

【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22年8月31日提出
【計算期間】	第5計算期間 （自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7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>

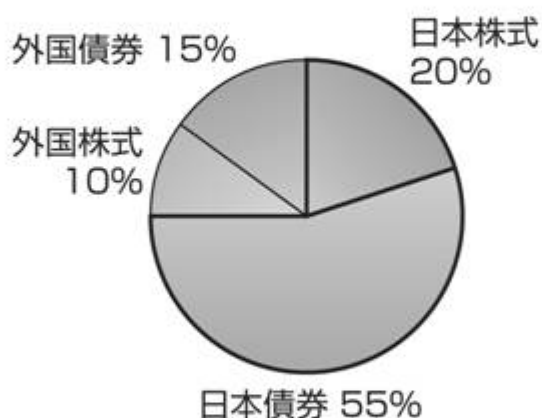
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 内外の株式および債券に投資します。

- 各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国内	海外	合計
株式	20%	10%	30%
債券	55%	15%	70%
合計	75%	25%	100%

※資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。

2

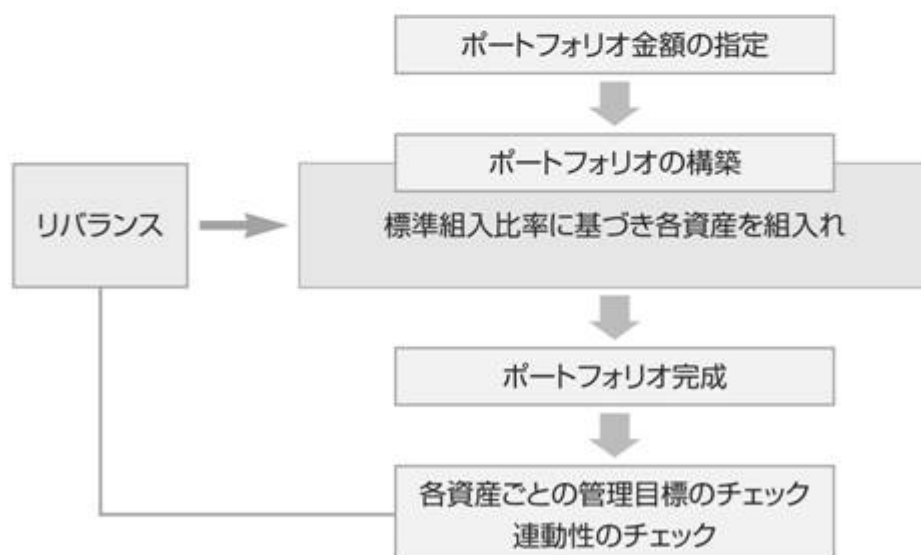
各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

- 合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークを標準組入比率に準拠して指数化したものです。

各資産ごとのベンチマーク

日本株式	東証株価指数（TOPIX）
日本債券	NOMURA-BPI総合指数
外国株式	MSCIコクサイ指数（円ベース）
外国債券	シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

運用プロセス



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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資家のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



- ・市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。
- ・保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

- ・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

3

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お申込みを行なう場合に限り購入することができます。

4

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、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3.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ご購入の申込みを行なう場合を除きます。）。

5

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せん。収益分配金は、自動的に再投資されます。

●決算日は、毎年6月5日（休業日の場合翌営業日）です。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ②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。

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行いません。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いません。

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

2. 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をめざして運用を行いません。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いません。

(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めざす手法です。

NOMURA-BPI総合指数とは

NOMURA-BPI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-BPI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

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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、シティグループ・グローバル・マーケット・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。

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、償還の準備に入る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) 【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

(3) 【ファンドの仕組み】

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

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）
受託会社	住友信託銀行株式会社 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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、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（ファミリ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22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。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド、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。

② 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】

① 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)⑦、⑧および⑨に定めるものに限りま。）

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

- ② 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。

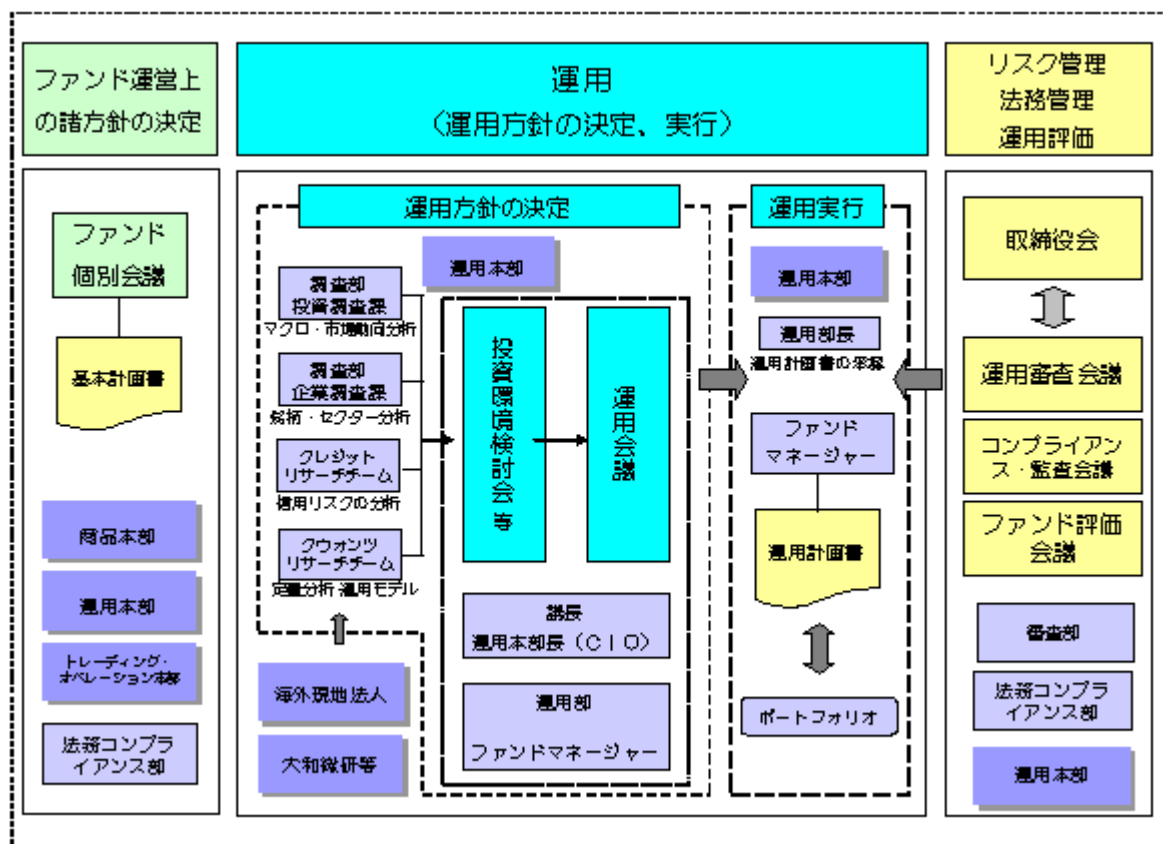
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（C I O）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

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

ニ. 運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ. 運用本部長（C I O）（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）

C I Oを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. 運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は20～30名程度です。

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は平成22年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。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- ② 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。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

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。

② 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。

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付ける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券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦ 先物取引等（信託約款）

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

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)③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)③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。

⑧ スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

ホ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ.において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由に

より、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

⑩ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

ロ. 前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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。

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑫ 外貨建資産（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の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。

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合

には、制約されることがあります。

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、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

① 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
 2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

① 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。

② 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

① 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)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

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

② 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ます。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券

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ます。）
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。

- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、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。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資は、行ないません。
- ④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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-BPI 総合指数とは

NOMURA-BPI 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-BPI 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

① 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。

② 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

- ① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
 - 1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券
 - 2. 国債証券
 - 3. 地方債証券
 - 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 - 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 - 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 - 10. コマーシャル・ペーパー
 - 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 - 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 16. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券と

みなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

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

(3) 主な投資制限

- ① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りします。
- ② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、シティグループ・グローバル・マーケット・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すよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ. 為替リスク

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

なお、当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。このため、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す。

ロ. カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

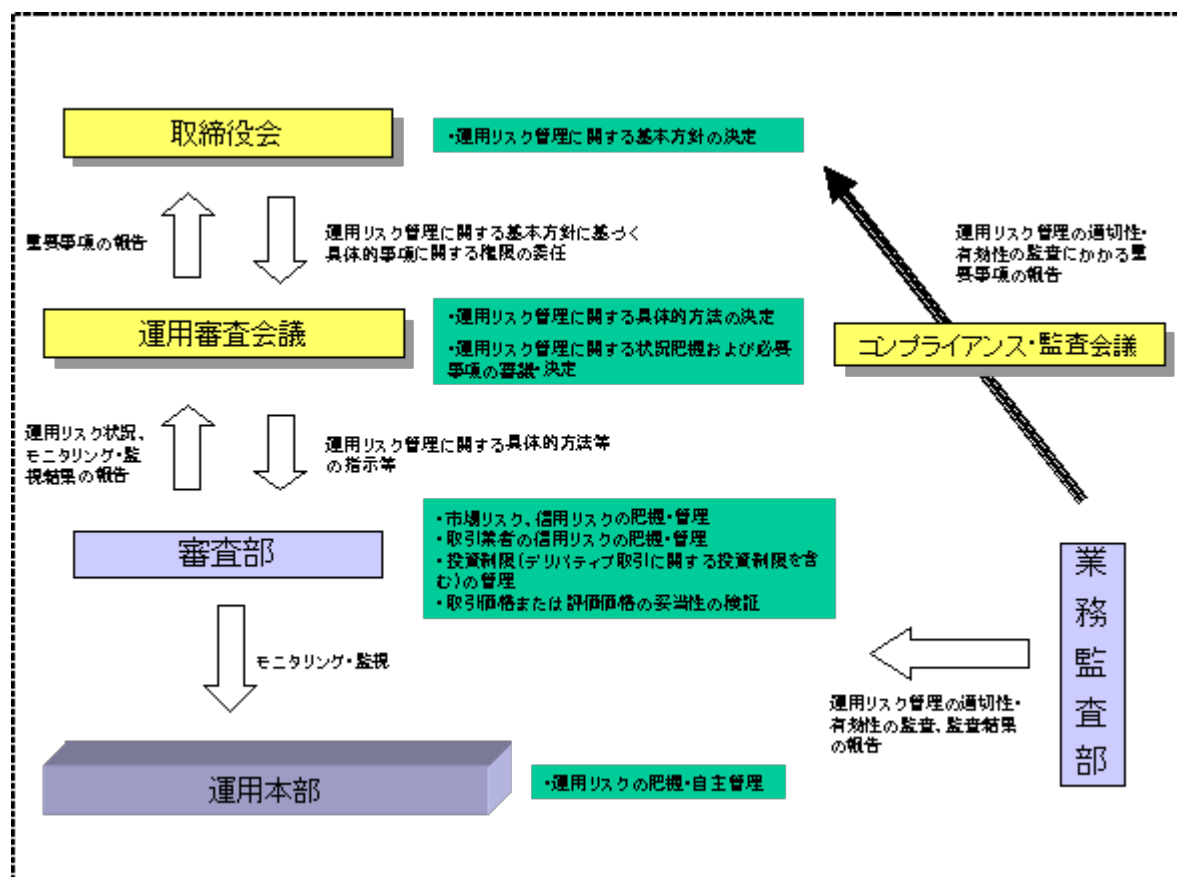
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所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けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料

ありません。

- ② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.189%（税抜0.18%）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。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.0735% (税抜0.07%)	年率0.084% (税抜0.08%)	年率0.0315% (税抜0.03%)

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

(4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、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23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

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

ハ. 損益通算について

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

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

<注1>個別元本について

- ① 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。
- ② 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。

- ③ 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

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「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。
- ② 受益者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

（※）上記は、平成22年6月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成22年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	4,104,218,481	99.74
内 日本	4,104,218,481	99.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,655,634	0.26
純資産総額	4,114,874,115	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	86,919,500,220	97.44
内 日本	86,919,500,220	97.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,285,981,338	2.56
純資産総額	89,205,481,558	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	2,389,725,000	2.68
内 日本	2,389,725,000	2.68

（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	6,912,713,650	60.00
内 日本	6,912,713,650	60.00
地方債証券	1,077,570,257	9.35
内 日本	1,077,570,257	9.35
特殊債券	1,719,399,860	14.92
内 日本	1,719,399,860	14.92
社債券	1,726,659,564	14.99
内 日本	1,726,659,564	14.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	83,955,944	0.73
純資産総額	11,520,299,275	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	40,154,414,495	97.07
内 オーストラリア	1,586,723,609	3.84
内 カナダ	2,385,057,581	5.77
内 スイス	1,661,780,777	4.02

内 デンマーク	205,440,430	0.50
内 ユーロ	6,061,699,955	14.65
内 英国	4,350,087,168	10.52
内 香港	514,121,037	1.24
内 イスラエル	171,417,630	0.41
内 ノルウェー	149,532,000	0.36
内 ニュージーランド	14,957,110	0.04
内 スウェーデン	607,470,107	1.47
内 シンガポール	339,812,976	0.82
内 米国	22,106,314,114	53.44
投資証券	638,402,336	1.54
内 オーストラリア	113,328,763	0.27
内 ユーロ	62,847,893	0.15
内 英国	51,553,793	0.12
内 香港	16,159,954	0.04
内 シンガポール	9,384,134	0.02
内 米国	385,127,799	0.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	575,471,335	1.39
純資産総額	41,368,288,166	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）	549,620,064	1.33
内 米国	549,620,064	1.33

（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	96,288,006,446	95.16
内 オーストラリア	827,144,738	0.82
内 カナダ	2,861,210,379	2.83
内 スイス	513,348,797	0.51
内 デンマーク	880,636,340	0.87
内 ユーロ	41,274,527,738	40.79
内 英国	7,590,677,345	7.50
内 マレーシア	539,258,216	0.53
内 ノルウェー	260,819,276	0.26
内 ポーランド	808,086,155	0.80
内 スウェーデン	621,414,051	0.61
内 シンガポール	388,112,945	0.38
内 米国	39,722,770,464	39.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,902,302,831	4.84
純資産総額	101,190,309,277	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	2,134,824,860	2.11
内 日本	2,134,824,860	2.11

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

（2）【投資資産】（平成22年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

（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 —	2,112,626,818	1.09540 2,314,171,417	1.1038 2,331,917,481	— —	56.67%
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 —	1,759,671,814	0.45616 802,695,543	0.4472 786,925,235	— —	19.12%
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 —	340,009,137	1.77910 604,912,041	1.7626 599,300,104	— —	14.56%
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 —	491,440,506	0.81427 400,167,937	0.7856 386,075,661	— —	9.38%

（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	99.74%
合計	99.74%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

