

【表紙】
【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長 殿
【提出日】 平成21年8月28日提出
【計算期間】 第4計算期間
（自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日）
【ファンド名】 ダイワ・ライフ・バランス 30
【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
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部 【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、国内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行いません。社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの

- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「その他の指数」…日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

1

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

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

(注) 当ファンドは、マザーファンド方式で運用を行ないます。マザーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なうしくみです。ただし、市況動向等によっては、ベビーファンドから内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。

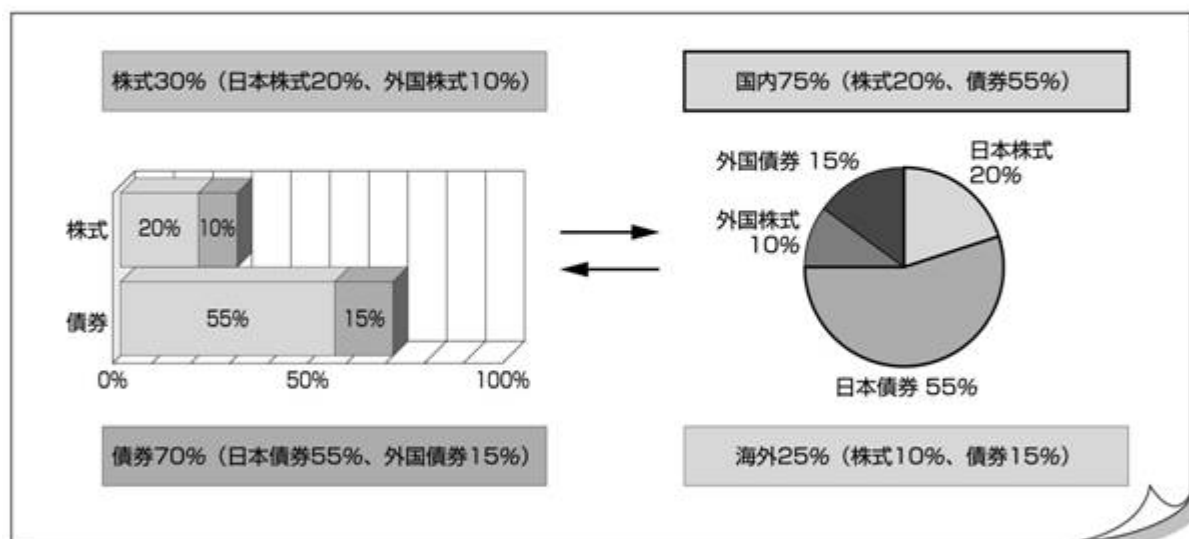
2

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

3

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

標準組入比率(基準ポートフォリオ)について



〈標準組入比率〉

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%
 ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)受益証券：信託財産の純資産総額の55%
 外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%
 外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

4

運用の特色、関連説明

(a) 合成ベンチマークについて

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

(b) 各マザーファンドの運用プロセス

i. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

ii. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

NOMURA-BPI総合指数に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行ないます。ポートフォリオの構築にあたっては、金利リスクや信用リスクなどのリスク特性がベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)と同程度となるように、リスクモデル^(注1)を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法^(注2)と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることで、同指数との連動をめざします。また、NOMURA-BPI総合指数の構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注1) リスクモデルとは…

債券のリターンを、国債イールドカーブの変化、種別スプレッドの変化、個別銘柄独自の変化など、リターンに共通の影響を与える複数の要素に分解して説明可能とする計量モデルです。当ファンドでは、NOMURA-BPI総合指数に連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

(注2) 層化抽出法とは…

ポートフォリオを残存期間やセクターなどの特性値で分類し、各グループの構成比をベンチマークの構成比に近づけることを目指す手法です。

iii. 外国株式インデックスマザーファンド

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

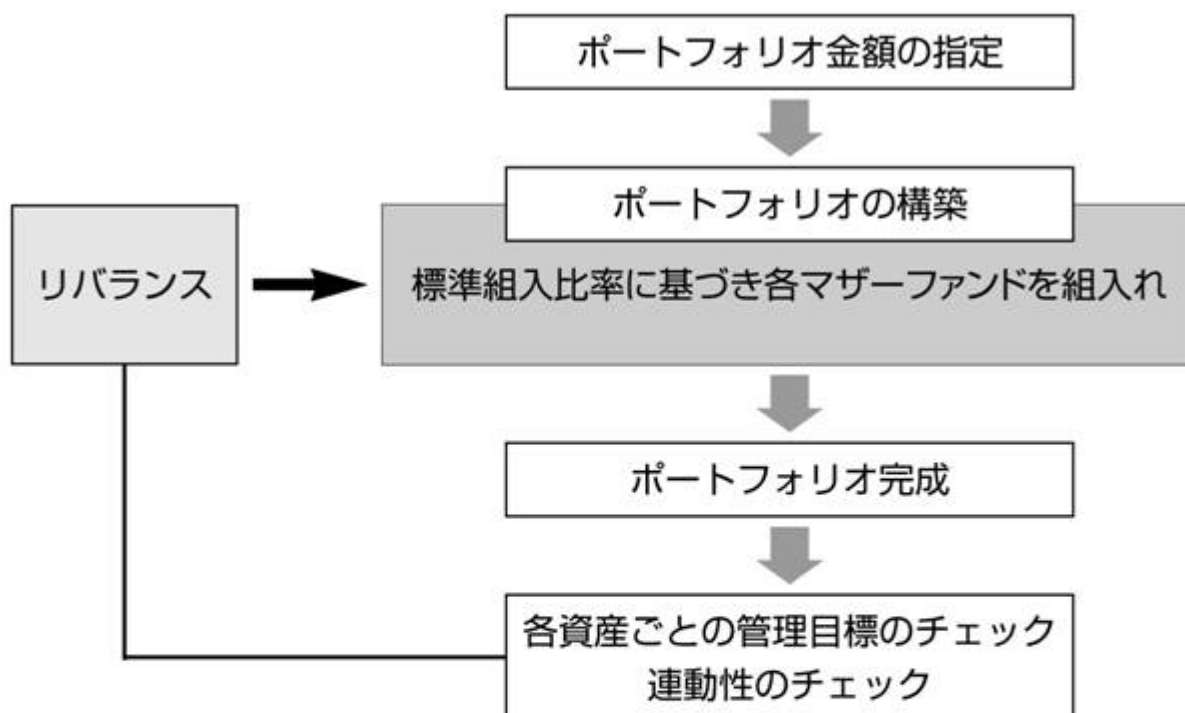
(注) ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

iv. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

(c) 運用プロセス



- 標準組入比率にしたがって、各資産のマザーファンド受益証券へ投資し、ポートフォリオを構築します。
- 合成ベンチマークに連動する投資成果をめざすため、各資産ごとのウェイトが標準組入比率から乖離しないよう管理目標を設定し、各資産の比率をその範囲内に維持するように運用を行ないます。
- 各資産の価格変動により、各資産の組入比率が管理目標を超えた場合は、標準組入比率に近づける方向へリバランスを行ないます。

5

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

6

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

7

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。

8

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

9

毎計算期末に、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。収益分配金は、自動的に再投資されます。

10

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、所得税および地方税がかかりません。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（前8.の前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合を除きます。）。

(2) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
お取扱窓口	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（ 3 ）	
	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
収益分配金、償還金など↑↓お申込金（ 3 ）		
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
損益↑↓信託金（ 3 ）		
受託会社	住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 など（マザーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

< 委託会社の概況（平成21年6月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

投資態度

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

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

< 標準組入比率 >

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の20%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）受益証券：信託財産の純資産総額の55%

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

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

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

ホ．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】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、および に定めるものに限り、）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から4.までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の5.から24.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

8．特別の法律により法人の発行する債券

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

10. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5. から前15. までの証券または証書の性質を有するもの
17. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
23. 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
24. 外国の者に対する権利で前23. の有価証券の性質を有するもの

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

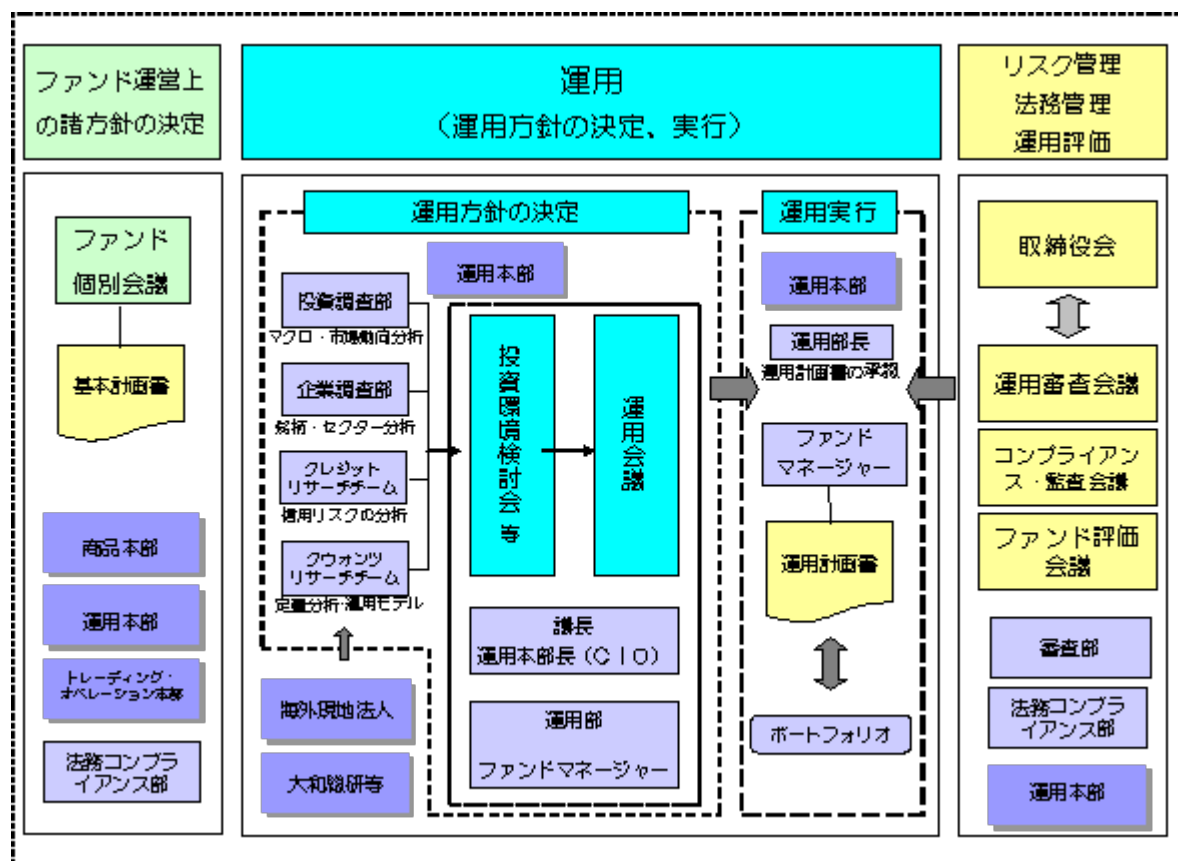
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(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15～25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21年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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．委託会社は、信託財産に属する株式、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株式、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50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株式、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。

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予

約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

信用取引（信託約款）

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等（信託約款）

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額、以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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.の範囲内で貸付けすることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

外貨建資産（信託約款）

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

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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、または解約代金の入金日までの間、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から支弁します。

<参 考> マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことができます。

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

（注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

２．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

（１）投資方針

主要投資対象

内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債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。

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生じたとき、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

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限り、）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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、）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券

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．コマーシャル・ペーパー

8．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7.までの証券または証書の性質を有するもの

9．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。）

10．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。）

11．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。）

12．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。）

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

14．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、）

15．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

16．外国の者に対する権利で前15.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8.ならびに前12.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8.ならびに前12.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9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2

項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(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、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

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

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

金利先渡取引

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が、保有金利商品の時価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、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

NOMURA - B P I は、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

NOMURA - B P I に関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

3．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

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。

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

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

ローバル・マーケット・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。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資家のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいませよう、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。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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。

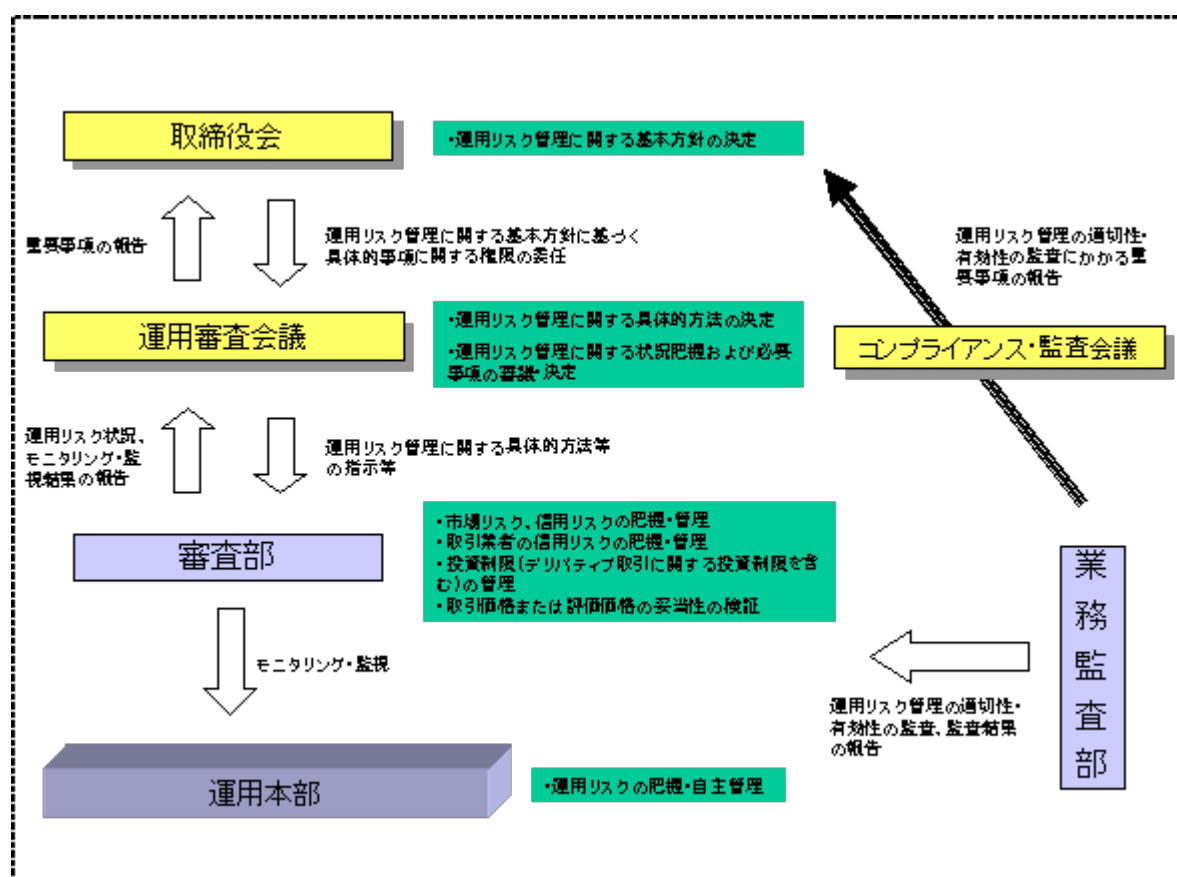
ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(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。

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

(3) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.189%（税抜0.18%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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0.0735% (税抜0.07%)	年0.084% (税抜0.08%)	年0.0315% (税抜0.03%)

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。

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

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、所得税および地方税がかかりませ

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。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用され、源泉徴収選択口座においては申告不要の特例があります。

ハ．損益通算について

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

<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。

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

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成21年6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	4,042,511,645	99.80
内 日本	4,042,511,645	99.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,955,733	0.20
純資産総額	4,050,467,378	100.00

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	88,487,173,680	96.82
内 日本	88,487,173,680	96.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,908,077,666	3.18
純資産総額	91,395,251,346	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	3,291,220,000	3.60
内 日本	3,291,220,000	3.60

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
国債証券	7,640,270,010	66.33
内 日本	7,640,270,010	66.33
地方債証券	885,354,146	7.69
内 日本	885,354,146	7.69
特殊債券	1,534,069,991	13.32
内 日本	1,534,069,991	13.32
社債券	1,341,589,795	11.65
内 日本	1,341,589,795	11.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	117,787,895	1.02
純資産総額	11,519,071,837	100.00

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株式	38,458,682,075	97.51
内 オーストラリア	1,407,424,751	3.57
内 カナダ	2,093,577,160	5.31
内 スイス	1,548,361,957	3.93

内 デンマーク	193,126,570	0.49
内 ユーロ	6,673,023,576	16.92
内 英国	4,354,555,715	11.04
内 香港	495,561,375	1.26
内 ノルウェー	147,291,975	0.37
内 ニュージーランド	16,783,233	0.04
内 スウェーデン	498,300,304	1.26
内 シンガポール	265,166,236	0.67
内 米国	20,765,509,223	52.65
投資証券	445,911,481	1.13
内 オーストラリア	84,916,876	0.22
内 ユーロ	49,486,645	0.13
内 英国	54,379,415	0.14
内 香港	11,781,403	0.03
内 シンガポール	3,615,612	0.01
内 米国	241,731,531	0.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	536,581,189	1.36
純資産総額	39,441,174,745	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	530,666,472	1.35
内 米国	530,666,472	1.35
為替予約取引（買建）	51,162,400	0.13
内 日本	51,162,400	0.13

（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	95,414,963,448	97.75
内 オーストラリア	599,480,050	0.61
内 カナダ	2,351,003,643	2.41
内 スイス	688,449,035	0.71
内 デンマーク	822,331,968	0.84
内 ユーロ	50,201,837,892	51.43
内 英国	8,008,831,446	8.21
内 マレーシア	516,295,559	0.53
内 ノルウェー	281,275,745	0.29
内 ポーランド	796,129,980	0.82
内 スウェーデン	656,162,182	0.67
内 シンガポール	405,212,591	0.42
内 米国	30,087,953,357	30.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,191,578,948	2.25
純資産総額	97,606,542,396	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）	4,100,928,785	4.20
内 日本	4,100,928,785	4.20

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっとも近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（注4）為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】(平成21年6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	ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(BPI) 日本	親投資信託受 益証券 -	2,050,815,813	1.05684 2,167,392,814	1.0653 2,184,734,085	- -	53.94%
2	トピックス・インデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,738,187,262	0.47770 830,332,092	0.4846 842,325,547	- -	20.80%
3	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 -	311,923,526	1.93339 603,072,074	1.9434 606,192,180	- -	14.97%
4	外国株式インデックスマザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	533,446,081	0.78410 418,275,093	0.7672 409,259,833	- -	10.10%

（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	99.80%
合計	99.80%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	951,600	4,385 4,173,707,200	3,670 3,492,372,000	- -	3.82%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	4,284,000	777 3,332,158,239	598 2,561,832,000	- -	2.80%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	632,800	3,085 1,952,566,400	2,660 1,683,248,000	- -	1.84%
4	三井住友フィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	393,000	5,560 2,185,363,941	3,930 1,544,490,000	- -	1.69%
5	キヤノン 日本	株式 電気機器	429,000	3,944 1,692,285,800	3,160 1,355,640,000	- -	1.48%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	335,600	4,659 1,563,751,295	3,920 1,315,552,000	- -	1.44%
7	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	466,300	2,680 1,249,741,300	2,480 1,156,424,000	- -	1.27%
8	任 天 堂 日本	株式 その他製品	39,000	43,635 1,701,788,790	26,630 1,038,570,000	- -	1.14%
9	パナソニック 日本	株式 電気機器	789,300	1,827 1,442,626,300	1,302 1,027,668,600	- -	1.12%
10	武田薬品 日本	株式 医薬品	272,000	4,966 1,350,839,340	3,760 1,022,720,000	- -	1.12%
11	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	7,072	155,076 1,096,700,774	141,200 998,566,400	- -	1.09%
12	ソ ニ ー 日本	株式 電気機器	392,600	3,089 1,213,001,707	2,525 991,315,000	- -	1.08%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	544,900	2,364 1,288,563,700	1,788 974,281,200	- -	1.07%
14	みずほフィナンシャルＧ 日本	株式 銀行業	4,114,200	402 1,657,553,443	226 929,809,200	- -	1.02%
15	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	1,041,300	987 1,028,644,281	814 847,618,200	- -	0.93%
16	東京海上ＨＤ 日本	株式 保険業	314,100	3,429 1,077,335,500	2,670 838,647,000	- -	0.92%
17	三菱地所 日本	株式 不動産業	512,000	1,998 1,023,310,880	1,611 824,832,000	- -	0.90%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	137,700	7,440 1,024,558,661	5,810 800,037,000	- -	0.88%
19	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	2,031,000	409 831,321,960	370 751,470,000	- -	0.82%
20	三井物産 日本	株式 卸売業	627,700	1,377 864,966,900	1,146 719,344,200	- -	0.79%
21	セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ 日本	株式 小売業	291,400	2,889 841,883,400	2,270 661,478,000	- -	0.72%
22	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	307,200	2,410 740,352,200	2,130 654,336,000	- -	0.72%
23	ＪＦＥホールディングス 日本	株式 鉄鋼	197,500	3,540 699,168,300	3,250 641,875,000	- -	0.70%
24	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	173,400	4,127 715,777,500	3,420 593,028,000	- -	0.65%
25	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,136	565,064 641,913,124	512,000 581,632,000	- -	0.64%
26	富士フイルムＨＬＤＧＳ 日本	株式 化学	189,000	2,757 521,151,300	3,060 578,340,000	- -	0.63%

27	信越化学	日本	株式 化学	128,900	5,005 645,163,600	4,480 577,472,000	- -	0.63%
28	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	298,800	1,532 457,997,900	1,882 562,341,600	- -	0.62%
29	中部電力	日本	株式 電気・ガス業	250,400	2,521 631,410,300	2,230 558,392,000	- -	0.61%
30	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	1,835	398,233 730,758,045	302,000 554,170,000	- -	0.61%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.82%
合計	96.82%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.41%
建設業	2.20%
食料品	3.07%
繊維製品	0.91%
パルプ・紙	0.40%
化学	5.65%
医薬品	4.16%
石油・石炭製品	0.88%
ゴム製品	0.59%
ガラス・土石製品	1.17%
鉄鋼	2.69%
非鉄金属	1.25%
金属製品	0.65%
機械	4.32%
電気機器	12.79%
輸送用機器	9.12%
精密機器	1.31%
その他製品	2.35%
電気・ガス業	5.10%
陸運業	3.93%
海運業	0.59%
空運業	0.50%
倉庫・運輸関連業	0.25%
情報・通信業	5.60%
卸売業	4.43%
小売業	3.53%
銀行業	9.98%
証券・商品先物取引業	1.70%

保険業	2.36%
その他金融業	0.76%
不動産業	2.48%
サービス業	1.57%
合計	96.82%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2009年9月	買建	356	3,311,151,733	3,291,220,000	3.60%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっとも近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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	2 7 3 2年国債 日本	国債証券 -	180,000,000	100.60 181,093,600	100.74 181,348,200	0.800000 10/10/15	1.57%
2	2 8 8 10年国債 日本	国債証券 -	166,000,000	103.58 171,949,230	104.36 173,242,580	1.700000 17/09/20	1.50%
3	2 8 9 10年国債 日本	国債証券 -	149,000,000	101.57 151,349,830	102.62 152,903,800	1.500000 17/12/20	1.33%
4	2 9 6 10年国債 日本	国債証券 -	144,000,000	100.84 145,221,390	101.98 146,852,640	1.500000 18/09/20	1.27%
5	2 9 8 10年国債 日本	国債証券 -	138,000,000	99.99 137,994,250	99.95 137,940,660	1.300000 18/12/20	1.20%
6	3 9 0 東北電力 日本	社債券 -	130,000,000	103.50 134,556,240	103.96 135,160,610	2.250000 11/09/22	1.17%
7	2 7 2 10年国債 日本	国債証券 -	130,000,000	102.94 133,833,300	103.27 134,260,100	1.400000 15/09/20	1.17%
8	2 9 9 10年国債 日本	国債証券 -	130,000,000	99.34 129,145,600	99.65 129,552,800	1.300000 19/03/20	1.12%
9	5 政保中部空港 日本	特殊債券 -	121,000,000	100.33 121,407,145	100.75 121,913,792	0.800000 13/03/28	1.06%
10	2 8 6 10年国債 日本	国債証券 -	115,000,000	104.63 120,326,210	105.31 121,115,700	1.800000 17/06/20	1.05%
11	2 8 2 10年国債 日本	国債証券 -	113,000,000	104.62 118,222,170	104.99 118,643,220	1.700000 16/09/20	1.03%
12	3 7 8 東北電力 日本	社債券 -	100,000,000	116.95 116,951,000	118.31 118,316,300	3.850000 16/04/25	1.03%
13	6 9 5年国債 日本	国債証券 -	110,000,000	100.69 110,766,150	101.34 111,479,500	0.900000 12/12/20	0.97%

14	2 7 9 1 0 年国債 日本	国債証券 -	102,000,000	107.49 109,640,590	107.06 109,205,280	2.000000 16/03/20	0.95%
15	1 4 4 神奈川県公債 日本	地方債証券 -	100,000,000	104.66 104,661,000	104.80 104,802,600	1.830000 16/12/20	0.91%
16	2 6 公営企業 日本	特殊債券 -	100,000,000	103.07 103,070,000	104.30 104,301,300	1.780000 17/03/24	0.91%
17	6 0 5 年国債 日本	国債証券 -	102,000,000	101.77 103,805,980	101.92 103,963,500	1.200000 11/09/20	0.90%
18	1 8 共同発行地方 日本	地方債証券 -	100,000,000	102.47 102,478,400	103.66 103,669,700	1.600000 14/09/25	0.90%
19	2 成田国際空港 日本	特殊債券 -	100,000,000	102.06 102,061,600	103.38 103,384,200	1.660000 15/12/18	0.90%
20	1 3 首都高速道路 日本	特殊債券 -	100,000,000	101.03 101,032,000	102.63 102,638,300	1.480000 15/03/20	0.89%
21	4 国際協力銀行 日本	特殊債券 -	100,000,000	101.45 101,456,400	102.62 102,628,600	1.520000 12/03/20	0.89%
22	1 2 - こ 名古屋市債 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.51 101,513,700	102.45 102,459,700	1.400000 12/05/21	0.89%
23	2 5 三菱化学 日本	社債券 -	100,000,000	101.92 101,924,000	102.38 102,380,700	1.800000 13/02/05	0.89%
24	1 公営企業 日本	特殊債券 -	100,000,000	101.28 101,283,500	102.35 102,358,400	1.420000 11/12/26	0.89%
25	2 1 東京瓦斯 日本	社債券 -	100,000,000	101.13 101,131,400	102.17 102,170,800	1.390000 11/11/15	0.89%
26	5 7 6 東京都公債 日本	地方債証券 -	100,000,000	101.56 101,563,210	102.04 102,048,900	1.400000 11/08/25	0.89%
27	4 8 2 東京電力 日本	社債券 -	100,000,000	101.14 101,141,600	101.95 101,952,500	1.450000 11/05/25	0.89%
28	7 9 3 政保公営企業 日本	特殊債券 -	100,000,000	102.00 102,000,700	101.89 101,899,600	1.800000 10/09/22	0.88%
29	4 1 三菱電機 日本	社債券 -	100,000,000	100.39 100,393,200	101.82 101,828,800	1.400000 12/12/07	0.88%
30	い 6 8 8 利付商工債 日本	特殊債券 -	100,000,000	100.05 100,050,100	101.82 101,823,300	1.350000 12/09/27	0.88%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	66.33%
地方債証券	7.69%
特殊債券	13.32%
社債券	11.65%
合計	98.98%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	EXXON MOBIL CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	122,900	7,629 937,702,730	6,776 832,817,815	- -	2.11%
2	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	199,600	1,912 381,697,727	2,290 457,243,401	- -	1.16%
3	JOHNSON & JOHNSON 米国	株式 医薬品	70,700	5,553 392,666,018	5,468 386,639,183	- -	0.98%
4	BP PLC 英国	株式 石油・石炭製 品	478,000	826 395,160,872	770 368,107,599	- -	0.93%
5	PROCTER & GAMBLE CO 米国	株式 化学	72,937	6,012 438,567,665	5,014 365,750,048	- -	0.93%
6	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	434,500	910 395,633,130	815 354,364,505	- -	0.90%
7	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	145,695	2,690 391,950,024	2,421 352,781,823	- -	0.89%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	93,250	3,829 357,134,466	3,655 340,855,699	- -	0.86%
9	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	33,100	8,023 265,568,845	10,160 336,320,438	- -	0.85%
10	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	50,318	7,416 373,180,883	6,421 323,099,365	- -	0.82%
11	JPMORGAN CHASE & CO 米国	株式 銀行業	91,820	2,933 269,338,423	3,321 305,021,082	- -	0.77%
12	GENERAL ELECTRIC CO 米国	株式 電気機器	262,800	1,574 413,727,422	1,129 296,721,593	- -	0.75%
13	APPLE INC 米国	株式 電気機器	21,600	8,902 192,292,860	13,630 294,419,658	- -	0.75%
14	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製 品	54,150	5,537 299,843,903	5,281 285,998,862	- -	0.73%
15	WAL-MART STORES 米国	株式 小売業	58,600	5,318 311,639,147	4,681 274,332,829	- -	0.70%
16	CISCO SYSTEMS 米国	株式 電気機器	146,400	1,578 231,128,518	1,823 266,920,857	- -	0.68%
17	WELLS FARGO & CO 米国	株式 銀行業	112,472	2,603 292,789,356	2,355 264,885,653	- -	0.67%
18	BANK OF AMERICA CORP 米国	株式 銀行業	208,201	1,373 285,909,334	1,266 263,659,896	- -	0.67%
19	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	1,341,737	201 270,695,240	187 251,735,408	- -	0.64%
20	PFIZER INC 米国	株式 医薬品	168,860	1,556 262,845,477	1,465 247,398,914	- -	0.63%
21	BANCO SANTANDER SA ユーロ	株式 銀行業	207,950	843 175,417,975	1,165 242,377,786	- -	0.61%
22	COCA COLA CO 米国	株式 食料品	51,400	4,458 229,161,180	4,636 238,306,997	- -	0.60%
23	TELEFONICA S.A. ユーロ	株式 情報・通信業	108,027	2,135 230,659,549	2,202 237,914,614	- -	0.60%

