、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。

同一銘柄の株式等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式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、取得時において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株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ハ．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。

ニ．前八.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。

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。）。

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行なうことの指図をすることができます。

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行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引（信託約款）

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八.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．前八.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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。

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るときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ. の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ. においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約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の買予約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為替の売予約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の売予約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。

ニ．前ロ. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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（外国債券インデックスマザーファンド）の概要

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下

同じ。)および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

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。

債券先物取引の利用に伴うリスク

債券先物の価格は、金利の動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建ている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建ている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている債券先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国為替予約取引の利用に伴うリスク

外国為替予約とは、将来あらかじめ定めた条件（時期、金額、為替レート等）で外貨の売買を行なう契約のことをいいます。買予約（外貨を買う契約）を行なっている場合、当該外貨の為替レートが円安方向に変動すれば収益が発生し、円高方向に変動すれば損失が発生します（売予約を行なっている場合は逆の結果となります。）。

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。ファンドで行なっている外国為替予約取引について損失が発生した場合、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。また、取引の相手方の債務不履行により損失が発生することがあり、この場合基準価額が下落する要因となります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

す。

(2) 換金性が制限される場合

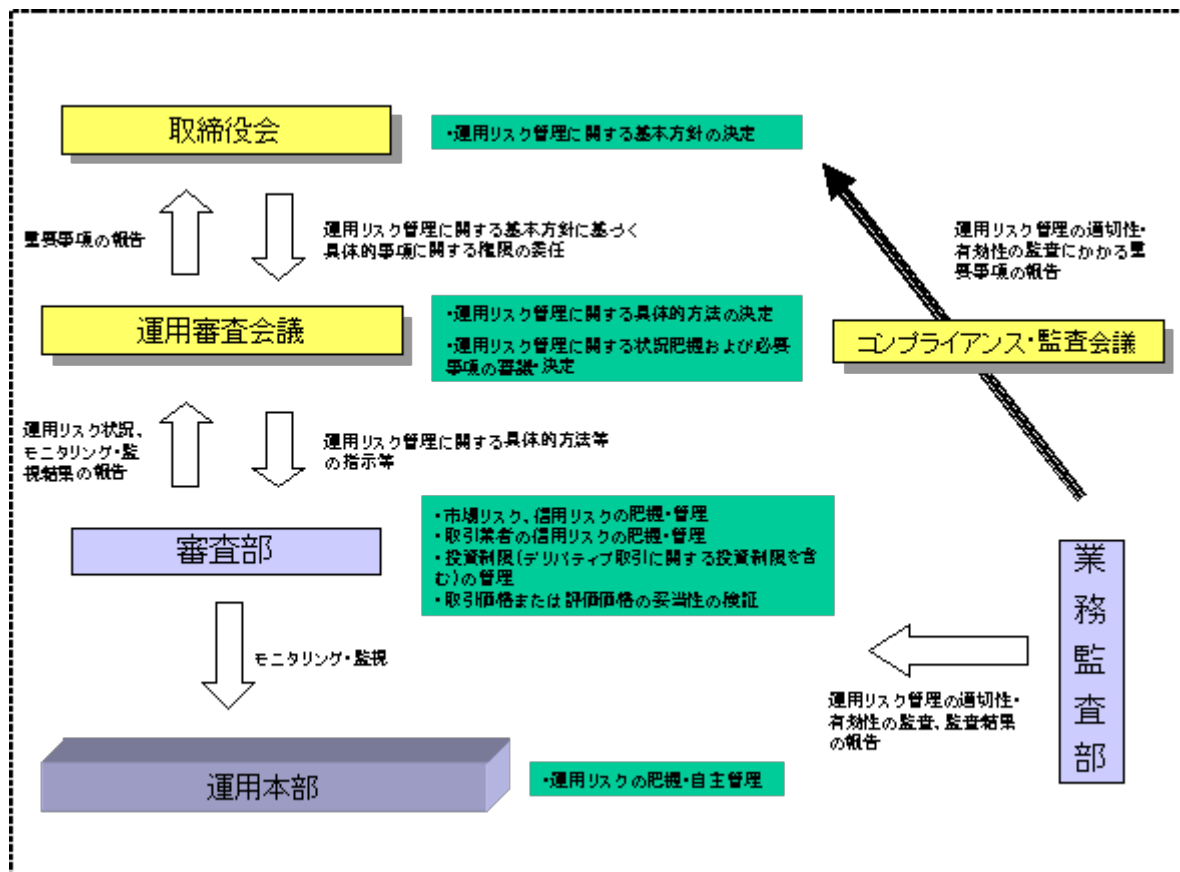
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け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け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

きます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.6825%（税抜0.65%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.252% （税抜0.24%）	年率0.3465% （税抜0.33%）	年率0.084% （税抜0.08%）

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

することができません。

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 >

有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。

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

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

ハ．損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

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

< 注1 > 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

- () 上記は、平成22年12月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成22年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	6,705,625,541	99.77
内 日本	6,705,625,541	99.77
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,244,392	0.23
純資産総額	6,720,869,933	100.00

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	98,615,129,168	98.17
内 オーストラリア	1,109,337,265	1.10
内 カナダ	2,871,913,988	2.86
内 スイス	533,502,862	0.53
内 デンマーク	835,218,778	0.83
内 ユーロ	41,787,856,975	41.60
内 英国	7,667,913,961	7.63
内 メキシコ	863,398,540	0.86
内 マレーシア	533,369,553	0.53
内 ノルウェー	257,645,922	0.26
内 ポーランド	922,633,934	0.92
内 スウェーデン	662,205,864	0.66
内 シンガポール	378,006,378	0.38
内 米国	40,192,125,149	40.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,838,826,980	1.83
純資産総額	100,453,956,148	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	2,680,206,332	2.67
内 日本	2,680,206,332	2.67