	銘柄名 地域	種類 業種	株数、口数 または額面金 額	簿価単価 簿価	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,059,800	3,790 4,017,157,683	3,080 3,264,184,000	— —	3.66%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	5,798,400	514 2,981,378,496	405 2,348,352,000	— —	2.63%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	657,700	2,874 1,890,235,374	2,597 1,708,046,900	— —	1.91%
4	キヤノン 日本	株式 電気機器	478,300	3,702 1,770,975,319	3,330 1,592,739,000	— —	1.79%
5	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	579,200	3,181 1,842,683,120	2,538 1,470,009,600	— —	1.65%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	321,400	4,275 1,374,255,332	3,640 1,169,896,000	— —	1.31%
7	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	484,000	2,414 1,168,557,632	2,411 1,166,924,000	— —	1.31%
8	武田薬品 日本	株式 医薬品	303,000	3,918 1,187,220,394	3,820 1,157,460,000	— —	1.30%
9	任 天 堂 日本	株式 その他製品	43,500	24,452 1,063,685,232	26,350 1,146,225,000	— —	1.28%
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	606,500	1,962 1,190,490,540	1,864 1,130,516,000	— —	1.27%
11	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	6,732,400	182 1,230,481,235	147 989,662,800	— —	1.11%
12	ソ ニ ー 日本	株式 電気機器	411,500	2,664 1,096,354,206	2,383 980,604,500	— —	1.10%
13	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	6,731	148,129 997,060,035	134,500 905,319,500	— —	1.01%
14	パナソニック 日本	株式 電気機器	754,400	1,411 1,065,104,520	1,122 846,436,800	— —	0.95%
15	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	142,500	6,430 916,286,110	5,930 845,025,000	— —	0.95%
16	ファナック 日本	株式 電気機器	79,500	8,186 650,810,820	10,140 806,130,000	— —	0.90%
17	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	332,200	2,019 670,958,999	2,371 787,646,200	— —	0.88%
18	東 芝 日本	株式 電気機器	1,731,000	497 861,337,220	445 770,295,000	— —	0.86%
19	野村ホールディングス 日本	株式 証券・商品先 物取引業	1,519,800	674 1,024,918,373	489 743,182,200	— —	0.83%
20	東京海上HD 日本	株式 保険業	308,500	2,699 832,679,600	2,352 725,592,000	— —	0.81%
21	三井物産 日本	株式 卸売業	653,200	1,281 837,276,745	1,054 688,472,800	— —	0.77%
22	関西電力 日本	株式 電気・ガス業	313,700	2,156 676,381,244	2,161 677,905,700	— —	0.76%
23	新日本製鐵 日本	株式 鉄鋼	2,264,000	351 795,946,150	296 670,144,000	— —	0.75%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	533,000	1,515 807,942,760	1,247 664,651,000	— —	0.75%
25	セブン&アイ・HLDS 日本	株式 小売業	324,600	2,164 702,703,742	2,047 664,456,200	— —	0.74%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	924,200	617 570,793,265	626 578,549,200	— —	0.65%

27	小松製作所	日本	株式 機械	356,400	1,782 635,420,500	1,618 576,655,200	— —	0.65%
28	日立	日本	株式 電気機器	1,760,000	287 506,381,480	324 570,240,000	— —	0.64%
29	中部電力	日本	株式 電気・ガス業	257,200	2,207 567,722,344	2,202 566,354,400	— —	0.63%
30	信越化学	日本	株式 化学	132,500	5,949 788,363,030	4,175 553,187,500	— —	0.62%

（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	97.44%
合計	97.44%

（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	0.11%
鉱業	0.32%
建設業	1.95%
食料品	3.19%
繊維製品	0.83%
パルプ・紙	0.42%
化学	5.74%
医薬品	4.21%
石油・石炭製品	0.70%
ゴム製品	0.58%
ガラス・土石製品	1.16%
鉄鋼	2.38%
非鉄金属	1.21%
金属製品	0.69%
機械	4.48%
電気機器	14.11%
輸送用機器	9.31%
精密機器	1.40%
その他製品	2.34%
電気・ガス業	5.37%
陸運業	4.00%
海運業	0.60%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.24%
情報・通信業	5.62%
卸売業	4.70%
小売業	3.66%
銀行業	9.31%
証券・商品先物取引業	1.51%

保険業	2.52%
その他金融業	0.66%
不動産業	2.11%
サービス業	1.67%
合計	97.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2010年9月	買建	285	2,426,625,826	2,389,725,000	2.68%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

① 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	305 10年国債 日本	国債証券 —	191,000,000	100.03 191,063,720	102.59 195,950,720	1.300000 19/12/20	1.70%
2	88 5年国債 日本	国債証券 —	173,000,000	100.09 173,161,970	100.81 174,403,030	0.500000 15/03/20	1.51%
3	289 10年国債 日本	国債証券 —	153,000,000	103.91 158,993,010	106.04 162,251,910	1.500000 17/12/20	1.41%
4	288 10年国債 日本	国債証券 —	145,000,000	105.63 153,172,200	107.60 156,024,350	1.700000 17/09/20	1.35%
5	287 2年国債 日本	国債証券 —	154,000,000	100.27 154,422,800	100.23 154,366,520	0.300000 11/12/15	1.34%
6	301 10年国債 日本	国債証券 —	135,000,000	102.35 138,172,500	104.88 141,597,450	1.500000 19/06/20	1.23%
7	296 10年国債 日本	国債証券 —	131,000,000	103.19 135,180,520	105.55 138,278,360	1.500000 18/09/20	1.20%
8	272 10年国債 日本	国債証券 —	130,000,000	104.16 135,408,000	105.31 136,914,700	1.400000 15/09/20	1.19%
9	390 東北電力 日本	社債券 —	130,000,000	103.42 134,454,710	102.48 133,236,350	2.250000 11/09/22	1.16%
10	5 政保中部空港 日本	特殊債券 —	121,000,000	101.43 122,739,859	101.62 122,960,684	0.800000 13/03/28	1.07%
11	303 10年国債 日本	国債証券 —	115,000,000	101.26 116,454,750	103.81 119,382,650	1.400000 19/09/20	1.04%
12	378 東北電力 日本	社債券 —	100,000,000	118.50 118,500,700	118.99 118,990,100	3.850000 16/04/25	1.03%
13	279 10年国債 日本	国債証券 —	102,000,000	107.77 109,925,400	108.92 111,105,540	2.000000 16/03/20	0.96%

14	2 9 3 大阪府公債	日本	地方債証券 —	100,000,000	107.20 107,206,900	108.72 108,726,600	2.100000 16/08/30	0.94%
15	1 4 4 神奈川県公債	日本	地方債証券 —	100,000,000	106.11 106,112,900	107.92 107,920,800	1.830000 16/12/20	0.94%
16	2 6 公営企業	日本	特殊債券 —	100,000,000	105.63 105,638,800	107.70 107,709,300	1.780000 17/03/24	0.93%
17	2 8 6 10年国債	日本	国債証券 —	99,000,000	106.46 105,402,380	108.34 107,257,590	1.800000 17/06/20	0.93%
18	2 9 9 10年国債	日本	国債証券 —	103,000,000	100.87 103,896,100	103.43 106,541,140	1.300000 19/03/20	0.92%
19	2 政保地方公営機	日本	特殊債券 —	100,000,000	103.51 103,514,600	105.94 105,948,800	1.600000 18/11/16	0.92%
20	2 成田国際空港	日本	特殊債券 —	100,000,000	104.46 104,466,700	105.74 105,746,800	1.660000 15/12/18	0.92%
21	6 2 4 東京都公債	日本	地方債証券 —	100,000,000	105.06 105,061,000	105.37 105,370,000	1.500000 15/06/19	0.91%
22	7 三井住友BK劣後	日本	社債券 —	100,000,000	103.89 103,892,100	105.32 105,328,900	2.010000 14/02/05	0.91%
23	1 8 共同発行地方	日本	地方債証券 —	100,000,000	104.59 104,598,900	105.30 105,304,000	1.600000 14/09/25	0.91%
24	3 2 9 政保道路債	日本	特殊債券 —	100,000,000	104.84 104,846,000	105.22 105,222,100	1.600000 14/06/27	0.91%
25	6 東京三菱BK劣後	日本	社債券 —	100,000,000	104.39 104,398,000	104.99 104,992,500	1.730000 14/12/22	0.91%
26	2 0 共同発行地方	日本	地方債証券 —	100,000,000	104.37 104,375,000	104.98 104,984,800	1.500000 14/11/25	0.91%
27	1 3 首都高速道路	日本	特殊債券 —	100,000,000	103.84 103,847,400	104.72 104,722,300	1.480000 15/03/20	0.91%
28	4 7 日本政策投資B	日本	特殊債券 —	100,000,000	104.18 104,187,000	104.58 104,588,200	1.570000 14/03/20	0.91%
29	2 7 東日本旅客鉄道	日本	社債券 —	100,000,000	103.51 103,510,400	103.72 103,724,600	1.460000 13/09/20	0.90%
30	2 5 三菱化学	日本	社債券 —	100,000,000	103.39 103,399,400	103.45 103,455,100	1.800000 13/02/05	0.90%

（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	60.00%
地方債証券	9.35%
特殊債券	14.92%
社債券	14.99%
合計	99.27%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

① 投資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	131,655	6,491 854,591,946	5,069 667,361,723	— —	1.61%
2	APPLE INC 米国	株式 電気機器	23,500	17,864 419,822,204	22,657 532,462,022	— —	1.29%
3	MICROSOFT CORP 米国	株式 サービス業	206,100	2,572 530,089,608	2,063 425,257,177	— —	1.03%
4	PROCTER & GAMBLE CO 米国	株式 化学	75,637	5,521 417,632,657	5,337 403,683,261	— —	0.98%
5	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食料品	89,250	3,945 352,160,499	4,277 381,768,526	— —	0.92%
6	JOHNSON & JOHNSON 米国	株式 医薬品	71,200	5,553 395,429,861	5,241 373,198,730	— —	0.90%
7	HSBC HOLDINGS PLC 英国	株式 銀行業	447,800	939 420,875,313	819 366,768,732	— —	0.89%
8	INT'L BUSINESS MACHINES 米国	株式 電気機器	33,100	11,121 368,136,082	11,067 366,349,582	— —	0.89%
9	GENERAL ELECTRIC CO 米国	株式 電気機器	275,200	1,410 388,228,474	1,281 352,583,598	— —	0.85%
10	JPMORGAN CHASE & CO 米国	株式 銀行業	103,520	3,645 377,389,992	3,279 339,449,202	— —	0.82%
11	BANK OF AMERICA CORP 米国	株式 銀行業	259,101	1,384 358,612,113	1,289 334,020,987	— —	0.81%
12	AT&T INC 米国	株式 情報・通信業	150,095	2,388 358,438,147	2,164 324,838,721	— —	0.79%
13	CHEVRON CORP 米国	株式 石油・石炭製 品	51,018	6,916 352,865,058	6,048 308,582,006	— —	0.75%
14	WELLS FARGO & CO 米国	株式 銀行業	126,072	2,404 303,104,616	2,294 289,245,275	— —	0.70%
15	CISCO SYSTEMS 米国	株式 電気機器	149,300	2,064 308,288,564	1,912 285,601,584	— —	0.69%
16	PFIZER INC 米国	株式 医薬品	204,563	1,615 330,397,694	1,263 258,464,205	— —	0.62%
17	VODAFONE GROUP PLC 英国	株式 情報・通信業	1,365,237	184 251,434,168	189 258,337,708	— —	0.62%
18	GOOGLE INC-CL A 米国	株式 サービス業	6,400	50,814 325,214,788	40,192 257,234,719	— —	0.62%
19	MERCK & CO INC 米国	株式 医薬品	81,321	3,206 260,780,563	3,134 254,928,844	— —	0.62%
20	INTEL CORP 米国	株式 電気機器	144,600	1,704 246,501,829	1,750 253,069,434	— —	0.61%
21	WAL-MART STORES 米国	株式 小売業	57,800	4,833 279,385,687	4,326 250,081,642	— —	0.60%
22	BHP BILLITON LTD オーストラリア	株式 鉱業	86,200	3,032 261,399,879	2,860 246,579,238	— —	0.60%
23	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	55,550	4,538 252,105,534	4,265 236,935,304	— —	0.57%
24	COCA COLA CO 米国	株式 食料品	52,600	5,059 266,118,465	4,453 234,238,236	— —	0.57%

25	HEWLETT-PACKARD CO 米国	株式 電気機器	59,200	4,341 257,029,445	3,919 232,044,109	— —	0.56%
26	PEPSICO INC 米国	株式 食料品	41,100	5,521 226,936,707	5,417 222,664,609	— —	0.54%
27	ROCHE HOLDING AG-GENUS スイス	株式 医薬品	18,000	13,612 245,031,948	12,240 220,322,844	— —	0.53%
28	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・石炭製品	53,900	4,513 243,275,799	3,963 213,610,853	— —	0.52%
29	GLAXOSMITHKLINE PLC 英国	株式 医薬品	140,102	1,693 237,222,590	1,494 209,365,080	— —	0.51%
30	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S 英国	株式 石油・石炭製品	91,500	2,436 222,940,821	2,272 207,964,457	— —	0.50%

（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	97.07%
投資証券	1.54%
合計	98.61%

（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	0.16%
鉱業	3.53%
建設業	0.71%
食料品	6.62%
繊維製品	0.20%
パルプ・紙	0.26%
化学	4.07%
医薬品	7.37%
石油・石炭製品	7.23%
ゴム製品	0.10%
ガラス・土石製品	0.27%
鉄鋼	0.51%
非鉄金属	0.09%
金属製品	0.33%
機械	2.46%
電気機器	8.87%
輸送用機器	1.73%
精密機器	0.42%
その他製品	0.79%
電気・ガス業	2.63%
陸運業	0.81%
海運業	0.25%
空運業	0.12%
倉庫・運輸関連業	0.03%

情報・通信業	4.73%
卸売業	0.39%
小売業	4.66%
銀行業	11.87%
証券・商品先物取引業	0.73%
保険業	4.02%
その他金融業	1.98%
不動産業	0.57%
サービス業	10.33%
消費材	0.30%
石油他	2.57%
建設資材	0.35%
水道	0.17%
持株会社	0.26%
コングロマリット	1.04%
電力	1.44%
フロンテーション	0.05%
その他製造	1.70%
新聞・出版	0.35%
合計	97.07%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	米国	S&P500 2010年9月	買建	24	576,657,782	549,620,064	1.33%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

① 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 —	619,271,520	104.78 648,928,433	107.76 667,357,954	3.750000 18/11/15	0.66%
2	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	614,670,560	96.60 593,777,908	99.59 612,168,851	2.750000 19/02/15	0.60%
3	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	516,900,160	103.39 534,464,427	105.66 546,177,385	3.625000 19/08/15	0.54%
4	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	498,142,400	99.61 496,240,847	105.54 525,769,378	3.625000 20/02/15	0.52%