24	GOOGLE INC-CL A 米国	株式 サービス業	5,800	28,510 165,360,999	40,721 236,185,752	- -	0.60%
25	ROCHE HOLDING AG-GENUS スイス	株式 医薬品	17,400	15,018 261,323,551	13,238 230,352,510	- -	0.58%
26	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	86,200	2,419 208,560,545	2,639 227,491,713	- -	0.58%
27	HEWLETT-PACKARD CO 米国	株式 電気機器	60,400	3,337 201,561,695	3,742 226,045,176	- -	0.57%
28	GLAXOSMITHKLINE PLC 英国	株式 医薬品	132,302	1,795 237,530,543	1,703 225,322,147	- -	0.57%
29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S 英国	株式 石油・石炭製品	91,500	2,737 250,441,230	2,450 224,223,898	- -	0.57%
30	INTEL CORP 米国	株式 電気機器	139,300	1,309 182,467,869	1,572 219,069,281	- -	0.56%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.51%
投資証券	1.13%
合計	98.64%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.27%
鉱業	2.98%
建設業	0.75%
食料品	6.44%
繊維製品	0.20%
パルプ・紙	0.21%
化学	3.82%
医薬品	7.76%
石油・石炭製品	8.88%
ゴム製品	0.10%
ガラス・土石製品	0.28%
鉄鋼	0.62%
非鉄金属	0.08%
金属製品	0.26%
機械	2.20%
電気機器	8.11%
輸送用機器	1.80%
精密機器	0.40%
その他製品	0.81%
電気・ガス業	2.93%
陸運業	0.82%
海運業	0.21%
空運業	0.11%

倉庫・運輸関連業	0.00%
情報・通信業	5.05%
卸売業	0.32%
小売業	4.80%
銀行業	11.30%
証券・商品先物取引業	0.90%
保険業	3.88%
その他金融業	1.86%
不動産業	0.59%
サービス業	10.28%
消費材	0.31%
石油他	2.69%
建設資材	0.36%
水道	0.19%
持株会社	0.27%
コング`ロマリット	0.98%
電力	1.68%
プ`ランテーション	0.03%
その他製造	1.67%
新聞・出版	0.30%
合計	97.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	米国	S&P500 2009年9月	買建	24	536,329,142	530,666,472	1.35%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2009年7月	買建	400,000	38,184,000	38,400,000	0.10%
		英ポンド買/円売 2009年7月	買建	80,000	12,588,000	12,762,400	0.03%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日にもっとも近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

（注4）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

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 -	666,981,470	98.78 658,857,644	93.89 626,228,902	2.750000 19/02/15	0.64%

2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	505,684,670	100.30 507,205,675	100.48 508,132,184	2.625000 14/06/30	0.52%
3	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	499,155,990	100.05 499,454,668	99.96 498,996,260	0.875000 11/02/28	0.51%
4	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	450,772,780	107.43 484,281,082	108.02 486,929,265	5.000000 12/01/04	0.50%
5	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	464,867,900	105.21 489,116,564	104.19 484,369,108	4.250000 19/04/25	0.50%
6	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	448,945,560	108.23 485,913,164	106.71 479,069,807	4.750000 38/12/07	0.49%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	473,329,300	98.69 467,153,832	98.84 467,852,880	2.250000 14/05/31	0.48%
8	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	422,582,540	111.30 470,342,819	108.57 458,810,541	6.000000 31/05/01	0.47%
9	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	451,019,580	96.34 434,548,686	99.61 449,260,604	4.250000 32/06/07	0.46%
10	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	388,700,040	117.31 456,015,113	114.81 446,278,177	6.500000 27/11/01	0.46%
11	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	435,457,890	101.75 443,102,526	101.89 443,696,753	4.500000 19/03/01	0.45%
12	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	386,884,500	109.53 423,754,593	113.27 438,224,073	5.000000 18/03/07	0.45%
13	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	408,216,360	103.63 423,067,271	106.85 436,215,920	5.000000 12/02/01	0.45%
14	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	397,780,550	108.10 430,012,708	108.81 432,860,817	5.000000 12/07/04	0.44%
15	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	424,364,200	109.17 463,288,104	101.99 432,817,535	3.750000 18/11/15	0.44%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	429,452,730	99.97 429,338,509	100.17 430,221,450	0.875000 10/12/31	0.44%
17	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	391,192,080	106.71 417,445,982	107.41 420,218,532	5.000000 12/03/07	0.43%
18	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	394,861,500	102.68 405,483,003	106.12 419,027,024	4.000000 16/09/07	0.43%
19	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	389,784,280	105.29 410,435,671	106.65 415,724,424	4.750000 13/02/01	0.43%
20	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	442,369,920	99.81 441,539,545	93.63 414,221,922	4.000000 38/10/25	0.42%
21	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	375,960,220	106.93 402,040,580	107.87 405,559,568	4.500000 13/01/04	0.42%
22	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	376,935,260	112.23 423,049,520	107.53 405,322,254	4.250000 15/08/15	0.42%
23	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 -	290,430,250	143.28 416,131,367	138.35 401,813,155	8.000000 21/11/15	0.41%
24	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	368,235,010	107.49 395,841,589	107.90 397,358,717	4.250000 14/07/04	0.41%
25	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	353,700,180	107.34 379,694,287	110.76 391,758,319	4.750000 15/09/07	0.40%

26	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 -	386,086,800	96.58 372,899,431	100.35 387,476,712	4.250000 27/12/07	0.40%
27	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	367,015,240	101.46 372,399,354	104.63 384,037,407	4.250000 14/08/01	0.39%
28	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	404,421,520	96.70 391,082,285	94.74 383,152,992	5.000000 39/08/01	0.39%
29	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 -	356,850,490	106.76 381,005,700	106.94 381,648,031	5.000000 11/07/04	0.39%
30	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 -	356,005,080	111.87 398,285,924	106.87 380,480,429	4.125000 15/05/15	0.39%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.75%
合計	97.75%

（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	カナダドル買/円売 2009年7月	買建	1,516,678	131,603,559	125,823,566	0.13%
		カナダドル買/円売 2009年8月	買建	245,000	20,328,875	20,320,300	0.02%
		スイスフラン買/円売 2009年7月	買建	285,000	25,421,086	25,319,400	0.03%
		スイスフラン買/円売 2009年8月	買建	68,000	6,041,256	6,041,120	0.01%
		デンマーククローネ買/円売 2009年7月	買建	1,569,000	28,452,543	28,540,109	0.03%
		デンマーククローネ買/円売 2009年8月	買建	402,000	7,304,340	7,308,360	0.01%
		ユーロ買/円売 2009年7月	買建	12,104,000	1,634,512,094	1,640,334,080	1.68%
		ユーロ買/円売 2009年8月	買建	3,205,000	434,239,040	434,117,250	0.44%
		オーストラリアドル買/円売 2009年7月	買建	802,081	61,965,597	62,425,992	0.06%
		英ポンド買/円売 2009年7月	買建	1,979,345	312,770,065	315,764,934	0.32%
		英ポンド買/円売 2009年8月	買建	469,000	74,727,177	74,782,050	0.08%
		米ドル買/円売 2009年7月	買建	10,453,359	1,006,537,821	1,003,522,440	1.03%
		米ドル買/円売 2009年8月	買建	2,624,000	251,859,392	251,799,040	0.26%
		マレーシアリンギット買/円売 2009年7月	買建	1,047,027	28,291,722	28,541,961	0.03%
		ホーランドスロチ買/円売 2009年7月	買建	875,000	26,226,894	26,276,250	0.03%

	ホーランド・ス・ロチ買/円売 2009年8月	買建	227,000	6,836,105	6,796,380	0.01%
	スウェーデン・クロナ買/円売 2009年7月	買建	1,747,000	21,777,804	21,907,379	0.02%
	スウェーデン・クロナ買/円売 2009年8月	買建	457,000	5,731,237	5,730,780	0.01%
	シンガポール・ドル買/円売 2009年7月	買建	235,273	15,426,584	15,577,394	0.02%

（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17年6月6日）	1,000,000	-	1.0000	-
第1計算期間末 （平成18年6月5日）	4,338,594,533	4,338,594,533	1.0920	1.0920
第2計算期間末 （平成19年6月5日）	4,751,944,272	4,751,944,272	1.1896	1.1896
第3計算期間末 （平成20年6月5日）	4,530,306,609	4,530,306,609	1.1377	1.1377
平成20年6月末日	4,455,165,271	-	1.1211	-
7月末日	4,472,951,076	-	1.1231	-
8月末日	4,455,183,736	-	1.1174	-
9月末日	4,209,849,508	-	1.0556	-
10月末日	3,836,426,189	-	0.9773	-
11月末日	3,800,568,135	-	0.9633	-
12月末日	3,850,309,645	-	0.9774	-
平成21年1月末日	3,708,569,022	-	0.9408	-
2月末日	3,694,151,919	-	0.9438	-
3月末日	3,762,050,122	-	0.9585	-
4月末日	3,843,768,993	-	0.9855	-
5月末日	3,935,427,540	-	1.0065	-
第4計算期間末 （平成21年6月5日）	3,978,806,206	3,978,806,206	1.0168	1.0168
6月末日	4,050,467,378	-	1.0226	-

【分配の推移】

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

第4計算期間	0.0000
--------	--------

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	9.2
第2計算期間	8.9
第3計算期間	4.4
第4計算期間	10.6

第二部 【ファンドの詳細情報】

第1 【ファンドの沿革】

平成17年6月6日 信託契約締結、当初設定、運用開始

第2 【手続等】

1 【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、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（半休日においては午前11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。この時刻を過ぎで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す。

2 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時（半休日においては午前11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。この時刻を過ぎで行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

< 一部解約 >

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

・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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

第3 【管理及び運営】

1 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）、2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

- ・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6月6日から翌年6月5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、その翌日から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、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただ

し、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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す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。

2 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

収益分配金は、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に支払われます。

販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

受託会社は、収益分配金について、毎計算期間終了日の翌営業日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に収益分配金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

償還金にかかる請求権

受益者は、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。

償還金は、信託終了日後1か月以内の委託会社の指定する日（原則として信託終了日から起算して5営業日まで）から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社が当ファンドの償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受託会社は、償還金について、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償還金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から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、「第2 手続等」の「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第4 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成19年6月6日から平成20年6月5日まで）及び第4期計算期間（平成20年6月6日から平成21年6月5日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス30

ダイワ・ライフ・バランス 30

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成20年6月5日現在	第4期 平成21年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,752,716	11,585,545
親投資信託受益証券	4,521,489,914	3,970,944,364
未収入金	-	560,000
流動資産合計	4,535,242,630	3,983,089,909
資産合計	4,535,242,630	3,983,089,909
負債の部		
流動負債		
未払解約金	514,621	564,812
未払受託者報酬	707,408	594,999
未払委託者報酬	3,537,220	2,975,224
その他未払費用	176,772	148,668
流動負債合計	4,936,021	4,283,703
負債合計	4,936,021	4,283,703
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,982,119,510	1 3,912,926,874
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	548,187,099	65,879,332
（分配準備積立金）	324,824,596	301,579,019
元本等合計	4,530,306,609	3,978,806,206
純資産合計	4,530,306,609	3,978,806,206
負債純資産合計	4,535,242,630	3,983,089,909

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
営業収益		
受取利息	67,526	35,026
有価証券売買等損益	199,693,666	477,345,550
営業収益合計	199,626,140	477,310,524
営業費用		
受託者報酬	1,445,347	1,261,075
委託者報酬	7,227,071	6,305,723
その他費用	361,167	315,108
営業費用合計	9,033,585	7,881,906
営業損失（ ）	208,659,725	485,192,430
経常損失（ ）	208,659,725	485,192,430
当期純損失（ ）	208,659,725	485,192,430
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	13,918,742	37,881,400
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	757,282,900	548,187,099
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,911,289	4,670,595
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,911,289	4,670,595
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,266,107	39,667,332
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	74,266,107	39,667,332
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	548,187,099	65,879,332

(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3期 自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第3期 平成20年6月5日現在	第4期 平成21年6月5日現在
1. 1 期首元本額	3,994,661,372円	3,982,119,510円
期中追加設定元本額	381,154,709円	223,779,082円
期中一部解約元本額	393,696,571円	292,971,718円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,982,119,510口	3,912,926,874口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第3期 自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（223,362,503円）及び分配準備積立金（324,824,596円）より分配対象額は548,187,099円（1万口当たり1,376.62円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（49,583,473円）及び分配準備積立金（301,579,019円）より分配対象額は351,162,492円（1万口当たり897.44円）ですが、分配を行っておりません。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第3期 平成20年6月5日現在		第4期 平成21年6月5日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,521,489,914	204,070,825	3,970,944,364	436,038,056
合計	4,521,489,914	204,070,825	3,970,944,364	436,038,056

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第3期 自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5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3期 平成20年6月5日現在	第4期 平成21年6月5日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1377円 (11,377円)	1.0168円 (10,168円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	1,742,109,348	832,205,635	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	2,010,472,049	2,124,465,814	
	外国株式インデックスマザーファンド	535,445,531	419,842,840	
	外国債券インデックスマザーファンド	307,421,429	594,430,075	
親投資信託受益証券 合計		4,595,448,357	3,970,944,364	
合計		4,595,448,357	3,970,944,364	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考）

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

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年6月5日現在 金 額（円）	平成21年6月5日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,214,482,465	1,261,640,665
株式 3	97,022,385,000	86,910,298,700
派生商品評価勘定	191,830,339	277,376,955
未収入金	2,184,007	-
未収配当金	693,510,142	674,879,091
差入委託証拠金	74,230,000	38,321,000
流動資産合計	100,198,621,953	89,162,516,411
資産合計	100,198,621,953	89,162,516,411
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	501,012	19,299
前受金	189,245,000	265,882,000
未払金	-	114,204,000
未払解約金	159,415,000	18,464,000
流動負債合計	349,161,012	398,569,299
負債合計	349,161,012	398,569,299
純資産の部		
元本等		
元本 1	137,304,656,548	185,822,662,537
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ） 2	37,455,195,607	97,058,715,425
元本等合計	99,849,460,941	88,763,947,112
純資産合計	99,849,460,941	88,763,947,112
負債純資産合計	100,198,621,953	89,162,516,411

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引	先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 （会計方針の変更） 従来、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上していましたが、「投資信託に関する会計規則に関する細則」の改正により、平成19年7月1日以降計上する受取配当金については、原則として、株式の配当落ち日において、予想配当金額についてもその全額を計上する方法に変更しました。	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分		平成20年6月5日現在	平成21年6月5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	109,545,207,316円	137,304,656,548円
	同期中における追加設定元本額	37,340,297,389円	63,231,398,384円
	同期中における一部解約元本額	9,580,848,157円	14,713,392,395円
	同期末における元本の内訳		
	ファンド名		
	適格機関投資家専用投信1号	1,805,465,578円	1,869,501,381円
	トピックス・インデックスファンド	11,155,443,911円	12,621,747,086円
	トピックス インデックス オープン	4,555,850,857円	- 円
	ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	32,766,519,580円	39,922,760,343円
	適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	1,197,783,125円	1,134,072,648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）	317,171,805円	443,542,905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）	6,066,170,668円	6,961,598,127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）	292,306,999円	399,500,970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）	7,448,345,318円	9,330,703,812円

D C ダイワ日本株式インデックス	40,496,337,177円	47,641,531,873円
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	1,378,829,978円	1,742,109,348円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	520,941円	14,810,425円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	819,673円	16,756,838円
年金ダイワ日本株式インデックス	227,002,583円	643,139,852円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	478,800円	8,853,720円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	791,884円	3,306,293円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	692,459円	897,635円
ダイワ世界分散バランスファンド 1 5 V A	395,330,707円	541,117,017円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	2,612,669,796円	3,806,303,937円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A（国内株式型）	1,497,591,082円	2,159,221,882円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	95,810,817円	116,834,393円
ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A	524,249,505円	801,539,690円
ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A（国内株式型）	265,626,198円	380,371,813円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	4,529,551,887円	4,185,224,653円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	475,424,484円	568,728,238円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	7,646,028,863円	30,187,918,286円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	501,911,694円	2,369,393,830円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 7 5 V A	1,215,687,234円	5,566,214,893円
ダイワライフスタイル 2 5	82,172,768円	138,900,305円
ダイワライフスタイル 5 0	263,711,162円	398,813,568円
ダイワライフスタイル 7 5	260,283,263円	328,907,878円
D C ・ダイワ・トピックス・イン デックス（確定拠出年金専用ファ ンド）	9,228,075,752円	11,518,338,898円
計	137,304,656,548円	185,822,662,537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	137,304,656,548口	185,822,662,537口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は37,455,195,607円であり ます。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は97,058,715,425円であり ます。
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。
	株式 76,550,000円	株式 60,910,000円

（有価証券関係に関する注記）
売買目的有価証券

種 類	平成20年6月5日現在		平成21年6月5日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	97,022,385,000	7,849,038,150	86,910,298,700	14,846,880,258
合計	97,022,385,000	7,849,038,150	86,910,298,700	14,846,880,258

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年9月20日から平成20年6月5日まで、及び平成20年9月20日から平成21年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	平成20年6月5日 現在				平成21年6月5日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,655,755,000	-	2,848,000,000	192,245,000	1,651,943,000	-	1,929,900,000	277,957,000

合計	2,655,755,000	-	2,848,000,000	192,245,000	1,651,943,000	-	1,929,900,000	277,957,000
----	---------------	---	---------------	-------------	---------------	---	---------------	-------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成20年6月5日現在	平成21年6月5日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7272円 (7,272円)	0.4777円 (4,777円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額 (円)		備考
		単 価	金 額	
極 洋	41,000	204	8,364,000	
日本水産	98,600	268	26,424,800	
マルハニチロホールディングス	161,000	147	23,667,000	
サカタのタネ	15,200	1,326	20,155,200	
ホクト	8,100	1,843	14,928,300	
ショーボンドHD	8,000	1,824	14,592,000	
日鉄鉱業	22,000	448	9,856,000	
三井松島	36,000	152	5,472,000	
国際石油開発帝石	378	829,000	313,362,000	
関東天然瓦斯	12,000	601	7,212,000	
石油資源開発	11,700	5,380	62,946,000	
間組	40,500	113	4,576,500	
東急建設	32,270	292	9,422,840	
コムシスホールディングス	42,000	973	40,866,000	
ミサワホーム	13,900	345	4,795,500	
高松コンストラクションGP	6,500	1,388	9,022,000	
東建コーポレーション	3,480	2,670	9,291,600	
大成建設	373,000	227	84,671,000	
大 林 組	233,000	430	100,190,000	
清水建設	236,000	413	97,468,000	
長谷工コーポレーション	335,500	88	29,524,000	
鹿島建設	342,000	300	102,600,000	
不動テトラ	47,400	89	4,218,600	
鉄建建設	51,000	100	5,100,000	
安藤建設	40,000	140	5,600,000	
太平工業	14,000	313	4,382,000	
西松建設	91,000	142	12,922,000	
大豊建設	34,000	87	2,958,000	
前田建設	53,000	351	18,603,000	
奥 村 組	81,000	363	29,403,000	

東鉄工業	20,000	513	10,260,000
浅沼組	33,000	81	2,673,000
戸田建設	89,000	375	33,375,000
熊谷組	60,000	90	5,400,000
青木あすなろ建設	9,000	416	3,744,000
北野建設	23,000	233	5,359,000
三井ホーム	14,000	497	6,958,000
矢作建設	10,000	636	6,360,000
大東建託	36,400	4,510	164,164,000
NIPPOコーポレーション	17,000	921	15,657,000
前田道路	25,000	881	22,025,000
日本道路	39,000	271	10,569,000
東亜建設	83,000	126	10,458,000
五洋建設	104,000	134	13,936,000
住友林業	57,300	662	37,932,600
日本基礎技術	22,300	210	4,683,000
パナホーム	32,000	516	16,512,000
大和ハウス	207,000	876	181,332,000
ライト工業	29,600	227	6,719,200
積水ハウス	234,000	891	208,494,000
コミュニチュア	10,000	651	6,510,000
ユアテック	16,000	477	7,632,000
西部電気工業	17,000	402	6,834,000
中電工	12,900	1,400	18,060,000
関電工	39,000	696	27,144,000
大明	12,000	841	10,092,000
きんでん	49,000	778	38,122,000
東京エネシス	11,000	803	8,833,000
トーエネック	15,000	476	7,140,000
日本電設工業	17,000	986	16,762,000
協和エクシオ	31,000	900	27,900,000
日本工営	34,000	288	9,792,000
東電通	31,000	167	5,177,000
九電工	17,000	607	10,319,000
三機工業	21,000	721	15,141,000
日揮	83,000	1,541	127,903,000
中外炉工業	31,000	284	8,804,000
太平電業	13,000	939	12,207,000
高砂熱学	24,000	783	18,792,000
日立プラントテクノロジー	24,000	491	11,784,000
三晃金属	12,000	370	4,440,000
NECネットエスアイ	8,100	1,072	8,683,200
大気社	12,500	1,020	12,750,000
ダイダン	14,000	451	6,314,000
日比谷総合設	13,000	832	10,816,000
東芝プラントシステム	14,000	1,084	15,176,000
日本製粉	52,000	429	22,308,000
日清製粉G本社	75,500	1,058	79,879,000
昭和産業	41,000	278	11,398,000
日本農産工業	29,000	257	7,453,000
協同飼料	43,000	122	5,246,000
中部飼料	9,000	670	6,030,000
日本配合飼料	31,000	122	3,782,000
ユニ・チャーム ペットケア	4,800	2,700	12,960,000
日本甜菜糖	50,000	229	11,450,000

三井製糖	35,000	321	11,235,000
日本M & A センター	16	340,000	5,440,000
アコーディア・ゴルフ	212	75,900	16,090,800
パソナグループ	88	53,800	4,734,400
テンプホールディングス	10,500	711	7,465,500
森永製菓	91,000	201	18,291,000
中 村 屋	22,000	468	10,296,000
江崎グリコ	29,000	911	26,419,000
名糖産業	3,900	1,405	5,479,500
山崎製パン	55,000	995	54,725,000
雪印乳業	92,000	286	26,312,000
森永乳業	71,000	321	22,791,000
ヤクルト	44,100	1,883	83,040,300
明治ホールディングス	23,900	3,200	76,480,000
プリマハム	55,000	114	6,270,000
日本ハム	64,000	1,121	71,744,000
伊藤ハム	63,000	347	21,861,000
丸大食品	36,000	240	8,640,000
米 久	9,000	948	8,532,000
S F o o d s	6,500	750	4,875,000
スタジオアリス	5,600	644	3,606,400
N E C フィールドینگ	7,000	1,129	7,903,000
新日鉄ソリューションズ	5,300	1,407	7,457,100
総合警備保障	26,500	914	24,221,000
日本駐車場開発	1,385	4,910	6,800,350
カカクコム	61	366,000	22,326,000
新日本科学	4,600	394	1,812,400
ソネット・エムスリー	38	329,000	12,502,000
ディー・エヌ・エー	101	312,000	31,512,000
博報堂 D Y H L D G S	10,640	4,920	52,348,800
ぐるなび	44	238,800	10,507,200
パシフィックゴルフ G R P	204	56,400	11,505,600
サッポロホールディングス	120,000	425	51,000,000
アサヒビール	155,700	1,295	201,631,500
キリン H D	339,000	1,209	409,851,000
宝ホールディングス	71,000	545	38,695,000
オエノンホールディングス	28,000	212	5,936,000
メルシャン	31,000	187	5,797,000
養 命 酒	8,000	889	7,112,000
三国コカ・コ - ラ	12,200	768	9,369,600
コカ・コーラウエスト	25,300	1,632	41,289,600
コカコーラセントラルジャパン	9,800	1,303	12,769,400
ダイドードリンコ	4,000	2,540	10,160,000
伊 藤 園	23,100	1,286	29,706,600
キーコーヒー	7,500	1,573	11,797,500
日清オイリオグループ	36,000	470	16,920,000
不二製油	22,000	1,074	23,628,000
J - オイルミルズ	32,000	323	10,336,000
ローソン	22,900	3,860	88,394,000
サンエー	3,300	2,870	9,471,000
カワチ薬品	5,600	1,807	10,119,200
エービーシー・マート	7,600	2,195	16,682,000
アスクル	7,100	1,445	10,259,500
ゲオ	146	67,000	9,782,000
ポイント	6,570	4,390	28,842,300

伊藤忠食品	2,100	3,200	6,720,000
J A L U X	4,200	1,262	5,300,400
エディオン	29,700	647	19,215,900
サーラコーポレーション	12,000	521	6,252,000
バルス	51	82,100	4,187,100
双日	458,600	208	95,388,800
アルフレッサホールディングス	14,500	4,040	58,580,000
ハニーズ	6,290	639	4,019,310
キッコーマン	73,000	942	68,766,000
味の素	225,000	711	159,975,000
キューピー	42,600	960	40,896,000
ハウス食品	30,200	1,403	42,370,600
カゴメ	31,600	1,483	46,862,800
焼津水産化工	6,400	988	6,323,200
アリアケジャパン	7,000	1,417	9,919,000
ニチレイ	96,000	360	34,560,000
横浜冷凍	19,000	573	10,887,000
東洋水産	33,000	2,085	68,805,000
日清食品H D	25,900	2,960	76,664,000
永谷園	10,000	864	8,640,000
フジッコ	10,000	1,118	11,180,000
ロックフィールド	5,000	1,198	5,990,000
日本たばこ産業	1,835	270,000	495,450,000
わらべや日洋	5,100	1,167	5,951,700
片倉工業	9,400	800	7,520,000
グンゼ	55,000	340	18,700,000
昭栄	13,300	783	10,413,900
神栄	24,000	145	3,480,000
アルペン	5,600	1,654	9,262,400
ビックカメラ	204	31,000	6,324,000
DCM JAPAN HLDGS	36,700	537	19,707,900
あいホールディングス	21,600	383	8,272,800
J. フロントリテイリング	186,000	413	76,818,000
ドトール・日レスH D	10,900	1,323	14,420,700
マツモトキヨシHLDGS	13,900	1,980	27,522,000
ココカラファインH D	5,700	1,308	7,455,600
三越伊勢丹H D	134,100	890	119,349,000
東洋紡績	264,000	148	39,072,000
ユニチカ	178,000	91	16,198,000
富士紡ホールディングス	38,000	101	3,838,000
日清紡ホールディングス	55,000	971	53,405,000
倉敷紡績	83,000	170	14,110,000
大和紡績	55,000	261	14,355,000
シキボウ	51,000	136	6,936,000
日東紡績	80,000	168	13,440,000
トヨタ紡織	26,000	1,359	35,334,000
バイタルKSKHD	9,800	508	4,978,400
日本毛織	27,000	565	15,255,000
ダイドーリミテッド	12,300	525	6,457,500
野村不動産HLDGS	20,500	1,615	33,107,500
ヒューリック	21,400	429	9,180,600
日本コークス工業	55,000	139	7,645,000
JFE商事HLDGS	48,000	371	17,808,000
サークルKサンクス	18,200	1,367	24,879,400
コスモス薬品	3,400	1,371	4,661,400