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

（注3）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】（平成22年12月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	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 -	3,964,072,796	1.75748 6,966,806,862	1.6916 6,705,625,541	- -	99.77%

(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	99.77%
合計	99.77%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	605,959,640	106.03 642,505,066	101.86 617,272,906	3.375000 19/11/15	0.61%
2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	570,348,510	110.11 628,050,669	106.08 605,054,217	3.750000 18/11/15	0.60%
3	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	566,111,030	102.16 578,361,673	98.42 557,217,426	2.750000 19/02/15	0.55%
4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	500,674,560	104.65 523,985,968	100.78 504,624,882	3.125000 19/05/15	0.50%
5	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	476,064,580	108.33 515,744,563	104.20 496,073,574	3.625000 19/08/15	0.49%
6	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	458,788,700	107.86 494,881,607	103.49 474,809,601	3.625000 20/02/15	0.47%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	429,207,830	105.89 454,522,508	104.50 448,535,059	2.625000 14/06/30	0.45%
8	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	421,810,800	106.79 450,451,753	106.17 447,836,526	5.250000 12/06/07	0.45%
9	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	428,555,910	106.55 456,643,464	102.17 437,859,859	3.500000 20/05/15	0.44%
10	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	427,578,030	101.64 434,607,413	101.42 433,688,120	1.375000 12/10/15	0.43%
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	427,607,700	99.65 426,132,453	99.26 424,460,507	3.750000 16/08/01	0.42%

12	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	404,840,800	104.02 421,131,594	103.20 417,828,093	3.000000 15/10/25	0.42%
13	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	401,745,700	104.60 420,230,020	103.26 414,878,767	2.250000 14/05/31	0.41%
14	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	370,097,000	109.42 404,986,044	107.67 398,498,244	4.250000 19/04/25	0.40%
15	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	388,299,850	101.75 395,095,097	101.64 394,667,968	1.500000 12/07/15	0.39%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	377,706,150	107.71 406,857,511	104.35 394,140,145	3.250000 17/03/31	0.39%
17	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	381,943,630	106.21 405,662,329	103.05 393,608,188	3.000000 17/02/28	0.39%
18	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	378,439,560	101.75 385,088,743	101.46 383,964,778	1.375000 13/01/15	0.38%
19	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	379,580,420	102.36 388,549,905	100.37 381,003,847	1.875000 15/06/30	0.38%
20	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	355,914,720	107.53 382,715,098	106.99 380,793,159	4.750000 38/12/07	0.38%
21	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	401,664,210	96.07 385,901,795	94.52 379,665,061	2.625000 20/08/15	0.38%
22	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	375,505,920	100.83 378,641,394	100.76 378,378,540	1.000000 12/03/31	0.38%
23	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	375,831,880	100.65 378,297,337	100.57 377,974,122	0.875000 12/02/29	0.38%
24	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	361,571,130	105.94 383,052,071	104.16 376,626,952	2.625000 14/12/31	0.37%
25	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	374,854,000	100.29 375,948,574	100.27 375,892,346	0.625000 12/06/30	0.37%
26	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	373,468,670	100.49 375,336,013	100.48 375,291,197	0.750000 12/05/31	0.37%
27	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	358,875,400	104.70 375,764,076	104.54 375,182,698	5.000000 12/01/04	0.37%
28	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	379,915,900	99.58 378,335,450	98.42 373,943,622	4.250000 19/02/01	0.37%
29	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	368,253,310	100.86 371,431,336	100.84 371,372,416	1.000000 12/04/30	0.37%
30	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	371,105,460	103.99 385,919,990	99.51 369,305,599	4.375000 39/11/15	0.37%

(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	98.17%
合計	98.17%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
設定時 (平成12年4月28日)	1,000,000,000	-	1.0000	-
第2計算期間末 (平成13年11月30日)	1,338,780,397	1,339,825,731	1.2807	1.2817
第3計算期間末 (平成14年12月2日)	1,378,968,643	1,379,925,832	1.4406	1.4416
第4計算期間末 (平成15年12月1日)	1,171,032,411	1,171,806,765	1.5123	1.5133

第5計算期間末 (平成16年11月30日)	1,414,208,376	1,415,085,255	1.6128	1.6138
第6計算期間末 (平成17年11月30日)	2,538,320,744	2,539,733,085	1.7969	1.7979
第7計算期間末 (平成18年11月30日)	3,756,522,251	3,756,522,251	1.9288	1.9288
第8計算期間末 (平成19年11月30日)	5,352,781,905	5,352,781,905	2.0291	2.0291
第9計算期間末 (平成20年12月1日)	5,245,325,890	5,245,325,890	1.6704	1.6704
第10計算期間末 (平成21年11月30日)	6,454,783,875	6,454,783,875	1.7612	1.7612
平成21年12月末日	6,720,610,091	-	1.7928	-
平成22年1月末日	6,518,535,484	-	1.7314	-
2月末日	6,455,250,926	-	1.7066	-
3月末日	6,822,326,812	-	1.7699	-
4月末日	6,893,180,351	-	1.7791	-
5月末日	6,597,482,722	-	1.6860	-
6月末日	6,537,095,859	-	1.6384	-
7月末日	6,790,294,770	-	1.6712	-
8月末日	6,738,620,330	-	1.6463	-
9月末日	7,045,260,288	-	1.6889	-
10月末日	6,882,213,069	-	1.6358	-
第11計算期間末 (平成22年11月30日)	6,916,479,400	6,916,479,400	1.6293	1.6293
12月末日	6,720,869,933	-	1.5670	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金（円）
第2計算期間	0.0010
第3計算期間	0.0010
第4計算期間	0.0010
第5計算期間	0.0010
第6計算期間	0.0010
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率（%）
第2計算期間	22.3
第3計算期間	12.6
第4計算期間	5.0
第5計算期間	6.7