5	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	466,024,160	103.45 482,134,615	104.64 487,684,963	2.625000 14/06/30	0.48%
6	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	443,788,450	108.92 483,374,380	108.29 480,578,513	5.250000 12/06/07	0.47%
7	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	464,254,560	100.87 468,316,787	101.55 471,469,076	1.375000 12/10/15	0.47%
8	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	463,192,800	100.72 466,537,052	100.71 466,499,997	1.000000 11/09/30	0.46%
9	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	436,206,400	101.91 444,568,477	103.26 450,465,987	2.250000 14/05/31	0.45%
10	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	427,251,030	103.22 441,034,148	103.03 440,209,554	3.750000 16/08/01	0.44%
11	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	434,348,320	100.76 437,653,711	100.69 437,367,041	1.000000 11/08/31	0.43%
12	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	410,104,800	99.56 408,326,611	105.34 432,016,699	3.250000 17/03/31	0.43%
13	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	414,705,760	98.15 407,059,623	103.75 430,257,226	3.000000 17/02/28	0.43%
14	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	421,607,200	101.48 427,846,987	101.86 429,461,742	1.500000 12/07/15	0.42%
15	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	404,503,120	101.64 411,161,241	104.66 423,365,100	3.000000 15/10/25	0.42%
16	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	410,901,120	99.96 410,740,612	101.39 416,645,518	1.375000 13/01/15	0.41%
17	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	400,460,480	99.69 399,257,554	103.48 414,412,523	3.375000 19/11/15	0.41%
18	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	407,715,840	99.85 407,142,490	100.80 410,977,567	1.000000 12/03/31	0.41%
19	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	408,069,760	99.70 406,858,303	100.57 410,412,080	0.875000 12/02/29	0.41%
20	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	392,585,760	101.34 397,861,131	104.24 409,254,951	2.625000 14/12/31	0.40%
21	FRENCH GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	369,788,300	107.22 396,490,713	110.62 409,063,515	4.250000 19/04/25	0.40%
22	UNITED KINGDOM GILT BOND 英国	国債証券 —	374,458,980	110.71 414,563,537	108.58 406,587,560	4.750000 38/12/07	0.40%
23	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	399,841,120	100.28 400,965,673	100.78 402,979,873	1.000000 12/04/30	0.40%
24	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	393,293,600	100.02 393,401,141	101.35 398,638,460	1.375000 13/02/15	0.39%
25	U.S. TREASURY BOND 米国	国債証券 —	267,652,000	143.21 383,325,841	145.27 388,826,090	8.000000 21/11/15	0.38%
26	U.S. TREASURY NOTE 米国	国債証券 —	347,372,480	110.49 383,818,801	111.89 388,702,858	4.250000 15/08/15	0.38%
27	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	379,599,010	104.02 394,877,870	102.35 388,527,179	4.250000 19/02/01	0.38%
28	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	358,576,060	107.56 385,698,753	106.91 383,385,938	5.000000 12/01/04	0.38%
29	GERMAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	351,029,360	103.18 362,213,155	108.42 380,589,542	3.500000 19/07/04	0.38%
30	ITALIAN GOVERNMENT BOND ユーロ	国債証券 —	336,151,580	116.19 390,581,244	112.11 376,872,982	6.000000 31/05/01	0.37%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

国債証券	95.16%
合計	95.16%

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

ハ、投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2010年7月	買建	8,173,262	738,928,530	723,088,478	0.71%
		米ドル買/円売 2010年8月	買建	1,144,000	101,162,776	101,152,480	0.10%
		カナダドル買/円売 2010年7月	買建	1,198,559	103,950,914	100,379,276	0.10%
		カナダドル買/円売 2010年8月	買建	90,000	7,533,045	7,532,100	0.01%
		豪ドル買/円売 2010年7月	買建	203,000	15,733,785	15,237,180	0.02%
		豪ドル買/円売 2010年8月	買建	30,000	2,242,455	2,242,200	0.00%
		英ポンド買/円売 2010年7月	買建	1,550,543	207,619,056	206,315,275	0.20%
		英ポンド買/円売 2010年8月	買建	142,000	18,885,290	18,884,580	0.02%
		スイスフラン買/円売 2010年7月	買建	119,000	9,574,560	9,722,300	0.01%
		スイスフラン買/円売 2010年8月	買建	18,000	1,470,780	1,470,600	0.00%
		デンマーククローネ買/円売 2010年7月	買建	2,222,282	32,748,472	32,156,414	0.03%
		デンマーククローネ買/円売 2010年8月	買建	153,000	2,213,481	2,212,380	0.00%
		スウェーデンクローナ買/円売 2010年7月	買建	966,000	11,222,047	10,954,440	0.01%
		スウェーデンクローナ買/円売 2010年8月	買建	142,000	1,609,868	1,608,860	0.00%
		ポーランドズロチ買/円売 2010年7月	買建	867,472	23,003,803	22,606,317	0.02%
		ポーランドズロチ買/円売 2010年8月	買建	78,000	2,015,933	2,027,220	0.00%
		ユーロ買/円売 2010年7月	買建	7,097,000	789,606,858	765,056,600	0.76%
		ユーロ買/円売 2010年8月	買建	1,041,000	112,189,611	112,178,160	0.11%

（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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
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
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
平成21年6月末日	4,050,467,378	—	1.0226	—
7月末日	4,095,979,782	—	1.0334	—
8月末日	4,112,607,729	—	1.0418	—
9月末日	4,072,891,623	—	1.0324	—
10月末日	4,073,972,505	—	1.0318	—
11月末日	4,039,224,701	—	1.0159	—
12月末日	4,185,818,975	—	1.0443	—
平成22年1月末日	4,136,877,558	—	1.0298	—
2月末日	4,108,593,537	—	1.0266	—
3月末日	4,267,715,666	—	1.0641	—
4月末日	4,308,375,642	—	1.0741	—
5月末日	4,134,143,678	—	1.0281	—
第5計算期間末 (平成22年6月7日)	4,101,691,920	4,101,691,920	1.0200	1.0200
6月末日	4,114,874,115	—	1.0156	—

② 【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
第5計算期間	0.0000

③ 【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5計算期間	0.3

[次へ](#)

(参考情報)

2010年6月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,156円
純資産総額	41億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-1.2%
3か月間	-4.6%
6か月間	-2.7%
1年間	-0.7%
3年間	-14.6%
5年間	0.4%
設定来	1.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 06年6月	第2期 07年6月	第3期 08年6月	第4期 09年6月	第5期 10年6月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率	
国内債券	272	56.3%	日本円	76.1%	直接利回り(%)	1.9	トヨタ自動車	日本	0.7%
国内株式・先物	1,298	19.1%	米ドル	11.0%	最終利回り(%)	1.0	TOPIX先物 2209月	日本	0.5%
外国債券	562	13.9%	ユーロ	7.8%	修正デュレーション	6.5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
外国株式・先物	1,196	9.2%	英ポンド	2.1%	残存年数	7.7	本田技研	日本	0.4%
外国リート	41	0.1%	カナダ・ドル	1.0%	債券格付別構成 比率		キャノン	日本	0.3%
			豪ドル	0.5%	AAA	75.1%	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%
			スイス・フラン	0.5%	AA	14.4%	日本電信電話	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	A	5.3%	東京電力	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	0.2%	BBB	-	武田薬品	日本	0.2%
コール・ローン、その他	2.0%		その他	0.6%	BB以下・無格付	5.2%	任天堂	日本	0.2%
合計	3,369	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		3.7%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を5.2%保有しております。

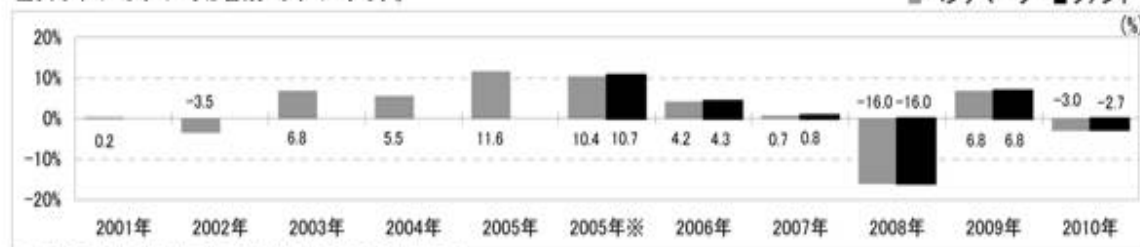
※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2005年※は設定日(6月6日)から年末、2010年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

(4) 【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
第5計算期間	307,120,335	198,888,477

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

第2 【管理及び運営】

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

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金（解約）手続等】

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

<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。

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、委託会社または販売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することもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所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に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 外国の株式：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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年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】

① 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、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

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

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金にかかる請求権

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、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

② 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、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

③ 換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

ただし、第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）については、改正前の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づき、第5期計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）については、改正後の財務諸表等規則及び投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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は、あずさ監査法人により監査を受け、第5期計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

1 【財務諸表】

ダイワ・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4期 平成21年6月5日現在	第5期 平成22年6月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,585,545	12,176,283
親投資信託受益証券	3,970,944,364	4,093,633,122
未収入金	560,000	676,000
流動資産合計	3,983,089,909	4,106,485,405
資産合計	3,983,089,909	4,106,485,405
負債の部		
流動負債		
未払解約金	564,812	680,250
未払受託者報酬	594,999	657,810
未払委託者報酬	2,975,224	3,289,287
その他未払費用	148,668	166,138
流動負債合計	4,283,703	4,793,485
負債合計	4,283,703	4,793,485
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 3,912,926,874	※ 1 4,021,158,732
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	65,879,332	80,533,188
（分配準備積立金）	301,579,019	286,862,137
元本等合計	3,978,806,206	4,101,691,920
純資産合計	3,978,806,206	4,101,691,920
負債純資産合計	3,983,089,909	4,106,485,405

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	第5期 自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
営業収益		
受取利息	35,026	12,124
有価証券売買等損益	△477,345,550	20,976,758
営業収益合計	△477,310,524	20,988,882
営業費用		
受託者報酬	1,261,075	1,304,603
委託者報酬	6,305,723	6,523,410
その他費用	315,108	325,976
営業費用合計	7,881,906	8,153,989
営業利益又は営業損失（△）	△485,192,430	12,834,893
経常利益又は経常損失（△）	△485,192,430	12,834,893
当期純利益又は当期純損失（△）	△485,192,430	12,834,893
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△37,881,400	4,322,792
期首剰余金又は期首欠損金（△）	548,187,099	65,879,332
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,670,595	9,562,352
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,670,595	9,562,352
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,667,332	3,420,597
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	39,667,332	3,420,597
分配金	※ 1 —	※ 1 —
期末剰余金又は期末欠損金（△）	65,879,332	80,533,188

(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4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	第5期 自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	-----	計算期間末日の取扱い 平成22年6月5日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を平成22年6月7日としております。このため、当計算期間は367日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期 平成21年6月5日現在	第5期 平成22年6月7日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	3,982,119,510円 223,779,082円 292,971,718円	3,912,926,874円 307,120,335円 198,888,477円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,912,926,874口	4,021,158,732口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	第5期 自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7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（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。	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（6,386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（382,616,029円）及び分配準備積立金（286,855,751円）より分配対象額は669,478,166円（1万口当たり1,664.89円）ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

第5期計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期 自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 平成22年6月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第4期 平成21年6月5日現在		第5期 平成22年6月7日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
親投資信託受益証券	3,970,944,364	△436,038,056	10,270,349
合計	3,970,944,364	△436,038,056	10,270,349

（デリバティブ取引に関する注記）

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）

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。

第5期計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第5期 平成22年6月7日現在
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	第5期 自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7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4期 平成21年6月5日現在	第5期 平成22年6月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0168円 (10,168円)	1.0200円 (10,200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	1,735,354,106	791,668,543	

	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	2,115,446,961	2,317,260,601	
	外国株式インデックスマザーファンド	476,096,975	387,542,937	
	外国債券インデックスマザーファンド	335,672,311	597,161,041	
親投資信託受益証券 合計		4,662,570,353	4,093,633,122	
合計		4,662,570,353	4,093,633,122	

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（B P I）」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21年6月5日現在	平成22年6月7日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,261,640,665	1,508,663,622
株式 ※3	86,910,298,700	88,263,002,160
派生商品評価勘定	277,376,955	8,417
未収配当金	674,879,091	798,310,971
前払金	—	68,986,000
差入委託証拠金	38,321,000	25,952,000
流動資産合計	89,162,516,411	90,664,923,170
資産合計	89,162,516,411	90,664,923,170
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,299	163,250,534
前受金	265,882,000	—
未払金	114,204,000	—
未払解約金	18,464,000	2,520,000
流動負債合計	398,569,299	165,770,534
負債合計	398,569,299	165,770,534
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	185,822,662,537	198,354,719,498
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△97,058,715,425	△107,855,566,862
元本等合計	88,763,947,112	90,499,152,636
純資産合計	88,763,947,112	90,499,152,636
負債純資産合計	89,162,516,411	90,664,923,170

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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	137,304,656,548円	185,822,662,537円
同期中における追加設定元本額	63,231,398,384円	27,809,108,440円
同期中における一部解約元本額	14,713,392,395円	15,277,051,479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	1,869,501,381円	1,831,790,484円
トピックス・インデックスファンド	12,621,747,086円	11,633,195,872円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	39,922,760,343円	38,068,703,665円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	1,134,072,648円	1,084,969,397円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	443,542,905円	376,125,613円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	6,961,598,127円	6,623,777,325円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	399,500,970円	382,409,676円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	9,330,703,812円	8,915,772,323円
DCダイワ日本株式インデックス	47,641,531,873円	52,994,599,361円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,742,109,348円	1,735,354,106円
ダイワ・ライフ・バランス50	14,810,425円	125,240,652円
ダイワ・ライフ・バランス70	16,756,838円	109,667,024円
年金ダイワ日本株式インデックス	643,139,852円	1,069,032,077円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	8,853,720円	13,847,139円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	3,306,293円	11,213,483円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	897,635円	723,409円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	541,117,017円	446,355,548円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,806,303,937円	3,380,578,742円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	2,159,221,882円	1,954,697,691円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	116,834,393円	111,128,818円

ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	801,539,690円	724,180,906円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA（国内株式型）	380,371,813円	344,471,550円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	4,185,224,653円	4,123,786,222円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	568,728,238円	592,377,181円
ダイワ・バランスファンド35V A	30,187,918,286円	36,192,352,107円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,369,393,830円	2,372,743,452円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	5,566,214,893円	5,406,345,110円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	－円	3,046,908,989円
ダイワ国内バランスファンド25 VA（適格機関投資家専用）	－円	511,708,554円
ダイワ国内バランスファンド30 VA（適格機関投資家専用）	－円	283,008,803円
ダイワライフスタイル25	138,900,305円	153,368,263円
ダイワライフスタイル50	398,813,568円	442,521,267円
ダイワライフスタイル75	328,907,878円	378,737,384円
DC・ダイワ・トピックス・イン デックス（確定拠出年金専用ファ ンド）	11,518,338,898円	12,913,027,305円
計	185,822,662,537円	198,354,719,498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	185,822,662,537口	198,354,719,498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97,058,715,425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107,855,566,862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 60,910,000円	株式 56,070,000円