グリーンホスピタルサプライ	86	59,000	5,074,000
セブン&アイ・H L D G S	291,400	2,290	667,306,000
ツルハホールディングス	5,600	2,845	15,932,000
サンマルクホールディングス	2,700	2,695	7,276,500
帝 人	318,000	261	82,998,000
東 レ	514,000	493	253,402,000
三菱レイヨン	196,000	258	50,568,000
ク ラ レ	114,000	978	111,492,000
旭 化 成	483,000	456	220,248,000
サカイ オーベックス	36,000	98	3,528,000
稲葉製作所	6,400	974	6,233,600
宮地エンジニアリングG	44,000	79	3,476,000
三協・立山H L D G S	91,000	78	7,098,000
トーカロ	6,400	1,354	8,665,600
S U M C O	41,500	1,385	57,477,500
川田テクノロジーズ	3,300	1,290	4,257,000
住江織物	34,000	123	4,182,000
日本バイリ - ン	14,000	426	5,964,000
アツギ	78,000	138	10,764,000
セーレン	20,400	448	9,139,200
小松精練	18,000	381	6,858,000
ワコールホールディングス	45,000	1,188	53,460,000
ホギメディカル	3,700	4,830	17,871,000
サンエー・インターナショナル	5,200	735	3,822,000
レナウン	21,000	149	3,129,000
I Tホールディングス	24,200	1,614	39,058,800
コーエーテクモHD	12,800	730	9,344,000
特種東海H L D G S	55,000	267	14,685,000
ドワンゴ	46	155,700	7,162,200
マクロミル	56	114,900	6,434,400
ティーガイア	66	126,200	8,329,200
インターネットイニシアティブ	48	152,200	7,305,600
ソネットエンタテインメント	44	201,100	8,848,400
王子製紙	315,000	417	131,355,000
三菱製紙	118,000	142	16,756,000
北越製紙	47,000	437	20,539,000
中越パルプ	37,000	253	9,361,000
大王製紙	33,000	845	27,885,000
日本製紙G本社	36,200	2,655	96,111,000
レンゴー	60,000	531	31,860,000
トーモク	40,000	185	7,400,000
ザ・パックス	5,900	1,485	8,761,500
昭和電工	406,000	154	62,524,000
住友化学	569,000	438	249,222,000
日本化成	24,000	172	4,128,000
住友精化	20,000	368	7,360,000
日産化学	53,000	1,026	54,378,000
ラサ工業	43,000	134	5,762,000
クレハ	50,000	454	22,700,000
テイカ	20,000	265	5,300,000
石原産業	101,000	114	11,514,000
日本曹達	50,000	429	21,450,000
東ソー	210,000	311	65,310,000
トクヤマ	95,000	709	67,355,000
セントラル硝子	79,000	374	29,546,000

東亜合成	85,000	262	22,270,000
ダイソー	36,000	218	7,848,000
関東電化	19,000	453	8,607,000
電気化学	166,000	262	43,492,000
イビデン	52,000	2,890	150,280,000
信越化学	128,900	4,820	621,298,000
日本カ - バイド	23,000	106	2,438,000
堺 化 学	29,000	420	12,180,000
エア・ウォーター	55,000	1,021	56,155,000
大陽日酸	119,000	841	100,079,000
日本化学工業	34,000	240	8,160,000
日本パ - カライジング	18,000	934	16,812,000
高压ガス	26,000	464	12,064,000
戸田工業	18,000	395	7,110,000
ステラ ケミファ	4,000	3,640	14,560,000
保土谷化学	34,000	211	7,174,000
日本触媒	51,000	771	39,321,000
大日精化	32,000	264	8,448,000
カネカ	96,000	664	63,744,000
協和発酵キリン	105,000	995	104,475,000
三菱瓦斯化学	131,000	547	71,657,000
三井化学	238,000	339	80,682,000
J S R	69,900	1,464	102,333,600
東京応化工業	14,900	1,820	27,118,000
三菱ケミカルH L D G S	448,500	433	194,200,500
日本合成化学	23,000	475	10,925,000
ダイセル化学	99,000	523	51,777,000
住友ベ - クライト	78,000	456	35,568,000
積水化学	173,000	576	99,648,000
日本ゼオン	68,000	385	26,180,000
アイカ工業	24,800	945	23,436,000
宇部興産	328,000	237	77,736,000
積水樹脂	13,000	809	10,517,000
タキロン	26,000	270	7,020,000
旭有機材	34,000	255	8,670,000
日立化成	32,900	1,487	48,922,300
ニチバン	21,000	289	6,069,000
大倉工業	26,000	258	6,708,000
積水化成品	27,000	298	8,046,000
群栄化学	31,000	206	6,386,000
日本化薬	57,000	591	33,687,000
イーピーエス	23	364,000	8,372,000
フェイス	442	6,780	2,996,760
野村総合研究所	35,600	1,817	64,685,200
ドリームインキュベータ	44	74,300	3,269,200
サイバネットシステム	156	33,400	5,210,400
電通	76,700	1,843	141,358,100
シンプレクス・テクノロジー	151	45,400	6,855,400
A D E K A	33,400	846	28,256,400
日油	69,000	381	26,289,000
ミヨシ油脂	42,000	150	6,300,000
ハリマ化成	11,000	368	4,048,000
花 王	198,000	2,040	403,920,000
三洋化成	26,000	481	12,506,000
武田薬品	272,000	3,730	1,014,560,000

アステラス製薬	173,400	3,220	558,348,000
大日本住友製薬	55,000	754	41,470,000
塩野義製薬	113,000	1,837	207,581,000
田辺三菱製薬	76,000	1,010	76,760,000
わかもと製薬	16,000	400	6,400,000
あすか製薬	10,000	822	8,220,000
日本新薬	20,000	1,100	22,000,000
中外製薬	102,300	1,735	177,490,500
科研製薬	34,000	837	28,458,000
エーザイ	95,600	3,150	301,140,000
ロート製薬	35,000	974	34,090,000
小野薬品	38,400	4,140	158,976,000
久光製薬	23,900	2,990	71,461,000
持田製薬	32,000	884	28,288,000
大正製薬	72,000	1,769	127,368,000
参天製薬	23,600	2,950	69,620,000
エスエス製薬	21,000	499	10,479,000
扶桑薬品	30,000	295	8,850,000
日本ケミファ	17,000	273	4,641,000
ツムラ	22,700	2,985	67,759,500
テ ル モ	53,000	3,950	209,350,000
みらかホールディングス	14,600	2,050	29,930,000
キッセイ薬品工業	16,000	2,170	34,720,000
生化学工業	15,600	1,000	15,600,000
栄研化学	8,000	751	6,008,000
鳥居薬品	5,600	1,487	8,327,200
東和薬品	3,200	4,160	13,312,000
沢井製薬	5,100	4,960	25,296,000
ゼリア新薬工業	12,000	1,065	12,780,000
第一三共	227,900	1,712	390,164,800
キョーリン	19,000	1,353	25,707,000
大日本塗料	49,000	109	5,341,000
日本ペイント	85,000	463	39,355,000
関西ペイント	86,000	612	52,632,000
中国塗料	23,000	652	14,996,000
日本特殊塗料	12,000	329	3,948,000
藤倉化成	12,600	518	6,526,800
太陽インキ製造	6,200	2,145	13,299,000
D I C	256,000	157	40,192,000
サカタインクス	20,000	323	6,460,000
東洋インキ	77,000	299	23,023,000
オリエンタルランド	21,600	6,310	136,296,000
ダスキン	23,800	1,598	38,032,400
パーク 2 4	44,900	857	38,479,300
フジ・メディア・HD	753	130,100	97,965,300
秀英予備校	9,700	362	3,511,400
ラウンドワン	13,200	895	11,814,000
リゾートトラスト	14,600	937	13,680,200
オービック	2,280	16,080	36,662,400
ヤフー	5,395	27,280	147,175,600
ビー・エム・エル	4,900	1,955	9,579,500
ワタベウェディング	4,200	1,549	6,505,800
トレンドマイクロ	35,500	3,390	120,345,000
もしもしホットライン	6,150	1,854	11,402,100
東急コミュニティー	3,200	1,883	6,025,600

リソー教育	1,328	3,600	4,780,800
日本オラクル	11,500	3,340	38,410,000
アルファシステムズ	2,700	1,999	5,397,300
フューチャーアーキテクト	120	41,200	4,944,000
シーエーシー	7,000	703	4,921,000
ユー・エス・エス	10,550	5,080	53,594,000
オービックビジネス	2,500	3,790	9,475,000
伊藤忠テクノソリューションズ	9,000	2,565	23,085,000
東京個別指導学院	24,600	167	4,108,200
カルチュア・コンビニエンス	36,000	792	28,512,000
大塚商会	5,800	4,670	27,086,000
総合メディカル	2,300	2,240	5,152,000
セントラルスポーツ	5,500	866	4,763,000
電通国際情報	9,400	524	4,925,600
富士フイルムHLDS	189,000	2,765	522,585,000
コニカミノルタHLDS	195,500	1,077	210,553,500
資生堂	132,000	1,599	211,068,000
ライオン	88,000	441	38,808,000
高砂香料	28,000	523	14,644,000
マンダム	8,200	2,200	18,040,000
ミルボン	4,200	2,050	8,610,000
ファンケル	14,100	1,135	16,003,500
コーセー	12,400	2,020	25,048,000
ドクターシーラボ	60	150,900	9,054,000
エステー	7,400	956	7,074,400
コニシ	8,800	820	7,216,000
長谷川香料	9,700	989	9,593,300
小林製薬	10,600	3,380	35,828,000
荒川化学工業	8,400	926	7,778,400
日本高純度化学	28	252,200	7,061,600
アース製薬	6,500	2,565	16,672,500
イハラケミカル	22,000	364	8,008,000
大成ラミック	4,400	2,030	8,932,000
クミアイ化学	22,000	466	10,252,000
日本農薬	18,000	894	16,092,000
新日本石油	539,000	598	322,322,000
昭和シェル石油	61,600	941	57,965,600
コスモ石油	212,000	341	72,292,000
東燃ゼネラル石油	114,000	1,017	115,938,000
新日鉱ホールディングス	320,000	572	183,040,000
AOCホールディングス	19,100	985	18,813,500
出光興産	9,100	8,890	80,899,000
横浜ゴム	96,000	426	40,896,000
東洋ゴム	82,000	227	18,614,000
ブリヂストン	242,900	1,418	344,432,200
住友ゴム	66,900	694	46,428,600
オカモト	37,000	339	12,543,000
アキレス	78,000	153	11,934,000
ニッタ	7,400	1,434	10,611,600
東海ゴム	14,400	970	13,968,000
三ツ星ベルト	27,000	413	11,151,000
バンドー化学	36,000	240	8,640,000
鬼怒川ゴム	27,000	149	4,023,000
旭硝子	382,000	754	288,028,000
日本板硝子	249,000	306	76,194,000

有沢製作所	12,900	471	6,075,900
日本山村硝子	43,000	224	9,632,000
日本電気硝子	125,000	983	122,875,000
オハラ	4,400	1,201	5,284,400
住友大阪セメント	153,000	211	32,283,000
太平洋セメント	310,000	187	57,970,000
東海カーボン	69,000	485	33,465,000
日本カーボン	41,000	282	11,562,000
東洋炭素	3,300	4,040	13,332,000
ノリタケ	42,000	311	13,062,000
TOTO	122,000	591	72,102,000
日本碍子	93,000	1,778	165,354,000
日本特殊陶業	68,000	884	60,112,000
MARUWA	4,400	1,511	6,648,400
品川白煉瓦	30,000	213	6,390,000
黒崎播磨	24,000	213	5,112,000
フジミインコーポレーテッド	8,000	1,493	11,944,000
ニチアス	40,000	292	11,680,000
新日本製鐵	2,031,000	369	749,439,000
住友金属工業	1,323,000	270	357,210,000
神戸製鋼所	1,073,000	179	192,067,000
日新製鋼	296,000	248	73,408,000
中山製鋼所	49,000	225	11,025,000
合同製鐵	49,000	307	15,043,000
JFEホールディングス	197,500	3,150	622,125,000
東京製鐵	33,900	1,197	40,578,300
共英製鋼	6,300	2,435	15,340,500
大和工業	17,900	2,600	46,540,000
東京鐵鋼	19,000	365	6,935,000
大阪製鐵	5,600	1,732	9,699,200
淀川製鋼所	60,000	533	31,980,000
東洋鋼鈑	18,000	486	8,748,000
丸一鋼管	21,200	1,924	40,788,800
モリ工業	25,000	225	5,625,000
大同特殊鋼	119,000	463	55,097,000
日本高周波	40,000	110	4,400,000
日本金属工業	60,000	230	13,800,000
日本冶金工	45,000	457	20,565,000
山陽特殊鋼	40,000	423	16,920,000
愛知製鋼	43,000	388	16,684,000
日立金属	50,000	904	45,200,000
日本金属	35,000	190	6,650,000
大平洋金属	55,000	823	45,265,000
日本電工	31,000	598	18,538,000
栗本鉄工所	34,000	96	3,264,000
日本製鋼所	111,000	1,227	136,197,000
三菱製鋼	51,000	240	12,240,000
日本軽金属	157,000	113	17,741,000
三井金属	227,000	253	57,431,000
東邦亜鉛	44,000	424	18,656,000
三菱マテリアル	470,000	339	159,330,000
住友鉱山	201,000	1,520	305,520,000
DOWAホールディングス	99,000	451	44,649,000
古河機金	120,000	116	13,920,000
大阪チタニウム	7,600	4,060	30,856,000

東邦チタニウム	12,800	1,840	23,552,000
住友軽金属	107,000	109	11,663,000
古河スカイ	41,000	189	7,749,000
古河電工	247,000	369	91,143,000
住友電工	255,000	1,069	272,595,000
フジクラ	118,000	444	52,392,000
三菱電線工業	45,000	92	4,140,000
昭和電線H L D G S	84,000	86	7,224,000
タツタ電線	25,000	243	6,075,000
日立電線	62,000	315	19,530,000
リョービ	50,000	272	13,600,000
アサヒHD	10,800	1,804	19,483,200
東洋製罐	59,600	1,874	111,690,400
横河ブリッジH L D G S	16,000	782	12,512,000
三和ホールディングス	80,000	296	23,680,000
文化シヤツタ -	22,000	344	7,568,000
住生活グループ	93,200	1,410	131,412,000
日本フィルコン	8,800	506	4,452,800
ノーリツ	13,200	1,193	15,747,600
長府製作所	8,500	1,881	15,988,500
リンナイ	14,700	4,100	60,270,000
ユニプレス	11,100	935	10,378,500
日東精工	18,000	290	5,220,000
三洋工業	29,000	172	4,988,000
岡 部	19,100	391	7,468,100
日立ツール	7,500	711	5,332,500
東 プ レ	16,600	777	12,898,200
高周波熱錬	13,000	757	9,841,000
東京製綱	59,000	299	17,641,000
日本発条	50,000	556	27,800,000
三浦工業	11,900	2,050	24,395,000
タ ク マ	34,000	238	8,092,000
ツ ガ ミ	31,000	203	6,293,000
オークマ	48,000	468	22,464,000
東芝機械	43,000	386	16,598,000
ア マ ダ	118,000	639	75,402,000
アイダエンジニア	23,200	318	7,377,600
牧野フライス	37,000	329	12,173,000
オーエスジー	32,400	718	23,263,200
旭ダイヤモンド	21,000	524	11,004,000
森精機製作所	33,100	1,070	35,417,000
ディスコ	6,900	3,690	25,461,000
日東工器	5,600	1,962	10,987,200
豊田自動織機	59,300	2,495	147,953,500
大阪機工	42,000	101	4,242,000
オ - エム製作所	9,000	380	3,420,000
津田駒工業	27,000	144	3,888,000
島精機製作所	9,200	2,380	21,896,000
日阪製作所	9,000	1,144	10,296,000
やまびこ	3,600	1,232	4,435,200
ナプテスコ	32,000	952	30,464,000
三井海洋開発	5,400	1,745	9,423,000
S M C	22,900	10,270	235,183,000
新川	7,600	1,246	9,469,600
ホソカワミクロン	16,000	435	6,960,000

ユニオンツール	4,500	2,590	11,655,000
オイレス工業	9,500	1,335	12,682,500
サトー	9,200	870	8,004,000
日精樹脂工業	12,000	291	3,492,000
小松製作所	343,800	1,472	506,073,600
住友重機械	195,000	443	86,385,000
日立建機	39,500	1,645	64,977,500
井関農機	80,000	319	25,520,000
T O W A	9,800	447	4,380,600
丸山製作所	24,000	198	4,752,000
北川鉄工所	49,000	120	5,880,000
クボタ	353,000	699	246,747,000
東洋エンジニア	49,000	355	17,395,000
三菱化工機	29,000	269	7,801,000
月島機械	13,000	558	7,254,000
帝国電機製作所	3,700	2,185	8,084,500
東京機械	35,000	162	5,670,000
新東工業	17,400	754	13,119,600
アイチ コーポレーション	14,800	424	6,275,200
小森コーポレーション	22,200	1,188	26,373,600
住友精密	20,000	396	7,920,000
酒井重工業	26,000	178	4,628,000
荏原製作所	167,000	309	51,603,000
西島製作所	7,500	1,413	10,597,500
千代田化工建	66,000	815	53,790,000
ダイキン工業	80,600	3,150	253,890,000
オルガノ	14,000	763	10,682,000
ト - ヨ - カネツ	55,000	197	10,835,000
栗田工業	42,500	2,635	111,987,500
椿本チエイン	41,000	346	14,186,000
T C M	34,000	136	4,624,000
日 機 装	22,000	660	14,520,000
木村化工機	8,000	911	7,288,000
新興プランテック	14,100	857	12,083,700
アネスト岩田	21,000	283	5,943,000
ダイフク	31,500	670	21,105,000
加藤製作所	22,000	238	5,236,000
油研工業	28,000	171	4,788,000
タダノ	36,000	499	17,964,000
フジテック	27,000	416	11,232,000
シーケーディ	22,600	515	11,639,000
平和	18,900	1,097	20,733,300
理想科学工業	6,000	869	5,214,000
S A N K Y O	19,900	4,990	99,301,000
日本金銭機械	9,900	899	8,900,100
マースエンジニアリング	4,100	2,695	11,049,500
キャノンファインテック	8,100	1,161	9,404,100
ダイコク電機	4,100	1,250	5,125,000
ア マ ノ	23,000	924	21,252,000
J U K I	44,000	150	6,600,000
サンデン	45,000	255	11,475,000
ブラザー工業	88,500	915	80,977,500
マックス	14,000	1,052	14,728,000
グローリー	22,700	1,882	42,721,400
大和冷機工業	16,000	415	6,640,000

セガサミーホールディングス	84,000	1,074	90,216,000
日本ピストンリング	44,000	101	4,444,000
リ ケ ン	39,000	274	10,686,000
帝国ピストン	12,700	455	5,778,500
ホシザキ電機	15,000	1,057	15,855,000
大豊工業	8,300	713	5,917,900
日本精工	153,000	484	74,052,000
N T N	131,000	359	47,029,000
ジェイテクト	73,900	867	64,071,300
不 二 越	77,000	193	14,861,000
ミネベア	111,000	404	44,844,000
日本トムソン	25,000	487	12,175,000
T H K	45,800	1,556	71,264,800
ユーシン精機	3,900	1,439	5,612,100
イーグル工業	12,000	405	4,860,000
キッツ	35,000	313	10,955,000
日 立	1,238,000	317	392,446,000
東 芝	1,425,000	356	507,300,000
三菱電機	690,000	573	395,370,000
富士電機H L D G S	173,000	152	26,296,000
東洋電機製造	16,000	593	9,488,000
安川電機	81,000	594	48,114,000
シンフォニア テクノロジー	49,000	238	11,662,000
明 電 舎	70,000	480	33,600,000
オリジン電気	15,000	293	4,395,000
デンヨー	8,800	822	7,233,600
日立工機	25,500	935	23,842,500
三桜工業	12,900	461	5,946,900
マキタ	44,800	2,340	104,832,000
東芝テック	54,000	401	21,654,000
芝浦メカトロニクス	15,000	454	6,810,000
マブチモーター	11,100	4,760	52,836,000
日本電産	36,500	6,000	219,000,000
高岳製作所	38,000	326	12,388,000
ダイヘン	38,000	359	13,642,000
J V C ケンウッドH D	224,300	70	15,701,000
日新電機	18,000	473	8,514,000
大崎電気	12,000	951	11,412,000
オムロン	87,400	1,503	131,362,200
日東工業	11,600	931	10,799,600
I D E C	11,600	660	7,656,000
エルピーダメモリ	36,000	1,111	39,996,000
ジーエス・ユアサ コーポ	119,000	854	101,626,000
サクサホールディングス	28,000	130	3,640,000
メルコホールディングス	4,400	1,276	5,614,400
日本電気	746,000	379	282,734,000
富 士 通	761,000	495	376,695,000
沖 電 気	210,000	104	21,840,000
岩崎通信機	37,000	100	3,700,000
電気興業	21,000	501	10,521,000
サンケン電気	44,000	408	17,952,000
アイホン	6,400	1,579	10,105,600
N E C エレクトロニクス	14,300	960	13,728,000
セイコーエプソン	54,000	1,461	78,894,000
ワコム	147	176,200	25,901,400

アルバック	12,100	2,345	28,374,500
ナナオ	6,400	1,868	11,955,200
日本信号	19,500	796	15,522,000
京三製作所	21,000	369	7,749,000
能美防災	10,000	797	7,970,000
ホーチキ	10,000	578	5,780,000
マスプロ電工	8,000	859	6,872,000
日本無線	33,000	248	8,184,000
パナソニック	789,300	1,338	1,056,083,400
シャープ	357,000	1,097	391,629,000
アンリツ	37,000	375	13,875,000
富士通ゼネラル	21,000	324	6,804,000
日立国際電気	22,000	632	13,904,000
ソ ニ ー	392,600	2,695	1,058,057,000
T D K	38,700	4,370	169,119,000
帝国通信工業	32,000	265	8,480,000
三洋電機	735,000	245	180,075,000
ミツミ電機	26,500	1,904	50,456,000
タムラ製作所	25,000	369	9,225,000
アルプス電気	63,400	543	34,426,200
池上通信機	26,000	97	2,522,000
パイオニア	59,200	266	15,747,200
日本電波工業	6,000	2,170	13,020,000
日本トリム	2,050	1,948	3,993,400
ローランド ディー . ジー .	3,100	1,342	4,160,200
フオスタ - 電機	8,400	1,115	9,366,000
クラリオン	46,000	92	4,232,000
S M K	24,000	355	8,520,000
ヨコオ	10,300	488	5,026,400
東 光	39,000	172	6,708,000
ホシデン	18,500	1,266	23,421,000
ヒロセ電機	12,700	10,470	132,969,000
日本航空電子	17,000	608	10,336,000
日立マクセル	16,000	1,139	18,224,000
ユニデン	23,000	334	7,682,000
アルパイン	16,300	865	14,099,500
スミダコーポレーション	7,300	593	4,328,900
アイコム	4,200	1,907	8,009,400
船井電機	6,600	3,750	24,750,000
横河電機	80,900	553	44,737,700
新電元工業	31,000	239	7,409,000
山武	18,700	1,953	36,521,100
日本光電工業	15,000	1,263	18,945,000
チ ノ ー	20,000	253	5,060,000
堀場製作所	10,600	2,405	25,493,000
アドバンテスト	50,800	1,897	96,367,600
小野測器	13,000	422	5,486,000
エスベック	8,800	701	6,168,800
サンクス	11,600	311	3,607,600
キーエンス	15,100	20,700	312,570,000
日置電機	3,900	1,665	6,493,500
シスメックス	13,900	3,390	47,121,000
メガチップス	7,300	1,770	12,921,000
O B A R A	5,700	785	4,474,500
ミヤチテクノス	6,600	632	4,171,200

東京電波	3,900	735	2,866,500
デンソー	162,400	2,360	383,264,000
コーセル	11,100	862	9,568,200
日立メディコ	7,000	1,070	7,490,000
新日本無線	13,000	281	3,653,000
オプテックス	6,500	938	6,097,000
千代田インテグレ	5,400	1,070	5,778,000
スタンレー電気	51,600	1,613	83,230,800
岩崎電気	33,000	219	7,227,000
ウシオ電機	41,100	1,446	59,430,600
日本セラミック	6,800	1,050	7,140,000
新神戸電機	8,000	812	6,496,000
日本デジタル研究所	8,500	1,062	9,027,000
古河電池	6,000	917	5,502,000
双信電機	10,900	383	4,174,700
図 研	6,700	673	4,509,100
日本電子	29,000	382	11,078,000
カ シ オ	70,900	889	63,030,100
ファナック	71,400	7,850	560,490,000
日本シイエムケイ	15,000	775	11,625,000
エンプラス	6,000	961	5,766,000
ロ ー ム	37,900	6,280	238,012,000
浜松ホトニクス	26,600	1,886	50,167,600
三井ハイテック	11,000	856	9,416,000
新光電気工業	21,500	1,119	24,058,500
京 セ ラ	65,900	7,500	494,250,000
太陽誘電	37,000	1,011	37,407,000
村田製作所	82,500	4,160	343,200,000
ユーシン	11,900	447	5,319,300
双葉電子工業	13,200	1,897	25,040,400
日東電工	67,700	2,790	188,883,000
北陸電気工業	46,000	154	7,084,000
パナソニック電工	120,000	778	93,360,000
東海理化電機	19,700	1,448	28,525,600
ニチコン	23,400	1,206	28,220,400
日本ケミコン	39,000	341	13,299,000
K O A	11,800	648	7,646,400
三井造船	268,000	226	60,568,000
日立造船	332,500	112	37,240,000
佐世保重工業	48,000	222	10,656,000
三菱重工業	1,316,000	357	469,812,000
川崎重工業	614,000	216	132,624,000
I H I	505,000	163	82,315,000
日本車輜	49,000	558	27,342,000
近畿車輜	15,000	636	9,540,000
日産自動車	935,400	598	559,369,200
いすゞ自動車	355,000	167	59,285,000
トヨタ自動車	951,600	3,860	3,673,176,000
日野自動車	109,000	305	33,245,000
三菱自動車工業	1,659,000	175	290,325,000
武蔵精密工業	7,400	1,513	11,196,200
トヨタ車体	16,200	1,523	24,672,600
日産車体	26,000	723	18,798,000
関東自動車	11,700	921	10,775,700
新明和工業	38,000	343	13,034,000

極東開発工業	18,100	441	7,982,100
日信工業	13,600	1,192	16,211,200
トピー工業	69,000	173	11,937,000
ティラド	28,000	192	5,376,000
曙ブレーキ	20,900	481	10,052,900
タチエス	10,800	772	8,337,600
N O K	39,500	1,225	48,387,500
カヤバ工業	54,000	204	11,016,000
市光工業	29,000	185	5,365,000
大同メタル工業	16,000	399	6,384,000
プレス工業	34,000	191	6,494,000
カルソニックカンセイ	46,000	204	9,384,000
太平洋工業	20,000	314	6,280,000
ケーヒン	17,000	1,266	21,522,000
アイシン精機	67,600	1,979	133,780,400
マ ツ ダ	295,000	277	81,715,000
ダイハツ	78,000	907	70,746,000
愛知機械	28,000	279	7,812,000
今仙電機製作所	7,100	1,041	7,391,100
本田技研	632,800	2,850	1,803,480,000
スズキ	149,500	2,170	324,415,000
富士重工業	252,000	406	102,312,000
ヤマハ発動機	85,400	1,183	101,028,200
ショーワ	17,000	431	7,327,000
小糸製作所	37,000	1,057	39,109,000
エクセディ	8,900	1,936	17,230,400
ミツバ	17,000	306	5,202,000
豊田合成	20,900	2,095	43,785,500
愛三工業	10,500	689	7,234,500
ヨ ロ ズ	6,600	948	6,256,800
エフ・シー・シー	11,100	1,323	14,685,300
シマノ	28,400	3,420	97,128,000
タカタ	13,100	1,491	19,532,100
テイ・エス テック	15,500	1,340	20,770,000
小 野 建	7,200	916	6,595,200
はるやま商事	7,600	372	2,827,200
佐鳥電機	9,100	463	4,213,300
カップクリエイト	4,700	1,905	8,953,500
伯東	6,600	720	4,752,000
ライトオン	6,700	852	5,708,400
ナガイレーベン	5,000	1,707	8,535,000
ジーンズメイト	8,300	555	4,606,500
菱食	6,900	2,265	15,628,500
良品計画	7,800	4,070	31,746,000
三城ホールディングス	10,800	928	10,022,400
松田産業	5,500	1,746	9,603,000
メディセオ・パルタックHD	77,700	1,096	85,159,200
アドヴァン	11,200	486	5,443,200
アズワン	5,400	1,618	8,737,200
シモジマ	6,200	1,288	7,985,600
ドウシシャ	5,000	1,324	6,620,000
コナカ	13,400	262	3,510,800
コ ジ マ	13,300	541	7,195,300
コーナン商事	9,300	938	8,723,400
黒田電気	11,700	1,046	12,238,200