第6計算期間	11.5
第7計算期間	7.3
第8計算期間	5.2
第9計算期間	17.7
第10計算期間	5.4
第11計算期間	7.5

[次へ](#)

(参考情報)

2010年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※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	15,670円
純資産総額	67億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.8%
3カ月間	-7.2%
6カ月間	-4.4%
1年間	-12.6%
3年間	-24.1%
5年間	-12.8%
設定来	57.2%



※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: 50円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	00年11月	01年11月	02年12月	03年12月	04年11月	05年11月	06年11月	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月
分配金	0円	10円	10円	10円	10円	10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10銘柄	償還日	比率
外国債券	601	97.9%	ユーロ	42.4%	直接利回り(%)	U.S. TREASURY NOTE	2019/11/15	0.6%
			米ドル	41.0%	最終利回り(%)	U.S. TREASURY NOTE	2018/11/15	0.6%
コール・ローン、その他		2.1%	英ポンド	7.9%	修正デュレーション	U.S. TREASURY NOTE	2019/02/15	0.6%
合計	601	100.0%	カナダドル	2.9%	残存年数	U.S. TREASURY NOTE	2019/05/15	0.5%
債券種別構成			豪ドル	1.1%	格付別構成	U.S. TREASURY NOTE	2019/08/15	0.5%
国債		97.9%	メキシコ・ペソ	1.0%	AAA	U.S. TREASURY NOTE	2020/02/15	0.5%
			ポーランド・ズロチ	0.9%	AA	U.S. TREASURY NOTE	2014/06/30	0.4%
			デンマーク・クローネ	0.8%	A	UNITED KINGDOM GILT BOND	2012/06/07	0.4%
			スウェーデン・クローネ	0.7%	BBB	U.S. TREASURY NOTE	2020/05/15	0.4%
			その他	1.2%	BB以下	U.S. TREASURY NOTE	2012/10/15	0.4%
合計		97.9%	合計	100.0%	合計	合計		5.0%

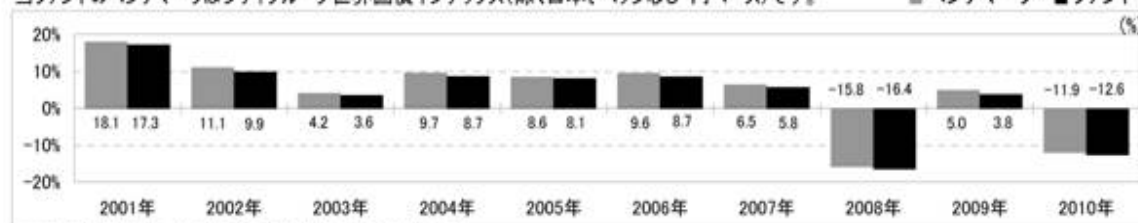
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはシティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

■ベンチマーク ■ファンド



・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。

・2010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。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第2計算期間	50,667,072	14,229,759
第3計算期間	258,443,400	346,588,091
第4計算期間	461,076,103	643,911,931
第5計算期間	418,005,232	315,479,626
第6計算期間	698,373,857	162,660,052
第7計算期間	817,842,157	282,876,222
第8計算期間	1,113,681,692	423,244,350
第9計算期間	1,010,865,369	508,775,452
第10計算期間	833,689,510	308,817,851
第11計算期間	951,135,069	370,944,123

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。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、受益権の取得申込みの受付は行ないません。

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せん。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せん。

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。

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日には、一部解約の実行の請求の受付を行ないません。

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

す。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け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け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け付けたものとして、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日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

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

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。
- ・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 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。）

2. 価格情報会社の提供する価額

（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

・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 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。）

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

・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、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、前4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
 9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
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を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該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、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 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 1.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 3.または前 3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請

求することができます。

運用報告書

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

公告

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。

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】

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号。以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

ただし、第10期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、第11期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第11期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

1 【財務諸表】

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第10期 平成21年11月30日現在	第11期 平成22年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	31,168,097	49,968,020
親投資信託受益証券	6,447,210,655	6,897,080,394
流動資産合計	6,478,378,752	6,947,048,414
資産合計	6,478,378,752	6,947,048,414
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,543,919	6,992,462
未払受託者報酬	2,682,991	2,868,609
未払委託者報酬	19,116,514	20,439,091
その他未払費用	251,453	268,852
流動負債合計	23,594,877	30,569,014
負債合計	23,594,877	30,569,014
純資産の部		
元本等		
元本	3,664,958,298	4,245,149,244
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,789,825,577	2,671,330,156
(分配準備積立金)	510,491,749	464,387,120
元本等合計	6,454,783,875	6,916,479,400
純資産合計	6,454,783,875	6,916,479,400
負債純資産合計	6,478,378,752	6,947,048,414

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期	第11期
	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
営業収益		
受取利息	13,683	15,271
有価証券売買等損益	329,848,849	476,130,261
営業収益合計	329,862,532	476,114,990
営業費用		
受託者報酬	5,039,575	5,655,393
委託者報酬	35,907,455	40,295,105
その他費用	472,295	530,028
営業費用合計	41,419,325	46,480,526
営業利益又は営業損失（ ）	288,443,207	522,595,516
経常利益又は経常損失（ ）	288,443,207	522,595,516
当期純利益又は当期純損失（ ）	288,443,207	522,595,516
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	24,098,667	16,467,320
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,105,239,251	2,789,825,577
剰余金増加額又は欠損金減少額	629,206,568	668,822,142
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	629,206,568	668,822,142
剰余金減少額又は欠損金増加額	208,964,782	281,189,367
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	208,964,782	281,189,367
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,789,825,577	2,671,330,156