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
-----	----------------------------

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年6月5日現在		平成22年6月7日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	86,910,298,700	△14,846,880,258	△8,570,457,778
合計	86,910,298,700	△14,846,880,258	△8,570,457,778

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年9月20日から平成21年6月5日まで、及び平成21年9月25日から平成22年6月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成20年6月6日から平成21年6月5日まで）

I 取引の状況に関する事項

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

II 取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	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)
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	1,651,943,000	—	1,929,900,000	277,957,000
合計	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。

（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成22年6月7日 現在			
	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	2,407,946,000	—	2,245,340,000	△162,606,000
合計	2,407,946,000	—	2,245,340,000	△162,606,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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)	0.4777円 (4,777円)	0.4562円 (4,562円)

附属明細表

[次へ](#)

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	48,000	180	8,640,000	
日本水産	98,000	275	26,950,000	
マルハニチロホールディングス	195,000	142	27,690,000	
サカタのタネ	14,000	1,160	16,240,000	
ホクト	10,100	1,759	17,765,900	
ショーボンドHD	9,000	1,759	15,831,000	
日鉄鉱業	26,000	329	8,554,000	
三井松島	46,000	156	7,176,000	
国際石油開発帝石	419	541,000	226,679,000	
関東天然瓦斯	12,000	462	5,544,000	
石油資源開発	14,600	4,065	59,349,000	
間組	55,400	78	4,321,200	
東急建設	34,500	226	7,797,000	
コムシスホールディングス	39,900	725	28,927,500	
ミサワホーム	15,600	412	6,427,200	
高松コンストラクショングP	7,600	952	7,235,200	
東建コーポレーション	3,710	2,384	8,844,640	
大成建設	400,000	173	69,200,000	
大 林 組	243,000	358	86,994,000	
清水建設	245,000	306	74,970,000	
長谷工コーポレーション	489,000	86	42,054,000	
鹿島建設	388,000	205	79,540,000	
不動テトラ	84,400	55	4,642,000	
鉄建建設	68,000	82	5,576,000	
安藤建設	47,000	113	5,311,000	
太平工業	16,000	293	4,688,000	
西松建設	121,000	110	13,310,000	
大豊建設	40,000	72	2,880,000	
前田建設	65,000	270	17,550,000	
奥 村 組	84,000	314	26,376,000	
東鉄工業	14,000	548	7,672,000	
浅沼組	43,000	59	2,537,000	
戸田建設	100,000	303	30,300,000	
熊 谷 組	87,000	64	5,568,000	
青木あすなろ建設	9,500	400	3,800,000	
北野建設	27,000	208	5,616,000	
三井ホーム	14,000	469	6,566,000	
矢作建設	13,000	549	7,137,000	
大東建託	36,900	4,630	170,847,000	
N I P P O	20,000	702	14,040,000	
前田道路	26,000	728	18,928,000	
日本道路	34,000	190	6,460,000	
東亜建設	87,000	93	8,091,000	
東洋建設	141,000	45	6,345,000	
五洋建設	105,500	126	13,293,000	
住友林業	64,600	725	46,835,000	
日本基礎技術	24,100	185	4,458,500	
パナホーム	32,000	542	17,344,000	
大和ハウス	215,000	850	182,750,000	
ライト工業	30,400	193	5,867,200	

積水ハウス	261,000	852	222,372,000
コミュニチュア	9,000	508	4,572,000
ユアテック	17,000	370	6,290,000
西部電気工業	16,000	319	5,104,000
中電工	12,400	1,039	12,883,600
関 電 工	38,000	556	21,128,000
大明	12,800	670	8,576,000
きんでん	53,000	797	42,241,000
東京エネシス	12,000	572	6,864,000
トーエネック	15,000	471	7,065,000
日本電設工業	18,000	816	14,688,000
協和エクシオ	31,400	713	22,388,200
日本工営	33,000	263	8,679,000
東電通	31,000	158	4,898,000
九電工	20,000	491	9,820,000
三機工業	22,000	673	14,806,000
日 揮	86,000	1,378	118,508,000
中外炉工業	33,000	227	7,491,000
太平電業	11,000	639	7,029,000
高砂熱学	24,800	753	18,674,400
三晃金属	18,000	193	3,474,000
N E C ネットスアイ	7,100	1,108	7,866,800
大 気 社	12,600	1,190	14,994,000
ダイダン	15,000	450	6,750,000
日比谷総合設	13,400	760	10,184,000
東芝プラントシステム	13,000	1,113	14,469,000
日本製粉	54,000	428	23,112,000
日清製粉G本社	84,000	996	83,664,000
昭和産業	40,000	261	10,440,000
協同飼料	50,000	100	5,000,000
中部飼料	10,000	636	6,360,000
日本配合飼料	45,000	106	4,770,000
ユニ・チャーム ペットケア	5,500	3,810	20,955,000
日本甜菜糖	54,000	195	10,530,000
三井製糖	35,000	299	10,465,000
日本M&Aセンター	20	301,500	6,030,000
アコーディア・ゴルフ	225	89,900	20,227,500
パソナグループ	89	56,800	5,055,200
テンプホールディングス	13,000	757	9,841,000
森永製菓	92,000	194	17,848,000
中 村 屋	24,000	423	10,152,000
江崎グリコ	32,000	1,004	32,128,000
名糖産業	5,000	1,219	6,095,000
山崎製パン	67,000	1,147	76,849,000
森永乳業	80,000	342	27,360,000
ヤクルト	48,700	2,329	113,422,300
明治ホールディングス	27,500	3,470	95,425,000
雪印メグミルク	18,500	1,598	29,563,000
プリマハム	61,000	101	6,161,000
日本ハム	65,000	1,106	71,890,000
伊藤ハム	59,000	307	18,113,000
丸大食品	40,000	254	10,160,000
米 久	8,500	814	6,919,000
S F o o d s	6,000	731	4,386,000
スタジオアリス	6,100	798	4,867,800

NECフィールドディング	8,400	1,071	8,996,400
新日鉄ソリューションズ	7,300	1,730	12,629,000
総合警備保障	29,600	953	28,208,800
日本駐車場開発	1,250	4,285	5,356,250
カカクコム	56	339,000	18,984,000
新日本科学	6,300	391	2,463,300
エムスリー	37	349,500	12,931,500
ディー・エヌ・エー	30,000	2,856	85,680,000
博報堂DYHLDGS	10,780	4,485	48,348,300
ぐるなび	55	135,600	7,458,000
パシフィックゴルフGRP	199	60,400	12,019,600
サッポロホールディングス	135,000	391	52,785,000
アサヒビール	159,300	1,505	239,746,500
麒麟HD	376,000	1,200	451,200,000
宝ホールディングス	76,000	448	34,048,000
オエノンホールディングス	37,000	182	6,734,000
メルシャン	34,000	174	5,916,000
養命酒	9,000	841	7,569,000
三国コカ・コーラ	12,600	700	8,820,000
コカ・コーラウエスト	23,000	1,444	33,212,000
コカコーラセントラルジャパン	11,100	1,095	12,154,500
ダイドードリンコ	4,100	3,115	12,771,500
伊藤園	23,500	1,303	30,620,500
キーコーヒー	7,800	1,519	11,848,200
日清オイリオグループ	36,000	444	15,984,000
不二製油	22,600	1,255	28,363,000
J-オイルミルズ	37,000	265	9,805,000
ローソン	22,900	3,775	86,447,500
サンエー	3,000	3,350	10,050,000
カワチ薬品	5,600	1,816	10,169,600
エービーシー・マート	8,400	3,285	27,594,000
アスクル	6,300	1,629	10,262,700
ゲオ	142	105,800	15,023,600
ポイント	7,420	5,050	37,471,000
伊藤忠食品	2,200	2,924	6,432,800
くらコーポレーション	4,800	1,383	6,638,400
エレマテック	5,500	1,052	5,786,000
JALUX	5,100	613	3,126,300
エディオン	32,800	777	25,485,600
サーラコーポレーション	12,500	533	6,662,500
パルス	51	101,000	5,151,000
双日	561,700	145	81,446,500
アルフレッサホールディングス	19,700	4,305	84,808,500
ハニーズ	7,890	1,017	8,024,130
キッコーマン	71,000	929	65,959,000
味の素	230,000	777	178,710,000
キューピー	47,200	973	45,925,600
ハウス食品	34,000	1,273	43,282,000
カゴメ	32,900	1,546	50,863,400
焼津水産化工	6,000	1,005	6,030,000
アリアケジャパン	8,100	1,408	11,404,800
ニチレイ	102,000	349	35,598,000
横浜冷凍	19,000	633	12,027,000
東洋水産	40,000	1,982	79,280,000
日清食品HD	29,500	3,020	89,090,000

永 谷 園	9,000	858	7,722,000
フジッコ	10,000	1,004	10,040,000
ロックフィールド	5,800	1,203	6,977,400
日本たばこ産業	1,902	288,600	548,917,200
わらべや日洋	5,900	1,029	6,071,100
片倉工業	11,100	866	9,612,600
グ ン ゼ	60,000	288	17,280,000
昭 栄	15,700	626	9,828,200
神 栄	25,000	162	4,050,000
アルペン	6,300	1,490	9,387,000
ビックカメラ	215	33,700	7,245,500
DCMホールディングス	41,200	519	21,382,800
あい ホールディングス	22,900	316	7,236,400
J. フロント リテイリング	193,000	457	88,201,000
ドトール・日レスHD	13,700	1,239	16,974,300
マツモトキヨシHLDGS	14,000	1,818	25,452,000
ココカラファイン HD	6,600	1,635	10,791,000
三越伊勢丹HD	141,800	883	125,209,400
東洋紡績	299,000	145	43,355,000
ユニチカ	204,000	77	15,708,000
富士紡ホールディングス	45,000	132	5,940,000
日清紡ホールディングス	58,000	843	48,894,000
倉敷紡績	87,000	142	12,354,000
ダイワボウHD	65,000	188	12,220,000
シキボウ	58,000	118	6,844,000
日東紡績	79,000	204	16,116,000
トヨタ紡織	24,600	1,430	35,178,000
クリエイトSDH	3,200	1,700	5,440,000
バイタルKSKHD	11,700	482	5,639,400
UKCホールディングス	5,200	1,086	5,647,200
CHIグループ	5,600	374	2,094,400
日本毛織	30,000	610	18,300,000
ダイドーリミテッド	13,100	701	9,183,100
野村不動産HLDGS	39,200	1,231	48,255,200
ヒューリック	23,900	679	16,228,100
日本コークス工業	86,500	154	13,321,000
JFE商事HLDGS	54,000	408	22,032,000
あさひ	4,000	1,348	5,392,000
サークルKサンクス	16,500	1,147	18,925,500
コスモス薬品	3,500	1,938	6,783,000
シップヘルスケアHD	108	65,300	7,052,400
セブン&アイ・HLDGS	322,900	2,025	653,872,500
ツルハホールディングス	6,300	2,876	18,118,800
サンマルクホールディングス	2,700	3,390	9,153,000
トリドール	25	167,000	4,175,000
帝 人	306,000	253	77,418,000
東 レ	537,000	458	245,946,000
ク ラ レ	117,500	1,081	127,017,500
旭 化 成	465,000	480	223,200,000
サカイ オーベックス	43,000	98	4,214,000
稲葉製作所	6,800	929	6,317,200
宮地エンジニアリングG	55,000	85	4,675,000
三協・立山HLDGS	112,000	112	12,544,000
トーカロ	5,000	1,736	8,680,000
SUMCO	47,000	1,737	81,639,000

川田テクノロジーズ	2,800	1,297	3,631,600
住江織物	34,000	175	5,950,000
日本バイリーン	13,000	388	5,044,000
アツギ	94,000	109	10,246,000
セーレン	21,400	489	10,464,600
小松精練	20,000	333	6,660,000
ワコールホールディングス	47,000	1,031	48,457,000
ホギメディカル	3,700	4,600	17,020,000
サンエー・インターナショナル	5,000	1,140	5,700,000
レナウン	23,100	366	8,454,600
I Tホールディングス	25,400	1,057	26,847,800
コーエーテクモHD	17,000	597	10,149,000
特種東海HLDGS	57,000	215	12,255,000
ドワンゴ	53	154,600	8,193,800
マクロミル	54	131,600	7,106,400
ティーガイア	71	129,200	9,173,200
ザッパラス	36	125,800	4,528,800
インターネットイニシアティブ	51	235,400	12,005,400
ソネットエンタテインメント	44	224,200	9,864,800
王子製紙	351,000	435	152,685,000
三菱製紙	132,000	104	13,728,000
北越紀州製紙	59,500	448	26,656,000
中越パルプ	41,000	156	6,396,000
大王製紙	37,000	666	24,642,000
日本製紙G本社	35,800	2,603	93,187,400
レンゴー	63,000	538	33,894,000
トーモク	31,000	233	7,223,000
ザ・パック	5,600	1,430	8,008,000
昭和電工	547,000	174	95,178,000
住友化学	549,000	364	199,836,000
日本化成	24,000	167	4,008,000
住友精化	20,000	326	6,520,000
日産化学	55,000	1,053	57,915,000
ラサ工業	55,000	92	5,060,000
クレハ	53,000	440	23,320,000
テイカ	20,000	253	5,060,000
石原産業	157,000	68	10,676,000
日本曹達	56,000	314	17,584,000
東ソー	208,000	244	50,752,000
トクヤマ	136,000	439	59,704,000
セントラル硝子	85,000	357	30,345,000
東亜合成	97,000	400	38,800,000
ダイソー	39,000	226	8,814,000
関東電化	21,000	646	13,566,000
電気化学	174,000	422	73,428,000
イビデン	53,800	2,660	143,108,000
信越化学	131,900	4,525	596,847,500
日本カーバイド	34,000	166	5,644,000
堺 化 学	31,000	378	11,718,000
エア・ウォーター	63,000	1,006	63,378,000
大陽日酸	113,000	695	78,535,000
日本化学工業	41,000	205	8,405,000
日本パーカライジング	19,000	1,118	21,242,000
高压ガス	15,000	465	6,975,000
四国化成	14,000	456	6,384,000