ネットワンシステムズ	183	156,100	28,566,300
ワタミ	9,900	1,823	18,047,700
ドン・キホーテ	15,100	1,701	25,685,100
丸文	8,800	524	4,611,200
メガネトップ	7,900	1,396	11,028,400
西松屋チェーン	19,500	845	16,477,500
ゼンショー	25,500	508	12,954,000
ハピネット	3,400	1,121	3,811,400
幸楽苑	7,100	1,118	7,937,800
トーマンエレクトロニクス	4,200	945	3,969,000
ユニマットライフ	6,000	857	5,142,000
サイゼリヤ	11,100	1,205	13,375,500
エクセル	5,200	900	4,680,000
ガリバーインターナショナル	2,420	2,810	6,800,200
日本エム・ディ・エム	13,600	191	2,597,600
ユナイテッドアローズ	11,300	621	7,017,300
シークス	7,500	431	3,232,500
京都きもの友禅	7,600	782	5,943,200
コロワイド	18,500	549	10,156,500
壱番屋	3,600	2,050	7,380,000
マクニカ	3,900	1,269	4,949,100
スギホールディングス	11,700	1,849	21,633,300
島津製作所	80,000	768	61,440,000
J M S	15,000	384	5,760,000
アロカ	5,400	831	4,487,400
モリテックス	5,500	350	1,925,000
長野計器	5,300	822	4,356,600
スター精密	14,400	969	13,953,600
東京計器	32,000	152	4,864,000
東京精密	13,800	1,364	18,823,200
ニコン	129,000	1,524	196,596,000
トプコン	17,600	571	10,049,600
オリンパス	81,000	1,993	161,433,000
大日本スクリーン	82,000	286	23,452,000
キャノン電子	7,200	1,406	10,123,200
タムロン	6,800	1,398	9,506,400
H O Y A	169,400	2,060	348,964,000
ノーリツ鋼機	7,500	806	6,045,000
エー・アンド・デイ	8,100	470	3,807,000
キャノン	429,000	3,250	1,394,250,000
リコー	239,000	1,339	320,021,000
日本電産コパル	7,500	912	6,840,000
日本電産サンキョー	23,000	467	10,741,000
シチズンホールディングス	96,900	491	47,577,900
リズム時計	48,000	102	4,896,000
バンダイナムコH L D G S	79,300	1,002	79,458,600
フランスベッドH L D G S	59,000	129	7,611,000
パイロットコーポレーション	76	112,900	8,580,400
エイベックス・グループHD	15,600	900	14,040,000
トッパン・フォームズ	16,900	1,145	19,350,500
フジシールインターナショナル	8,500	1,692	14,382,000
タカラトミー	23,700	594	14,077,800
廣済堂	13,500	221	2,983,500
スルガ	4,300	1,058	4,549,400
タカノ	5,500	604	3,322,000

プロネクサス	11,600	663	7,690,800
大建工業	44,000	157	6,908,000
き も と	9,700	510	4,947,000
凸版印刷	225,000	862	193,950,000
大日本印刷	224,000	1,194	267,456,000
共同印刷	39,000	248	9,672,000
日本写真印刷	11,400	3,860	44,004,000
光村印刷	17,000	316	5,372,000
藤森工業	7,700	915	7,045,500
宝印刷	7,600	836	6,353,600
前澤化成工業	7,400	956	7,074,400
アシックス	73,000	790	57,670,000
ツ ツ ミ	3,300	1,765	5,824,500
ニ チ ハ	9,400	632	5,940,800
ローランド	5,900	1,047	6,177,300
エフピコ	4,000	4,450	17,800,000
ヤマハ	59,400	1,190	70,686,000
河合楽器	45,000	99	4,455,000
クリナップ	9,100	500	4,550,000
ピジヨン	4,900	2,720	13,328,000
天馬	6,800	1,053	7,160,400
パラマウントベッド	8,200	1,326	10,873,200
兼松日産農林	34,000	70	2,380,000
リンテック	14,100	1,568	22,108,800
信越ポリマー	17,500	537	9,397,500
東 リ	29,000	186	5,394,000
イトーキ	20,200	265	5,353,000
任 天 堂	39,000	25,320	987,480,000
三菱鉛筆	8,300	1,093	9,071,900
タカラスタンダ - ド	35,000	551	19,285,000
コ ク ヨ	38,200	791	30,216,200
ナカバヤシ	27,000	219	5,913,000
ニ フ コ	16,300	1,292	21,059,600
ダイワ精工	56,000	133	7,448,000
岡村製作所	32,000	503	16,096,000
日本バルカー	37,000	233	8,621,000
MUTOHホールディングス	15,000	164	2,460,000
伊 藤 忠	543,000	720	390,960,000
丸 紅	636,000	460	292,560,000
高 島	24,000	161	3,864,000
F & A アクアホールディングス	6,500	1,034	6,721,000
三陽商会	39,000	330	12,870,000
長瀬産業	37,000	954	35,298,000
豊田通商	72,300	1,416	102,376,800
オンワ - ドホールディングス	52,000	587	30,524,000
三共生興	21,800	197	4,294,600
兼 松	131,000	94	12,314,000
美 津 濃	39,000	436	17,004,000
ファミリーマート	22,300	2,805	62,551,500
ルック	22,000	99	2,178,000
三井物産	627,700	1,298	814,754,600
日本紙パルプ	41,000	284	11,644,000
東京エレクトロン	53,900	4,900	264,110,000
日立ハイテクノロジーズ	24,800	1,512	37,497,600
東都水産	24,000	147	3,528,000

セイコーHD	32,000	265	8,480,000
山 善	29,700	313	9,296,100
住友商事	429,000	996	427,284,000
日本ユニシス	17,800	874	15,557,200
内田洋行	21,000	306	6,426,000
三菱商事	544,900	1,908	1,039,669,200
第一実業	23,000	309	7,107,000
キヤノンマーケティングJPN	27,600	1,300	35,880,000
西華産業	38,000	231	8,778,000
菱洋エレクトロ	9,000	783	7,047,000
ユアサ商事	86,000	114	9,804,000
神鋼商事	26,000	176	4,576,000
阪和興業	72,000	388	27,936,000
菱電商事	15,000	537	8,055,000
ニプロ	17,000	1,803	30,651,000
岩谷産業	82,000	265	21,730,000
すてきナイスグループ	37,000	149	5,513,000
昭光通商	55,000	118	6,490,000
ニチモウ	29,000	167	4,843,000
富士通ビジネス	5,700	1,712	9,758,400
兼松エレクトロニクス	7,000	800	5,600,000
三愛石油	24,000	403	9,672,000
稲畑産業	21,700	359	7,790,300
G S Iクレオス	32,000	117	3,744,000
明和産業	20,700	190	3,933,000
東京スタイル	26,000	754	19,604,000
ユニ・チャーム	15,500	6,580	101,990,000
デサント	23,000	432	9,936,000
東邦ホールディングス	17,200	960	16,512,000
サンゲツ	12,800	2,090	26,752,000
ミツウロコ	16,400	572	9,380,800
シナネン	25,000	487	12,175,000
伊藤忠エネクス	19,800	611	12,097,800
ザ・トーカイ	21,000	384	8,064,000
サンリオ	21,000	814	17,094,000
リョーサン	12,000	2,130	25,560,000
新光商事	9,200	778	7,157,600
三信電気	10,200	718	7,323,600
東陽テクニカ	11,900	933	11,102,700
モスフード サービス	11,000	1,515	16,665,000
加賀電子	8,800	1,021	8,984,800
三益半導体	6,100	1,207	7,362,700
木曽路	8,900	1,930	17,177,000
千 趣 会	13,800	651	8,983,800
ケーヨー	17,000	483	8,211,000
アデランスホールディングス	9,600	1,020	9,792,000
上新電機	18,000	669	12,042,000
日本瓦斯	9,000	1,381	12,429,000
ベスト電器	26,000	405	10,530,000
マルエツ	17,000	481	8,177,000
ロイヤルホールディングス	12,900	1,045	13,480,500
いなげや	12,000	929	11,148,000
島 忠	17,400	2,030	35,322,000
チヨダ	10,800	1,410	15,228,000
ライフコーポレーション	5,700	1,610	9,177,000

カ ス ミ	21,000	413	8,673,000
リンガーハット	6,900	1,242	8,569,800
A O K Iホールディングス	8,400	1,028	8,635,200
オークワ	11,000	1,014	11,154,000
コメリ	9,900	2,105	20,839,500
青山商事	18,600	1,612	29,983,200
しまむら	7,500	7,640	57,300,000
C F Sコーポレーション	12,500	598	7,475,000
高 島 屋	101,000	609	61,509,000
丸 善	43,000	97	4,171,000
松 屋	15,000	1,161	17,415,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	48,000	543	26,064,000
丸 栄	20,000	179	3,580,000
ニッセンHD	18,400	429	7,893,600
パ ル コ	22,100	744	16,442,400
丸井グループ	97,500	647	63,082,500
クレディセゾン	63,100	1,294	81,651,400
セディナ	79,600	214	17,034,400
ダイエー	36,400	473	17,217,200
イズミヤ	27,000	534	14,418,000
イオン	295,000	886	261,370,000
ユ ニ ー	57,000	747	42,579,000
イ ズ ミ	20,200	1,127	22,765,400
平 和 堂	16,000	1,167	18,672,000
フ ジ	9,200	1,714	15,768,800
ヤオコー	4,900	2,775	13,597,500
ゼビオ	7,700	1,907	14,683,900
ケーズホールディングス	12,800	2,165	27,712,000
新生銀行	429,000	139	59,631,000
あおぞら銀行	263,000	145	38,135,000
三菱UFJフィナンシャルG	4,284,000	624	2,673,216,000
りそなホールディングス	235,600	1,498	352,928,800
中央三井トラストHD	376,000	354	133,104,000
三井住友フィナンシャルG	308,600	3,920	1,209,712,000
第四銀行	103,000	368	37,904,000
北越銀行	94,000	192	18,048,000
西日本シティ銀行	236,000	221	52,156,000
札幌北洋ホール	109,000	284	30,956,000
千葉銀行	288,000	599	172,512,000
横浜銀行	500,000	473	236,500,000
常陽銀行	278,000	462	128,436,000
群馬銀行	167,000	513	85,671,000
武蔵野銀行	11,100	2,820	31,302,000
千葉興業銀行	15,000	1,012	15,180,000
関東つくば銀行	23,400	329	7,698,600
東京都民銀行	14,100	1,662	23,434,200
七十七銀行	121,000	528	63,888,000
青森銀行	49,000	379	18,571,000
秋田銀行	53,000	330	17,490,000
山形銀行	46,000	442	20,332,000
岩手銀行	5,000	5,230	26,150,000
東邦銀行	60,000	373	22,380,000
荘内銀行	35,000	182	6,370,000
みちのく銀行	40,000	216	8,640,000
ふくおかフィナンシャルG	318,000	406	129,108,000

静岡銀行	227,000	926	210,202,000
十六銀行	93,000	353	32,829,000
スルガ銀行	84,000	915	76,860,000
八十二銀行	135,000	550	74,250,000
山梨中央銀行	50,000	496	24,800,000
大垣共立銀行	84,000	429	36,036,000
福井銀行	67,000	312	20,904,000
北國銀行	84,000	329	27,636,000
清水銀行	3,100	3,740	11,594,000
滋賀銀行	68,000	550	37,400,000
南都銀行	73,000	517	37,741,000
百五銀行	72,000	467	33,624,000
京都銀行	124,000	875	108,500,000
三重銀行	37,000	311	11,507,000
池田銀行	6,900	3,710	25,599,000
ほくほくフィナンシャルG	506,000	208	105,248,000
広島銀行	212,000	387	82,044,000
山陰合同銀行	44,000	797	35,068,000
中国銀行	59,000	1,285	75,815,000
鳥取銀行	38,000	262	9,956,000
伊予銀行	82,000	986	80,852,000
百十四銀行	86,000	441	37,926,000
四国銀行	55,000	365	20,075,000
阿波銀行	65,000	558	36,270,000
鹿児島銀行	51,000	654	33,354,000
大分銀行	41,000	484	19,844,000
宮崎銀行	40,000	368	14,720,000
肥後銀行	59,000	525	30,975,000
佐賀銀行	51,000	284	14,484,000
十八銀行	48,000	297	14,256,000
沖縄銀行	6,300	3,340	21,042,000
琉球銀行	18,000	904	16,272,000
住友信託	695,000	488	339,160,000
みずほ信託銀行	701,000	111	77,811,000
八千代銀行	4,500	2,975	13,387,500
みずほフィナンシャルG	4,114,200	241	991,522,200
紀陽ホールディングス	292,000	117	34,164,000
山口フィナンシャルG	67,000	1,217	81,539,000
芙蓉総合リース	7,700	1,968	15,153,600
興銀リース	10,200	1,214	12,382,800
東京センチュリーリース	25,300	878	22,213,400
S B Iホールディングス	5,776	17,750	102,524,000
日本証券金融	28,800	746	21,484,800
大阪証券金融	17,200	197	3,388,400
アイフル	40,100	300	12,030,000
ポケットカード	12,400	238	2,951,200
長野銀行	36,000	228	8,208,000
名古屋銀行	71,000	437	31,027,000
愛知銀行	2,800	7,410	20,748,000
第三銀行	50,000	276	13,800,000
中京銀行	40,000	309	12,360,000
東日本銀行	42,000	217	9,114,000
愛媛銀行	52,000	243	12,636,000
みなと銀行	78,000	131	10,218,000
京葉銀行	66,000	448	29,568,000

関西アーバン銀行	99,000	200	19,800,000
栃木銀行	41,000	477	19,557,000
北日本銀行	3,200	2,685	8,592,000
香川銀行	30,000	403	12,090,000
東和銀行	60,000	52	3,120,000
徳島銀行	24,000	464	11,136,000
武富士	47,540	536	25,481,440
リコーリース	5,400	1,749	9,444,600
イオン クレジットサービス	32,100	1,297	41,633,700
ア コ ム	32,810	2,380	78,087,800
プロミス	34,100	1,229	41,908,900
ジャックス	44,000	184	8,096,000
日立キャピタル	17,000	1,112	18,904,000
オリックス	36,080	5,570	200,965,600
三菱ＵＦＪリース	18,330	2,685	49,216,050
ジャフコ	11,200	3,330	37,296,000
大和証券Ｇ本社	483,000	629	303,807,000
野村ホールディングス	1,041,300	763	794,511,900
みずほ証券	186,000	301	55,986,000
みずほインベストアズ証	132,000	115	15,180,000
岡三証券グループ	63,000	460	28,980,000
丸三証券	25,700	596	15,317,200
東洋証券	35,000	232	8,120,000
東海東京ＨＤ	86,000	331	28,466,000
光世証券	33,000	111	3,663,000
水戸証券	29,000	296	8,584,000
いちよし証券	18,400	804	14,793,600
松井証券	57,100	824	47,050,400
マネックスＧ	371	38,250	14,190,750
カブドットコム証券	165	115,900	19,123,500
岩井証券	9,300	766	7,123,800
三井住友海上ＨＤ	174,100	2,785	484,868,500
ＳＯＮＹ ＦＨ	255	263,200	67,116,000
日本興亜損害保険	281,000	566	159,046,000
損害保険ジャパン	341,000	702	239,382,000
ニッセイ同和損害保険	83,000	474	39,342,000
あいおい損害保険	190,000	456	86,640,000
富士火災	92,000	137	12,604,000
東京海上ＨＤ	314,100	2,815	884,191,500
Ｔ＆Ｄホールディングス	107,150	2,855	305,913,250
三井不動産	325,000	1,626	528,450,000
三菱地所	512,000	1,560	798,720,000
平和不動産	60,500	290	17,545,000
東京建物	112,000	467	52,304,000
ダイビル	19,800	783	15,503,400
サンケイビル	12,900	494	6,372,600
東急不動産	152,000	394	59,888,000
京阪神不動産	18,000	402	7,236,000
住友不動産	187,000	1,500	280,500,000
大京	83,000	153	12,699,000
テーオーシー	29,600	356	10,537,600
レオパレス２１	51,600	800	41,280,000
空港施設	12,400	493	6,113,200
住友不動産販売	3,550	4,110	14,590,500
ゴールドクレスト	5,900	2,315	13,658,500

日本エスリード	6,700	475	3,182,500
東急リパブル	10,600	715	7,579,000
飯田産業	7,000	709	4,963,000
日神不動産	11,000	332	3,652,000
アーネストワン	15,400	251	3,865,400
タカラレーベン	10,900	184	2,005,600
イオンモール	33,300	1,709	56,909,700
リサ・パートナーズ	111	73,400	8,147,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	457	82,300	37,611,100
サンフロンティア不動産	99	22,950	2,272,050
東武鉄道	317,000	519	164,523,000
相模鉄道	103,000	398	40,994,000
東京急行	409,000	441	180,369,000
京浜急行	188,000	719	135,172,000
小田急電鉄	236,000	784	185,024,000
京王電鉄	190,000	549	104,310,000
京成電鉄	123,000	500	61,500,000
富士急行	25,000	405	10,125,000
東日本旅客鉄道	137,700	5,450	750,465,000
西日本旅客鉄道	691	311,000	214,901,000
東海旅客鉄道	615	615,000	378,225,000
西日本鉄道	95,000	357	33,915,000
ハマキョウレックス	3,000	2,005	6,015,000
近畿鉄道	663,000	418	277,134,000
阪急阪神H L D G S	495,000	456	225,720,000
南海電鉄	153,000	429	65,637,000
京阪電鉄	163,000	405	66,015,000
名古屋鉄道	255,000	300	76,500,000
日本通運	316,000	417	131,772,000
ヤマトホールディングス	147,000	1,214	178,458,000
山 九	90,000	356	32,040,000
日 新	38,000	205	7,790,000
丸全昭和運輸	29,000	264	7,656,000
センコー	33,000	315	10,395,000
トナミホールディングス	28,000	235	6,580,000
日本梱包運輸	21,000	950	19,950,000
福山通運	59,000	405	23,895,000
セイノーホールディングス	57,000	715	40,755,000
神奈川中央交通	15,000	508	7,620,000
日立物流	15,500	1,107	17,158,500
日本郵船	397,000	449	178,253,000
商船三井	389,000	672	261,408,000
川崎汽船	179,000	430	76,970,000
新和海運	33,000	303	9,999,000
乾 汽 船	10,700	735	7,864,500
明治海運	9,600	514	4,934,400
飯野海運	36,700	576	21,139,200
太平洋海運	26,000	117	3,042,000
第一中央汽船	51,000	297	15,147,000
全日本空輸	762,000	346	263,652,000
日本航空	1,071,000	186	199,206,000
パスコ	21,000	189	3,969,000
三菱倉庫	53,000	968	51,304,000
三井倉庫	34,000	351	11,934,000
住友倉庫	60,000	387	23,220,000

渋沢倉庫	26,000	380	9,880,000
ヤマタネ	46,000	118	5,428,000
東陽倉庫	32,000	190	6,080,000
日本トランスシティ	22,000	273	6,006,000
東洋埠頭	47,000	141	6,627,000
上 組	87,000	714	62,118,000
郵船航空サービス	6,700	1,241	8,314,700
近鉄エクスプレス	6,900	2,315	15,973,500
バンテック	46	89,000	4,094,000
東京放送HD	43,500	1,353	58,855,500
日本テレビ放送網	6,910	10,390	71,794,900
テレビ朝日	191	146,800	28,038,800
テレビ東京	3,100	2,950	9,145,000
スカパーJ S A T H D	598	37,050	22,155,900
イー・アクセス	347	79,900	27,725,300
N E C モバイリング	3,900	1,670	6,513,000
日本電信電話	335,600	3,790	1,271,924,000
K D D I	1,136	514,000	583,904,000
光通信	9,300	2,010	18,693,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	7,072	138,700	980,886,400
G M O インターネット	17,000	395	6,715,000
学習研究社	36,000	180	6,480,000
ゼンリン	11,200	1,420	15,904,000
昭文社	7,500	650	4,875,000
角川グループH L D G S	6,500	2,275	14,787,500
東京電力	466,300	2,385	1,112,125,500
中部電力	250,400	2,150	538,360,000
関西電力	307,200	2,060	632,832,000
中国電力	110,000	1,937	213,070,000
北陸電力	75,500	2,185	164,967,500
東北電力	184,100	1,927	354,760,700
四国電力	76,600	2,695	206,437,000
九州電力	162,600	1,995	324,387,000
北海道電力	69,200	1,780	123,176,000
沖縄電力	5,500	4,770	26,235,000
電源開発	53,400	2,665	142,311,000
東京瓦斯	936,000	346	323,856,000
大阪瓦斯	794,000	307	243,758,000
東邦瓦斯	191,000	398	76,018,000
西部瓦斯	92,000	248	22,816,000
静岡瓦斯	24,000	503	12,072,000
松 竹	43,000	760	32,680,000
東 宝	52,400	1,390	72,836,000
エイチ・アイ・エス	7,300	1,860	13,578,000
東 映	34,000	413	14,042,000
N T T データ	454	285,800	129,753,200
共立メンテナンス	4,100	1,590	6,519,000
東京テアトル	40,000	191	7,640,000
吉本興業	12,900	908	11,713,200
よみうりランド	24,000	305	7,320,000
東京都競馬	65,000	164	10,660,000
常磐興産	48,000	154	7,392,000
カナモト	18,000	427	7,686,000
東京ドーム	66,000	315	20,790,000
D T S	8,300	936	7,768,800

スクウェア・エニックス・HD	19,000	2,205	41,895,000
シーイーシー	8,200	725	5,945,000
日立ソフトウェア	11,300	1,509	17,051,700
カプコン	15,400	1,816	27,966,400
日本空港ビルデング	18,400	1,199	22,061,600
トランス・コスモス	11,000	1,076	11,836,000
乃村工藝社	22,000	262	5,764,000
住商情報システム	8,100	1,355	10,975,500
藤田観光	25,000	409	10,225,000
近畿日本ツーリスト	29,000	111	3,219,000
日本管財	3,700	1,361	5,035,700
セコム	75,100	3,790	284,629,000
C S Kホールディングス	23,200	405	9,396,000
日立情報	6,500	1,892	12,298,000
アイネス	10,800	570	6,156,000
メイテック	13,700	1,303	17,851,100
T K C	7,600	1,786	13,573,600
アサツー ディ・ケイ	15,800	1,948	30,778,400
富士ソフト	9,500	1,844	17,518,000
ソラン	12,400	569	7,055,600
応用地質	9,700	1,039	10,078,300
日システム	13,800	997	13,758,600
コナミ	33,300	1,737	57,842,100
ベネッセコーポレーション	26,600	3,870	102,942,000
イオンディライト	6,100	1,494	9,113,400
ニチイ学館	19,300	753	14,532,900
ダイセキ	11,600	2,145	24,882,000
トラスコ中山	8,900	1,466	13,047,400
ヤマダ電機	35,480	5,330	189,108,400
オートバックスセブン	11,700	3,320	38,844,000
アークランドサカモト	6,700	903	6,050,100
ニトリ	15,700	6,010	94,357,000
ユーエスシー	4,700	893	4,197,100
愛眼	9,200	560	5,152,000
吉野家ホールディングス	169	108,800	18,387,200
加藤産業	10,800	1,414	15,271,200
富士エレクトロニクス	7,400	758	5,609,200
松屋フーズ	5,200	1,299	6,754,800
J B C Cホールディングス	8,700	636	5,533,200
J Kホールディングス	8,900	470	4,183,000
サガミチェーン	10,000	906	9,060,000
日伝	3,600	2,650	9,540,000
因幡電機産業	7,100	2,150	15,265,000
住金物産	39,000	243	9,477,000
プレナス	9,500	1,395	13,252,500
ミニストップ	6,800	1,511	10,274,800
アークス	10,200	1,286	13,117,200
パロー	16,300	733	11,947,900
ミスミグループ本社	24,400	1,379	33,647,600
大庄	5,100	1,297	6,614,700
タキヒヨー	15,000	492	7,380,000
ファーストリテイリング	14,600	12,480	182,208,000
ソフトバンク	298,800	1,782	532,461,600
スズケン	25,700	2,545	65,406,500
サンドラッグ	14,100	1,897	26,747,700

ベルーナ	11,200	368	4,121,600	
合計	104,337,218		86,910,298,700	

[次へ](#)

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

トヨタ自動車	5,000株	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	300株
--------	--------	--------------	------

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年6月5日現在 金 額（円）	平成21年6月5日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	200,311,348	226,529,605
国債証券	8,277,916,270	7,699,093,410
地方債証券	974,173,319	917,819,790
特殊債券	1,435,196,511	1,528,028,561
社債券	1,597,772,836	1,136,630,234
未収利息	43,493,141	42,485,772
前払費用	9,717,164	5,978,365
流動資産合計	12,538,580,589	11,556,565,737
資産合計	12,538,580,589	11,556,565,737
負債の部		
流動負債		
未払金	108,063,880	163,617,200
流動負債合計	108,063,880	163,617,200
負債合計	108,063,880	163,617,200
純資産の部		
元本等		
元本	12,166,198,651	10,781,184,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	264,318,058	611,764,385
元本等合計	12,430,516,709	11,392,948,537
純資産合計	12,430,516,709	11,392,948,537
負債純資産合計	12,538,580,589	11,556,565,737

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成20年6月5日現在	平成21年6月5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	3,910,125,090円	12,166,198,651円
	同期中における追加設定元本額	9,945,106,658円	5,210,271,958円
	同期中における一部解約元本額	1,689,033,097円	6,595,286,457円
	同期末における元本の内訳 ファンド名		
	ダイワ・ライフ・バランス 3 0	2,330,360,339円	2,010,472,049円
	ダイワ・ライフ・バランス 5 0	448,173円	8,680,542円
	ダイワ・ライフ・バランス 7 0	221,306円	3,245,304円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 安定コース）	54,996,560円	80,138,302円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 6 分散コース）	68,337,146円	68,229,072円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 成長コース）	13,400,679円	12,856,247円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2020	386,644円	5,070,449円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	204,727円	590,303円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	48,297円	42,013円
	ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	7,989,747,203円	4,637,722,661円
	ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	503,116,659円	378,123,406円
	ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	352,103,040円	1,059,674,847円
	ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 7 5 V A	852,827,878円	2,516,338,957円
	計	12,166,198,651円	10,781,184,152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	12,166,198,651口	10,781,184,152口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年6月5日現在		平成21年6月5日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	8,277,916,270	131,621,910	7,699,093,410	24,580,760
地方債証券	974,173,319	9,269,632	917,819,790	4,141,109
特殊債証券	1,435,196,511	13,107,490	1,528,028,561	8,643,403
社債証券	1,597,772,836	12,481,423	1,136,630,234	9,976,080
合計	12,285,058,936	166,480,455	11,281,571,995	1,820,168

（注）「当期間」とは当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年12月1日から平成20年6月5日まで、及び平成20年12月2日から平成21年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

	平成20年6月5日現在	平成21年6月5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）	1.0217円 (10,217円)	1.0567円 (10,567円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 40年国債	24,000,000	24,771,120	
	2 40年国債	8,000,000	7,850,080	
	2 30年国債	5,000,000	5,193,900	
	3 30年国債	4,000,000	4,086,640	
	4 30年国債	8,000,000	8,966,240	
	5 30年国債	3,000,000	3,000,000	
	6 30年国債	9,000,000	9,298,350	
	7 30年国債	7,000,000	7,090,510	
	8 30年国債	4,000,000	3,689,680	
	9 30年国債	7,000,000	5,942,860	
	10 30年国債	12,000,000	9,516,000	
	11 30年国債	13,000,000	11,729,380	
	12 30年国債	8,000,000	7,787,120	
	13 30年国債	5,000,000	4,768,500	
	14 30年国債	10,000,000	10,279,400	
	15 30年国債	8,000,000	8,367,040	
	16 30年国債	13,000,000	13,611,390	
	17 30年国債	11,000,000	11,304,150	
	18 30年国債	18,000,000	18,131,940	
	19 30年国債	9,000,000	9,058,950	
	20 30年国債	12,000,000	12,547,200	
	20 利付国債20年	15,000,000	17,448,600	
	21 30年国債	9,000,000	9,059,670	
	22 30年国債	12,000,000	12,553,680	
	23 30年国債	15,000,000	15,696,150	
	24 30年国債	13,000,000	13,606,840	
	25 30年国債	13,000,000	13,077,090	
	26 30年国債	28,000,000	28,742,280	
	27 30年国債	30,000,000	31,431,900	
	28 30年国債	25,000,000	26,206,000	
	29 30年国債	43,000,000	44,177,340	
	30 30年国債	13,000,000	13,092,430	
	30 利付国債20年	16,000,000	18,591,840	
	32 利付国債20年	8,000,000	9,359,200	
	33 利付国債20年	5,000,000	5,905,850	
	34 利付国債20年	27,000,000	31,416,390	
	36 利付国債20年	33,000,000	37,249,080	
	37 利付国債20年	5,000,000	5,683,350	
	38 利付国債20年	11,000,000	12,179,420	

3 9	2 0 年国債	32,000,000	35,193,280
4 0	2 0 年国債	36,000,000	38,629,080
4 1	2 0 年国債	40,000,000	40,102,400
4 2	2 0 年国債	13,000,000	14,298,310
4 3	2 0 年国債	14,000,000	15,808,940
4 4	2 0 年国債	18,000,000	19,642,320
4 5	2 0 年国債	20,000,000	21,619,400
4 6	2 0 年国債	19,000,000	20,144,560
4 7	2 0 年国債	18,000,000	19,059,300
4 8	2 0 年国債	26,000,000	28,305,420
4 9	5 年国債	3,000,000	3,014,730
4 9	2 0 年国債	10,000,000	10,449,000
5 0	2 0 年国債	30,000,000	30,694,200
5 1	5 年国債	8,000,000	8,080,080
5 1	2 0 年国債	15,000,000	15,488,100
5 2	5 年国債	20,000,000	20,169,000
5 2	2 0 年国債	14,000,000	14,583,800
5 3	5 年国債	22,000,000	22,252,780
5 3	2 0 年国債	17,000,000	17,693,090
5 4	5 年国債	25,000,000	25,355,250
5 4	2 0 年国債	14,000,000	14,722,960
5 5	5 年国債	36,000,000	36,702,360
5 5	2 0 年国債	20,000,000	20,543,400
5 6	2 0 年国債	15,000,000	15,381,450
5 7	5 年国債	18,000,000	18,385,920
5 7	2 0 年国債	19,000,000	19,261,440
5 8	5 年国債	78,000,000	79,829,100
5 8	2 0 年国債	16,000,000	16,180,000
5 9	5 年国債	30,000,000	30,582,900
5 9	2 0 年国債	27,000,000	26,590,410
6 0	5 年国債	94,000,000	95,741,820
6 0	2 0 年国債	15,000,000	14,215,650
6 1	5 年国債	3,000,000	3,058,920
6 1	2 0 年国債	19,000,000	17,039,960
6 2	5 年国債	2,000,000	2,044,280
6 2	2 0 年国債	17,000,000	14,741,040
6 3	5 年国債	25,000,000	25,517,250
6 3	2 0 年国債	23,000,000	22,833,710
6 4	5 年国債	45,000,000	46,369,350
6 4	2 0 年国債	25,000,000	25,084,500
6 5	5 年国債	52,000,000	53,427,400
6 5	2 0 年国債	15,000,000	15,025,650
6 6	5 年国債	38,000,000	38,698,060
6 6	2 0 年国債	11,000,000	10,880,870
6 7	5 年国債	15,000,000	15,372,300
6 7	2 0 年国債	9,000,000	9,005,130
6 8	5 年国債	67,000,000	68,228,110
6 8	2 0 年国債	19,000,000	19,737,200
6 9	5 年国債	110,000,000	111,236,400
6 9	2 0 年国債	17,000,000	17,442,510
7 0	5 年国債	17,000,000	17,115,940
7 0	2 0 年国債	27,000,000	28,712,340
7 1	5 年国債	82,000,000	84,072,140
7 1	2 0 年国債	8,000,000	8,299,920
7 2	5 年国債	45,000,000	46,473,750
7 2	2 0 年国債	39,000,000	39,852,540
7 3	5 年国債	24,000,000	24,597,600