(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10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成20年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成20年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第10期 平成21年11月30日現在	第11期 平成22年11月30日現在
1. 1 期首元本額	3,140,086,639円	3,664,958,298円
期中追加設定元本額	833,689,510円	951,135,069円
期中一部解約元本額	308,817,851円	370,944,123円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,664,958,298口	4,245,149,244口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1 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（13,683円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,984,197,703円）及び分配準備積立金（510,478,066円）より分配対象額は3,494,689,452円（1万口当たり9,535.41円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,224,746,681円）及び分配準備積立金（464,387,120円）より分配対象額は3,689,133,801円（1万口当たり8,690.23円）であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

区分	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投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。

金融商品の時価等に関する事項

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

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第10期 平成21年11月30日現在		第11期 平成22年11月30日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	6,447,210,655	320,218,890	472,170,507
合計	6,447,210,655	320,218,890	472,170,507

（デリバティブ取引に関する注記）

第10期計算期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで）

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

第11期計算期間（平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期 平成22年11月30日現在
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	第11期 自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	第10期 平成21年11月30日現在	第11期 平成22年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7612円 (17,612円)	1.6293円 (16,293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	外国債券インデックスマザーファンド	3,923,477,100	6,897,080,394
親投資信託受益証券 合計		3,923,477,100	6,897,080,394
合計		3,923,477,100	6,897,080,394

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

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日	自 平成21年12月1日 至 平成22年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,371,630,589円	54,257,278,019円
同期中における追加設定元本額	14,735,003,425円	6,701,378,651円
同期中における一部解約元本額	2,849,355,995円	2,196,422,550円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	3,478,207,239円	3,311,430,139円
ダイワ国内重視バランスファンド 30 V A（一般投資家私募）	97,143,037円	101,809,977円
ダイワ国内重視バランスファンド 50 V A（一般投資家私募）	736,271,135円	740,675,120円
ダイワ国際分散バランスファンド 30 V A（一般投資家私募）	238,430,558円	240,619,691円
ダイワ国際分散バランスファンド 50 V A（一般投資家私募）	2,186,512,902円	2,239,754,053円
DCダイワ外国債券インデックス	20,597,727,536円	24,170,405,109円
ダイワ・ライフ・バランス30	316,096,987円	355,179,920円
ダイワ・ライフ・バランス50	8,307,664円	18,942,122円

ダイワ・ライフ・バランス70	4,062,129円	10,561,784円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	56,467,030円	87,901,955円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	45,482,134円	62,288,888円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	9,135,492円	13,165,507円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	3,102,056円	4,547,046円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	472,531円	1,387,417円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	28,978円	24,118円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	3,633,693,132円	3,738,312,581円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	363,602,261円	390,499,413円
ダイワ・バランスファンド35 VA	13,601,204,072円	13,782,880,123円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,531,561,434円	2,531,346,833円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	2,254,587,104円	2,187,663,969円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	629,237,291円	787,018,884円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	3,416,283,730円	3,923,477,100円
ダイワライフスタイル25	17,225,767円	21,967,550円
ダイワライフスタイル50	25,110,700円	31,550,258円
ダイワライフスタイル75	7,325,120円	8,824,563円
計	54,257,278,019円	58,762,234,120円
2. 本報告書における開示対象ファンドの 計算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	54,257,278,019口	58,762,234,120口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、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。 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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

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

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年12月2日から平成21年11月30日まで、及び平成21年12月1日から平成22年11月30日まで）を指しております。

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

区 分	自 平成20年12月2日 至 平成21年11月30日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成21年11月30日 現在		
	契約額等 （円）	うち	時価 （円）
			評価損益 （円）

	1年超			
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,492,887,041	-	1,458,480,648	34,406,393
アメリカ・ドル	618,800,930	-	601,513,117	17,287,813
イギリス・ポンド	97,307,616	-	94,712,190	2,595,426
オーストラリア・ドル	28,526,902	-	27,732,134	794,768
カナダ・ドル	32,735,388	-	32,023,030	712,358
スイス・フラン	7,651,749	-	7,509,840	141,909
スウェーデン・クローナ	8,756,525	-	8,540,700	215,825
デンマーク・クローネ	55,219,899	-	54,167,818	1,052,081
ポーランド・ズロチ	11,444,412	-	11,342,020	102,392
ユーロ	632,443,620	-	620,939,799	11,503,821
合計	1,492,887,041	-	1,458,480,648	34,406,393

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(平成21年12月1日から平成22年11月30日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

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

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

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成21年11月30日現在	平成22年11月30日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8872円 (18,872円)	1.7579円 (17,579円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,899,403.640	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,884,838.880	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,375,637.090	
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,157,037.040	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,090,984.800	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,905,188.190	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,126,450.620	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,959,210.000	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,164,825.600	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,443,407.540	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,094,339.600	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,096,759.280	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,296,610.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,343,827.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,195,586.000	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,711,582.080	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,225,145.040	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,090,239.300	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,304,566.800	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,366,667.300	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,448,947.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,029,284.210	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,746,673.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,068,593.900	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,238,296.920	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,392,720.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,176,824.000	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,807,273.210	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,263,039.220	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,129,128.000	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,149,760.820	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,917,487.800	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,057,690.000	

3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,345,132.890	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,386,545.990	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,173,376.900	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,573,995.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,975,843.800	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,520,826.960	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,291,608.800	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,568,784.480	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,473,409.400	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,584,626.800	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,555,981.100	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,668,450.000	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,800,066.720	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,297,053.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,111,787.060	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	7,707,088.830	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,556,526.860	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000	2,496,600.320	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,207,273.250	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20120115	2,825,000.000	2,850,142.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,521,099.000	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120215	2,353,000.000	2,381,941.900	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	7,097,333.080	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,839,371.200	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,310,566.750	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120315	2,326,000.000	2,356,982.320	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,408,935.820	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,559,401.820	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120415	2,241,000.000	2,271,813.750	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,498,008.880	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,102,910.930	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120515	2,454,000.000	2,488,601.400	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	6,144,000.000	6,430,064.640	