戸田工業	15,000	655	9,825,000
ステラ ケミファ	4,300	3,415	14,684,500
保土谷化学	24,000	299	7,176,000
日本触媒	48,000	836	40,128,000
大日精化	34,000	335	11,390,000
カネカ	107,000	545	58,315,000
協和発酵キリン	103,000	871	89,713,000
三菱瓦斯化学	136,000	480	65,280,000
三井化学	258,000	272	70,176,000
J S R	77,700	1,603	124,553,100
東京応化工業	14,900	1,596	23,780,400
三菱ケミカルH L D G S	462,000	428	197,736,000
日本合成化学	22,000	568	12,496,000
ダイセル化学	103,000	633	65,199,000
住友ベークライト	75,000	462	34,650,000
積水化学	164,000	561	92,004,000
日本ゼオン	77,000	519	39,963,000
アイカ工業	22,200	945	20,979,000
宇部興産	371,000	230	85,330,000
積水樹脂	12,000	823	9,876,000
タキロン	26,000	263	6,838,000
旭有機材	39,000	207	8,073,000
日立化成	36,700	1,735	63,674,500
ニチバン	18,000	285	5,130,000
大倉工業	26,000	263	6,838,000
積水化成品	25,000	382	9,550,000
群栄化学	31,000	223	6,913,000
日本化薬	63,000	713	44,919,000
イーピーエス	53	214,000	11,342,000
フェイス	387	8,290	3,208,230
野村総合研究所	45,300	1,980	89,694,000
ドリームインキュベータ	47	57,500	2,702,500
サイバネットシステム	168	28,140	4,727,520
電通	77,900	2,242	174,651,800
シンプレクス・テクノロジー	130	54,700	7,111,000
A D E K A	35,200	835	29,392,000
日油	74,000	369	27,306,000
ミヨシ油脂	50,000	133	6,650,000
ハリマ化成	10,000	459	4,590,000
花 王	219,600	1,971	432,831,600
三洋化成	25,000	521	13,025,000
武田薬品	300,500	3,750	1,126,875,000
アステラス製薬	169,000	2,934	495,846,000
大日本住友製薬	62,900	689	43,338,100
塩野義製薬	117,000	1,601	187,317,000
田辺三菱製薬	70,000	1,268	88,760,000
わかもと製薬	16,000	291	4,656,000
あすか製薬	12,000	631	7,572,000
日本新薬	21,000	951	19,971,000
中外製薬	84,700	1,572	133,148,400
科研製薬	37,000	777	28,749,000
エーザイ	98,400	2,954	290,673,600
ロート製薬	37,000	1,017	37,629,000
小野薬品	39,200	3,580	140,336,000
久光製薬	24,100	3,270	78,807,000

持田製薬	33,000	813	26,829,000
大正製薬	67,000	1,722	115,374,000
参天製薬	24,500	2,992	73,304,000
扶桑薬品	34,000	284	9,656,000
日本ケミファ	18,000	315	5,670,000
ツムラ	24,200	2,572	62,242,400
テ ル モ	59,000	4,315	254,585,000
みらかホールディングス	16,800	2,623	44,066,400
キッセイ薬品工業	17,000	1,736	29,512,000
生化学工業	15,900	874	13,896,600
栄研化学	7,200	780	5,616,000
鳥居薬品	5,700	1,396	7,957,200
東和薬品	4,200	5,580	23,436,000
沢井製薬	5,400	7,690	41,526,000
ゼリア新薬工業	14,000	893	12,502,000
第一三共	252,700	1,587	401,034,900
キョーリン	22,000	1,213	26,686,000
大日本塗料	65,000	93	6,045,000
日本ペイント	75,000	569	42,675,000
関西ペイント	97,000	716	69,452,000
中国塗料	24,000	613	14,712,000
日本特殊塗料	10,900	329	3,586,100
藤倉化成	13,800	516	7,120,800
太陽インキ製造	6,800	2,276	15,476,800
D I C	270,000	146	39,420,000
サカタインクス	21,000	378	7,938,000
東洋インキ	79,000	333	26,307,000
オリエンタルランド	20,800	7,090	147,472,000
ダスキン	24,200	1,470	35,574,000
パーク 2 4	47,000	931	43,757,000
フジ・メディア・HD	840	126,200	106,008,000
秀英予備校	4,800	500	2,400,000
ラウンドワン	13,100	579	7,584,900
リゾートトラスト	13,100	1,261	16,519,100
オービック	2,570	16,920	43,484,400
ヤフー	4,421	32,250	142,577,250
ビー・エム・エル	4,800	2,133	10,238,400
ワタベウェディング	3,900	1,021	3,981,900
トレンドマイクロ	32,600	2,562	83,521,200
もしもしホットライン	6,200	2,040	12,648,000
東急コミュニティー	2,400	2,314	5,553,600
リソー教育	1,107	5,000	5,535,000
日本オラクル	12,400	4,150	51,460,000
アルファシステムズ	3,300	1,676	5,530,800
フューチャーアーキテクト	137	31,550	4,322,350
シーエーシー	9,400	674	6,335,600
ユー・エス・エス	10,890	5,950	64,795,500
オービックビジネスC	2,150	4,225	9,083,750
伊藤忠テクノソリュー	11,800	3,210	37,878,000
東京個別指導学院	14,900	259	3,859,100
カルチュア・コンビニエンス	31,800	401	12,751,800
大塚商会	6,500	5,830	37,895,000
総合メディカル	2,500	2,539	6,347,500
サイボウズ	138	33,550	4,629,900
セントラルスポーツ	5,400	850	4,590,000

電通国際情報S	8,500	584	4,964,000
富士フイルムHLDGS	170,100	2,625	446,512,500
コニカミノルタHLDGS	177,000	972	172,044,000
資 生 堂	145,800	1,757	256,170,600
ライオン	97,000	444	43,068,000
高砂香料	27,000	397	10,719,000
マンダム	8,400	2,411	20,252,400
ミルボン	4,400	2,086	9,178,400
ファンケル	16,700	1,210	20,207,000
コーセー	12,400	2,119	26,275,600
ドクターシーラボ	64	240,400	15,385,600
エスター	7,100	994	7,057,400
コ ニ シ	7,700	933	7,184,100
長谷川香料	11,400	1,335	15,219,000
小林製薬	11,800	3,660	43,188,000
荒川化学工業	7,800	961	7,495,800
日本高純度化学	27	273,300	7,379,100
アース製薬	6,400	2,698	17,267,200
イハラケミカル	21,000	244	5,124,000
大成ラミック	3,600	2,061	7,419,600
クミアイ化学	21,000	230	4,830,000
日本農薬	20,000	436	8,720,000
昭和シェル石油	78,100	624	48,734,400
コスモ石油	221,000	244	53,924,000
東燃ゼネラル石油	113,000	779	88,027,000
ユシロ化学	5,600	1,130	6,328,000
AOCホールディングス	21,900	547	11,979,300
出光興産	9,200	6,260	57,592,000
JXホールディングス	827,000	468	387,036,000
横浜ゴム	92,000	413	37,996,000
東洋ゴム	86,000	204	17,544,000
ブリヂストン	249,300	1,443	359,739,900
住友ゴム	62,700	812	50,912,400
オカモト	36,000	357	12,852,000
アキレス	79,000	123	9,717,000
ニッタ	8,700	1,452	12,632,400
東海ゴム工業	13,800	1,106	15,262,800
三ツ星ベルト	27,000	373	10,071,000
バンドー化学	34,000	288	9,792,000
鬼怒川ゴム	22,000	368	8,096,000
旭 硝 子	392,000	941	368,872,000
日本板硝子	243,000	235	57,105,000
有沢製作所	13,900	621	8,631,900
日本山村硝子	36,000	237	8,532,000
日本電気硝子	139,000	1,130	157,070,000
オハラ	3,700	1,384	5,120,800
住友大阪セメント	151,000	174	26,274,000
太平洋セメント	321,000	121	38,841,000
東海カーボン	84,000	455	38,220,000
日本カーボン	48,000	268	12,864,000
東洋炭素	4,000	3,890	15,560,000
ノリタケ	50,000	284	14,200,000
TOTO	125,000	568	71,000,000
日本碍子	95,000	1,623	154,185,000
日本特殊陶業	70,000	1,107	77,490,000

MARUWA	2,500	1,900	4,750,000
品川リフラクトリーズ	24,000	252	6,048,000
黒崎播磨	22,000	346	7,612,000
フジミインコーポレーテッド	8,200	1,271	10,422,200
ニチアス	44,000	332	14,608,000
新日本製鐵	2,248,000	306	687,888,000
住友金属工業	1,466,000	216	316,656,000
神戸製鋼所	1,112,000	181	201,272,000
日新製鋼	309,000	155	47,895,000
中山製鋼所	47,000	150	7,050,000
合同製鐵	49,000	193	9,457,000
J F Eホールディングス	171,600	2,891	496,095,600
東京製鐵	39,800	949	37,770,200
共英製鋼	8,100	1,279	10,359,900
大和工業	19,900	2,338	46,526,200
東京鐵鋼	20,000	213	4,260,000
大阪製鐵	5,200	1,192	6,198,400
淀川製鋼所	61,000	373	22,753,000
東洋鋼鋳	19,000	429	8,151,000
丸一鋼管	23,500	1,594	37,459,000
モリ工業	17,000	323	5,491,000
大同特殊鋼	133,000	357	47,481,000
日本高周波	58,000	107	6,206,000
日本金属工業	68,000	127	8,636,000
日本冶金工	51,000	289	14,739,000
山陽特殊鋼	44,000	409	17,996,000
愛知製鋼	47,000	355	16,685,000
日立金属	46,000	870	40,020,000
日本金属	32,000	143	4,576,000
大平洋金属	63,000	638	40,194,000
日本電工	40,000	586	23,440,000
栗本鉄工所	52,000	114	5,928,000
日本製鋼所	125,000	808	101,000,000
三菱製鋼	55,000	176	9,680,000
日本軽金属	209,000	120	25,080,000
三井金属	242,000	260	62,920,000
東邦亜鉛	45,000	340	15,300,000
三菱マテリアル	461,000	240	110,640,000
住友鋁山	208,000	1,219	253,552,000
DOWAホールディングス	96,000	464	44,544,000
古河機金	162,000	97	15,714,000
大阪チタニウム	8,600	2,938	25,266,800
東邦チタニウム	14,200	1,767	25,091,400
住友軽金属	129,000	100	12,900,000
古河スカイ	42,000	261	10,962,000
古河電工	257,000	381	97,917,000
住友電工	263,100	1,059	278,622,900
フジクラ	124,000	421	52,204,000
昭和電線HLDGS	120,000	85	10,200,000
タツタ電線	25,000	199	4,975,000
日立電線	69,000	236	16,284,000
リョービ	51,000	307	15,657,000
アサヒHD	12,500	1,662	20,775,000
東洋製罐	61,200	1,345	82,314,000
横河ブリッジHLDGS	18,000	557	10,026,000

三和ホールディングス	82,000	277	22,714,000
文化シヤッター	29,000	243	7,047,000
住生活グループ	104,400	1,745	182,178,000
日本ファイルコン	8,100	440	3,564,000
ノーリツ	13,800	1,621	22,369,800
長府製作所	9,100	1,898	17,271,800
リンナイ	13,700	4,590	62,883,000
ユニプレス	12,200	1,453	17,726,600
日東精工	18,000	265	4,770,000
三洋工業	31,000	125	3,875,000
岡 部	22,600	365	8,249,000
日立ツール	5,600	995	5,572,000
東 プ レ	17,600	653	11,492,800
高周波熱錬	13,700	630	8,631,000
東京製綱	61,000	214	13,054,000
日本発条	56,000	885	49,560,000
三浦工業	11,700	2,148	25,131,600
タ ク マ	36,000	214	7,704,000
ツ ガ ミ	27,000	574	15,498,000
オークマ	59,000	522	30,798,000
東芝機械	45,000	354	15,930,000
ア マ ダ	132,000	622	82,104,000
アイダエンジニア	22,900	357	8,175,300
牧野フライス	43,000	552	23,736,000
オーエスジー	36,400	975	35,490,000
旭ダイヤモンド	22,000	1,274	28,028,000
森精機製作所	34,300	908	31,144,400
ディスコ	7,900	6,190	48,901,000
日東工器	5,100	1,777	9,062,700
豊田自動織機	65,900	2,360	155,524,000
大阪機工	54,000	115	6,210,000
オーエム製作所	12,000	280	3,360,000
津田駒工業	35,000	150	5,250,000
島精機製作所	10,700	2,095	22,416,500
日阪製作所	11,000	870	9,570,000
やまびこ	4,400	822	3,616,800
ナブテスコ	33,000	1,238	40,854,000
三井海洋開発	6,200	1,296	8,035,200
SMC	25,400	11,550	293,370,000
新川	7,300	1,326	9,679,800
ホソカワミクロン	18,000	318	5,724,000
ユニオンツール	5,600	2,254	12,622,400
オイレス工業	10,300	1,287	13,256,100
サトー	10,000	997	9,970,000
日精樹脂工業	11,800	262	3,091,600
小松製作所	355,100	1,624	576,682,400
住友重機械	172,000	507	87,204,000
日立建機	34,100	1,736	59,197,600
井関農機	88,000	225	19,800,000
TOWA	10,100	715	7,221,500
丸山製作所	29,000	171	4,959,000
北川鉄工所	48,000	150	7,200,000
クボタ	325,000	733	238,225,000
東洋エンジニア	56,000	266	14,896,000
三菱化工機	30,000	195	5,850,000

月島機械	15,000	631	9,465,000
帝国電機製作所	3,400	1,560	5,304,000
東京機械	47,000	108	5,076,000
新東工業	16,700	705	11,773,500
アイチ コーポレーション	16,800	373	6,266,400
小森コーポレーション	24,000	902	21,648,000
住友精密	20,000	292	5,840,000
酒井重工業	30,000	136	4,080,000
荏原製作所	167,000	384	64,128,000
西島製作所	8,200	1,460	11,972,000
千代田化工建	67,000	663	44,421,000
ダイキン工業	89,300	2,856	255,040,800
オルガノ	16,000	601	9,616,000
トーヨーカネツ	51,000	150	7,650,000
栗田工業	43,900	2,366	103,867,400
椿本チエイン	46,000	378	17,388,000
日 機 装	26,000	670	17,420,000
木村化工機	8,700	693	6,029,100
新興プランテック	16,100	798	12,847,800
アネスト岩田	20,000	292	5,840,000
ダイフク	32,500	572	18,590,000
加藤製作所	26,000	176	4,576,000
油研工業	29,000	196	5,684,000
タダノ	38,000	416	15,808,000
フジテック	21,000	479	10,059,000
シーケーディ	22,700	684	15,526,800
平和	15,300	916	14,014,800
理想科学工業	7,500	988	7,410,000
SANKYO	22,200	3,850	85,470,000
日本金銭機械	8,500	712	6,052,000
マースエンジニアリング	3,900	1,512	5,896,800
ダイコク電機	3,200	1,225	3,920,000
ア マ ノ	23,800	755	17,969,000
JUK I	61,000	180	10,980,000
サンデン	52,000	245	12,740,000
ブラザー工業	106,000	986	104,516,000
マックス	15,000	893	13,395,000
グローリー	23,100	2,037	47,054,700
大和冷機工業	11,000	421	4,631,000
セガサミーホールディングス	86,600	1,191	103,140,600
日本ピストンリング	57,000	115	6,555,000
リ ケ ン	37,000	298	11,026,000
帝国ピストン	12,300	710	8,733,000
ホシザキ電機	15,700	1,490	23,393,000
大豊工業	8,100	712	5,767,200
日本精工	157,000	643	100,951,000
N T N	181,000	361	65,341,000
ジェイテクト	75,000	893	66,975,000
不 二 越	88,000	241	21,208,000
ミネベア	115,000	501	57,615,000
日本トムソン	29,000	567	16,443,000
T H K	51,300	1,841	94,443,300
ユーシン精機	4,300	1,441	6,196,300
イーグル工業	11,000	620	6,820,000
キッツ	39,000	426	16,614,000