7 3	2 0 年国債	13,000,000	13,093,080
7 4	5 年国債	25,000,000	25,323,500
7 4	2 0 年国債	29,000,000	29,588,990
7 5	5 年国債	44,000,000	44,712,360
7 5	2 0 年国債	16,000,000	16,279,680
7 6	5 年国債	60,000,000	61,221,000
7 6	2 0 年国債	23,000,000	22,792,310
7 7	5 年国債	45,000,000	45,541,800
7 7	2 0 年国債	9,000,000	9,037,890
7 8	5 年国債	18,000,000	18,114,120
7 8	2 0 年国債	5,000,000	4,942,300
7 9	5 年国債	20,000,000	19,951,800
7 9	2 0 年国債	17,000,000	17,030,940
8 0	5 年国債	98,000,000	98,193,060
8 0	2 0 年国債	16,000,000	16,253,280
8 1	5 年国債	178,000,000	178,081,880
8 1	2 0 年国債	28,000,000	28,000,000
8 2	5 年国債	85,000,000	85,449,650
8 2	2 0 年国債	27,000,000	27,381,780
8 3	2 0 年国債	28,000,000	28,330,120
8 4	2 0 年国債	18,000,000	17,966,520
8 5	2 0 年国債	26,000,000	26,260,520
8 6	2 0 年国債	22,000,000	22,843,260
8 7	2 0 年国債	3,000,000	3,071,490
8 8	2 0 年国債	25,000,000	25,903,250
8 9	2 0 年国債	25,000,000	25,537,750
9 0	2 0 年国債	39,000,000	39,771,810
9 1	2 0 年国債	21,000,000	21,725,130
9 2	2 0 年国債	54,000,000	54,207,900
9 3	2 0 年国債	17,000,000	16,790,730
9 4	2 0 年国債	33,000,000	33,085,470
9 5	2 0 年国債	30,000,000	30,926,100
9 6	2 0 年国債	29,000,000	29,018,850
9 7	2 0 年国債	27,000,000	27,374,490
9 8	2 0 年国債	27,000,000	26,964,360
9 9	2 0 年国債	64,000,000	63,829,120
1 0 0	2 0 年国債	29,000,000	29,370,620
1 0 1	2 0 年国債	24,000,000	25,036,800
1 0 2	2 0 年国債	15,000,000	15,633,000
1 0 3	2 0 年国債	24,000,000	24,635,760
1 0 4	2 0 年国債	26,000,000	25,876,760
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	37,817,980
1 0 6	2 0 年国債	20,000,000	20,218,800
1 0 7	2 0 年国債	12,000,000	11,933,880
1 0 8	2 0 年国債	54,000,000	51,999,840
1 0 9	2 0 年国債	25,000,000	24,049,250
1 1 0	2 0 年国債	45,000,000	44,749,800
2 2 3	利付国債	5,000,000	5,094,700
2 2 4	利付国債	5,000,000	5,101,100
2 2 5	利付国債	19,000,000	19,478,800
2 2 6	利付国債	35,000,000	35,828,800
2 2 7	利付国債	9,000,000	9,206,910
2 2 8	利付国債	16,000,000	16,339,520
2 2 9	1 0 年国債	5,000,000	5,097,250
2 3 1	1 0 年国債	26,000,000	26,499,720
2 3 3	1 0 年国債	33,000,000	33,700,920
2 3 4	1 0 年国債	40,000,000	40,922,000

2 3 6	1 0 年国債	10,000,000	10,274,000	
2 3 7	1 0 年国債	45,000,000	46,307,700	
2 3 8	1 0 年国債	9,000,000	9,236,880	
2 3 9	1 0 年国債	9,000,000	9,247,050	
2 4 0	1 0 年国債	37,000,000	37,905,020	
2 4 1	1 0 年国債	18,000,000	18,449,640	
2 4 2	1 0 年国債	17,000,000	17,369,920	
2 4 3	1 0 年国債	17,000,000	17,315,010	
2 4 4	1 0 年国債	6,000,000	6,088,140	
2 4 5	1 0 年国債	11,000,000	11,121,660	
2 4 6	1 0 年国債	15,000,000	15,114,000	
2 4 7	1 0 年国債	26,000,000	26,177,320	
2 4 8	1 0 年国債	20,000,000	20,062,600	
2 4 9	1 0 年国債	33,000,000	32,981,520	
2 5 0	1 0 年国債	44,000,000	43,706,520	
2 5 1	1 0 年国債	13,000,000	13,119,730	
2 5 2	1 0 年国債	55,000,000	55,722,150	
2 5 3	1 0 年国債	56,000,000	58,093,840	
2 5 4	1 0 年国債	31,000,000	31,894,970	
2 5 5	1 0 年国債	4,000,000	4,132,920	
2 5 6	1 0 年国債	14,000,000	14,401,660	
2 5 7	1 0 年国債	15,000,000	15,364,650	
2 5 8	1 0 年国債	55,000,000	56,316,700	
2 6 0	1 0 年国債	40,000,000	41,516,400	
2 6 1	1 0 年国債	32,000,000	33,530,240	
2 6 2	1 0 年国債	45,000,000	47,380,500	
2 6 3	1 0 年国債	6,000,000	6,230,520	
2 6 4	1 0 年国債	6,000,000	6,198,600	
2 6 5	1 0 年国債	38,000,000	39,262,740	
2 6 6	1 0 年国債	39,000,000	40,090,050	
2 6 7	1 0 年国債	45,000,000	46,020,600	
2 6 8	1 0 年国債	25,000,000	25,816,250	
2 6 9	1 0 年国債	67,000,000	68,433,130	
2 7 0	1 0 年国債	88,000,000	89,781,120	
2 7 1	1 0 年国債	47,000,000	47,669,750	
2 7 2	1 0 年国債	130,000,000	133,229,200	
2 7 3	2 年国債	180,000,000	181,427,400	
2 7 3	1 0 年国債	49,000,000	50,521,940	
2 7 4	2 年国債	25,000,000	25,135,500	
2 7 4	1 0 年国債	11,000,000	11,326,590	
2 7 5	2 年国債	69,000,000	69,380,190	
2 7 5	1 0 年国債	30,000,000	30,707,100	
2 7 6	2 年国債	90,000,000	90,351,000	
2 7 6	1 0 年国債	16,000,000	16,578,080	
2 7 7	2 年国債	20,000,000	20,041,800	
2 7 7	1 0 年国債	45,000,000	46,579,950	
2 7 8	2 年国債	70,000,000	70,128,800	
2 7 8	1 0 年国債	36,000,000	37,731,600	
2 7 9	2 年国債	50,000,000	50,078,000	
2 7 9	1 0 年国債	96,000,000	101,864,640	
2 8 0	2 年国債	35,000,000	35,050,050	
2 8 0	1 0 年国債	50,000,000	52,660,500	
2 8 1	1 0 年国債	27,000,000	28,622,430	
2 8 2	1 0 年国債	113,000,000	117,174,220	
2 8 3	1 0 年国債	69,000,000	72,060,840	
2 8 4	1 0 年国債	71,000,000	73,526,890	
2 8 5	1 0 年国債	69,000,000	71,326,680	

	2 8 6 1 0 年国債	103,000,000	107,093,220	
	2 8 7 1 0 年国債	72,000,000	75,441,600	
	2 8 8 1 0 年国債	161,000,000	165,937,870	
	2 8 9 1 0 年国債	172,000,000	174,239,440	
	2 9 0 1 0 年国債	52,000,000	52,162,760	
	2 9 1 1 0 年国債	52,000,000	51,734,800	
	2 9 2 1 0 年国債	43,000,000	44,197,980	
	2 9 3 1 0 年国債	69,000,000	71,383,260	
	2 9 4 1 0 年国債	53,000,000	54,361,040	
	2 9 5 1 0 年国債	59,000,000	59,520,380	
	2 9 6 1 0 年国債	144,000,000	144,884,160	
	2 9 7 1 0 年国債	44,000,000	43,797,160	
	2 9 8 1 0 年国債	138,000,000	136,152,180	
	2 9 9 1 0 年国債	130,000,000	127,946,000	
	3 0 0 1 0 年国債	63,000,000	63,161,280	
国債証券 合計		7,548,000,000	7,699,093,410	
地方債証券	1 2 共同発行地方	50,000,000	51,117,000	
	1 4 共同発行地方	16,400,000	16,837,437	
	1 8 共同発行地方	100,000,000	103,140,000	
	2 7 共同発行地方	20,000,000	20,252,580	
	7 6 川崎市公債	25,000,000	25,040,900	
	1 1 2 神奈川県公債	35,000,000	35,572,145	
	1 4 4 神奈川県公債	100,000,000	103,441,500	
	5 7 6 東京都公債	100,000,000	102,016,900	
	5 8 3 東京都公債	7,400,000	7,593,036	
	6 0 4 東京都公債	10,000,000	10,280,730	
	1 2 - こ 名古屋市債	100,000,000	102,328,800	
	1 2 - ゆ 名古屋市債	20,000,000	20,447,600	
	1 4 - 1 横浜市公債	5,000,000	5,118,035	
	1 4 - 5 横浜市公債	20,000,000	20,041,260	
	1 7 - 9 千葉県 5 年	100,500,000	101,675,347	
	1 6 川崎市 5 年	60,000,000	61,775,340	
	1 8 川崎市 5 年	60,000,000	60,597,900	
	1 9 神奈川県 5 年	40,000,000	40,310,000	
	2 0 東京都 5 年	30,000,000	30,233,280	
地方債証券 合計		899,300,000	917,819,790	
特殊債券	1 アフリカ開発銀行 S U B	50,000,000	58,265,850	
	5 政保中部空港	121,000,000	121,513,161	
	6 政保政策投資 B K	25,000,000	25,108,500	
	1 4 政保国民生活	19,000,000	19,568,898	
	3 9 政保関西空港	16,000,000	15,852,960	
	1 9 0 政保首都高速	3,000,000	3,077,328	
	1 9 3 しんきん中金	100,000,000	100,526,800	
	3 0 9 政保道路債	20,000,000	20,393,360	
	3 1 2 政保道路債	30,000,000	30,548,640	
	3 1 7 政保道路債	100,000,000	99,070,200	
	3 1 9 政保道路債	40,000,000	40,234,720	
	3 2 3 政保道路債	85,000,000	87,569,550	
	3 2 8 政保道路債	41,000,000	42,236,068	
	3 3 3 政保道路債	21,000,000	21,736,491	
	3 3 4 政保道路債	2,000,000	2,059,218	
	7 9 3 政保公営企業	100,000,000	101,966,800	
	8 0 0 政保公営企業	19,000,000	19,347,472	
	8 0 3 政保公営企業	25,000,000	25,449,550	
	8 0 9 政保公営企業	15,000,000	15,350,850	
	8 2 8 政保公営企業	15,000,000	14,859,180	

	8 2 9 政保公営企業	10,000,000	10,143,880	
	8 3 1 政保公営企業	4,000,000	4,139,740	
	8 4 2 政保公営企業	5,000,000	5,226,035	
	い 6 8 6 利付農林債	30,000,000	30,735,510	
	い 6 8 8 利付商工債	100,000,000	101,494,000	
	2 成田国際空港	100,000,000	102,222,500	
	1 公営企業	100,000,000	102,228,800	
	4 国際協力銀行	100,000,000	102,419,700	
	1 3 首都高速道路	100,000,000	101,909,500	
	2 6 公営企業	100,000,000	102,773,300	
特殊債券 合計		1,496,000,000	1,528,028,561	
社債券	4 みずほコーポレート	100,000,000	101,489,200	
	1 2 三菱ＵＦＪファイナンス	100,000,000	100,970,500	
	1 6 ソニー	100,000,000	100,404,400	
	2 1 東京瓦斯	100,000,000	102,074,400	
	2 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,719,600	
	4 1 三菱電機	100,000,000	101,064,100	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,308,631	
	3 7 8 東北電力	100,000,000	117,289,400	
	3 9 0 東北電力	130,000,000	135,144,750	
	4 8 2 東京電力	100,000,000	101,918,700	
	5 1 3 東京電力	57,000,000	59,445,585	
	5 1 6 東京電力	17,000,000	17,326,468	
	8 ゴールドマン サックス	100,000,000	95,474,500	
社債券 合計		1,107,000,000	1,136,630,234	
合計		11,050,300,000	11,281,571,995	

第２ 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年6月5日現在	平成21年6月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	184,272,236	134,535,893
コール・ローン	239,579,644	69,284,830
株式	38,303,847,558	38,637,941,300
投資証券	559,188,688	427,571,778
派生商品評価勘定	11,733,246	79,823,235
未収入金	-	108,260,260
未収配当金	87,144,055	131,353,147
差入委託証拠金	172,907,668	164,120,496
流動資産合計	39,558,673,095	39,752,890,939
資産合計	39,558,673,095	39,752,890,939
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	695,772	-
未払金	75,160,820	-
未払解約金	125,058,000	108,899,000
その他未払費用	-	55,389
流動負債合計	200,914,592	108,954,389
負債合計	200,914,592	108,954,389
純資産の部		
元本等		
元本 1	30,808,672,404	50,561,223,631
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ） 2	8,549,086,099	10,917,287,081
元本等合計	39,357,758,503	39,643,936,550
純資産合計	39,357,758,503	39,643,936,550
負債純資産合計	39,558,673,095	39,752,890,939

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	(1)株式 同左 (2)投資証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分		平成20年6月5日現在	平成21年6月5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	14,978,362,016円	30,808,672,404円
	同期中における追加設定元本額	18,466,040,170円	25,956,993,314円
	同期中における一部解約元本額	2,635,729,782円	6,204,442,087円
	同期末における元本の内訳 ファンド名		
	ダイワ外国株式インデックスV A	1,736,819,706円	1,825,634,080円
	ダイワ国内重視バランスファンド 3 0 V A（一般投資家私募）	85,837,312円	139,917,994円
	ダイワ国内重視バランスファンド 5 0 V A（一般投資家私募）	1,370,194,511円	1,888,495,135円
	ダイワ国際分散バランスファンド 3 0 V A（一般投資家私募）	161,687,932円	249,225,404円

ダイワ国際分散バランスファンド 5 0 V A（一般投資家私募）	4,042,184,146円	5,982,787,046円
D Cダイワ外国株式インデックス	6,512,051,735円	9,437,925,872円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	365,399,452円	535,445,531円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	187,331円	6,181,105円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	241,964円	5,851,212円
大和D C海外株式インデックス ファンド	997,210,601円	1,147,659,082円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2020	154,044円	3,481,202円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	252,781円	1,174,974円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	248,600円	381,816円
ダイワ世界分散バランスファンド 1 5 V A	107,799,388円	168,413,914円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	1,397,027,007円	2,379,276,845円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	34,382,327円	48,857,957円
ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A	285,275,163円	501,358,081円
ダイワ世界バランスファンド4 0 V A	7,510,263,039円	7,764,580,427円
ダイワ世界バランスファンド6 0 V A	1,313,945,969円	1,758,523,713円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	3,208,903,578円	14,519,374,128円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	1,596,306,299円	2,059,911,632円
ダイワライフスタイル2 5	11,056,624円	23,274,084円
ダイワライフスタイル5 0	35,889,823円	62,081,104円
ダイワライフスタイル7 5	35,353,072円	51,411,293円
計	30,808,672,404円	50,561,223,631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	30,808,672,404口	50,561,223,631口

3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,917,287,081円であります。
------------	--	--

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年6月5日現在		平成21年6月5日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	38,303,847,558	2,296,683,335	38,637,941,300	2,623,385,226
投資証券	559,188,688	26,507,959	427,571,778	4,686,327
合計	38,863,036,246	2,323,191,294	39,065,513,078	2,618,698,899

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年12月1日から平成20年6月5日まで、及び平成20年12月2日から平成21年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 取引の内容	同左	
	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。	
2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、信託約款に従って為替予約取引を利用しております。	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金、配当金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

1. 株式関連

種 類	平成20年6月5日 現在				平成21年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	424,642,302	-	435,679,776	11,037,474	465,572,715	-	545,395,950	79,823,235

合計	424,642,302	-	435,679,776	11,037,474	465,572,715	-	545,395,950	79,823,235

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成20年6月5日現在	平成21年6月5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)	1.2775円 (12,775円)	0.7841円 (7,841円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,000	184.260	184,260.000	
	AVON PRODUCTS	9,700	26.720	259,184.000	
	ABBOTT LABS	38,500	44.750	1,722,875.000	
	ALCOA	21,100	10.690	225,559.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,500	10.180	45,810.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	5,500	33.730	185,515.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	4,229	20.250	85,637.250	

ALLEGHENY ENERGY INC	4,300	25.290	108,747.000	
AFLAC INC	11,900	34.290	408,051.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,500	35.040	122,640.000	
HANSEN NATURAL CORPORATIO	1,700	36.550	62,135.000	
ADOBE SYSTEMS	14,100	29.440	415,104.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,500	79.460	119,190.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	15.940	165,776.000	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	86.670	156,006.000	
ASSOCIATED BANC-CORP	3,900	14.370	56,043.000	
GARMIN LTD	3,900	23.290	90,831.000	
AETNA INC	10,100	25.520	257,752.000	
DST SYSTEMS INC	800	38.580	30,864.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	4,700	68.320	321,104.000	
ALTERA CORPORATION	9,400	16.820	158,108.000	
FORTUNE BRANDS INC	4,900	36.620	179,438.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL	17,800	35.480	631,544.000	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	14.130	60,066.630	
WR BERKLEY CORP	4,700	23.130	108,711.000	
AUTOZONE INC	1,200	158.400	190,080.000	
DOLLAR TREE INC	2,500	44.290	110,725.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,400	28.140	95,676.000	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	3,000	40.360	121,080.000	
CELANESE CORP-SERIES A	5,400	21.190	114,426.000	
D.R.HORTON INC	7,366	9.410	69,314.060	
WYETH	33,100	44.220	1,463,682.000	
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	4,600	29.730	136,758.000	
AUTODESK INC	7,100	22.190	157,549.000	
MOODY'S CORP	5,500	28.870	158,785.000	
DEVON ENERGY CORPORATION	10,700	65.450	700,315.000	
CONSOL ENERGY INC	5,600	41.460	232,176.000	
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	24.280	77,696.000	
CITIGROUP INC	138,533	3.570	494,562.810	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,300	38.130	468,999.000	
AMERICAN ELEC POWER	10,800	26.380	284,904.000	
DUN&BRADSTREET CORP	1,700	83.080	141,236.000	
HESS CORP	7,700	59.660	459,382.000	
COVIDIEN LTD	12,425	35.650	442,951.250	
DAVITA INC	2,800	47.120	131,936.000	

DANAHER CORP	6,900	62.950	434,355.000
AVNET INC	5,200	22.220	115,544.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,600	119.740	191,584.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,300	28.380	434,214.000
PEABODY ENERGY CORP	6,700	35.310	236,577.000
BUNGE LIMITED	3,400	65.390	222,326.000
TYCO ELECTRONICS LTD	10,325	20.390	210,526.750
APPLE INC	21,600	143.740	3,104,784.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	12,800	9.440	120,832.000
BOEING CO	17,100	50.570	864,747.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,515	24.100	84,711.500
MEADWESTVACO CORP	4,800	17.140	82,272.000
SPECTRA ENERGY CORP	14,696	16.490	242,337.040
BECTON DICKINSON & CO	6,400	67.520	432,128.000
SAIC INC	5,100	18.700	95,370.000
BURLINGTON NORTHERN SANTA	8,900	77.020	685,478.000
BJ SERVICES CO	9,800	15.700	153,860.000
NISOURCE INC	9,100	10.980	99,918.000
JOY GLOBAL INC	3,600	38.360	138,096.000
BMC SOFTWARE INC	5,800	35.320	204,856.000
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	52.190	229,636.000
BARD(C.R.) INC	2,600	74.550	193,830.000
BLACK & DECKER CORP	1,900	32.000	60,800.000
BANK OF NEW YORK MELLON	29,271	28.870	845,053.770
VERIZON COMMUNICATIONS	71,000	29.570	2,099,470.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	280	2,933.000	821,240.000
H&R BLOCK INC	8,800	15.760	138,688.000
BB&T CORPORATION	14,800	22.260	329,448.000
BECKMAN COULTER INC	2,100	55.350	116,235.000
HOSPIRA INC	5,220	35.460	185,101.200
BROADCOM CORP-CL A	10,650	25.770	274,450.500
BAKER HUGHES INC	7,900	40.070	316,553.000
BRISTOL MYERS SQUIBB	47,700	19.980	953,046.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,200	54.060	64,872.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	13.270	94,721.260
JPMORGAN CHASE & CO	91,820	35.350	3,245,837.000
XTO ENERGY INC	12,466	41.590	518,460.940
LEGG MASON INC	3,550	23.470	83,318.500

PACTIV CORPORATION	3,300	21.810	71,973.000
T ROWE PRICE GROUP INC	5,300	42.770	226,681.000
CIGNA CORP	8,800	23.070	203,016.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,900	43.720	214,228.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,400	47.670	66,738.000
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,400	45.990	110,376.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,760	30.550	145,418.000
WHITE MOUNTAINS INSURANCE	200	214.620	42,924.000
CATERPILLAR INC DEL	15,100	38.020	574,102.000
PETROHAWK ENERGY CORP	6,500	25.110	163,215.000
FIRST AMERICAN CORPORATIO	2,200	22.410	49,302.000
AQUA AMERICA INC	3,900	16.510	64,389.000
CHARLES RIVER LABORATORIE	2,000	31.690	63,380.000
VIRGIN MEDIA INC	10,200	8.910	90,882.000
MOSAIC CO/THE	4,500	53.680	241,560.000
CORNING INC	39,900	15.630	623,637.000
CISCO SYSTEMS	146,400	19.670	2,879,688.000
DU PONT	22,000	28.710	631,620.000
MORGAN STANLEY	25,000	31.200	780,000.000
DOW CHEMICAL	20,300	17.970	364,791.000
DELL INC	40,800	12.100	493,680.000
ENSCO INTERNATIONAL INC	4,400	40.040	176,176.000
DTE ENERGY COMPANY	5,000	31.250	156,250.000
DEVRY INC	1,800	45.560	82,008.000
TELEPHONE AND DATA SYSTEM	1,500	31.750	47,625.000
AGCO CORP	2,800	30.400	85,120.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,500	32.070	465,015.000
DENBURY RESOURCES INC	5,300	16.950	89,835.000
DEERE & CO	11,200	46.420	519,904.000
QUANTA SERVICES INC	4,300	23.680	101,824.000
TIME WARNER INC	28,633	24.480	700,935.840
URBAN OUTFITTERS INC	3,000	21.700	65,100.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,000	22.230	66,690.000
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	4,950	14.970	74,101.500
CONSOLIDATED EDISON INC	7,500	35.540	266,550.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,200	31.940	70,268.000
NYSE EURONEXT	7,100	30.000	213,000.000
COLGATE PALMOLIVE CO	12,300	71.320	877,236.000

AMETEK INC	2,500	33.990	84,975.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,000	50.790	101,580.000
COSTCO WHOLESALE CORP	11,300	47.870	540,931.000
SCANA CORP	2,700	30.700	82,890.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,200	22.080	114,816.000
CUMMINS INC	6,000	36.230	217,380.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,000	12.760	178,640.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	62.860	220,010.000
LORILLARD INC	4,500	68.840	309,780.000
PROGRESS ENERGY INC	7,500	35.670	267,525.000
CABOT OIL & GAS CORP	3,600	35.860	129,096.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	15.040	109,792.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,200	36.810	44,172.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,600	27.950	72,670.000
COCA COLA CO	51,400	49.760	2,557,664.000
COCA-COLA ENTERPRISES	7,600	17.580	133,608.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	33.800	192,660.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	5,400	35.750	193,050.000
FMC TECHNOLOGIES INC	4,000	42.900	171,600.000
FRANKLIN RESOURCES INC	3,800	73.290	278,502.000
CSX CORP	10,300	34.050	350,715.000
FLUOR CORP	5,300	51.670	273,851.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,900	61.590	178,611.000
EXPEDIA INC	6,950	16.560	115,092.000
AMAZON.COM INC	8,300	85.520	709,816.000
FLOWERVE CORP	1,500	79.540	119,310.000
EXXON MOBIL CORP	123,900	72.980	9,042,222.000
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	60.530	96,848.000
FLIR SYSTEMS INC	3,000	23.120	69,360.000
AES CORP	20,800	10.430	216,944.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,700	73.600	198,720.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,900	73.370	139,403.000
EOG RESOURCES INC	6,300	73.210	461,223.000
FTI CONSULTING INC	1,400	50.250	70,350.000
EQUITABLE RESOURCES INC	3,400	36.530	124,202.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,700	22.540	128,478.000
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	30.850	317,755.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,200	36.360	152,712.000

AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,490	20.040	190,179.600
FORD MOTOR CO	45,523	6.360	289,526.280
MACY'S INC	10,598	12.880	136,502.240
ARCH COAL INC	4,300	18.660	80,238.000
FOSTER WHEELER AG	4,600	27.890	128,294.000
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,840	22.280	107,835.200
FOREST LABORATORIES INC	9,000	23.820	214,380.000
LIBERTY GLOBAL INC	3,135	13.880	43,513.800
DISCOVERY COMMUNICATION-C	4,240	20.530	87,047.200
FPL GROUP INC	8,500	55.580	472,430.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	8,504	56.330	479,030.320
US BANCORP	40,700	18.750	763,125.000
FAMILY DOLLAR STORES	4,500	30.690	138,105.000
FASTENAL CO	2,700	34.650	93,555.000
FISERV INC	5,200	45.190	234,988.000
GENERAL ELECTRIC CO	265,800	13.750	3,654,750.000
EMBARQ CORP	3,046	43.500	132,501.000
GENZYME CORP-GENL DIVISIO	7,100	61.600	437,360.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,900	12.210	96,459.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,500	59.100	502,350.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,200	149.470	1,524,594.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	24.450	119,805.000
GOODRICH CORP	4,100	53.320	218,612.000
GOOGLE INC-CL A	5,800	440.280	2,553,624.000
GENERAL MILLS INC	8,900	51.970	462,533.000
FIRSTENERGY CORP	8,200	39.420	323,244.000
GENUINE PARTS CO	4,400	34.850	153,340.000
FIFTH THIRD BANCORP	12,500	7.000	87,500.000
HARRIS CORP	4,300	30.960	133,128.000
HARSCO CORP	3,000	30.710	92,130.000
HALLIBURTON CO	22,100	22.830	504,543.000
HOME DEPOT INC	40,900	24.570	1,004,913.000
ASSURANT INC	2,800	24.460	68,488.000
HERSHEY CO/THE	4,300	35.140	151,102.000
HARLEY-DAVIDSON INC	7,200	18.710	134,712.000
HUMANA INC	5,200	31.010	161,252.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,100	24.980	152,378.000
HELMERICH & PAYNE	3,300	34.770	114,741.000