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

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

11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,326,628.590	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,395,750.000	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,052,628.640	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,161,529.580	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,080,888.200	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,346,245.840	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,283,506.260	
8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,103,295.560	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,094,688.200	
7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,153,743.750	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,080,951.720	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	1,003,016.120	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,451,711.000	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,081,797.120	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,241,294.120	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,181,926.880	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,154,298.390	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,014,396.720	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,137,157.790	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,101,881.250	
6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,571,259.950	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	853,152.300	
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	943,688.320	
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,027,249.650	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,024,010.840	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	998,973.750	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,121,641.640	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,775,532.240	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	873,237.300	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,803,390.540	
5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,608,130.400	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,437,246.980	
4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,041,290.700	
5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	3,323,366.550	

	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,101,767.760	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	2,950,507.440	
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,043,690.160	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	2,759,143.590	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	3,755,268.270	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	4,554,000.000	4,735,795.680	
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	1,749,000.000	1,895,478.750	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,255,239.440	
	3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	3,991,787.040	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 464,956,000.000 (39,181,842,120)	アメリカ・ドル 499,235,875.920 (42,070,607,264)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,199,662.800	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	705,664.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,003,853.400	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	942,000.000	1,322,944.800	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,319,495.600	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	1,815,000.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,585,634.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,910,000.000	2,142,447.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,856,121.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,491,242.900	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,142,332.400	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,025,894.200	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,976,780.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,339,000.000	1,338,196.600	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,693,790.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,045,336.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,379,000.000	1,402,167.200	
	5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	3,335,000.000	3,561,446.500	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	902,000.000	1,031,076.200	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,855,396.400	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,478,118.000	

	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,183,962.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,495,000.000	2,480,529.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,001,636.000	
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	1,798,000.000	1,846,546.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	125,000.000	123,987.500	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,191,000.000	1,228,754.700	
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	1,914,000.000	1,963,381.200	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	343,000.000	352,672.600	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	2,483,000.000	2,577,602.300	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	363,000.000	343,398.000	
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,619,032.400	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	1,295,000.000	1,326,339.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	921,000.000	909,119.100	
	イギリス・ポンド 小計	イギリス・ポンド 55,823,000.000 (7,323,419,370)	イギリス・ポンド 59,949,560.700 (7,864,782,868)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	6.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	1,423,000.000	1,470,314.750	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,442,255.900	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	986,000.000	1,019,139.460	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	780,000.000	769,376.400	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,741,000.000	1,760,464.380	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,219,000.000	1,241,502.740	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	770,000.000	797,843.200	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	1,790,109.440	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20121115	733,000.000	729,195.730	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	187,000.000	189,997.610	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	327,000.000	330,999.210	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	509,000.000	496,045.950	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	508,000.000	496,021.360	
	オーストラリア・ドル 小計	オーストラリア・ドル 12,496,000.000 (1,017,549,280)	オーストラリア・ドル 12,533,266.130 (1,020,583,861)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	424,000.000	627,447.920	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	610,597.080	

	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,357,000.000	2,129,797.930	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,681,437.600	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,127,698.790	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	924,959.080	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,836,931.250	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,321,425.920	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,134,606.480	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	1,980,035.280	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,058,838.450	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,014,889.800	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	651,740.970	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,611,892.380	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,423,757.840	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,041,000.000	2,155,500.100	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,658,780.640	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	659,800.680	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,646,014.090	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120901	1,661,000.000	1,672,311.410	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20111201	1,529,000.000	1,526,630.050	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	695,000.000	718,407.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120301	598,000.000	598,221.260	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	251,000.000	253,356.890	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130301	359,000.000	359,104.110	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	212,000.000	211,896.120	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,001,061.320	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	418,000.000	425,060.020	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	882,000.000	886,480.560	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20121201	449,000.000	447,567.690	
	カナダ・ドル 小計	カナダ・ドル 30,812,000.000 (2,550,925,480)	カナダ・ドル 34,356,249.310 (2,844,353,880)	
	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	506,956.320	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	363,971.770	

	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	582,257.900	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	537,311.880	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	555,155.370	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	438,597.740	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	339,616.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	730,000.000	751,206.500	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	315,414.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	107,815.760	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	346,297.900	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	327,520.480	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	243,242.840	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	184,273.340	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	117,000.000	119,527.200	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	142,000.000	148,428.340	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	237,653.220	
	シンガポール・ドル 小計	シンガポール・ドル 5,739,000.000 (367,468,170)	シンガポール・ドル 6,105,246.560 (390,918,937)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	972,000.000	1,045,531.800	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	917,000.000	1,017,860.830	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	763,000.000	946,173.410	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	410,000.000	538,006.100	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	721,000.000	774,887.540	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20170605	316,000.000	375,584.960	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,332,000.000	1,480,358.160	
	スイス・フラン 小計	スイス・フラン 5,431,000.000 (457,887,610)	スイス・フラン 6,178,402.800 (520,901,140)	
スウェーデン・クローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,275,000.000	8,372,652.000	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	8,315,000.000	8,903,452.550	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	4,550,000.000	4,973,059.000	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,495,498.000	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,338,400.000	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,486,949.000	