日 立	1,745,000	345	602,025,000
東 芝	1,731,000	446	772,026,000
三菱電機	710,000	713	506,230,000
富士電機H L D G S	215,000	248	53,320,000
東洋電機製造	14,000	426	5,964,000
安川電機	91,000	710	64,610,000
シンフォニア テクノロジー	50,000	180	9,000,000
明 電 舎	80,000	343	27,440,000
オリジン電気	15,000	385	5,775,000
デンヨー	8,700	623	5,420,100
日立工機	22,000	830	18,260,000
三桜工業	11,600	685	7,946,000
マキタ	49,800	2,563	127,637,400
東芝テック	54,000	319	17,226,000
芝浦メカトロニクス	15,000	441	6,615,000
マブチモーター	11,000	4,485	49,335,000
日本電産	36,700	8,500	311,950,000
高岳製作所	36,000	297	10,692,000
ダイヘン	43,000	372	15,996,000
日新電機	15,000	445	6,675,000
大崎電気	13,000	756	9,828,000
オムロン	91,000	1,876	170,716,000
日東工業	12,700	885	11,239,500
I D E C	12,700	738	9,372,600
エルピーダメモリ	80,900	1,713	138,581,700
ジーエス・ユアサ コーポ	152,000	597	90,744,000
サクサホールディングス	27,000	146	3,942,000
メルコホールディングス	4,200	2,462	10,340,400
日本電気	1,002,000	242	242,484,000
富 士 通	790,000	552	436,080,000
沖 電 気	280,000	81	22,680,000
岩崎通信機	54,000	75	4,050,000
電気興業	24,000	404	9,696,000
サンケン電気	47,000	379	17,813,000
アイホン	5,700	1,374	7,831,800
ルネサスエレクトロニクス	19,900	894	17,790,600
セイコーエプソン	61,700	1,188	73,299,600
ワコム	157	134,500	21,116,500
アルバック	13,600	1,879	25,554,400
ナナオ	6,300	1,912	12,045,600
日本信号	19,900	659	13,114,100
京三製作所	19,000	406	7,714,000
能美防災	10,000	532	5,320,000
ホーチキ	9,000	463	4,167,000
マスプロ電工	7,700	822	6,329,400
日本無線	32,000	210	6,720,000
パナソニック	749,500	1,169	876,165,500
シャープ	368,000	949	349,232,000
アンリツ	42,000	377	15,834,000
富士通ゼネラル	23,000	432	9,936,000
日立国際電気	19,000	795	15,105,000
ソ ニ ー	409,900	2,639	1,081,726,100
T D K	39,800	5,080	202,184,000
帝国通信工業	26,000	205	5,330,000
三洋電機	819,000	126	103,194,000

ミツミ電機	25,600	1,552	39,731,200
タムラ製作所	24,000	261	6,264,000
アルプス電気	67,300	865	58,214,500
池上通信機	44,000	75	3,300,000
パイオニア	67,700	319	21,596,300
日本電波工業	5,900	1,626	9,593,400
日本トリム	2,250	1,781	4,007,250
ローランド ディー. ジー.	3,600	1,297	4,669,200
フオスター電機	7,000	2,403	16,821,000
クラリオン	52,000	164	8,528,000
S M K	26,000	404	10,504,000
ヨコオ	10,000	572	5,720,000
ホシデン	21,200	1,009	21,390,800
ヒロセ電機	13,100	8,150	106,765,000
日本航空電子	17,000	601	10,217,000
T O A	12,000	490	5,880,000
ユニデン	27,000	238	6,426,000
アルパイン	17,000	1,105	18,785,000
スミダコーポレーション	7,200	1,038	7,473,600
アイコム	4,500	2,318	10,431,000
船井電機	6,600	3,395	22,407,000
横河電機	83,600	622	51,999,200
新電元工業	29,000	282	8,178,000
山武	20,900	2,218	46,356,200
日本光電工業	14,700	1,795	26,386,500
チ ノ ー	22,000	229	5,038,000
堀場製作所	13,200	2,408	31,785,600
アドバンテスト	56,700	2,001	113,456,700
小野測器	14,000	296	4,144,000
エスベック	9,000	628	5,652,000
サンクス	10,800	400	4,320,000
キーエンス	15,400	20,320	312,928,000
日置電機	4,200	1,818	7,635,600
シスメックス	14,300	5,200	74,360,000
メガチップス	7,100	1,289	9,151,900
O B A R A	6,800	988	6,718,400
東京電波	5,200	578	3,005,600
デンソー	180,000	2,476	445,680,000
コーセル	11,400	1,203	13,714,200
日立メディコ	6,000	737	4,422,000
オプテックス	6,400	942	6,028,800
千代田インテグレ	5,400	1,185	6,399,000
スタンレー電気	51,200	1,612	82,534,400
岩崎電気	35,000	174	6,090,000
ウシオ電機	46,400	1,385	64,264,000
日本セラミック	5,200	1,220	6,344,000
新神戸電機	8,000	725	5,800,000
日本デジタル研究所	8,400	981	8,240,400
古河電池	6,000	607	3,642,000
双信電機	7,500	376	2,820,000
図 研	7,300	665	4,854,500
日本電子	32,000	313	10,016,000
カ シ オ	87,700	585	51,304,500
ファナック	79,200	9,320	738,144,000
日本シイエムケイ	17,200	499	8,582,800

エンプラス	4,700	1,786	8,394,200	
ローム	37,700	5,540	208,858,000	
浜松ホトニクス	29,900	2,541	75,975,900	
三井ハイテック	11,700	665	7,780,500	
新光電気工業	21,300	1,317	28,052,100	
京セラ	63,200	7,660	484,112,000	
太陽誘電	32,000	1,205	38,560,000	
村田製作所	85,700	4,355	373,223,500	
ユーシン	10,700	737	7,885,900	
双葉電子工業	14,200	1,501	21,314,200	
日東電工	66,400	3,090	205,176,000	
北陸電気工業	37,000	173	6,401,000	
パナソニック電工	133,000	904	120,232,000	
東海理化電機	19,700	1,693	33,352,100	
ニチコン	26,800	1,023	27,416,400	
日本ケミコン	42,000	392	16,464,000	
K O A	11,300	844	9,537,200	
三井造船	326,000	196	63,896,000	
日立造船	355,000	118	41,890,000	
佐世保重工業	58,000	174	10,092,000	
三菱重工業	1,286,000	327	420,522,000	
川崎重工業	601,000	244	146,644,000	
I H I	569,000	146	83,074,000	
日本車輛	32,000	404	12,928,000	
近畿車輛	14,000	412	5,768,000	
日産自動車	920,800	634	583,787,200	
いすゞ自動車	528,000	276	145,728,000	
トヨタ自動車	1,054,600	3,210	3,385,266,000	※
日野自動車	108,000	451	48,708,000	
三菱自動車工業	1,709,000	116	198,244,000	
武蔵精密工業	8,400	1,972	16,564,800	
トヨタ車体	15,400	1,178	18,141,200	
日産車体	33,000	600	19,800,000	
関東自動車	14,600	718	10,482,800	
新明和工業	37,000	337	12,469,000	
極東開発工業	17,700	306	5,416,200	
日信工業	14,000	1,396	19,544,000	
トピー工業	73,000	184	13,432,000	
ティラド	30,000	263	7,890,000	
曙ブレーキ	27,700	420	11,634,000	
タチエス	11,800	862	10,171,600	
N O K	40,000	1,483	59,320,000	
カヤバ工業	56,000	319	17,864,000	
大同メタル工業	16,000	328	5,248,000	
プレス工業	45,000	281	12,645,000	
カルソニックカンセイ	61,000	274	16,714,000	
太平洋工業	19,000	423	8,037,000	
ケーヒン	15,900	1,704	27,093,600	
アイシン精機	67,500	2,493	168,277,500	
マツダ	510,000	227	115,770,000	
ダイハツ	77,000	826	63,602,000	
愛知機械	21,000	271	5,691,000	
今仙電機製作所	6,800	1,209	8,221,200	
本田技研	654,400	2,696	1,764,262,400	
スズキ	152,400	1,833	279,349,200	

富士重工業	263,000	561	147,543,000
ヤマハ発動機	96,000	1,302	124,992,000
ショーワ	18,700	523	9,780,100
小糸製作所	38,000	1,355	51,490,000
エクセディ	10,300	2,171	22,361,300
ミツバ	16,000	503	8,048,000
豊田合成	23,600	2,350	55,460,000
愛三工業	9,600	675	6,480,000
ヨ ロ ズ	5,800	1,367	7,928,600
エフ・シー・シー	11,300	1,710	19,323,000
シマノ	31,400	3,600	113,040,000
タカタ	12,800	2,031	25,996,800
テイ・エス テック	16,000	1,491	23,856,000
小 野 建	7,500	782	5,865,000
はるやま商事	7,900	363	2,867,700
佐島電機	8,300	720	5,976,000
カッパクリエイト	5,700	1,810	10,317,000
伯東	5,400	819	4,422,600
ライトオン	7,800	687	5,358,600
ナガイレーベン	5,300	2,121	11,241,300
ジーンズメイト	7,400	343	2,538,200
菱食	8,000	1,961	15,688,000
良品計画	8,900	3,520	31,328,000
三城ホールディングス	10,900	683	7,444,700
松田産業	5,400	1,370	7,398,000
メディパルHD	80,200	1,027	82,365,400
アドヴァン	8,400	582	4,888,800
アズワン	5,600	1,626	9,105,600
シモジマ	6,900	1,133	7,817,700
ドウシシャ	4,300	1,987	8,544,100
コナカ	15,100	274	4,137,400
コ ジ マ	12,100	590	7,139,000
コーナン商事	7,700	994	7,653,800
黒田電気	11,300	1,229	13,887,700
ネットワンシステムズ	163	111,600	18,190,800
ワタミ	8,900	1,626	14,471,400
ドン・キホーテ	13,200	2,327	30,716,400
丸文	8,400	542	4,552,800
メガネトップ	7,800	597	4,656,600
西松屋チェーン	18,700	886	16,568,200
ゼンショー	31,300	838	26,229,400
ハピネット	3,300	1,099	3,626,700
幸楽苑	5,800	1,207	7,000,600
トーメンエレクトロニクス	3,100	998	3,093,800
サイゼリヤ	12,500	1,805	22,562,500
エクセル	3,500	1,015	3,552,500
ガリバーインターナショナル	2,050	2,861	5,865,050
日本エム・ディ・エム	13,300	235	3,125,500
ユナイテッドアローズ	9,500	1,127	10,706,500
シークス	5,800	1,010	5,858,000
京都きもの友禅	6,500	862	5,603,000
コロワイド	20,000	440	8,800,000
壺番屋	3,100	2,169	6,723,900
マクニカ	3,200	1,845	5,904,000
スギホールディングス	11,500	1,780	20,470,000

島津製作所	90,000	658	59,220,000
J M S	13,000	336	4,368,000
アロカ	5,400	706	3,812,400
モリテックス	5,600	243	1,360,800
長野計器	7,000	613	4,291,000
スター精密	16,800	894	15,019,200
東京計器	37,000	121	4,477,000
東京精密	16,300	1,357	22,119,100
ニコン	143,400	1,634	234,315,600
トプコン	17,600	457	8,043,200
オリンパス	90,000	2,267	204,030,000
大日本スクリーン	88,000	427	37,576,000
キヤノン電子	7,600	2,200	16,720,000
タムロン	7,800	1,266	9,874,800
HOYA	176,900	2,107	372,728,300
ノーリツ銅機	8,200	648	5,313,600
エー・アンド・デイ	9,000	471	4,239,000
キヤノン	478,300	3,675	1,757,752,500
リ コ ー	228,000	1,274	290,472,000
日本電産コパル	8,200	1,296	10,627,200
日本電産サンキョー	20,000	741	14,820,000
シチズンホールディングス	93,000	519	48,267,000
リズム時計	50,000	138	6,900,000
バンダイナムコHLDGS	89,800	792	71,121,600
フランスベッドHLDGS	67,000	130	8,710,000
パイロットコーポレーション	76	129,300	9,826,800
エイベックス・グループHD	14,700	1,110	16,317,000
トッパン・フォームズ	15,700	902	14,161,400
フジシールインターナショナル	8,000	1,900	15,200,000
タカラトミー	25,700	678	17,424,600
廣済堂	14,900	152	2,264,800
レック	3,700	1,279	4,732,300
タカノ	6,500	563	3,659,500
プロネクス	12,300	498	6,125,400
大建工業	40,000	211	8,440,000
き も と	8,000	542	4,336,000
凸版印刷	232,000	749	173,768,000
大日本印刷	230,000	1,072	246,560,000
共同印刷	32,000	214	6,848,000
日本写真印刷	13,000	2,637	34,281,000
光村印刷	18,000	303	5,454,000
藤森工業	6,400	1,172	7,500,800
宝印刷	7,800	681	5,311,800
前澤化成工業	8,200	837	6,863,400
アシックス	73,000	795	58,035,000
ツ ツ ミ	4,400	1,975	8,690,000
ニ チ ハ	10,600	892	9,455,200
ローランド	6,800	1,005	6,834,000
エフピコ	3,900	4,530	17,667,000
ヤマハ	56,800	903	51,290,400
河合楽器	43,000	170	7,310,000
クリナップ	9,600	531	5,097,600
ピジョン	4,900	3,180	15,582,000
天馬	8,000	985	7,880,000
パラマウントベッド	8,700	1,650	14,355,000