WINDSTREAM CORP	11,500	8.430	96,945.000
HENRY SCHEIN INC	2,900	45.800	132,820.000
HEWLETT-PACKARD CO	60,400	36.090	2,179,836.000
DIRECTV GROUP INC/THE	13,800	22.160	305,808.000
HEINZ H J CO	6,800	36.560	248,608.000
INT'L BUSINESS MACHINES	33,100	106.330	3,519,523.000
INTERNATIONAL PAPER	9,700	14.630	141,911.000
ITT CORP	4,100	44.370	181,917.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,629	22.010	189,924.290
LEGGETT & PLATT INC	3,600	15.450	55,620.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,435	13.670	46,956.450
JUNIPER NETWORKS INC	14,200	24.130	342,646.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	43.000	133,300.000
JOHNSON & JOHNSON	67,200	55.840	3,752,448.000
HOLOGIC INC	8,800	13.560	119,328.000
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	52.650	552,825.000
KROGER CO	14,300	22.990	328,757.000
KLA-TENCOR CORPORATION	5,600	27.670	154,952.000
LOCKHEED MARTIN CORP	8,300	84.500	701,350.000
TIM HORTONS INC	5,783	26.490	153,191.670
LIMITED BRANDS	8,000	12.820	102,560.000
LOWE'S COS INC	35,600	20.090	715,204.000
ELI LILLY & CO	24,800	34.380	852,624.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	29,700	1.120	33,264.000
LAM RESEARCH CORP	3,200	27.000	86,400.000
RANGE RESOURCES CORP	3,900	46.230	180,297.000
LSI CORP	22,500	4.300	96,750.000
LOEWS CORP	8,500	28.150	239,275.000
LINCOLN NATIONAL CORP	6,449	19.180	123,691.820
MCDONALD'S CORP	27,800	60.240	1,674,672.000
3M CO	16,000	59.850	957,600.000
MANPOWER INC	2,700	43.960	118,692.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,300	30.750	224,475.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,100	82.820	91,102.000
MCAFEE INC	3,300	40.550	133,815.000
MURPHY OIL CORP	3,900	58.600	228,540.000
MATTEL INC	9,800	16.460	161,308.000
KBR INC	3,600	18.430	66,348.000

MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,800	30.910	117,458.000
MYLAN INC	8,200	13.580	111,356.000
METLIFE INC	19,100	32.030	611,773.000
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	16,600	11.340	188,244.000
MOTOROLA INC	56,800	6.380	362,384.000
MONSANTO CO	13,906	82.900	1,152,807.400
MCDERMOTT INTL INC	7,400	21.990	162,726.000
MIRANT CORP	3,800	16.500	62,700.000
ROCKWELL INTL CORP	3,600	32.780	118,008.000
MERCK & CO INC	51,100	26.580	1,358,238.000
MASCO CORP	12,100	11.060	133,826.000
M & T BANK CORP	2,000	49.670	99,340.000
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	11,436	44.820	512,561.520
MARSH & MCLENNAN COS	11,700	19.680	230,256.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,000	24.180	169,260.000
NETAPP INC	8,900	18.860	167,854.000
NIKE INC -CL B	9,400	57.540	540,876.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,100	40.440	408,444.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,600	22.130	101,798.000
NATIONAL SEMICONDUCTOR	7,700	13.990	107,723.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,400	48.180	404,712.000
NEWMONT MINIG CORP	11,300	47.440	536,072.000
MCKESSON CORP	7,300	40.620	296,526.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	50,900	44.430	2,261,487.000
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	5,600	20.170	112,952.000
NUCOR CORP	8,400	46.310	389,004.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,900	18.950	168,655.000
WESTERN UNION CO	15,546	17.120	266,147.520
NEWELL RUBBERMAID INC	5,900	11.510	67,909.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	20,800	68.620	1,427,296.000
OMNICARE INC	3,200	25.480	81,536.000
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	10.540	80,894.500
PAYCHEX INC	8,500	27.450	233,325.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	6,700	29.490	197,583.000
PATTERSON COS INC	2,100	20.540	43,134.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	37.990	144,362.000
ALTRIA GROUP INC	50,000	16.970	848,500.000
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	30.210	163,134.000

PG & E CORPORATION	9,800	37.520	367,696.000
PFIZER INC	168,860	14.640	2,472,110.400
XCEL ENERGY INC	11,600	17.500	203,000.000
STRYKER CORP	7,700	40.440	311,388.000
AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	2,400	45.580	109,392.000
PARKER HANNIFIN CORP	5,100	46.830	238,833.000
PALL CORP	4,000	26.670	106,680.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	27.660	88,512.000
PATTERSON-UTI ENERGY INC	4,200	14.590	61,278.000
PROCTER & GAMBLE CO	73,637	53.350	3,928,533.950
EXELON CORP	16,000	48.270	772,320.000
CONOCOPHILLIPS	35,800	45.970	1,645,726.000
PEPSICO INC	38,400	54.820	2,105,088.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	2,800	29.990	83,972.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,500	42.060	441,630.000
ACCENTURE LTD-CL A	13,800	30.200	416,760.000
QUESTAR CORP	4,600	33.600	154,560.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,600	26.100	120,060.000
PENTAIR INC	2,600	27.310	71,006.000
QUALCOMM INC	39,100	45.290	1,770,839.000
PARTNERRE LTD	1,200	66.640	79,968.000
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,900	20.480	59,392.000
INVESCO LTD	10,550	17.850	188,317.500
ADVANCE AUTO PARTS	3,250	44.560	144,820.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,300	21.570	179,031.000
MDU RESOURCES GROUP INC	3,800	19.000	72,200.000
ENERGEN CORP	1,500	38.610	57,915.000
RAYTHEON CO	10,500	45.020	472,710.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	3,100	28.730	89,063.000
RED HAT INC	5,200	20.030	104,156.000
REPUBLIC SERVICES INC	9,000	22.700	204,300.000
PRICELINE.COM INC	1,300	116.370	151,281.000
ROSS STORES INC	3,700	39.130	144,781.000
QUEST DIAGNOSTICS	4,400	52.910	232,804.000
ROBERT HALF INTL INC	3,200	22.080	70,656.000
REYNOLDS AMERICAN INC	4,700	39.530	185,791.000
POLO RALPH LAUREN CORP	1,400	56.860	79,604.000
PEPSI BOTTLING GROUP INC	7,000	33.320	233,240.000

ROWAN COS INC	3,300	22.530	74,349.000
QWEST COMMUNICATIONS INTL	42,200	4.190	176,818.000
ROCKWELL COLLINS INC.	4,900	47.690	233,681.000
REGIONS FINANCIAL CORP	18,335	4.080	74,806.800
SUNOCO INC	3,200	28.780	92,096.000
CHEVRON CORP	50,318	69.790	3,511,693.220
EDISON INTERNATIONAL	6,800	29.590	201,212.000
SCHERING PLOUGH CORP	36,300	24.160	877,008.000
SYMANTEC CORP	19,100	15.970	305,027.000
STANLEY WORKS/THE	1,800	35.910	64,638.000
SYNOPSIS INC	3,900	19.380	75,582.000
TRANSOCEAN LTD	8,422	82.020	690,772.440
SLM CORP	6,200	6.540	40,548.000
SANDISK CORP	5,700	15.810	90,117.000
SOUTHERN CO	20,200	28.730	580,346.000
SYSCO CORP	16,000	24.140	386,240.000
SMITH INTERNATIONAL INC	6,000	29.680	178,080.000
TRAVELERS COS INC	15,323	43.620	668,389.260
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,200	43.310	398,452.000
SPX CORP	1,400	48.670	68,138.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,400	16.690	56,746.000
STERICYCLE INC	2,200	50.440	110,968.000
SCHLUMBERGER LTD	30,000	58.310	1,749,300.000
SUPERVALU INC	5,173	17.080	88,354.840
AT&T INC	145,695	24.360	3,549,130.200
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	6.860	41,160.000
SIGMA-ALDRICH	3,300	48.830	161,139.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,700	53.800	145,260.000
SEMPRA ENERGY	6,300	46.490	292,887.000
TIFFANY & CO	3,100	30.220	93,682.000
SEAGATE TECHNOLOGY	16,300	8.930	145,559.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,100	20.080	584,328.000
SALESFORCE.COM INC	2,400	39.270	94,248.000
TIME WARNER CABLE	9,153	32.320	295,824.960
TYCO INTERNATIONAL LTD	10,325	28.340	292,610.500
UNION PACIFIC CORP	12,700	53.320	677,164.000
MARATHON OIL CORP	18,000	31.580	568,440.000
UNITED TECHNOLOGIES	21,200	55.130	1,168,756.000

UNITED PARCEL SERVICE-B	16,600	51.000	846,600.000	
SPRINT NEXTEL CORP	72,422	5.030	364,282.660	
UNUM GROUP	7,100	17.410	123,611.000	
AMEREN CORPORATION	5,800	24.170	140,186.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	30,226	27.270	824,263.020	
USX-US STEEL GRP	2,600	35.580	92,508.000	
VERISIGN INC	4,200	23.200	97,440.000	
VALERO ENERGY CORP	12,892	18.250	235,279.000	
WEYERHAEUSER CO	5,400	35.360	190,944.000	
WELLPOINT INC	11,800	48.030	566,754.000	
THE WALT DISNEY CO.	42,800	25.140	1,075,992.000	
WELLS FARGO & CO	93,072	25.100	2,336,107.200	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,500	28.310	70,775.000	
WASTE MANAGEMENT INC	12,200	28.490	347,578.000	
WILLIAMS COMPANY	12,400	17.300	214,520.000	
WHIRLPOOL CORP	1,900	43.860	83,334.000	
WAL-MART STORES	58,600	50.870	2,980,982.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	6,200	44.150	273,730.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	17,700	20.850	369,045.000	
WYNN RESORTS LTD	1,900	40.600	77,140.000	
XEROX CORP	20,000	7.250	145,000.000	
TJX COMPANIES INC	9,000	30.450	274,050.000	
WATERS CORP	2,500	47.000	117,500.000	
WHOLE FOODS MARKET INC	3,300	21.430	70,719.000	
WASHINGTON POST -CL B	140	354.150	49,581.000	
WALGREEN CO	25,800	30.930	797,994.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	4,700	27.220	127,934.000	
WESTERN DIGITAL CORP	5,700	23.970	136,629.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	3,500	40.540	141,890.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,500	32.820	443,070.000	
VISA INC-CLASS A SHS	11,700	69.520	813,384.000	
PPL CORPORATION	10,100	33.260	335,926.000	
PITNEY BOWES INC	6,300	22.440	141,372.000	
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	13.290	85,056.000	
PULTE HOMES INC	5,700	8.540	48,678.000	
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	46.000	188,600.000	
PPG INDUSTRIES INC	4,300	45.000	193,500.000	
NORTHERN TRUST CORP	5,500	57.160	314,380.000	

PRECISION CASTPARTS CORP	3,400	85.300	290,020.000	
NVIDIA CORP	13,250	10.890	144,292.500	
PNC FINANCIAL SERVICES	10,593	43.700	462,914.100	
LIBERTY MEDIA-INTERACTI A	13,450	6.030	81,103.500	
LIBERTY MEDIA CORP-ENT A	13,680	23.400	320,112.000	
TERADATA CORP	4,700	23.100	108,570.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,400	13.640	100,936.000	
NII HOLDINGS INC	5,300	19.740	104,622.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	39.340	405,202.000	
NRG ENERGY INC	4,600	22.370	102,902.000	
TORCHMARK CORP	2,100	40.140	84,294.000	
SUNPOWER CORP-CLASS A	700	29.940	20,958.000	
SUNPOWER CORP-CLASS B	1,000	26.600	26,600.000	
TEXTRON INC	6,000	12.270	73,620.000	
NEWS CORP-CL A	49,350	10.260	506,331.000	
NEWS CORP-CLASS B	12,100	11.610	140,481.000	
OMNICOM GROUP	6,800	32.010	217,668.000	
ORACLE CORPORATION	101,583	20.610	2,093,625.630	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,200	168.400	370,480.000	
ONEOK INC	2,200	29.610	65,142.000	
ROPER INDUSTRIES INC	2,200	46.760	102,872.000	
CEPHALON INC	1,900	59.030	112,157.000	
YUM! BRANDS INC	12,400	35.810	444,044.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,500	42.860	64,290.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	3,300	46.190	152,427.000	
NOBLE ENERGY INC	4,400	63.400	278,960.000	
BANK OF AMERICA CORP	177,001	11.870	2,101,001.870	
NORDSTROM INC	4,500	21.230	95,535.000	
AMERICAN EXPRESS CO	27,200	25.250	686,800.000	
ANALOG DEVICES	7,800	24.560	191,568.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	20,927	4.650	97,310.550	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	18.400	119,600.000	
AMERICAN INTL GROUP	39,450	1.640	64,698.000	
ANADARKO PETROLEUM CORP	11,800	48.570	573,126.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	2,900	15.210	44,109.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	13.100	161,130.000	
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,700	36.050	133,385.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	27.990	83,970.000	

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,300	26.810	195,713.000	
EMERSON ELECTRIC CO	16,900	34.570	584,233.000	
AON CORP	6,100	36.060	219,966.000	
AMGEN	26,500	51.010	1,351,765.000	
ALLERGAN INC	7,900	45.270	357,633.000	
COACH INC	9,000	26.940	242,460.000	
EATON CORP	4,600	47.880	220,248.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	6,800	22.880	155,584.000	
CELGENE CORP	11,100	45.110	500,721.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	4,300	12.420	53,406.000	
APPLIED MATERIALS INC	34,300	11.540	395,822.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,800	33.870	94,836.000	
CME GROUP INC	1,600	336.710	538,736.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	10,644	39.180	417,031.920	
ECOLAB INC	5,900	37.600	221,840.000	
EQUIFAX INC	3,800	26.960	102,448.000	
GAP INC	13,600	16.940	230,384.000	
GILEAD SCIENCES INC	22,700	44.920	1,019,684.000	
MARSHALL & ILSLEY CORP	7,399	6.660	49,277.340	
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	17.990	78,256.500	
ST JUDE MEDICAL INC	9,300	40.400	375,720.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,748	23.080	155,743.840	
HORMEL FOODS CORP	2,200	35.100	77,220.000	
SAFEWAY INC	11,400	20.730	236,322.000	
STATE STREET CORP	11,543	48.950	565,029.850	
STAPLES INC	19,200	20.500	393,600.000	
SUNTRUST BANKS INC	8,848	16.510	146,080.480	
CHARLES SCHWAB	22,300	18.460	411,658.000	
BAXTER INTL INC	15,900	47.380	753,342.000	
CONSTELLATION ENERGY	5,600	27.220	152,432.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	28.790	172,740.000	
CHUBB CORP	8,300	41.550	344,865.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,500	29.810	283,195.000	
FEDEX CORP	7,700	57.000	438,900.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	8,554	25.000	213,850.000	
FLEXTRONICS INTL LTD	24,600	4.150	102,090.000	
CERNER CORP	1,800	57.160	102,888.000	
CITRIX SYSTEMS INC	4,700	32.100	150,870.000	

INTEL CORP	139,300	16.130	2,246,909.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	5,300	30.940	163,982.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	16,600	5.400	89,640.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	7,400	14.930	110,482.000	
IRON MOUNTAIN INC	5,050	28.410	143,470.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,900	36.610	399,049.000	
ILLUMINA INC	2,800	38.840	108,752.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,800	23.390	369,562.000	
SUN MICROSYSTEMS INC	18,225	9.140	166,576.500	
SEALED AIR CORP	3,000	20.260	60,780.000	
ITT EDUCATIONAL SERVICES	1,000	92.040	92,040.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	900	155.500	139,950.000	
SARA LEE CORP	18,700	9.140	170,918.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	7,500	18.520	138,900.000	
COVANCE INC	1,700	45.440	77,248.000	
CARMAX INC	7,700	12.450	95,865.000	
COMERICA INC	4,900	22.580	110,642.000	
DUKE ENERGY CORP	33,392	14.070	469,825.440	
TARGET CORP	18,700	40.950	765,765.000	
DOVER CORP	4,500	35.310	158,895.000	
RR DONNELLEY & SONS CO	7,200	13.930	100,296.000	
WW GRAINGER INC	2,000	83.370	166,740.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	4,000	44.160	176,640.000	
JOHNSON CONTROLS INC	14,500	21.510	311,895.000	
CINTAS CORP	4,600	22.760	104,696.000	
CA INC	11,005	17.750	195,338.750	
CONAGRA INC	12,900	19.610	252,969.000	
CLOROX COMPANY	3,600	52.840	190,224.000	
ENTERGY CORP	4,900	74.440	364,756.000	
MICROSOFT CORP	199,600	21.830	4,357,268.000	
IMS HEALTH INC	4,500	12.010	54,045.000	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,200	39.260	164,892.000	
CVS CAREMARK CORP	34,174	30.350	1,037,180.900	
MEDTRONIC INC	26,900	34.120	917,828.000	
MILLIPORE CORP	1,900	65.250	123,975.000	
MICRON TECH	16,900	5.500	92,950.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	600	165.150	99,090.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	10.020	107,214.000	

HASBRO INC	2,900	25.650	74,385.000
KELLOGG CO	6,100	44.040	268,644.000
KEYCORP	12,800	5.500	70,400.000
KRAFT FOODS INC-A	36,511	27.040	987,257.440
KOHL'S CORP	6,400	45.850	293,440.000
SEARS HOLDING CORP	1,925	69.330	133,460.250
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	7,000	10.730	75,110.000
APACHE CORP	7,610	83.280	633,760.800
ACE LTD	9,000	46.070	414,630.000
ARROW ELECTRONICS INC	2,600	23.550	61,230.000
ALLSTATE	14,200	25.800	366,360.000
EBAY INC	28,900	18.000	520,200.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,900	45.030	85,557.000
XILINX INC	7,200	21.160	152,352.000
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	5,900	62.290	367,511.000
DISH NETWORK CORP	5,400	15.980	86,292.000
YAHOO! INC	34,700	16.670	578,449.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	2,600	33.960	88,296.000
TOLL BROTHERS INC	3,400	17.800	60,520.000
LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,900	23.660	163,254.000
NOBLE CORP	7,000	36.280	253,960.000
PROGRESSIVE CORP	16,800	16.640	279,552.000
PRAXAIR INC	7,900	76.010	600,479.000
PACCAR INC	8,837	34.590	305,671.830
PETSMART INC	3,700	21.010	77,737.000
EL PASO CORPORATION	15,100	9.750	147,225.000
EMC CORP/MASS	51,900	12.840	666,396.000
PRIDE INTERNATIONAL INC	5,600	25.530	142,968.000
BIOGEN IDEC INC	6,530	53.150	347,069.500
INTL GAME TECHNOLOGY	9,300	17.020	158,286.000
DEAN FOODS CO	4,200	18.480	77,616.000
STARBUCKS CORP	18,700	15.170	283,679.000
PERRIGO CO	2,200	26.420	58,124.000
NORTHEAST UTILITIES	4,700	21.040	98,888.000
INTUIT INC	7,700	27.630	212,751.000
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	2,600	35.350	91,910.000
BEST BUY COMPANY INC	9,200	37.030	340,676.000
BALL CORP	3,100	43.910	136,121.000

	BOSTON SCIENTIFIC CORP	35,847	9.400	336,961.800	
	BED BATH & BEYOND INC	6,700	29.640	198,588.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,100	23.130	210,483.000	
	VULCAN MATERIALS CO	2,800	46.260	129,528.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	3,800	30.400	115,520.000	
	VF CORP	2,400	59.640	143,136.000	
	CBS CORP-CL B	14,171	8.920	126,405.320	
	VIACOM INC-CLASS B	11,971	22.750	272,340.250	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	39.580	75,202.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,500	36.750	128,625.000	
	CARNIVAL CORP	11,900	25.990	309,281.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	2,700	28.000	75,600.000	
	COMCAST CORP -CL A	47,970	14.470	694,125.900	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	19,400	13.660	265,004.000	
アメリカ・ドル 小計		株 7,429,944		アメリカ・ドル 215,904,621.820 (20,867,181,699)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	KAZAKHMYS PLC	5,900	6.620	39,058.000	
	BP PLC	490,400	5.235	2,567,244.000	
	UNILEVER PLC	34,860	15.070	525,340.200	
	DRAX GROUP PLC	9,200	4.770	43,884.000	
	BARCLAYS PLC	206,300	2.660	548,758.000	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	49,600	3.230	160,208.000	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	2.495	40,169.500	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	41,900	2.872	120,336.800	
	REXAM PLC	13,500	3.037	40,999.500	
	PRUDENTIAL PLC	65,100	4.430	288,393.000	
	LONMIN PLC	3,200	14.100	45,120.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	422,815	0.372	157,287.180	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,400	12.270	78,528.000	
	BAE SYSTEMS PLC	94,100	3.350	315,235.000	
	AVIVA PLC	71,500	3.467	247,890.500	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	8,400	6.360	53,424.000	
	CAIRN ENERGY PLC	4,400	25.590	112,596.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	132,302	10.320	1,365,356.640	
	THOMSON REUTERS PLC	4,804	17.050	81,908.200	

CABLE & WIRELESS	64,000	1.280	81,920.000
REED ELSEVIER PLC	29,046	4.792	139,188.430
BG GROUP PLC	85,900	11.230	964,657.000
DIAGEO PLC	65,800	8.460	556,668.000
RIO TINTO PLC-REG	27,500	27.200	748,000.000
BRITISH AIRWAYS PLC	21,300	1.494	31,822.200
STANDARD CHARTERED PLC	44,300	12.420	550,206.000
TESCO PLC	209,000	3.608	754,072.000
LADBROKES PLC	16,835	2.015	33,922.520
SMITH & NEPHEW PLC	23,600	4.747	112,029.200
SMITHS GROUP PLC	10,333	7.230	74,707.590
PEARSON PLC	21,563	6.315	136,170.340
SAINSBURY (J) PLC	25,125	3.220	80,902.500
NEXT PLC	5,200	15.370	79,924.000
WHITBREAD PLC	6,111	9.150	55,915.650
TOMKINS PLC	31,700	1.497	47,454.900
CADBURY PLC	37,556	5.445	204,492.420
BUNZL PLC	11,555	5.115	59,103.820
VODAFONE GROUP PLC	1,341,737	1.125	1,509,454.120
BALFOUR BEATTY PLC	17,400	3.367	58,585.800
KINGFISHER PLC	66,411	1.966	130,564.020
WPP PLC	27,800	4.292	119,317.600
UNITED UTILITIES GROUP PL	21,727	5.315	115,479.000
SEVERN TRENT PLC	7,533	11.260	84,821.580
RECKITT BENCKISER PLC	16,200	26.880	435,456.000
SCHRODERS PLC	3,900	8.450	32,955.000
INTERNATIONAL POWER PLC	47,600	2.547	121,237.200
AMEC PLC	11,200	6.905	77,336.000
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	23,500	11.500	270,250.000
ASTRAZENECA PLC	35,600	25.110	893,916.000
WOLSELEY PLC	2,190	10.650	23,323.500
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	178,500	0.637	113,704.500
3I GROUP PLC	13,691	2.250	30,804.750
3I GROUP PLC-NPR	17,602	0.872	15,348.940
BRITISH SKY BROADCASTING	29,600	4.527	133,999.200
SAGE GROUP PLC (THE)	38,600	1.833	70,753.800
NATIONAL GRID PLC	62,528	5.590	349,531.520
LLOYDS BANKING GROUP PLC	297,665	0.671	199,733.210

RSA INSURANCE GROUP PLC	88,900	1.234	109,702.600	
IMPERIAL TOBACCO GROUP	25,300	16.160	408,848.000	
CENTRICA PLC	120,460	2.292	276,094.320	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-U	2,500	8.800	22,000.000	
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	49,760	16.880	839,948.800	
ICAP PLC	15,100	4.302	64,960.200	
SABMILLER PLC	24,700	12.680	313,196.000	
BHP BILLITON PLC	56,277	14.560	819,393.120	
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	7.440	73,656.000	
HSBC HOLDINGS PLC	399,200	5.312	2,120,550.400	
SHIRE PLC	14,600	8.800	128,480.000	
OLD MUTUAL PLC	131,400	0.735	96,579.000	
ANGLO AMERICAN PLC	35,983	17.520	630,422.160	
MORRISON SUPERMARKETS	63,100	2.540	160,274.000	
CARNIVAL PLC	4,461	16.590	74,007.990	
AUTONOMY CORP PLC	5,900	14.030	82,777.000	
FIRSTGROUP PLC	12,800	3.762	48,153.600	
COMPASS GROUP PLC	49,200	3.462	170,330.400	
FRIENDS PROVIDENT PLC	64,500	0.698	45,021.000	
BT GROUP PLC	199,600	0.918	183,232.800	
MAN GROUP PLC	47,925	2.475	118,614.370	
XSTRATA PLC	30,500	7.035	214,567.500	
BURBERRY GROUP PLC	15,389	4.052	62,356.220	
INTERCONTINENTAL HOTELS	6,700	6.605	44,253.500	
CAPITA GROUP PLC	19,290	7.360	141,974.400	
SERCO GROUP PLC	13,500	4.090	55,215.000	
TULLOW OIL PLC	19,700	9.765	192,370.500	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,600	15.260	54,936.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	7.715	33,552.530	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	91,500	16.840	1,540,860.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	69,381	16.910	1,173,232.710	
G4S PLC	32,600	2.122	69,177.200	
COBHAM PLC	38,200	1.787	68,263.400	
ADMIRAL GROUP PLC	4,800	8.695	41,736.000	
INVESTEC PLC	12,500	3.557	44,462.500	
CARPHONE WAREHOUSE GROUP	15,300	1.725	26,392.500	
ANTOFAGASTA PLC	13,900	6.195	86,110.500	
STANDARD LIFE PLC	57,900	1.869	108,215.100	

	EXPERIAN PLC	27,154	4.730	128,438.420	
	HOME RETAIL GROUP	29,454	2.520	74,224.080	
イギリス・ボンド 小計		株 6,605,472		イギリス・ボンド 27,276,044.650 (4,255,062,965)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LTD	86,200	35.110	3,026,482.000	
	LEND LEASE	12,900	7.600	98,040.000	
	ALUMINA LTD	37,600	1.375	51,700.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	11,500	43.200	496,800.000	
	OZ MINERALS LTD	60,579	0.870	52,703.730	
	FORTESCUE METALS GROUP	30,900	2.800	86,520.000	
	CSR LIMITED	41,700	1.670	69,639.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	6,300	6.300	39,690.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	46,000	22.210	1,021,660.000	
	WESTPAC BANKING	77,298	19.140	1,479,483.720	
	SANTOS LIMITED	17,100	14.470	247,437.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	51,400	16.840	865,576.000	
	RIO TINTO LTD	7,500	66.900	501,750.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	25,900	15.110	391,349.000	
	AMCOR	24,100	5.020	120,982.000	
	METCASH LTD	23,500	4.300	101,050.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	56,500	5.090	287,585.000	
	NEWCREST MINING	13,700	33.370	457,169.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.610	119,016.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	34,400	36.790	1,265,576.000	
	ORICA LIMITED	9,200	21.020	193,384.000	
	QBE INSURANCE	28,300	18.900	534,870.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,000	24.710	98,840.000	
	WOOLWORTHS	32,300	26.630	860,149.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	13,300	8.750	116,375.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	7.310	149,855.000	
	CROWN LTD	16,900	7.630	128,947.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	29,700	2.150	63,855.000	
	TELSTRA CORPORATION	103,700	3.280	340,136.000	
	AMP LIMITED	49,300	4.910	242,063.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES N	15,900	4.430	70,437.000	

		MACQUARIE GROUP LIMITED	8,800	36.200	318,560.000	
		ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,100	3.770	41,847.000	
		FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	1.225	95,182.500	
		CSL LIMITED	14,000	30.010	420,140.000	
		ONESTEEL LIMITED	44,700	2.770	123,819.000	
		WESFARMERS LIMITED	27,400	21.660	593,484.000	
		WESFARMERS LTD-PPS	4,400	21.600	95,040.000	
		COCHLEAR LIMITED	1,300	57.000	74,100.000	
		BLUESCOPE STEEL LTD	46,000	2.640	121,440.000	
		SUNCORP-METWAY LIMITED	30,200	6.250	188,750.000	
		BORAL LIMITED	13,000	4.340	56,420.000	
		ASX LTD	4,100	36.650	150,265.000	
		COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	9.000	125,100.000	
		MACQUARIE INFRASTRUCTURE	68,000	1.380	93,840.000	
		INSURANCE AUSTRALIA GROUP	52,300	3.570	186,711.000	
		SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	11.800	119,180.000	
		TRANSURBAN GROUP	33,300	4.190	139,527.000	
		TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	6.960	130,848.000	
		SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	22.860	123,444.000	
		AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	22,800	3.890	88,692.000	
		WORLEYPARSONS LTD	3,300	22.550	74,415.000	
		PERPETUAL LTD	1,300	29.590	38,467.000	
		TATTS GROUP LTD	36,900	2.560	94,464.000	
		AGL ENERGY LTD	14,500	13.960	202,420.000	
		BRAMBLES LTD	38,700	5.930	229,491.000	
オーストラリア・ドル 小計			株 1,635,777		オーストラリア・ドル 17,504,765.950 (1,357,494,599)	
カナダ・ドル			株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		IMPERIAL OIL LTD	7,900	44.530	351,787.000	
		SINO-FOREST CORPORATION	3,400	13.600	46,240.000	
		SILVER WHEATON CORP	8,200	11.950	97,990.000	
		INTACT FINANCIAL CORP	2,800	34.350	96,180.000	
		BCE INC	8,330	24.840	206,917.200	
		ADDAX PETROLEUM CORP	3,000	35.730	107,190.000	
		SUNCOR ENERGY INC	23,500	37.500	881,250.000	
		METRO INC-A	2,500	35.350	88,375.000	
		SHERRITT INTERNATIONAL CO	6,200	4.830	29,946.000	