	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,010,000.000	11,002,291.300	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	4,617,475.200	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 49,805,000.000 (601,146,350)	スウェーデン・クローナ 54,189,777.050 (654,070,609)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,323,000.000	3,341,054.750	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	5,212,000.000	5,464,834.120	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,728,000.000	8,527,461.600	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	6,810,000.000	7,437,882.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,535,000.000	9,355,896.300	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	12,228,836.290	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,309,000.000	9,032,298.450	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20121115	6,175,000.000	6,532,162.000	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 54,981,000.000 (816,467,850)	デンマーク・クローネ 61,920,425.510 (919,518,319)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,884,000.000	6,476,165.760	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,898,000.000	5,384,224.460	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,421,983.760	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	2,431,000.000	2,643,542.330	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 17,345,000.000 (237,626,500)	ノルウェー・クローネ 18,925,916.310 (259,285,053)	
ポーランド・ズロ チ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,382,046.800	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,318,145.360	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,232,964.630	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,762,298.150	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,702,447.940	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	3,317,000.000	3,351,961.180	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,753,000.000	3,819,240.450	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,373,076.100	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20120125	2,210,000.000	2,103,920.000	
	5.75% Poland Governmet Bond 20290425	1,078,000.000	1,023,237.600	
	Poland Governmet Bond 20120725	1,974,000.000	1,834,142.100	

	5.5% Poland Governmet Bond 20150425	1,964,000.000	1,968,811.800	
	Poland Governmet Bond 20121025	2,046,000.000	1,876,202.460	
	5.25% Poland Governmet Bond 20201025	978,000.000	921,227.100	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 33,243,000.000 (900,885,300)	ポーランド・ズロチ 32,669,721.670 (885,349,457)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,666,288.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,290,953.600	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	700,000.000	741,202.000	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,576,000.000	1,671,206.160	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,184,457.160	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,073,494.100	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,371,173.640	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,031,788.100	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	534,586.080	
	3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	769,012.440	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	619,153.700	
	2.509% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120827	1,189,000.000	1,178,810.270	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,141,868.030	
	2.711% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120214	573,000.000	571,779.510	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,074,606.720	
	3.21% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130531	721,000.000	722,348.270	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	375,429.920	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	877,000.000	897,890.140	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 19,310,000.000 (515,190,800)	マレーシア・リンギット 19,916,047.840 (531,360,156)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20121220	9,383,000.000	10,110,182.500	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	2,719,544.400	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	8,434,000.000	9,031,127.200	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	10,432,565.300	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	9,403,000.000	10,759,476.780	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20111222	12,432,000.000	13,045,519.200	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	4,427,000.000	4,772,527.350	

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

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

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

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

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

4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,315,765.220	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	927,241.200	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,786,541.550	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,148,039.060	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,207,855.850	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	853,865.880	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,086,664.150	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,405,059.570	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,558,207.860	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,653,569.100	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,579,738.830	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,932,917.840	
2% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120328	1,080,000.000	1,088,748.000	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,299,000.000	1,284,918.840	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	506,923.560	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	435,000.000	430,123.650	
5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	579,199.400	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	544,953.460	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	426,191.700	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	580,120.000	
4% IRISH TREASURY 20111111	278,000.000	276,790.700	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,031,755.450	
3.9% IRISH TREASURY 20120305	820,000.000	797,974.800	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000	743,612.860	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000	545,860.000	
5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000	671,269.140	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	984,939.900	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	919,692.000	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	765,653.480	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,979,551.000	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,463,131.350	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,495,616.710	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,269,820.380	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	702,764.320	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	854,668.160	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	982,047.240	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	843,000.000	906,941.550	

4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	557,543.330	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,420,495.020	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,051,000.000	1,109,740.390	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,069,669.180	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,174,737.030	
5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	801,654.250	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	385,063.000	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	424,340.570	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	591,427.590	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	611,077.500	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	687,000.000	726,090.300	
4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	391,000.000	421,052.260	
3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	431,000.000	443,080.930	
1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	822,840.860	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,304,656.080	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,316,294.200	
4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,017,920.080	
5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	976,358.030	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,055,229.440	
5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,439,996.050	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,704,364.300	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,038,549.000	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,242,790.000	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	2,076,286.500	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,755,668.970	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	959,733.920	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	1,572,000.000	1,583,538.480	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	966,168.140	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,397,298.700	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,232,000.000	1,136,150.400	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,866,000.000	1,882,775.340	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120430	2,036,000.000	2,018,877.240	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,450,949.820	

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

- (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 181銘柄	100%	41.8%
イギリス・ポンド	国債証券 34銘柄	100%	7.8%
オーストラリア・ドル	国債証券 13銘柄	100%	1.0%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	100%	2.8%
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	100%	0.4%

スイス・フラン	国債証券	7銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.6%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券	4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券	18銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	19銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	242銘柄	100%	41.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成22年12月30日

資産総額	6,736,039,076円	
負債総額	15,169,143円	
純資産総額（ - ）	6,720,869,933円	
発行済数量	4,288,890,358口	
1単位当たり純資産額（ / ）		1.5670円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成22年12月30日

資産総額	103,627,515,841円	
負債総額	3,173,559,693円	
純資産総額（ - ）	100,453,956,148円	
発行済数量	59,384,265,796口	
1単位当たり純資産額（ / ）		1.6916円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認める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て）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成22年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成22年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	10	29,262
追加型株式投資信託	357	6,869,733
株式投資信託 合計	367	6,898,995
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,933,442
公社債投資信託 合計	17	2,933,442
総合計	384	9,832,438

3 【委託会社等の経理状況】

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

なお、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表及び第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第52期事業年度に係る中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,961,462	4,783,803
有価証券	28,233,112	26,970,072
前払金	453	136
前払費用	84,549	77,248
未収入金	20,722	3,858
未収消費税等	27,138	-
未収委託者報酬	5,273,080	7,030,430
未収収益	25,476	90,787
貯蔵品	38,909	30,324
繰延税金資産	227,536	566,334
その他	2,030	256,955
流動資産計	37,894,473	39,809,953
固定資産		
有形固定資産	1	1,186,818
建物（純額）	349,484	318,162
器具備品（純額）	900,893	757,333