兼松日産農林	24,000	126	3,024,000
リンテック	17,700	1,578	27,930,600
信越ポリマー	16,100	569	9,160,900
東 リ	36,000	156	5,616,000
イトーキ	26,800	269	7,209,200
任 天 堂	43,300	25,810	1,117,573,000
三菱鉛筆	7,500	1,219	9,142,500
タカラスタンダード	39,000	528	20,592,000
コ ク ヨ	43,600	785	34,226,000
ナカバヤシ	33,000	179	5,907,000
ニ フ コ	18,500	1,839	34,021,500
グローブライド	68,000	98	6,664,000
岡村製作所	33,000	523	17,259,000
日本バルカー	44,000	189	8,316,000
MUTOHホールディングス	19,000	134	2,546,000
伊 藤 忠	524,000	729	381,996,000
丸 紅	620,000	489	303,180,000
高 島	27,000	135	3,645,000
F&Aアクアホールディングス	7,300	839	6,124,700
三陽商会	42,000	308	12,936,000
長瀬産業	42,000	953	40,026,000
豊田通商	71,900	1,240	89,156,000
オンワードホールディングス	54,000	647	34,938,000
三共生興	21,100	242	5,106,200
兼 松	190,000	70	13,300,000
美 津 濃	43,000	376	16,168,000
フアミリーマート	24,800	2,839	70,407,200
ルック	34,000	217	7,378,000
三井物産	650,900	1,181	768,712,900
日本紙パルプ	42,000	291	12,222,000
東京エレクトロン	64,500	5,270	339,915,000
日立ハイテクノロジーズ	24,400	1,738	42,407,200
東都水産	22,000	143	3,146,000
セイコーHD	35,000	234	8,190,000
山 善	33,200	414	13,744,800
住友商事	413,300	938	387,675,400
日本ユニシス	20,800	648	13,478,400
内田洋行	24,000	265	6,360,000
三菱商事	603,900	1,864	1,125,669,600
第一実業	27,000	278	7,506,000
キャノンマーケティングJPN	27,500	1,328	36,520,000
西華産業	33,000	187	6,171,000
菱洋エレクトロ	9,000	875	7,875,000
ユアサ商事	103,000	79	8,137,000
神鋼商事	29,000	180	5,220,000
阪和興業	83,000	360	29,880,000
菱電商事	15,000	475	7,125,000
ニプロ	16,400	1,681	27,568,400
岩谷産業	84,000	251	21,084,000
すてきナイスグループ	43,000	193	8,299,000
昭光通商	57,000	124	7,068,000
ニチモウ	33,000	155	5,115,000
兼松エレクトロニクス	6,800	807	5,487,600
三愛石油	23,000	345	7,935,000
稲畑産業	22,500	446	10,035,000

G S I クレオス	37,000	110	4,070,000
明和産業	18,200	218	3,967,600
東京スタイル	29,000	706	20,474,000
ユニ・チャーム	15,300	9,290	142,137,000
デサント	25,000	523	13,075,000
東邦ホールディングス	21,400	1,381	29,553,400
サンゲツ	14,100	1,873	26,409,300
ミツウロコ	14,500	567	8,221,500
シナネン	25,000	366	9,150,000
伊藤忠エネクス	21,100	463	9,769,300
ザ・トーカイ	23,000	384	8,832,000
サンリオ	24,200	898	21,731,600
リョーサン	11,200	2,206	24,707,200
新光商事	8,100	778	6,301,800
三信電気	9,000	780	7,020,000
東陽テクニカ	14,400	897	12,916,800
モスフード サービス	10,700	1,479	15,825,300
加賀電子	8,500	855	7,267,500
三益半導体	6,800	1,145	7,786,000
木曽路	8,800	1,794	15,787,200
千 趣 会	16,200	488	7,905,600
ケーヨー	17,300	438	7,577,400
アデランスホールディングス	10,300	1,050	10,815,000
上新電機	18,000	844	15,192,000
日本瓦斯	9,800	1,304	12,779,200
ベスト電器	27,500	230	6,325,000
マルエツ	20,000	342	6,840,000
ロイヤルホールディングス	13,000	905	11,765,000
いなげや	8,000	914	7,312,000
島 忠	18,800	1,698	31,922,400
チヨダ	11,300	1,104	12,475,200
ライフコーポレーション	5,000	1,356	6,780,000
カ ス ミ	21,400	447	9,565,800
リンガーハット	6,500	968	6,292,000
A O K I ホールディングス	7,900	1,368	10,807,200
オークワ	11,000	876	9,636,000
コメリ	9,600	2,104	20,198,400
青山商事	19,300	1,591	30,706,300
しまむら	8,400	8,080	67,872,000
C F S コーポレーション	10,000	467	4,670,000
高 島 屋	104,000	749	77,896,000
松 屋	16,000	809	12,944,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	570	24,510,000
丸 栄	30,000	120	3,600,000
ニッセンHD	19,400	327	6,343,800
パ ル コ	22,500	695	15,637,500
丸井グループ	93,200	633	58,995,600
クレディセゾン	59,500	1,044	62,118,000
セディナ	65,900	137	9,028,300
ダイエー	38,100	386	14,706,600
イズミヤ	29,000	399	11,571,000
イオン	265,500	924	245,322,000
ユ ニ ー	64,100	682	43,716,200
イ ズ ミ	22,600	1,196	27,029,600
平 和 堂	15,800	1,097	17,332,600

フ ジ	9,200	1,532	14,094,400
ヤオコー	3,900	2,472	9,640,800
ゼビオ	8,700	1,648	14,337,600
ケースホールディングス	15,800	2,029	32,058,200
新生銀行	379,000	93	35,247,000
あおぞら銀行	250,000	108	27,000,000
三菱UFJフィナンシャルG	5,769,000	428	2,469,132,000
りそなホールディングス	215,300	1,101	237,045,300
中央三井トラストHD	426,000	318	135,468,000
三井住友フィナンシャルG	577,700	2,631	1,519,928,700
第四銀行	105,000	277	29,085,000
北越銀行	97,000	143	13,871,000
西日本シティ銀行	259,000	247	63,973,000
札幌北洋ホール	111,000	332	36,852,000
千葉銀行	297,000	545	161,865,000
横浜銀行	520,000	424	220,480,000
常陽銀行	290,000	344	99,760,000
群馬銀行	188,000	466	87,608,000
武蔵野銀行	12,700	2,390	30,353,000
千葉興業銀行	17,300	618	10,691,400
筑波銀行	30,400	247	7,508,800
東京都民銀行	15,500	995	15,422,500
七十七銀行	125,000	456	57,000,000
青森銀行	61,000	211	12,871,000
秋田銀行	57,000	305	17,385,000
山形銀行	47,000	398	18,706,000
岩手銀行	5,300	4,700	24,910,000
東邦銀行	71,000	263	18,673,000
東北銀行	68,000	133	9,044,000
みちのく銀行	47,000	175	8,225,000
ふくおかフィナンシャルG	307,000	369	113,283,000
静岡銀行	235,000	756	177,660,000
十六銀行	100,000	316	31,600,000
スルガ銀行	79,000	803	63,437,000
八十二銀行	151,000	492	74,292,000
山梨中央銀行	52,000	345	17,940,000
大垣共立銀行	110,000	276	30,360,000
福井銀行	71,000	273	19,383,000
北國銀行	87,000	306	26,622,000
清水銀行	3,100	3,285	10,183,500
滋賀銀行	74,000	489	36,186,000
南都銀行	74,000	425	31,450,000
百五銀行	74,000	372	27,528,000
京都銀行	133,000	709	94,297,000
三重銀行	38,000	247	9,386,000
ほくほくフィナンシャルG	521,000	165	85,965,000
広島銀行	216,000	351	75,816,000
山陰合同銀行	48,000	642	30,816,000
中国銀行	65,000	1,024	66,560,000
鳥取銀行	33,000	246	8,118,000
伊予銀行	90,000	793	71,370,000
百十四銀行	90,000	317	28,530,000
四国銀行	61,000	273	16,653,000
阿波銀行	67,000	519	34,773,000
鹿児島銀行	51,000	552	28,152,000

大分銀行	55,000	290	15,950,000
宮崎銀行	45,000	217	9,765,000
肥後銀行	62,000	457	28,334,000
佐賀銀行	50,000	254	12,700,000
十八銀行	55,000	233	12,815,000
沖縄銀行	6,400	3,125	20,000,000
琉球銀行	16,900	1,000	16,900,000
住友信託	689,000	474	326,586,000
みずほ信託銀行	661,000	77	50,897,000
八千代銀行	4,800	1,796	8,620,800
みずほフィナンシャルG	6,659,700	161	1,072,211,700
紀陽ホールディングス	303,000	115	34,845,000
山口フィナンシャルG	74,000	844	62,456,000
芙蓉総合リース	7,600	2,273	17,274,800
興銀リース	11,900	1,574	18,730,600
東京センチュリーリース	20,000	1,125	22,500,000
SBIホールディングス	7,372	14,530	107,115,160
日本証券金融	35,000	537	18,795,000
大阪証券金融	19,000	178	3,382,000
ポケットカード	15,600	243	3,790,800
長野銀行	39,000	171	6,669,000
名古屋銀行	75,000	308	23,100,000
愛知銀行	3,000	5,750	17,250,000
第三銀行	54,000	245	13,230,000
中京銀行	36,000	248	8,928,000
東日本銀行	47,000	163	7,661,000
愛媛銀行	54,000	222	11,988,000
トマト銀行	43,000	173	7,439,000
みなと銀行	91,000	114	10,374,000
京葉銀行	65,000	434	28,210,000
関西アーバン銀行	86,000	129	11,094,000
栃木銀行	43,000	356	15,308,000
北日本銀行	3,300	2,227	7,349,100
東和銀行	109,000	69	7,521,000
福島銀行	136,000	51	6,936,000
リコーリース	6,200	1,993	12,356,600
イオン クレジットサービス	36,700	869	31,892,300
アコム	21,000	1,174	24,654,000
プロミス	35,300	650	22,945,000
ジャックス	53,000	167	8,851,000
日立キャピタル	19,900	1,255	24,974,500
オリックス	39,580	6,550	259,249,000
三菱UFJリース	20,840	3,475	72,419,000
ジャフコ	11,700	2,205	25,798,500
トモニホールディングス	52,000	275	14,300,000
大和証券G本社	718,000	389	279,302,000
野村ホールディングス	1,519,800	533	810,053,400
みずほ証券	206,000	222	45,732,000
みずほインベスタズ証	188,000	87	16,356,000
岡三証券グループ	65,000	349	22,685,000
丸三証券	26,100	517	13,493,700
東洋証券	38,000	151	5,738,000
東海東京HD	86,000	320	27,520,000
光世証券	43,000	92	3,956,000
水戸証券	31,000	188	5,828,000

いちよし証券	18,700	587	10,976,900
松井証券	49,300	595	29,333,500
NK S Jホールディングス	595,000	568	337,960,000
マネックスG	494	37,650	18,599,100
カブドットコム証券	25,800	423	10,913,400
極東証券	11,400	753	8,584,200
岩井証券	8,700	665	5,785,500
フィデアホール	46,700	162	7,565,400
池田泉州HD	264,300	132	34,887,600
MS & A D	225,000	2,106	473,850,000
SONY FH	254	291,700	74,091,800
第一生命	3,250	136,700	444,275,000
富士火災	108,000	140	15,120,000
東京海上HD	306,700	2,452	752,028,400
T & Dホールディングス	138,850	2,011	279,227,350
三井不動産	338,000	1,333	450,554,000
三菱地所	533,000	1,319	703,027,000
平和不動産	65,500	225	14,737,500
東京建物	119,000	317	37,723,000
ダイビル	23,000	739	16,997,000
サンケイビル	16,100	526	8,468,600
東急不動産	156,000	323	50,388,000
京阪神不動産	15,400	410	6,314,000
住友不動産	184,000	1,562	287,408,000
大京	92,000	169	15,548,000
テーオーシー	35,100	340	11,934,000
東京楽天地	18,000	343	6,174,000
レオパレス21	56,600	318	17,998,800
空港施設	13,300	374	4,974,200
住友不動産販売	3,280	4,150	13,612,000
ゴールドクレスト	5,960	1,833	10,924,680
東栄住宅	5,700	849	4,839,300
日本エスリード	4,500	720	3,240,000
東急リバブル	8,900	873	7,769,700
飯田産業	8,000	727	5,816,000
日神不動産	7,100	617	4,380,700
アーネストワン	14,200	874	12,410,800
イオンモール	37,500	1,732	64,950,000
タクトホーム	49	72,700	3,562,300
リサ・パートナーズ	122	39,150	4,776,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	518	74,600	38,642,800
東武鉄道	331,000	466	154,246,000
相鉄ホールディングス	119,000	385	45,815,000
東京急行	427,000	356	152,012,000
京浜急行	209,000	763	159,467,000
小田急電鉄	245,000	740	181,300,000
京王電鉄	212,000	546	115,752,000
京成電鉄	119,000	498	59,262,000
富士急行	27,000	461	12,447,000
新京成電鉄	22,000	351	7,722,000
東日本旅客鉄道	142,000	5,810	825,020,000
西日本旅客鉄道	663	320,500	212,491,500
東海旅客鉄道	654	748,000	489,192,000
西日本鉄道	109,000	354	38,586,000
ハマキョウレックス	3,000	2,347	7,041,000

近畿鉄道	702,000	266	186,732,000	
阪急阪神HLDGS	521,000	393	204,753,000	
南海電鉄	165,000	354	58,410,000	
京阪電鉄	171,000	367	62,757,000	
名古屋鉄道	270,000	246	66,420,000	
日本通運	325,000	402	130,650,000	
ヤマトホールディングス	155,000	1,226	190,030,000	
山 九	90,000	361	32,490,000	
日 新	38,000	197	7,486,000	
丸全昭和運輸	28,000	290	8,120,000	
センコー	30,000	362	10,860,000	
トナミホールディングス	25,000	183	4,575,000	
日本梱包運輸	24,000	1,002	24,048,000	
福山通運	58,000	446	25,868,000	
セイノーホールディングス	59,000	645	38,055,000	
神奈川中央交通	21,000	480	10,080,000	
日立物流	14,500	1,337	19,386,500	
日本郵船	567,000	326	184,842,000	
商船三井	372,000	629	233,988,000	
川崎汽船	199,000	359	71,441,000	
新和海運	32,000	256	8,192,000	
乾 汽 船	10,300	592	6,097,600	
明治海運	10,100	395	3,989,500	
飯野海運	38,700	467	18,072,900	
第一中央汽船	58,000	263	15,254,000	
全日本空輸	1,099,000	273	300,027,000	
パスコ	23,000	191	4,393,000	
三菱倉庫	56,000	1,045	58,520,000	
三井倉庫	36,000	334	12,024,000	
住友倉庫	57,000	430	24,510,000	
渋沢倉庫	26,000	301	7,826,000	
ヤマタネ	48,000	119	5,712,000	
東陽倉庫	34,000	186	6,324,000	
日本トランスシティ	22,000	283	6,226,000	
東洋埠頭	36,000	147	5,292,000	
上 組	90,000	706	63,540,000	
郵船航空サービス	7,300	1,361	9,935,300	
近鉄エクスプレス	6,800	2,197	14,939,600	
バンテック	45	117,400	5,283,000	
東京放送HD	43,700	1,262	55,149,400	
日本テレビ放送網	6,970	12,050	83,988,500	
テレビ朝日	203	130,700	26,532,100	
テレビ東京	3,600	1,777	6,397,200	
スカパーJ SATHD	639	31,550	20,160,450	
イー・アクセス	420	66,200	27,804,000	
NECモバイルリング	3,000	2,340	7,020,000	
日本電信電話	318,500	3,600	1,146,600,000	
KDDI	1,264	420,500	531,512,000	
光通信	11,100	1,578	17,515,800	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,717	133,400	896,047,800	※
GMOインターネット	25,800	370	9,546,000	
学研ホールディングス	40,000	172	6,880,000	
ゼンリン	11,700	979	11,454,300	
昭文社	7,400	556	4,114,400	
角川グループHLDGS	7,100	1,907	13,539,700	