NATIONAL BANK OF CANADA	4,800	52.020	249,696.000
GROUPE AEROPLAN INC	7,200	7.530	54,216.000
BANK OF NOVA SCOTIA	24,300	39.760	966,168.000
CANADIAN IMPERIAL BANK	10,200	55.040	561,408.000
TORONTO-DOMINION BANK	19,400	57.440	1,114,336.000
GREAT-WEST LIFE CO INC	8,100	22.300	180,630.000
ROYAL BANK OF CANADA	35,100	44.840	1,573,884.000
PROGRESS ENERGY RESOURCES	4,300	10.860	46,698.000
TRANSCANADA CORP	14,900	33.400	497,660.000
BOMBARDIER INC 'B'	44,500	3.500	155,750.000
BARRICK GOLD CORP	22,200	41.300	916,860.000
CAE INC	9,200	7.160	65,872.000
THOMSON REUTERS CORP	7,000	34.170	239,190.000
POTASH CORP OF SASKATCHEW	8,400	125.000	1,050,000.000
INMET MINING CRP	1,600	47.150	75,440.000
PETRO-CANADA	15,100	47.150	711,965.000
LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	34.770	121,695.000
CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	36.090	90,225.000
ROGERS COMMUNICATIONS-B	14,100	32.490	458,109.000
AGNICO-EAGLE MINES	4,700	66.330	311,751.000
KINROSS GOLD CORP	19,100	21.880	417,908.000
BANK OF MONTREAL	14,600	45.210	660,066.000
POWER CORP OF CANADA	9,300	26.000	241,800.000
CAMECO CORP	10,500	30.130	316,365.000
TELUS CORP	900	32.750	29,475.000
POWER FINANCIAL CORP	7,400	26.110	193,214.000
TECK RESOURCES LIMITED-B	12,100	19.000	229,900.000
NEXEN INC	11,100	27.700	307,470.000
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,500	51.000	127,500.000
TALISMAN ENERGY INC	26,800	17.220	461,496.000
IVANHOE MINES LTD	9,100	5.970	54,327.000
AGRIUM INC	4,000	51.500	206,000.000
CANADIAN NATURAL RESOURCE	14,700	63.740	936,978.000
GERDAU AMERISTEEL CORP	3,400	7.680	26,112.000
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	400	277.630	111,052.000
MAGNA INTERNATIONAL INC-A	3,600	38.320	137,952.000
TRANSALTA CORP	5,000	20.000	100,000.000
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	60.030	84,042.000

PAN AMERICAN SILVER CORP	1,700	25.600	43,520.000	
RESEARCH IN MOTION	13,600	90.040	1,224,544.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	13,700	30.080	412,096.000	
ENBRIDGE INC	10,600	39.300	416,580.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	12,400	19.920	247,008.000	
BROOKFIELD PROPERTIES COR	6,550	8.440	55,282.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	37,300	23.850	889,605.000	
BIOVAIL CORPORATION	5,200	13.000	67,600.000	
GOLDCORP INC	18,559	41.390	768,157.010	
ENCANA CORP	18,900	60.410	1,141,749.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,500	45.590	205,155.000	
IAMGOLD CORPORATION	8,500	11.620	98,770.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	17.580	59,772.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,400	48.060	547,884.000	
CGI GROUP INC - CL A	8,300	10.200	84,660.000	
HUSKY ENERGY INC	8,200	33.650	275,930.000	
ONEX CORPORATION	3,500	22.000	77,000.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,600	18.720	198,432.000	
TELUS CORPORATION-NON VOT	4,400	31.450	138,380.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	6,100	16.550	100,955.000	
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,500	44.500	244,750.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	41.000	184,500.000	
ELDORADO GOLD CORPORATION	12,400	10.550	130,820.000	
IGM FINANCIAL INC	2,800	39.920	111,776.000	
TMX GROUP INC	2,700	33.680	90,936.000	
SAPUTO INC	4,800	21.600	103,680.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LT	2,100	51.500	108,150.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	12.780	60,066.000	
ENSIGN ENERGY SERVICES IN	4,400	17.340	76,296.000	
TRICAN WELL SERVICE LTD	4,500	10.060	45,270.000	
YAMANA GOLD INC	22,600	12.400	280,240.000	
FORTIS INC	5,800	24.190	140,302.000	
NIKO RESOURCES LTD	1,200	76.300	91,560.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	2,500	24.650	61,625.000	
カナダ・ドル 小計	株 770,739		カナダ・ドル 24,772,135.210 (2,178,461,570)	

シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	30,000	14.940	448,200.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	12.600	604,800.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	12.320	202,910.400	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	3.990	131,670.000	
	KEPPEL CORP	43,000	7.080	304,440.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	3.520	68,288.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	9.710	165,070.000	
	CAPITALAND LIMITED	51,000	3.840	195,840.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.230	158,270.000	
	O.C.B.C.	75,000	7.200	540,000.000	
	SINGAPORE TELECOM	236,450	2.930	692,798.500	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	2.410	115,680.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	3.080	110,880.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	114,400	0.460	52,624.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	7.700	207,900.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	20,000	1.430	28,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	24,000	4.710	113,040.000	
シンガポール・ドル 小計		株 887,720		シンガポール・ドル 4,141,010.900 (276,826,579)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,950	47.000	185,650.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	17,400	142.100	2,472,540.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	24,205.000	96,820.000	
	ABB LTD	57,750	17.770	1,026,217.500	
	ARYZTA AG	2,300	32.100	73,830.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	93,250	39.900	3,720,675.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,250	63.400	79,250.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	26,300	49.760	1,308,688.000	
	JULIUS BAER HOLDING AG	5,900	45.620	269,158.000	
	SGS SA	150	1,400.000	210,000.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	950	185.500	176,225.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	3,332	202.300	674,063.600	
	BALOISE HOLDING -R	1,600	87.450	139,920.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	55,200	42.820	2,363,664.000	
	SWISS RE-REG	9,300	37.200	345,960.000	

	CIE FINANC RICHEMONT-A	14,550	23.740	345,417.000	
	UBS AG-REGISTERED	71,400	15.520	1,108,128.000	
	SWISSCOM AG-REG	670	316.000	211,720.000	
	GEBERIT AG-REG	1,000	132.100	132,100.000	
	GIVAUDAN REG	190	715.000	135,850.000	
	ACTELION LTD-REG	2,700	55.800	150,660.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	200	205.400	41,080.000	
	SYNGENTA AG	2,612	263.750	688,915.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,250	81.850	102,312.500	
	LOGITECH INTL-REG	4,650	16.320	75,888.000	
	SYNTHES INC	1,750	108.400	189,700.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,350	113.400	153,090.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	37.700	56,550.000	
	HOLCIM LTD-REG	5,550	58.750	326,062.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	98.050	93,147.500	
	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	3,350	25.740	86,229.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,750	87.150	152,512.500	
スイス・フラン 小計		株 394,058		スイス・フラン 17,192,023.100 (1,555,534,250)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ERICSSON LM-B SHS	74,780	69.200	5,174,776.000	
	VOLVO AB-B SHS	32,800	48.600	1,594,080.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,000	463.000	926,000.000	
	S.K.F. AB-B SHS	11,400	94.250	1,074,450.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	98.000	627,200.000	
	NORDEA AB	70,100	59.400	4,163,940.000	
	SCANIA AB-B SHS	7,700	76.250	587,125.000	
	SWEDISH MATCH AB	7,650	123.500	944,775.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	74.000	662,300.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	100.000	620,000.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	24,700	29.500	728,650.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	12,050	138.500	1,668,925.000	
	SWEDBANK AB	11,150	38.900	433,735.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	13,700	362.000	4,959,400.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	17,050	84.250	1,436,462.500	
	SKANSKA AB-B	9,000	82.750	744,750.000	

	SANDVIK AB	30,500	64.000	1,952,000.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	118.000	1,451,400.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,050	78.000	1,407,900.000	
	VOLVO AB-A SHS	13,900	48.100	668,590.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	63.000	579,600.000	
	TELIASONERA AB	54,000	38.100	2,057,400.000	
	ALFA LAVAL AB	9,000	74.000	666,000.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,700	69.500	952,150.000	
	ASSA ABLOY AB-B	7,600	100.500	763,800.000	
	SSAB AB-A SHARES	6,100	104.250	635,925.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,000	65.500	327,500.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,100	44.000	356,400.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 503,080		スウェーデン・クローナ 38,165,233.500 (483,171,855)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,500	279.500	3,214,250.000	
	DANSKE BANK A/S	12,300	91.750	1,128,525.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	32,600.000	619,400.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,950	378.000	1,493,100.000	
	CARLSBERG AS-B	1,700	338.500	575,450.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,600	425.500	680,800.000	
	COLOPLAST-B	550	369.500	203,225.000	
	DSV A/S	5,600	67.000	375,200.000	
	TOPDANMARK A/S	350	643.000	225,050.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	525	282.500	148,312.500	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	25	33,200.000	830,000.000	
デンマーク・クローネ 小計		株 38,119		デンマーク・クローネ 9,493,312.500 (174,771,882)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	TELECOM CORP OF NZ	58,589	2.560	149,987.840	
	FLETCHER BUILDING LTD	16,800	6.990	117,432.000	
ニュージーランド・ドル 小計		株 75,389		ニュージーランド・ドル 267,419.840 (16,363,420)	

ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	21,750	34.650	753,637.500	
	DNB NOR ASA	20,200	54.000	1,090,800.000	
	ORKLA ASA	16,550	50.200	830,810.000	
	TELENOR ASA	26,500	52.800	1,399,200.000	
	STATOILHYDRO ASA	30,973	134.600	4,168,965.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,110	207.500	1,060,325.000	
	SEADRILL LTD	9,650	92.400	891,660.000	
ノルウェー・クローネ 小計	RENEWABLE ENERGY CORP AS	3,900	65.800	256,620.000	
		株 134,633		ノルウェー・クローネ 10,452,018.300 (160,647,521)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	18,400	41.920	771,328.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	13,650	47.250	644,962.500	
	COMMERZBANK AG	21,600	5.580	120,528.000	
	VOLKSWAGEN AG	2,450	247.010	605,174.500	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,050	52.310	159,545.500	
	TUI AG	4,950	6.295	31,160.250	
	M.A.N.	2,950	45.120	133,104.000	
	SIEMENS AG	21,100	53.560	1,130,116.000	
	E.ON AG	46,200	24.830	1,147,146.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	7,700	27.090	208,593.000	
	GEA GROUP AG	3,400	11.400	38,760.000	
	BASF SE	23,350	31.300	730,855.000	
	LINDE	3,900	60.290	235,131.000	
	K+S AG	4,200	52.730	221,466.000	
	ALLIANZ SE-REG	11,700	70.330	822,861.000	
	THYSSENKRUPP AG	9,850	20.270	199,659.500	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,850	22.510	109,173.500	
	R.W.E. AG	10,700	58.900	630,230.000	
	LUFTHANSA	6,750	9.915	66,926.250	
	FRAPORT AG	1,100	29.560	32,516.000	
	FRESENIUS SE	850	33.570	28,534.500	
	HOCHTIEF AG	900	34.890	31,401.000	
	SAP AG	21,542	30.285	652,399.470	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	5,200	97.940	509,288.000	

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	2,350	47.060	110,591.000
BEIERSDORF AG	2,600	34.640	90,064.000
CELESIO AG	2,800	16.550	46,340.000
MERCK KGAA	1,750	68.600	120,050.000
ADIDAS-SALOMON AG	4,520	25.930	117,203.600
FRESENIUS SE-PFD	1,900	40.660	77,254.000
PUMA AG	230	166.110	38,205.300
HENKEL KGAA	3,750	19.500	73,125.000
METRO AG	3,450	35.830	123,613.500
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	72,800	8.045	585,676.000
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,200	30.940	160,888.000
DAIMLER AG	22,750	27.355	622,326.250
QIAGEN N.V.	5,100	12.520	63,852.000
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	25.880	47,878.000
DEUTSCHE POST AG	23,350	10.100	235,835.000
DEUTSCHE BOERSE AG	5,150	61.960	319,094.000
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	50.850	58,477.500
DEUTSCHE POSTBANK AG	2,400	16.370	39,288.000
SALZGITTER AG	1,050	67.470	70,843.500
SOLARWORLD AG	2,250	21.850	49,162.500
WACKER CHEMIE AG	400	90.510	36,204.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	26,426	13.960	368,906.960
ARCELORMITTAL	22,100	23.980	529,958.000
UNILEVER NV-CVA	43,050	17.510	753,805.500
HEINEKEN NV	7,200	25.315	182,268.000
REED ELSEVIER NV	18,927	8.201	155,220.320
AEGON NV	39,644	4.695	186,128.580
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	28,960	8.464	245,117.440
AKZO NOBEL	5,800	33.055	191,719.000
KONINKLIJKE DSM NV	3,450	25.140	86,733.000
WOLTERS KLUWER	7,250	13.590	98,527.500
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	1,250	17.205	21,506.250
ING GROEP N.V.	52,850	7.539	398,436.150
KONINKLIJKE KPN NV	41,550	9.185	381,636.750
ASML HOLDING NV	11,288	14.840	167,513.920
TNT NV	10,045	14.550	146,154.750
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	21.650	61,702.500
SBM OFFSHORE NV	3,807	12.135	46,197.940

FUGRO NV-CVA	1,550	31.310	48,530.500
TOTAL SA	54,150	41.190	2,230,438.500
MICHELIN (CGDE) - B	3,900	43.500	169,650.000
AIR LIQUIDE	6,338	65.650	416,089.700
PPR	2,350	60.675	142,586.250
SCHNEIDER ELECTRIC SA	5,150	53.255	274,263.250
BOUYGUES	6,950	27.910	193,974.500
LAFARGE SA	3,150	49.030	154,444.500
BNP PARIBAS	20,300	47.555	965,366.500
PEUGEOT SA	4,900	22.165	108,608.500
NATIXIS	34,600	1.521	52,626.600
THALES SA	2,250	32.520	73,170.000
GROUPE DANONE	11,550	32.500	375,375.000
DANONE-RTS	11,550	1.840	21,252.000
CARREFOUR	16,950	32.230	546,298.500
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	6,975	12.450	86,838.750
VIVENDI SA	29,000	18.850	546,650.000
L'OREAL	6,500	55.290	359,385.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	7,500	26.490	198,675.000
ALCATEL-LUCENT	63,600	1.867	118,741.200
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,350	50.660	68,391.000
CASINO GUICHARD PERRACH-R	1,350	2.520	3,402.000
PERNOD-RICARD	4,910	43.975	215,917.250
EURAZEO	750	33.590	25,192.500
SOCIETE GENERALE-A	12,400	43.410	538,284.000
LVMH	6,650	59.630	396,539.500
ACCOR SA	6,000	30.650	183,900.000
CAP GEMINI SA	4,400	26.400	116,160.000
PUBLICIS GROUPE	4,700	21.810	102,507.000
VALLOUREC	1,250	94.715	118,393.750
BUREAU VERITAS SA	850	37.000	31,450.000
EIFPAGE	1,300	43.780	56,914.000
SODEXO	2,650	35.530	94,154.500
ESSILOR INTERNATIONAL	5,450	33.430	182,193.500
AXA	38,350	14.350	550,322.500
TELEVISION FRANCAISE	4,200	8.592	36,086.400
CHRISTIAN DIOR	1,550	55.070	85,358.500
LAGARDERE S.C.A.	3,800	23.870	90,706.000

TECHNIP S.A.	3,350	36.785	123,229.750
RENAULT	4,000	29.470	117,880.000
HERMES INTERNATIONAL	1,850	95.250	176,212.500
ERAMET	200	201.500	40,300.000
STMICROELECTRONICS NV	21,650	5.364	116,130.600
ATOS ORIGIN	2,000	24.445	48,890.000
DASSAULT SYSTEMS SA	2,150	31.620	67,983.000
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	13.510	62,821.500
FRANCE TELECOM SA	46,650	16.110	751,531.500
ALSTOM	5,500	47.080	258,940.000
CNP ASSURANCES	1,000	69.430	69,430.000
AIR FRANCE-KLM	4,000	10.895	43,580.000
NEOPOST SA	1,000	59.990	59,990.000
SANOFI-AVENTIS	26,325	46.420	1,222,006.500
VINCI	10,800	33.675	363,690.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	8,650	11.655	100,815.750
VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,750	21.690	189,787.500
CREDIT AGRICOLE SA	23,250	10.640	247,380.000
GDF SUEZ	27,523	27.400	754,130.200
IMERYS SA	650	31.845	20,699.250
PAGESJAUNES GROUPE SA	3,550	8.813	31,286.150
ELECTRICITE DE FRANCE	5,150	35.720	183,958.000
SES	7,950	13.680	108,756.000
SAFRAN SA	4,300	9.098	39,121.400
ADP	950	54.000	51,300.000
SCOR SE	5,900	15.120	89,208.000
UCB SA	3,350	23.005	77,066.750
KBC GROUPE	4,600	14.410	66,286.000
COLRUYT SA	500	166.945	83,472.500
DELHAIZE GROUP	2,400	50.410	120,984.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,450	55.000	134,750.000
SOLVAY SA	1,750	62.950	110,162.500
UMICORE	4,250	16.630	70,677.500
DEXIA	17,350	5.500	95,425.000
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	19,500	24.640	480,480.000
FORTIS	42,400	2.629	111,469.600
BELGACOM SA	4,900	21.750	106,575.000
MOBISTAR SA	1,050	43.450	45,622.500

FONDIARIA-SAI SPA	2,500	12.620	31,550.000
BANCO POPOLARE SCARL	18,150	5.525	100,278.750
FIAT SPA	21,950	7.700	169,015.000
PARMALAT SPA	38,950	1.761	68,590.950
PRYSMIAN SPA	2,550	10.380	26,469.000
ASSICURAZIONI GENERALI	27,234	15.780	429,752.520
SAIPEM	8,150	18.630	151,834.500
MEDIOBANCA SPA	16,300	8.540	139,202.000
TENARIS SA	13,000	10.930	142,090.000
UNICREDIT SPA	368,399	1.973	726,851.220
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO	20,700	0.888	18,381.600
ALLEANZA ASSICURAZIONI	10,400	5.150	53,560.000
TELECOM ITALIA SPA	268,382	0.955	256,304.810
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.684	116,929.800
ITALCEMENTI SPA	2,200	8.165	17,963.000
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	2.070	44,194.500
INTESA SANPAOLO	202,547	2.490	504,342.030
ATLANTIA SPA	8,300	15.050	124,915.000
BANCA POPOLARE DI MILANO	13,850	4.627	64,083.950
ENI SPA	65,850	17.500	1,152,375.000
MEDIASET SPA	18,200	4.162	75,748.400
A2A SPA	42,800	1.357	58,079.600
FINMECCANICA SPA	11,225	9.970	111,913.250
MONTE DEI PASCHI SIENA	77,300	1.190	91,987.000
ENEL SPA	108,500	3.600	390,600.000
ENEL AXA	108,500	0.423	45,895.500
SNAM RETE GAS	24,000	3.047	73,128.000
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	14.810	55,537.500
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	13,750	9.895	136,056.250
LOTTOMATICA SPA	2,100	14.940	31,374.000
TERNA SPA	39,000	2.550	99,450.000
PIRELLI & C.	84,100	0.283	23,800.300
TELEFONICA S.A.	109,127	15.220	1,660,912.940
BANCO POPULAR ESPANOL	23,600	6.190	146,084.000
BANCO BILIBAO VIZCAYA	89,012	8.480	754,821.760
ACERINOX SA	4,900	13.230	64,827.000
IBERDROLA SA	81,100	6.060	491,466.000
IBERDROLA RENOVABLES SA	23,400	3.400	79,560.000

BANCO DE SABADELL SA	22,250	4.570	101,682.500
BANKINTER SA	8,850	8.740	77,349.000
REPSOL YPF SA	19,200	16.180	310,656.000
GRIFOLS SA	3,700	12.600	46,620.000
BANCO SANTANDER SA	210,350	7.570	1,592,349.500
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	6,400	13.640	87,296.000
GAS NATURAL SDG SA	3,550	12.410	44,055.500
MAPFRE SA	17,100	2.470	42,237.000
CRITERIA CAIXACORP SA	24,750	3.160	78,210.000
ZARDOYA OTIS SA	3,700	15.750	58,275.000
BANCO DE VALENCIA SA	5,800	6.830	39,614.000
SACYR VALLEHERMOSO SA	1,650	10.640	17,556.000
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	28.030	36,439.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,726	37.210	175,854.460
ACCIONA SA	750	91.750	68,812.500
INDRA SISTEMAS SA	2,400	15.270	36,648.000
GRUPO FERROVIAL	1,400	23.440	32,816.000
INDITEX	5,700	32.030	182,571.000
GAMESA CORP TECNOLOGICA	4,950	14.580	72,171.000
ENAGAS	4,300	13.180	56,674.000
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	32.920	100,406.000
GESTEVISION TELECINCO SA	3,500	7.300	25,550.000
CINTRA CONCESIONES DE INF	5,550	4.520	25,086.000
UPM-KYMMENE OYJ	15,450	6.720	103,824.000
NOKIA OYJ	97,350	10.860	1,057,221.000
WARTSILA OYJ	2,350	25.180	59,173.000
RAUTARUUKKI OYJ	1,900	15.800	30,020.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	14,250	4.240	60,420.000
METSO OYJ	4,450	13.410	59,674.500
ELISA OYJ-A SHARES	3,550	10.500	37,275.000
SAMPO OYJ-A SHS	11,800	13.550	159,890.000
FORTUM OYJ	11,850	17.210	203,938.500
KESKO OYJ-B SHS	1,950	20.030	39,058.500
KONE OYJ-B	4,250	21.650	92,012.500
OUTOKUMPU OYJ	2,700	13.440	36,288.000
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	13.060	49,628.000
NESTE OIL OYJ	4,300	10.840	46,612.000
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	1,700	35.510	60,367.000

	OMV AG	5,450	27.630	150,583.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	5,950	19.060	113,407.000	
	TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	10.680	117,480.000	
	VOESTALPINE AG	2,450	20.650	50,592.500	
	RAIFFEISEN INTL BANK HOLD	1,900	27.710	52,649.000	
	MARFIN INVESTMENT GROUP S	17,100	3.600	61,560.000	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	18,600	6.343	117,979.800	
	BRISA	7,950	5.180	41,181.000	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	2.800	151,340.000	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES	75,750	0.760	57,570.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	5,900	11.130	65,667.000	
	EDP RENOVAVEIS SA	7,700	7.220	55,594.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	12.200	92,720.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	10,713	19.200	205,689.600	
	ELAN CORPORATION PLC	6,500	5.580	36,270.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,600	16.350	75,210.000	
	CRH PLC	18,400	17.520	322,368.000	
	PUBLIC POWER CORP	2,400	16.500	39,600.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,500	3.870	29,025.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	1,300	20.100	26,130.000	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	15.300	73,440.000	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	8,828	8.290	73,184.120	
	OPAP SA	6,100	20.500	125,050.000	
	PIRAEUS BANK S.A.	6,791	7.490	50,864.590	
	ALPHA BANK A.E.	8,051	8.450	68,030.950	
ユーロ 小計		株 4,500,995		ユーロ 49,576,669.930 (6,797,457,214)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONGKONG ELECTRIC	32,500	41.600	1,352,000.000	
	MTR CORP	42,500	25.200	1,071,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	37,000	99.300	3,674,100.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	24.300	510,300.000	
	SINO LAND	60,000	14.340	860,400.000	
	CHEUNG KONG	36,000	94.450	3,400,200.000	
	WHARF HOLDINGS	36,000	32.050	1,153,800.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	75.950	1,519,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	47,000	51.150	2,404,050.000	

	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	10.580	433,780.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	63,300	57.050	3,611,265.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	47.350	1,704,600.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	35.500	887,500.000	
	HK & CHINA GAS	109,960	16.040	1,763,758.400	
	HANG SENG BANK	20,200	117.000	2,363,400.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	64,000	15.660	1,002,240.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	59,000	3.330	196,470.000	
	WING HANG BANK LIMITED	4,500	70.600	317,700.000	
	HONG KONG EX & CL	26,900	127.300	3,424,370.000	
	LI & FUNG LTD	65,000	23.400	1,521,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	25.700	1,619,100.000	
	NWS HOLDINGS LTD	23,000	17.360	399,280.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	35.900	807,750.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	27.450	1,401,048.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	5.280	295,680.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	13.120	551,040.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	100,500	14.280	1,435,140.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	33,400	48.400	1,616,560.000	
香港・ドル 小計	株	1,238,300		香港・ドル 41,296,531.400 (514,967,746)	
合計	株	24,214,226		38,637,941,300 [38,637,941,300]	

[次へ](#)

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,947.000	127,840.020	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	5,937.000	324,100.830	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,000.000	159,030.000	
		VORNADO REALTY TRUST	3,456.000	173,525.760	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,900.000	172,431.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	11,250.000	109,012.500	
		KIMCO REALTY CORP	7,100.000	89,602.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	5,100.000	180,489.000	
		VENTAS INC	3,700.000	118,992.000	
		AMB PROPERTY CORP	2,400.000	48,384.000	
		DUKE REALTY CORP	5,200.000	51,584.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000.000	109,940.000	
		HEALTH CARE REIT INC	2,500.000	89,700.000	
		HCP INC	7,200.000	172,656.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	2,500.000	61,950.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	14,300.000	213,499.000	
		PROLOGIS	6,600.000	59,994.000	
		PUBLIC STORAGE	3,100.000	211,172.000	
		REGENCY CENTERS CORP	1,700.000	63,529.000	
	アメリカ・ドル 小計		95,890.000	アメリカ・ドル 2,537,431.110 (245,242,717)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
		LAND SECURITIES PLC	20,000.000	96,700.000	
		SEGRO	9,507.000	2,395.760	
		HAMMERSON PLC	20,400.000	61,812.000	
		BRITISH LAND CO PLC	16,100.000	61,019.000	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC		8,600.000	36,120.000	
	イギリス・ポンド 小計		74,607.000	イギリス・ポンド 258,046.760 (40,255,294)	
	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200.000	84,736.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	97,300.000	71,029.000	
		GPT GROUP	205,500.000	115,080.000	
		MIRVAC GROUP	43,800.000	58,254.000	
		STOCKLAND	41,600.000	133,952.000	
		WESTFIELD GROUP	46,396.000	549,792.600	
	オーストラリア・ドル 小計		485,796.000	オーストラリア・ドル 1,012,843.600 (78,546,022)	
	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITAMALL TRUST	39,000.000	56,940.000	
	シンガポール・ドル 小計		39,000.000	シンガポール・ドル 56,940.000 (3,806,439)	

	ユーロ			ユーロ	
		CORIO NV	1,250.000	40,756.250	
		ICADE	600.000	36,600.000	
		UNIBAIL-RODAMCO	2,150.000	239,402.500	
		KLEPIERRE	1,950.000	36,406.500	
	ユーロ 小計		5,950.000	ユーロ 353,165.250 (48,422,488)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	56,000.000	906,080.000	
香港・ドル 小計		56,000.000	香港・ドル 906,080.000 (11,298,818)		
投資証券 合計			427,571,778 [427,571,778]		
合計			427,571,778 [427,571,778]		

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 553銘柄 投資証券 19銘柄	98.8%	1.2%	54.0%
イギリス・ポンド	株式 97銘柄 投資証券 5銘柄	99.1%	0.9%	11.0%
オーストラリア・ドル	株式 56銘柄 投資証券 6銘柄	94.5%	5.5%	3.7%
カナダ・ドル	株式 81銘柄	100%	-%	5.6%
シンガポール・ドル	株式 17銘柄 投資証券 1銘柄	98.6%	1.4%	0.7%
スイス・フラン	株式 32銘柄	100%	-%	4.0%
スウェーデン・クローナ	株式 28銘柄	100%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.4%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 239銘柄 投資証券 4銘柄	99.3%	0.7%	17.5%
香港・ドル	株式 28銘柄 投資証券 1銘柄	97.9%	2.1%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成20年6月5日現在 金 額（円）	平成21年6月5日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,355,761,225	64,502,253
コール・ローン	1,648,270,886	1,093,953,722
国債証券	74,262,743,884	92,580,737,887
派生商品評価勘定	1,582,819	9,056,882
未収利息	1,062,819,098	1,274,271,980
前払費用	219,771,467	120,140,338
流動資産合計	78,550,949,379	95,142,663,062
資産合計	78,550,949,379	95,142,663,062
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,308,059	96,213
未払金	1,275,558,907	-
未払解約金	10,000,000	9,000,000
流動負債合計	1,292,866,966	9,096,213
負債合計	1,292,866,966	9,096,213
純資産の部		
元本等		
元本	1 36,568,278,437	49,199,465,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	40,689,803,976	45,934,101,536
元本等合計	77,258,082,413	95,133,566,849
純資産合計	77,258,082,413	95,133,566,849
負債純資産合計	78,550,949,379	95,142,663,062

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分		平成20年6月5日現在	平成21年6月5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	20,578,948,601円	36,568,278,437円
	同期中における追加設定元本額	17,425,816,965円	18,326,125,160円
	同期中における一部解約元本額	1,436,487,129円	5,694,938,284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	3,383,774,479円	3,611,906,985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）	99,133,471円	101,447,195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）	833,503,704円	745,935,929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）	231,147,053円	227,332,124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）	2,423,701,183円	2,081,324,444円
	D C ダイワ外国債券インデックス	15,411,033,407円	19,274,497,140円
	ダイワ・ライフ・バランス30	317,639,891円	307,421,429円
	ダイワ・ライフ・バランス50	54,974円	1,212,583円