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

（単位：千円）

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

資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計	12,833,851	12,259,401
株主資本合計	39,503,851	38,929,401
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	618,549	18,061
繰延ヘッジ損益	-	55,712
評価・換算差額等合計	618,549	73,774
純資産合計	38,885,301	38,855,627
負債・純資産合計	49,445,137	53,405,901

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	11,702,152	9,659,553
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777
当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計		
前期末残高	14,876,450	12,833,851
当期変動額		
剰余金の配当	8,555,962	6,495,227
当期純利益	6,513,363	5,920,777

当期変動額合計	2,042,599	574,450
当期末残高	12,833,851	12,259,401

(単位:千円)

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

重要な会計方針

	前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社及び関連会社株式 移動平均法による原価法によ り計上しております。 (2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく 時価法（評価差額は全部純資産 直入法により処理し、売却原価 は移動平均法により算定）を採 用しております。 時価のないもの 移動平均法による原価法を採 用しております。	(1) 子会社及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左
2. デリバティブの評価 基準及び評価方法	時価法により計上しておりま す。	同左
3. 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通 りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアに ついては、社内における利用可能 期間（5年）に基づいておりま す。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。	(1) 有形固定資産及び投資不動産 （リース資産を除く） 同左 (2) 無形固定資産（リース資産を除 く） 同左 (3) 長期前払費用 同左
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、 一般債権については貸倒実績率法 により、貸倒懸念債権及び破産更 生債権等については財務内容評価 法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与 の支給に備えるため、支給見込額 を計上しております。	(1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左

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

会計方針の変更

<p>前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)</p>
---	---

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

追加情報

前事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）	当事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
	<p>（投資有価証券売却損益の計上区分の変更） 従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利益に与える影響はありません。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成21年3月31日現在）	当事業年度 （平成22年3月31日現在）																
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">776,838千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,691,069千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資建物</td> <td style="text-align: right;">675,647千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">26,929千円</td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 1,848,998千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。</p>	建物	776,838千円	器具備品	1,691,069千円	投資建物	675,647千円	投資器具備品	26,929千円	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">815,365千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,938,369千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資建物</td> <td style="text-align: right;">688,305千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">27,339千円</td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 3,002,391千円</p> <p>3 同左</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p>	建物	815,365千円	器具備品	1,938,369千円	投資建物	688,305千円	投資器具備品	27,339千円
建物	776,838千円																
器具備品	1,691,069千円																
投資建物	675,647千円																
投資器具備品	26,929千円																
建物	815,365千円																
器具備品	1,938,369千円																
投資建物	688,305千円																
投資器具備品	27,339千円																

（損益計算書関係）

前事業年度 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）	当事業年度 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）
<p>1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除売却損</p> <p>器具備品 11,886千円</p> <p>2 貸倒引当金繰入額に関する注記 保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。 なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。</p> <p>4 特別損失の「その他」の主な内訳</p> <p>受益証券予備券廃棄損 21,160千円 ゴルフ会員権評価損 19,403千円</p>	<p>1 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>固定資産除売却損</p> <p>器具備品 1,439千円 ソフトウェア 14,793千円</p> <p>3 減損損失に関する注記 当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。 場所 千葉県浦安市 用途 賃貸等不動産（浦安寮） 種類 建物及び土地</p> <p>当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループングとしております。</p> <p>浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,450千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。 なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。</p>

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	6,495百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,490円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月22日

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成22年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

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

効力発生日

平成22年 6 月28日

（リース取引関係）

前事業年度 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)																										
<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年 3 月31日以前の 所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額 相当額及び期末残高相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td></td> <td style="text-align: center;">器具備品</td> </tr> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">4,599千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">3,613千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">- 千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,314千円</td> </tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>		器具備品	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	3,613千円	<hr/>		期末残高相当額	985千円	1年以内	985千円	1年超	- 千円	<hr/>		合計	985千円	支払リース料	1,314千円	減価償却費相当額	1,314千円	<p>（借主側） リース取引開始日が平成20年 3 月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(2)未経過リース料期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">985千円</td> </tr> </table> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法 同左</p>	支払リース料	985千円	減価償却費相当額	985千円
	器具備品																										
取得価額相当額	4,599千円																										
減価償却累計額相当額	3,613千円																										
<hr/>																											
期末残高相当額	985千円																										
1年以内	985千円																										
1年超	- 千円																										
<hr/>																											
合計	985千円																										
支払リース料	1,314千円																										
減価償却費相当額	1,314千円																										
支払リース料	985千円																										
減価償却費相当額	985千円																										

（金融商品関係）

当事業年度（自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

() デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

(*1) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

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

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

資産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	

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

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

(*1) 外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

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

(追加情報)

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

(有価証券関係)

前事業年度(平成21年3月31日現在)

1. その他有価証券で時価のあるもの

	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1)株式	55,101	67,520	12,418
(2)その他			
証券投資信託の受益証券	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	1,787,101	1,882,948	95,846
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	3,766,074	2,627,319	1,138,755

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

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	737,012
小計	737,012
その他有価証券	
非上場株式	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,098,103
MMF・中期国債ファンド	28,233,112
小計	31,503,352
合計	32,240,364

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

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

当事業年度(平成22年3月31日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 取引の状況に関する事項

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
<p>(1) 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。</p> <p>(2) 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。</p> <p>(3) 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。</p> <p>(4) 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。</p>

2. 取引の時価等に関する事項（平成21年3月31日現在）

通貨関連

（単位：千

円）

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

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

通貨関連

（単位：千円）

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

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

(税効果会計関係)