ダイワ・ライフ・バランス 7 0	55,842円	907,060円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 安定コース）	26,554,524円	44,341,875円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 6 分散コース）	32,969,960円	38,389,959円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 成長コース）	6,457,230円	7,264,561円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2020	146,958円	2,054,345円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	77,229円	263,804円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	23,435円	23,419円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	5,377,021,764円	3,583,489,811円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	403,071,319円	347,818,359円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	3,922,232,673円	11,137,980,114円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	688,635,445円	2,352,432,612円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 7 5 V A	625,069,347円	2,064,944,904円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	2,743,979,856円	3,221,864,643円
ダイワライフスタイル 2 5	13,320,537円	16,087,038円
ダイワライフスタイル 5 0	21,586,627円	23,776,154円
ダイワライフスタイル 7 5	7,087,529円	6,748,826円
計	36,568,278,437円	49,199,465,313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	36,568,278,437口	49,199,465,313口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成20年6月5日現在		平成21年6月5日現在	
	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	貸借対照表計上額 （円）	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	74,262,743,884	1,335,950,869	92,580,737,887	1,930,989,733
合計	74,262,743,884	1,335,950,869	92,580,737,887	1,930,989,733

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成19年12月1日から平成20年6月5日まで、及び平成20年12月2日から平成21年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の状況に関する事項

区 分	自 平成19年6月6日 至 平成20年6月5日	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左

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

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成20年6月5日 現在				平成21年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年 超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,628,875,100	-	1,623,149,860	5,725,240	1,133,796,065	-	1,142,756,734	8,960,669
アメリカ・ドル	439,259,320	-	439,565,760	306,440	390,689,593	-	393,146,780	2,457,187
イギリス・ポンド	132,787,991	-	131,802,600	985,391	43,488,143	-	43,814,164	326,021
カナダ・ドル	44,545,411	-	43,710,760	834,651	40,098,737	-	40,271,940	173,203
スイス・フラン	13,288,702	-	13,326,720	38,018	10,924,943	-	11,038,560	113,617
スウェーデン・クローナ	14,236,375	-	14,173,920	62,455	8,535,571	-	8,513,450	22,121
デンマーク・クローネ	15,534,923	-	15,464,250	70,673	11,332,361	-	11,438,580	106,219
ポーランド・ズロチ	20,706,104	-	20,648,600	57,504	10,194,410	-	10,224,580	30,170
ユーロ	948,516,274	-	944,457,250	4,059,024	618,532,307	-	624,308,680	5,776,373
合計	1,628,875,100	-	1,623,149,860	5,725,240	1,133,796,065	-	1,142,756,734	8,960,669

(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20年6月5日現在	平成21年6月5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)	2.1127円 (21,127円)	1.9336円 (19,336円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,356,188.310	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,307,283.000	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	1,967,641.120	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,075,284.620	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,036,350.750	
		9.125% U.S. TREASURY BOND 20180515	608,000.000	860,411.200	
		9% U.S. TREASURY BOND 20181115	405,000.000	572,945.400	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,270,327.920	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,130,384.480	
		8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,026,090.430	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	1,942,446.600	
		7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,055,791.800	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	991,742.880	

8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	917,335.000	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,076,883.250	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	981,358.080	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20221115	348,000.000	458,813.640	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,029,782.060	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	1,966,396.460	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,056,475.420	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	929,806.410	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,038,415.170	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	999,341.100	
6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,432,404.050	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	776,519.100	
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	860,694.880	
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	934,432.200	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	2,750,835.960	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	906,812.070	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,017,870.700	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,613,691.980	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	797,098.380	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,650,492.570	
5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,463,840.880	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,238,359.480	
4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	1,875,700.300	
5% U.S. TREASURY BOND 20370515	791,000.000	841,790.110	
4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	448,000.000	432,351.360	
4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	2,729,590.160	
3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	2,815,262.240	
4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	2,557,864.890	
5.75% U.S. TREASURY NOTE 20100815	2,267,000.000	2,407,259.290	
5% U.S. TREASURY NOTE 20110215	2,359,000.000	2,527,998.760	
5% U.S. TREASURY NOTE 20110815	2,202,000.000	2,392,428.960	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	2,050,701.120	
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,428,057.400	

4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,864,861.720	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,647,807.300	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,870,158.680	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,850,714.810	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,304,178.850	
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,064,486.680	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,007,522.200	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,802,033.880	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,043,739.640	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,813,027.680	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	3,949,872.840	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20100615	1,737,000.000	1,792,966.140	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100715	866,000.000	897,964.060	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20100815	1,062,000.000	1,107,050.040	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,215,228.420	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20100915	1,279,000.000	1,332,449.410	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20101015	1,252,000.000	1,313,423.120	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20101115	1,534,000.000	1,617,649.020	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	1,991,368.360	
4.375% U.S. TREASURY NOTE 20101215	1,267,000.000	1,337,673.260	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20110115	1,088,000.000	1,149,493.760	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	1,975,494.620	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110228	2,199,000.000	2,338,064.760	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20110331	1,116,000.000	1,194,811.920	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	2,212,000.000	2,376,771.880	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,163,235.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	1,286,000.000	1,385,703.580	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	1,392,000.000	1,510,097.280	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110731	1,891,000.000	2,046,478.020	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,198,100.400	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20110831	1,160,000.000	1,251,025.200	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110930	1,261,000.000	1,358,967.090	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,244,691.000	

4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,532,901.440	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,271,314.800	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,130,786.250	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,352,654.000	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,209,908.980	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,497,182.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,088,551.070	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,793,665.500	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	1,925,263.150	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,273,517.140	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,431,906.620	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,202,861.000	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,613,320.430	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,279,312.990	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,143,236.160	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,156,968.540	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,775,037.660	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,055,930.000	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,342,126.950	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,366,246.580	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	3,814,392.010	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,545,285.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,926,987.300	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,492,287.200	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,015,500.000	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20100531	3,276,000.000	3,344,828.760	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,542,351.520	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20100630	3,278,000.000	3,360,703.940	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,423,328.600	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20100731	3,358,000.000	3,443,360.360	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,524,715.760	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,248,358.750	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20100831	3,511,000.000	3,588,873.980	

	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,592,950.000	
	2% U.S. TREASURY NOTE 20100930	3,716,000.000	3,784,337.240	
	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,715,906.410	
	1.5% U.S. TREASURY NOTE 20101031	2,711,000.000	2,742,962.690	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,210,839.400	
	1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,111,870.380	
	3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	4,420,000.000	4,428,619.000	
	1.25% U.S. TREASURY NOTE 20101130	3,334,000.000	3,361,972.260	
	2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,427,456.420	
	1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000	2,471,543.200	
	0.875% U.S. TREASURY NOTE 20101231	4,473,000.000	4,482,259.110	
	1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,018,336.840	
	1.125% U.S. TREASURY NOTE 20120115	2,825,000.000	2,814,067.250	
	0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110131	3,145,000.000	3,150,629.550	
	1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,375,054.500	
	1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120215	2,353,000.000	2,357,023.630	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	6,390,128.480	
	0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110228	5,199,000.000	5,203,055.220	
	1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,613,066.800	
	2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,116,440.950	
	1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120315	2,326,000.000	2,326,348.900	
	0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110331	2,783,000.000	2,784,725.460	
	1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,259,603.430	
	2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,328,298.530	
	1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120415	2,241,000.000	2,237,055.840	
	0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110430	2,945,000.000	2,943,144.650	
	1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,281,745.060	
	2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	1,919,079.060	
	1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120515	2,454,000.000	2,444,601.180	
	3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	3,246,000.000	3,087,757.500	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 278,464,000.000 (26,913,545,600)	アメリカ・ドル 295,261,207.240 (28,536,995,680)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	

9% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110712	440,000.000	508,596.000	
8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,200,357.200	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	718,688.000	
6.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20101125	479,000.000	516,266.200	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,022,308.600	
8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	2,029,000.000	2,826,397.000	
6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,254,676.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	2,827,000.000	2,737,949.500	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,644,727.200	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,910,000.000	2,122,583.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,782,827.400	
4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,454,884.100	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,033,403.900	
4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	2,884,350.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20100607	1,286,000.000	1,337,825.800	
4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,904,771.400	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,339,000.000	1,252,232.800	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20110307	1,775,000.000	1,868,720.000	
4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,623,252.500	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	1,926,210.600	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	2,420,000.000	2,366,518.000	
5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	1,204,000.000	1,308,146.000	
5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	2,425,000.000	2,681,565.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,757,319.300	
4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,428,990.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,161,687.500	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	524,000.000	488,996.800	
4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	1,915,732.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	1,798,000.000	1,864,526.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	125,000.000	117,050.000	
4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	119,000.000	116,858.000	
2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	125,000.000	121,062.500	
イギリス・ボンド 小計	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	

		49,569,000.000 (7,732,764,000)	52,949,478.300 (8,260,118,616)	
オーストラリア・ドル	6.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	オーストラリア・ドル 1,737,000.000	オーストラリア・ドル 1,861,907.670	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,413,000.000	1,478,817.540	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	1,656,000.000	1,635,300.000	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,315,000.000	1,373,701.600	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	672,000.000	612,655.680	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 6,793,000.000 (526,797,150)	オーストラリア・ドル 6,962,382.490 (539,932,762)	
カナダ・ドル	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	カナダ・ドル 424,000.000	カナダ・ドル 613,663.680	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	589,969.680	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	588,000.000	880,624.080	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,582,301.100	
	5.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	628,000.000	658,690.360	
	6% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	907,000.000	992,412.190	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,176,562.780	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	951,436.200	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,720,001.250	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	759,000.000	848,152.140	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,137,610.880	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100901	700,000.000	729,659.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,240,000.000	1,448,245.600	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,051,662.550	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	735,000.000	773,874.150	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	999,840.400	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	667,244.640	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20100601	280,000.000	288,890.000	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,584,061.060	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,434,215.390	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20101201	868,000.000	893,588.640	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,675,000.000	1,724,178.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,891,000.000	1,937,518.600	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	603,254.820	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	1,235,000.000	1,236,988.350	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	909,000.000	880,257.420	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	331,000.000	328,587.010	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 25,163,000.000 (2,212,834,220)	カナダ・ドル 27,733,489.970 (2,438,883,108)	
シンガポール・ドル	4.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20100701	シンガポール・ドル 404,000.000	シンガポール・ドル 422,535.520	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	509,119.020	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	376,470.710	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20110701	255,000.000	271,365.900	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	580,693.540	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	539,882.820	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	549,055.080	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	428,066.100	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20110201	379,000.000	395,842.760	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	335,196.800	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	223,000.000	235,472.390	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	486,000.000	496,026.180	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	109,821.920	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	346,091.720	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	326,277.120	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,539,000.000 (370,282,150)	シンガポール・ドル 5,921,917.580 (395,880,191)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	スイス・フラン 347,000.000	スイス・フラン 383,164.340	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	589,000.000	662,766.360	
	3.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20100807	1,549,000.000	1,602,486.970	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	406,000.000	458,751.580	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	837,000.000	953,066.790	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,621,000.000	1,682,598.000	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,390,000.000	1,470,467.100	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	500,000.000	522,870.000	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン 7,239,000.000 (654,984,720)	スイス・フラン 7,736,171.140 (699,968,765)	

スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	6,520,000.000	7,692,948.000	
	5.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20110315	4,765,000.000	5,089,973.000	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	5,435,000.000	6,017,142.850	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	3,635,000.000	3,901,554.550	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,086,241.000	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,146,555.000	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,246,104.500	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	7,980,000.000	8,322,980.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	4,042,911.600	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 47,990,000.000 (607,553,400)	スウェーデン・クローナ 50,546,410.900 (639,917,562)	
デンマーク・クローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,323,000.000	2,992,604.750	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	6,171,000.000	6,726,945.390	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,058,000.000	7,640,285.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20101115	5,314,000.000	5,474,748.500	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	5,529,000.000	5,672,145.810	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	5,381,000.000	5,443,150.550	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	10,067,397.560	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 41,665,000.000 (767,052,650)	デンマーク・クローネ 44,017,277.560 (810,358,080)	
ノルウェー・クローネ	6% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20110516	5,217,000.000	5,606,501.220	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,232,000.000	5,881,814.400	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,004,000.000	4,289,765.480	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	2,856,000.000	2,895,698.400	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 17,309,000.000 (266,039,330)	ノルウェー・クローネ 18,673,779.500 (287,015,991)	
ポーランド・ズロチ	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,306,672.510	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	2,385,000.000	2,416,982.850	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20101124	2,411,000.000	2,435,857.410	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,195,027.760	

	4.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20110524	2,185,000.000	2,131,380.100	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,698,203.400	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,619,838.830	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	1,624,000.000	1,594,573.120	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20100725	562,000.000	532,551.200	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	2,400,000.000	2,389,536.000	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,330,011.940	
	0% POLAND GOVERNMENT BOND 20110725	1,665,000.000	1,481,816.700	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 25,934,000.000 (788,912,280)	ポーランド・ズロチ 25,132,451.820 (764,529,184)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.756% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110428	1,822,000.000	1,863,650.920	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,624,800.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,267,609.760	
	3.833% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110928	2,582,000.000	2,644,200.380	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,576,000.000	1,661,151.280	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,110,909.040	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,040,317.040	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,376,475.600	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	998,019.050	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,532,000.000	1,291,001.080	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	567,739.580	
	2.509% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120827	327,000.000	318,972.150	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 17,660,000.000 (488,122,400)	マレーシア・リンギット 17,764,845.880 (491,020,340)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20140111	250,000.000	275,130.000	
	4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,251,405.660	
	5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,521,962.650	
	5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	631,267.860	
	4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,063,858.020	
	5.35% HELLENIC REPUBLIC 20110518	913,000.000	963,361.080	
	5.25% HELLENIC REPUBLIC 20120518	781,000.000	825,001.540	
	8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	470,389.110	

4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	647,744.280	
5.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20110223	352,000.000	377,006.080	
5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	405,790.600	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	932,185.590	
5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	798,101.750	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20130520	552,000.000	566,318.880	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110730	1,145,000.000	1,228,115.550	
6.5% HELLENIC REPUBLIC 20191022	823,000.000	890,535.380	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110928	842,000.000	900,788.440	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	518,554.740	
5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,340,813.520	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	722,904.000	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	365,792.000	
5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	1,026,314.290	
5.9% HELLENIC REPUBLIC 20221022	583,000.000	599,842.870	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	982,709.000	
4% IRISH TREASURY 20111111	735,000.000	755,800.500	
2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20100915	394,000.000	401,009.260	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,206,504.960	
5.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110615	580,000.000	616,267.400	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	892,142.100	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,152,335.290	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	391,426.190	
4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	626,776.840	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,882,020.800	
5.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20100928	1,498,000.000	1,581,049.120	
3.9% IRISH TREASURY 20120305	131,000.000	133,713.010	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	591,472.310	
5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,519,407.130	
3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	612,595.260	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,308,381.800	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	564,289.000	
3.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110415	492,000.000	504,541.080	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	199,000.000	198,771.150	
3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	296,273.950	

4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	911,109.200	
5.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20110104	513,000.000	542,610.360	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,820,673.580	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	369,312.480	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20370920	972,000.000	775,101.960	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	1,010,343.600	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	930,820.100	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,078,296.700	
4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	636,331.250	
4.5% HELLENIC REPUBLIC 20140520	639,000.000	646,846.920	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,650,341.250	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	674,011.580	
4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	565,319.560	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,111,917.100	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,295,366.000	
4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	442,068.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	895,693.980	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,159,029.250	
4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	668,310.660	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	815,994.480	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	756,000.000	777,901.320	
4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	260,000.000	263,304.600	
3.7% HELLENIC REPUBLIC 20150720	789,000.000	753,913.170	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,048,260.400	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20100730	1,690,000.000	1,728,363.000	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,401,975.270	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	649,000.000	676,082.770	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	933,000.000	832,375.950	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,638,155.620	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,495,531.730	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,813,735.440	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,832,037.350	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110328	1,390,000.000	1,434,660.700	

3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	831,000.000	786,300.510	
3.6% HELLENIC REPUBLIC 20160720	533,000.000	495,892.540	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,337,476.020	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	630,000.000	653,385.600	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,002,395.760	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,513,266.390	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,223,990.700	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	993,000.000	1,034,139.990	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	200,000.000	199,388.000	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	653,548.640	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,141,779.160	
3.9% HELLENIC REPUBLIC 20110820	755,000.000	775,422.750	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	756,629.120	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110430	1,310,000.000	1,367,967.500	
4.3% HELLENIC REPUBLIC 20170720	875,000.000	828,248.750	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	909,372.690	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,481,235.160	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20400920	811,000.000	647,129.340	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,321,531.520	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	333,000.000	297,911.790	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	708,000.000	715,993.320	
4.7% HELLENIC REPUBLIC 20240320	1,016,000.000	901,374.880	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20101101	1,859,000.000	1,960,371.270	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	513,932.210	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,866,000.000	1,951,761.360	
4.1% HELLENIC REPUBLIC 20120820	610,000.000	622,175.600	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	587,000.000	583,448.650	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,482,782.700	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120430	264,000.000	267,091.440	
3.8% HELLENIC REPUBLIC 20110320	464,000.000	475,808.800	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,051,000.000	1,045,461.230	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,547,142.790	
4.6% HELLENIC REPUBLIC 20180720	760,000.000	723,922.800	

4% HELLENIC REPUBLIC 20130820	765,000.000	765,849.150	
6.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110425	1,673,000.000	1,825,309.920	
5.5% HELLENIC REPUBLIC 20140820	1,194,000.000	1,251,347.820	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110801	1,816,000.000	1,935,274.880	
4.3% HELLENIC REPUBLIC 20120320	2,491,000.000	2,559,950.880	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,398,659.850	
6% HELLENIC REPUBLIC 20190719	1,330,000.000	1,370,152.700	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	1,895,738.460	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,207,960.720	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	896,948.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,243,593.280	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20101025	1,337,000.000	1,412,741.050	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,952,474.000	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20111025	1,324,000.000	1,421,578.800	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	1,892,000.000	2,065,212.600	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	3,048,071.080	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,141,231.400	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,009,000.000	2,158,590.140	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	1,899,787.610	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,883,417.560	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	1,908,000.000	1,880,486.640	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,786,156.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,125,485.960	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,794,249.800	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	1,990,614.780	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,605,959.650	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,616,888.340	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,855,182.980	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,896,065.420	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,499,045.900	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,284,821.630	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,600,919.690	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,606,682.800	

3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	1,847,000.000	1,810,392.460	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,534,171.410	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	1,752,000.000	1,676,716.560	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,302,010.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	3,264,000.000	2,967,759.360	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,211,647.880	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,271,000.000	1,249,710.750	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	1,935,348.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,284,220.470	
2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100615	1,551,000.000	1,574,978.460	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,473,000.000	1,506,775.890	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,171,261.520	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100712	2,473,000.000	2,509,946.620	
6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	335,595.470	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,514,444.080	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110112	2,492,000.000	2,554,399.680	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	2,252,000.000	2,042,046.040	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110712	2,680,000.000	2,781,706.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110315	1,337,000.000	1,375,652.670	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	2,225,000.000	2,203,172.750	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,533,919.780	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	1,089,000.000	1,163,977.650	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110915	1,569,000.000	1,622,832.390	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,867,680.220	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,271,906.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20100912	2,107,000.000	2,172,022.020	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	861,000.000	920,340.120	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	2,317,000.000	2,409,448.300	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,252,627.790	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20100801	2,049,000.000	2,122,579.590	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110912	1,016,000.000	1,010,879.360	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	1,997,795.520	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,572,715.800	

5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,788,667.360	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110201	1,954,000.000	2,016,742.940	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	2,010,661.690	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,879,808.100	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,762,437.600	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101008	1,611,000.000	1,637,210.970	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,524,000.000	1,588,739.520	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110408	1,727,000.000	1,789,690.100	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	3,213,000.000	3,214,124.550	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111014	2,029,000.000	2,114,786.120	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	2,615,000.000	2,641,359.200	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,921,576.800	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120301	1,954,000.000	1,978,385.920	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	1,219,000.000	1,300,136.640	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,700,818.720	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	1,991,517.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,164,893.060	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,345,307.510	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100611	1,814,000.000	1,879,811.920	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100910	2,350,000.000	2,431,709.500	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20101210	1,792,000.000	1,816,227.840	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110311	1,512,000.000	1,507,040.640	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	741,000.000	901,730.310	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,335,841.320	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	1,865,192.700	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,000,470.380	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	921,389.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,565,363.800	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20100704	1,741,000.000	1,816,315.660	
5.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110104	2,052,000.000	2,175,879.240	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	740,000.000	826,942.600	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	1,776,147.490	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110704	2,633,000.000	2,814,229.390	

5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,591,448.060	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110715	1,032,000.000	1,101,876.720	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,189,259.050	
4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	2,981,467.460	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,001,758.310	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,116,838.280	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,230,790.100	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,106,800.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,339,839.800	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,906,429.240	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,887,028.600	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,174,591.390	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,385,627.750	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,022,280.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20100715	1,017,000.000	1,064,819.340	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,559,672.900	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,738,478.780	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,240,367.900	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	832,016.680	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,272,989.470	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	769,392.940	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,215,284.600	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	1,862,278.500	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	756,336.940	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	1,953,526.890	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	640,189.560	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	428,000.000	455,122.360	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,020,021.500	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,718,099.720	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110115	1,172,000.000	1,218,727.640	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	1,757,000.000	1,737,866.270	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	732,000.000	737,709.600	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120115	1,766,000.000	1,789,081.620	

	4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,415,767.210	
	ユーロ 小計	ユーロ 343,670,000.000 (47,120,593,700)	ユーロ 355,306,816.480 (48,716,117,608)	
国債証券 合計		88,449,481,600 [88,449,481,600]	92,580,737,887 [92,580,737,887]	
合計		88,449,481,600 [88,449,481,600]	92,580,737,887 [92,580,737,887]	

[次へ](#)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 142銘柄	100%	30.8%
イギリス・ポンド	国債証券 32銘柄	100%	8.9%
オーストラリア・ドル	国債証券 5銘柄	100%	0.6%
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	100%	2.6%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 8銘柄	100%	0.8%
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	100%	0.7%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.8%
マレーシア・リンギット	国債証券 12銘柄	100%	0.5%
ユーロ	国債証券 242銘柄	100%	52.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年6月30日

資産総額	4,051,054,930円
負債総額	587,552円
純資産総額（ - ）	4,050,467,378円
発行済数量	3,961,015,716口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0226円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド
純資産額計算書

平成21年6月30日

資産総額	91,542,461,937円
負債総額	147,210,591円
純資産総額（ - ）	91,395,251,346円
発行済数量	188,604,326,835口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.4846円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）
純資産額計算書

平成21年6月30日

資産総額	11,758,397,047円
負債総額	239,325,210円
純資産総額（ - ）	11,519,071,837円
発行済数量	10,812,553,736口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0653円

（参考）外国株式インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年6月30日

資産総額	39,867,032,962円
負債総額	425,858,217円
純資産総額（ - ）	39,441,174,745円
発行済数量	51,410,361,521口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7672円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成21年6月30日

資産総額	102,238,129,041円
負債総額	4,631,586,645円

純資産総額（ - ）	97,606,542,396円
発行済数量	50,225,266,993口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.9434円

第 5 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	4,385,021,786	413,097,579
第2計算期間	426,213,470	404,476,305
第3計算期間	381,154,709	393,696,571
第4計算期間	223,779,082	292,971,718

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

第三部 【特別情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成21年6月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

b. 委託会社の機構

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うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成21年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（公募）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	13	49,466
追加型株式投資信託	259	5,075,791
株式投資信託 合計	272	5,125,258
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,022,427
公社債投資信託 合計	17	3,022,427
総合計	289	8,147,685

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、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、あずさ監査法人により受けております。

3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,398,882	3,961,462
有価証券	32,206,041	28,233,112
前払金	3,357	453
前払費用	96,205	84,549
未収入金	75,494	20,722
未収消費税等	-	27,138
未収委託者報酬	8,899,037	5,273,080
未収収益	136,888	25,476
貯蔵品	83,453	38,909
繰延税金資産	779,955	227,536
デリバティブ資産	1,172,830	-
その他	30,104	2,030
流動資産計	46,882,252	37,894,473
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	1,618,595	1,252,162
器具備品（純額）	388,414	349,484
建設仮勘定	1,229,446	900,893
建設仮勘定	735	1,785
無形固定資産	1,989,254	1,980,730
ソフトウェア	1,976,209	1,967,944
電話加入権	11,850	11,850
その他	1,194	936
投資その他の資産	8,890,810	8,317,769
投資有価証券	7,690,544	7,780,508
関係会社株式	737,012	737,012

出資金	166,719	178,806
従業員に対する長期貸付金	176,298	155,692
差入保証金	633,855	618,264
長期前払費用	10,039	8,394
投資不動産（純額）	593,270	579,162
その他	43	-
貸倒引当金	3 1,116,972	3 1,740,069
固定資産計	12,498,661	11,550,663
資産合計	59,380,914	49,445,137

（単位：千円）

	前事業年度 （平成20年 3月31日現在）	当事業年度 （平成21年 3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	50,693	48,999
未払金	10,302,751	5,335,193
未払収益分配金	27,011	32,233
未払償還金	332,721	278,950
未払手数料	4,943,985	2,896,691
その他未払金	2 4,999,033	2 2,127,318
未払費用	2,177,782	1,528,570
未払法人税等	1,402,832	442,052
未払消費税等	425,013	-
前受収益	39,700	-
賞与引当金	480,300	223,000
その他	22,096	1,951
流動負債計	14,901,170	7,579,766
固定負債		
退職給付引当金	988,898	1,150,011
役員退職慰労引当金	46,260	62,520
繰延税金負債	2,300,289	1,767,537
固定負債計	3,335,448	2,980,068
負債合計	18,236,618	10,559,835
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	11,702,152	9,659,553
利益剰余金合計	14,876,450	12,833,851
株主資本合計	41,546,450	39,503,851

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	402,154	618,549
評価・換算差額等合計	402,154	618,549
純資産合計	41,144,295	38,885,301
負債・純資産合計	59,380,914	49,445,137

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

重要な会計方針

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

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

会計方針の変更

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額 8,555百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 3,280円

基準日 平成20年3月31日

効力発生日 平成20年6月23日

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

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

２．配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

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

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

(リース取引関係)

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

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

（有価証券関係）

１．その他有価証券で時価のあるもの

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

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

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

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

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

３．時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

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

４．その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

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

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

１．取引の状況に関する事項

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

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

2. 取引の時価等に関する事項

通貨関連

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

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

(退職給付関係)

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

3．退職給付費用に関する事項 勤務費用 152,041千円 その他 157,375 退職給付費用 309,416 なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は106,630千円であります。	3．退職給付費用に関する事項 勤務費用 168,703千円 その他 141,642 退職給付費用 310,345 なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。
---	---

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳 繰延税金資産 千円 減損損失 887,301 貸倒引当金 454,496 退職給付引当金 402,382 未払事業税 332,390 株式譲渡損繰延 287,965 その他有価証券評価差額金 275,900 投資有価証券評価損 214,784 賞与引当金 168,660 出資金評価損 118,268 器具備品 38,093 役員退職慰労引当金 18,823 未払社会保険料 18,208 前受収益 16,153 一括償却資産 10,048 その他 23,392 繰延税金資産小計 3,266,871 評価性引当額 1,947,529 繰延税金資産合計 1,319,341 繰延税金負債 株式譲渡益繰延 2,837,113 その他 2,562 繰延税金負債合計 2,839,675 繰延税金負債の純額 1,520,333	1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳 繰延税金資産 千円 減損損失 886,012 貸倒引当金 708,034 退職給付引当金 467,939 その他有価証券評価差額金 424,359 投資有価証券評価損 303,843 株式譲渡損繰延 287,965 出資金評価損 126,163 未払事業税 108,049 賞与引当金 90,738 器具備品 38,093 役員退職慰労引当金 25,439 未払社会保険料 11,283 その他 31,981 繰延税金資産小計 3,509,905 評価性引当額 2,210,636 繰延税金資産合計 1,299,269 繰延税金負債 株式譲渡益繰延 2,837,113 その他 2,156 繰延税金負債合計 2,839,269 繰延税金負債の純額 1,540,000
2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率 40.69% (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.20 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.52 住民税均等割 0.02 評価性引当額 2.45	2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率 40.69% (調整) 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.35 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 0.13 住民税均等割 0.03 評価性引当額 2.32

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

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

１．親会社及び法人主要株主等

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

２．兄弟会社等

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

（追加情報）

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

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

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

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

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

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

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20年7月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 公告の方法の変更（電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。）に変更）

平成21年4月2日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 株主名簿管理人の廃止

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

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 287,537百万円（平成21年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成21年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
株式会社りそな銀行	279,928	（注2）

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）銀行業を営むとともに、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 【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21年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受

託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
平成20年8月29日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第3期）・同添付書類
平成21年2月26日	半期報告書（第4期中）、有価証券届出書の訂正届出書・同添付書類

独立監査人の監査報告書

平成21年7月24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 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス30の平成20年6月6日から平成21年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス30の平成21年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 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。

独立監査人の監査報告書

平成20年7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 山元 太志 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス30の平成19年6月6日から平成20年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス30の平成20年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

（注2） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指 定 社 員	公認会計士	堀内 巧 印
業務執行社員		

指 定 社 員	公認会計士	小澤 陽一 印
業務執行社員		

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

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

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

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

以 上

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