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

<p>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</p> <p>法定実効税率 (調整) 40.69%</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 0.35</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.13</p> <p>住民税均等割 0.03</p> <p>評価性引当額 2.32</p> <p>その他 0.74</p> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.52</p>	<p>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</p> <p>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。</p>
---	---

(関連当事者情報)

前事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)

(追加情報)

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,915,828	未払手数料	2,154,948
同一の親会社をもつ会社	大和証券エスエムピーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	980,553	未払手数料	58,506
							為替予約	17,314,889	-	-

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	544,950	その他未払金	197,190
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	---------	--------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
- (3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (4) (株)大和総研との取引金額には、(株)大和総研ホールディングス(旧・(株)大和総研)分社化前の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証	598,500	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	22,043,473	未払手数料	2,870,857
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	676,687	未払手数料	64,597
							為替予約	3,946,508	-	-

- (注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として、代行手数料を支払っております。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
3. 大和証券エスエムピーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 14,907.00円 1株当たり当期純利益 2,496.95円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 14,895.63円 1株当たり当期純利益 2,269.77円 同左

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益(千円)	6,513,363	5,920,777
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

当中間会計期間末
(平成22年9月30日)

資産の部

流動資産

現金・預金		6,449,461
有価証券		15,679,929
未収委託者報酬		6,749,851
貯蔵品		31,123
繰延税金資産		149,110
その他		499,217

流動資産計		29,558,694
-------	--	------------

固定資産

有形固定資産	1	1,027,173
無形固定資産		2,186,747
投資その他の資産		
投資有価証券		10,171,248
その他	1	1,364,720
貸倒引当金		4,750

投資その他の資産合計		11,531,218
------------	--	------------

固定資産計		14,745,139
-------	--	------------

資産合計		44,303,833
------	--	------------

(単位:千円)

当中間会計期間末
(平成22年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		5,238,233
未払法人税等		667,986
賞与引当金		202,000
その他	3	2,493,174

流動負債計		8,601,395
-------	--	-----------

固定負債

繰延税金負債		1,933,977
退職給付引当金		1,282,101
役員退職慰労引当金		44,910

固定負債計		3,260,989
-------	--	-----------

負債合計		11,862,385
------	--	------------

純資産の部

株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	5,495,206
利益剰余金合計	5,869,503
株主資本合計	32,539,503
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	256,133
繰延ヘッジ損益	158,077
評価・換算差額等合計	98,055
純資産合計	32,441,448
負債・純資産合計	44,303,833

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

		当中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)
株主資本		
資本金		
前期末残高		15,174,272
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高		11,495,727
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高		374,297
当中間期変動額		
当中間期変動額合計		-
当中間期末残高		374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高		2,800,000
当中間期変動額		
別途積立金の取崩		2,800,000
当中間期変動額合計		2,800,000
当中間期末残高		-
繰越利益剰余金		
前期末残高		9,085,103
当中間期変動額		
別途積立金の取崩		2,800,000
剰余金の配当		11,216,657
中間純利益		4,826,760
当中間期変動額合計		3,589,897
当中間期末残高		5,495,206

(単位:千円)

当中間会計期間
(自 平成22年 4月 1日
至 平成22年 9月30日)

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

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 其他有価証券 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	(2) デリバティブ 時価法により計上しております。 (1) 有形固定資産及び投資不動産 定率法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6～47年 器具備品 3～20年 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利 用可能期間（5年）に基づいております。 (3) 長期前払費用 定額法によっております。
3. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実 績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財 務内容評価法により計上しております。 (2) 賞与引当金 役員および従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見 込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく 当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社 の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、 能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が 確定するためであります。 また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づ く当中間会計期間末要支給額を計上しております。 (4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程 に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

会計方針の変更

当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)
<p>(資産除去債務に関する会計基準) 当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。 なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成22年9月30日)	
1. 減価償却累計額 有形固定資産 投資不動産	 2,859,040千円 721,987千円
2. 債務保証 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,336,230千円に対して保証を行っております。	
3. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
1. 減価償却実施額	

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 6月28日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

（ ）デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

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

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

資 産

(1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

未払金

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

(3) 差入保証金

614,389

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(自平成22年4月1日至平成22年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

（単位：千円）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日）

該当事項はありません。

(追加情報)

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

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成22年 9 月30日)	
1 株当たり純資産額	12,436.70円
1 株当たり中間純利益金額	1,850.37円
(注) 1 . 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	
2 . 1 株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	4,826,760
普通株式に係る中間純利益(千円)	4,826,760
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
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。

（追加情報）

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

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （平成22年 3月末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
株式会社SBI証券	47,937	
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	
株式会社青森銀行	19,562	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	19,078	
株式会社十六銀行	36,839	
信金中央金庫	490,998	(注2)
住友信託銀行株式会社	342,037	(注3)
スルガ銀行株式会社	30,043	(注4)
株式会社中国銀行	15,149	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994	
株式会社東京都民銀行	48,120	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	
株式会社北洋銀行	121,101	
株式会社みずほ銀行	700,000	
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	
株式会社山口銀行	10,005	(注3)
株式会社りそな銀行	279,928	
労働金庫連合会	120,000	

(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) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(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) 銀行業法に基づき銀行業を営んでいます。

（注5）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（注6）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる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いません。

3 【資本関係】

該当ありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成22年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・ 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・ 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
 - 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ・ 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ・ 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- 次の事項を記載することがあります。
- ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ファンドの形態等を記載することがあります。
- 図案を採用することがあります。
- ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成23年1月7日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成21年12月1日から平成22年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成22年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

（注1） 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月17日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公 高 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福 井 淳 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	梅 津 広 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22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成22年1月15日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成20年12月2日から平成21年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックスの平成21年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

(注1) 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽一 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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