東京電力	481,600	2,376	1,144,281,600
中部電力	257,200	2,152	553,494,400
関西電力	312,900	2,120	663,348,000
中国電力	112,900	1,748	197,349,200
北陸電力	78,700	1,867	146,932,900
東北電力	191,200	1,849	353,528,800
四国電力	84,600	2,400	203,040,000
九州電力	168,200	1,913	321,766,600
北海道電力	72,000	1,850	133,200,000
沖縄電力	5,700	4,510	25,707,000
電源開発	51,000	2,725	138,975,000
東京瓦斯	964,000	409	394,276,000
大阪瓦斯	826,000	318	262,668,000
東邦瓦斯	214,000	472	101,008,000
西部瓦斯	103,000	244	25,132,000
静岡瓦斯	26,000	591	15,366,000
松 竹	46,000	763	35,098,000
東 宝	59,600	1,403	83,618,800
エイチ・アイ・エス	8,500	1,672	14,212,000
東 映	33,000	401	13,233,000
N T Tデータ	503	332,000	166,996,000
共立メンテナンス	5,000	1,225	6,125,000
東京テアトル	44,000	134	5,896,000
よみうりランド	23,000	297	6,831,000
東京都競馬	68,000	126	8,568,000
常磐興産	40,000	128	5,120,000
カナモト	15,000	399	5,985,000
東京ドーム	65,000	228	14,820,000
D T S	10,100	1,085	10,958,500
スクウェア・エニックス・HD	21,100	1,642	34,646,200
シーイーシー	8,800	453	3,986,400
カプコン	18,200	1,503	27,354,600
日本空港ビルデング	20,000	1,221	24,420,000
トランス・コスモス	11,000	802	8,822,000
乃村工藝社	24,000	302	7,248,000
住商情報システム	9,500	1,251	11,884,500
藤田観光	26,000	346	8,996,000
日本管財	4,100	1,421	5,826,100
セコム	77,400	3,830	296,442,000
C S Kホールディングス	33,900	413	14,000,700
アイネス	12,200	624	7,612,800
メイテック	12,600	1,590	20,034,000
T K C	8,700	1,566	13,624,200
アサツー ディ・ケイ	15,500	2,083	32,286,500
富士ソフト	10,700	1,576	16,863,200
応用地質	10,200	721	7,354,200
日システム	18,200	972	17,690,400
コナミ	34,100	1,487	50,706,700
ベネッセホールディングス	27,000	4,045	109,215,000
イオンディライト	7,100	1,484	10,536,400
ニチイ学館	18,500	865	16,002,500
ダイセキ	14,500	1,848	26,796,000
トラスコ中山	10,100	1,410	14,241,000
ヤマダ電機	36,870	6,070	223,800,900
オートバックスセブン	9,600	3,155	30,288,000

アーランドサカモト	6,100	1,117	6,813,700
ニ ト リ	14,550	7,340	106,797,000
愛 眼	9,000	445	4,005,000
吉野家ホールディングス	223	94,700	21,118,100
加藤産業	12,100	1,387	16,782,700
イエローハット	8,800	573	5,042,400
富士エレクトロニクス	4,700	961	4,516,700
松屋フーズ	4,000	1,283	5,132,000
J B C Cホールディングス	11,700	500	5,850,000
J Kホールディングス	10,900	312	3,400,800
サガミチェーン	11,000	551	6,061,000
日 伝	3,800	2,356	8,952,800
因幡電機産業	8,200	2,103	17,244,600
住金物産	42,000	212	8,904,000
プレナス	9,500	1,215	11,542,500
ミニストップ	7,500	1,170	8,775,000
アークス	10,700	1,138	12,176,600
バ ロ ー	17,200	691	11,885,200
ミスミグループ本社	27,300	1,692	46,191,600
大 庄	5,500	1,015	5,582,500
タキヒヨー	14,000	379	5,306,000
ファーストリテイリング	18,900	12,670	239,463,000
ソフトバンク	331,700	2,197	728,744,900
スズケン	28,400	3,160	89,744,000
サンドラッグ	15,700	2,078	32,624,600
ベルーナ	13,350	424	5,660,400
合計	114,690,667		88,263,002,160

(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21年6月5日現在	平成22年6月7日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	226,529,605	87,772,667
国債証券	7,699,093,410	6,985,465,220
地方債証券	917,819,790	1,076,384,550
特殊債券	1,528,028,561	1,717,307,089
社債券	1,136,630,234	1,724,241,298
未収入金	—	123,101,280
未収利息	42,485,772	48,754,532
前払費用	5,978,365	3,359,488
流動資産合計	11,556,565,737	11,766,386,124
資産合計	11,556,565,737	11,766,386,124
負債の部		
流動負債		
未払金	163,617,200	159,232,680
未払解約金	—	676,000
流動負債合計	163,617,200	159,908,680
負債合計	163,617,200	159,908,680
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	10,781,184,152	10,596,073,751
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	611,764,385	1,010,403,693
元本等合計	11,392,948,537	11,606,477,444
純資産合計	11,392,948,537	11,606,477,444
負債純資産合計	11,556,565,737	11,766,386,124

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7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21年6月5日現在	平成22年6月7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	12,166,198,651円	10,781,184,152円
同期中における追加設定元本額	5,210,271,958円	1,746,906,177円
同期中における一部解約元本額	6,595,286,457円	1,932,016,578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 30	2,010,472,049円	2,115,446,961円
ダイワ・ライフ・バランス 50	8,680,542円	77,357,871円
ダイワ・ライフ・バランス 70	3,245,304円	20,892,688円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	80,138,302円	119,897,715円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	68,229,072円	93,024,671円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	12,856,247円	19,983,469円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	5,070,449円	9,838,671円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	590,303円	2,263,381円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	42,013円	32,944円
ダイワ世界バランスファンド 40 VA	4,637,722,661円	4,417,230,023円
ダイワ世界バランスファンド 60 VA	378,123,406円	380,711,697円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 50 VA	1,059,674,847円	1,027,655,861円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 75 VA	2,516,338,957円	2,311,737,799円
計	10,781,184,152円	10,596,073,751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	10,781,184,152口	10,596,073,751口

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年6月5日現在		平成22年6月7日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	7,699,093,410	△24,580,760	71,558,900
地方債証券	917,819,790	4,141,109	6,054,825
特殊債券	1,528,028,561	8,643,403	5,742,334
社債券	1,136,630,234	9,976,080	585,841

合計	11,281,571,995	△1,820,168	83,941,900
----	----------------	------------	------------

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年12月2日から平成21年6月5日まで、及び平成21年12月1日から平成22年6月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成20年6月6日から平成21年6月5日まで）

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。

（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成22年6月7日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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）	1.0567円 (10,567円)	1.0954円 (10,954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	2 8 3 2年国債	27,000,000	27,052,380	
	2 8 4 2年国債	92,000,000	92,191,360	
	2 8 5 2年国債	11,000,000	11,009,570	
	2 8 6 2年国債	40,000,000	40,094,000	
	2 8 7 2年国債	154,000,000	154,383,460	
	2 8 9 2年国債	86,000,000	86,093,740	
	2 9 0 2年国債	20,000,000	20,022,800	
	2 9 2 2年国債	12,000,000	12,013,800	
	6 0 5年国債	102,000,000	103,380,060	
	6 1 5年国債	30,000,000	30,485,100	
	6 2 5年国債	2,000,000	2,035,380	
	6 3 5年国債	70,000,000	71,313,900	
	6 8 5年国債	77,000,000	78,822,590	
	6 9 5年国債	30,000,000	30,558,900	
	7 2 5年国債	80,000,000	83,166,400	
	7 5 5年国債	1,000,000	1,029,320	
	7 7 5年国債	5,000,000	5,130,300	
	7 8 5年国債	18,000,000	18,431,820	
	7 9 5年国債	20,000,000	20,339,600	
	8 2 5年国債	30,000,000	30,740,700	
	8 3 5年国債	26,000,000	26,652,340	
	8 4 5年国債	21,000,000	21,359,730	
	8 5 5年国債	29,000,000	29,490,100	

8 6	5年国債	40,000,000	40,506,800
8 7	5年国債	7,000,000	7,051,520
8 8	5年国債	173,000,000	174,055,300
1	4 0年国債	24,000,000	25,788,240
2	4 0年国債	25,000,000	25,507,000
3	4 0年国債	6,000,000	6,123,360
2 3 4	1 0年国債	35,000,000	35,563,150
2 3 6	1 0年国債	10,000,000	10,207,400
2 3 7	1 0年国債	45,000,000	46,083,600
2 3 8	1 0年国債	9,000,000	9,200,790
2 4 0	1 0年国債	16,000,000	16,373,440
2 4 2	1 0年国債	14,000,000	14,333,900
2 4 3	1 0年国債	17,000,000	17,366,860
2 4 4	1 0年国債	6,000,000	6,126,120
2 4 5	1 0年国債	11,000,000	11,203,500
2 4 6	1 0年国債	15,000,000	15,239,850
2 4 8	1 0年国債	11,000,000	11,159,500
2 4 9	1 0年国債	33,000,000	33,387,090
2 5 0	1 0年国債	10,000,000	10,094,800
2 5 1	1 0年国債	13,000,000	13,279,760
2 5 2	1 0年国債	55,000,000	56,349,150
2 5 4	1 0年国債	8,000,000	8,312,720
2 5 6	1 0年国債	14,000,000	14,581,000
2 5 7	1 0年国債	15,000,000	15,569,850
2 5 8	1 0年国債	55,000,000	57,180,750
2 6 1	1 0年国債	22,000,000	23,345,520
2 6 2	1 0年国債	45,000,000	47,931,750
2 6 3	1 0年国債	6,000,000	6,332,220
2 6 4	1 0年国債	19,000,000	19,971,660
2 6 8	1 0年国債	10,000,000	10,537,600
2 6 9	1 0年国債	41,000,000	42,808,920
2 7 0	1 0年国債	8,000,000	8,363,040
2 7 1	1 0年国債	41,000,000	42,658,450
2 7 2	1 0年国債	130,000,000	136,685,900
2 7 4	1 0年国債	11,000,000	11,632,390
2 7 5	1 0年国債	30,000,000	31,562,700
2 7 6	1 0年国債	25,000,000	26,572,250
2 7 7	1 0年国債	35,000,000	37,223,550
2 7 8	1 0年国債	36,000,000	38,702,880
2 7 9	1 0年国債	102,000,000	110,805,660
2 8 0	1 0年国債	7,000,000	7,573,370
2 8 1	1 0年国債	27,000,000	29,369,520
2 8 2	1 0年国債	13,000,000	13,915,850
2 8 3	1 0年国債	57,000,000	61,361,640
2 8 4	1 0年国債	74,000,000	79,213,300
2 8 5	1 0年国債	31,000,000	33,176,820
2 8 6	1 0年国債	99,000,000	106,579,440
2 8 7	1 0年国債	72,000,000	78,048,000
2 8 8	1 0年国債	145,000,000	155,042,700
2 8 9	1 0年国債	167,000,000	175,924,480
2 9 0	1 0年国債	56,000,000	58,480,800
2 9 1	1 0年国債	54,000,000	55,976,400
2 9 2	1 0年国債	55,000,000	58,687,750
2 9 3	1 0年国債	66,000,000	70,844,400
2 9 4	1 0年国債	53,000,000	56,469,910
2 9 5	1 0年国債	59,000,000	61,951,180
2 9 6	1 0年国債	131,000,000	137,214,640

297	10年国債	16,000,000	16,587,520
298	10年国債	34,000,000	34,966,280
299	10年国債	103,000,000	105,620,320
300	10年国債	63,000,000	65,673,090
301	10年国債	135,000,000	140,297,400
302	10年国債	14,000,000	14,427,700
303	10年国債	115,000,000	118,102,700
304	10年国債	48,000,000	48,869,760
305	10年国債	191,000,000	193,708,380
306	10年国債	86,000,000	87,695,920
307	10年国債	84,000,000	84,882,840
2	30年国債	9,000,000	9,617,400
3	30年国債	4,000,000	4,198,000
4	30年国債	8,000,000	9,211,920
5	30年国債	3,000,000	3,095,400
6	30年国債	9,000,000	9,590,670
7	30年国債	7,000,000	7,331,380
8	30年国債	4,000,000	3,828,560
9	30年国債	11,000,000	9,696,280
10	30年国債	12,000,000	9,877,200
11	30年国債	13,000,000	12,108,200
12	30年国債	8,000,000	8,037,680
13	30年国債	5,000,000	4,929,000
14	30年国債	10,000,000	10,610,300
15	30年国債	8,000,000	8,642,080
16	30年国債	13,000,000	14,050,790
17	30年国債	11,000,000	11,685,520
18	30年国債	13,000,000	13,556,140
19	30年国債	10,000,000	10,430,700
20	30年国債	12,000,000	13,007,400
21	30年国債	14,000,000	14,623,280
22	30年国債	12,000,000	13,020,360
23	30年国債	15,000,000	16,283,700
24	30年国債	13,000,000	14,119,560
25	30年国債	10,000,000	10,447,500
26	30年国債	32,000,000	34,083,200
27	30年国債	30,000,000	32,589,900
28	30年国債	30,000,000	32,619,900
29	30年国債	37,000,000	39,494,910
30	30年国債	40,000,000	41,847,600
31	30年国債	39,000,000	39,960,570
32	30年国債	21,000,000	21,990,990
20	利付国債20年	15,000,000	16,839,750
30	利付国債20年	16,000,000	18,716,640
32	利付国債20年	8,000,000	9,456,240
33	利付国債20年	5,000,000	5,995,400
36	利付国債20年	33,000,000	38,349,960
37	利付国債20年	5,000,000	5,847,350
38	利付国債20年	11,000,000	12,562,000
39	20年国債	32,000,000	36,296,000
40	20年国債	36,000,000	39,960,360
41	20年国債	40,000,000	41,714,400
42	20年国債	13,000,000	14,761,370
43	20年国債	14,000,000	16,238,040
44	20年国債	18,000,000	20,233,080
45	20年国債	20,000,000	22,284,800
46	20年国債	19,000,000	20,794,360

47	20年国債	23,000,000	25,139,460
48	20年国債	9,000,000	10,103,310
49	20年国債	10,000,000	10,807,500
50	20年国債	30,000,000	31,822,200
51	20年国債	15,000,000	16,036,050
52	20年国債	14,000,000	15,094,520
53	20年国債	17,000,000	18,308,320
54	20年国債	14,000,000	15,225,000
55	20年国債	25,000,000	26,610,750
56	20年国債	15,000,000	15,942,750
57	20年国債	19,000,000	19,988,190
58	20年国債	21,000,000	22,053,780
59	20年国債	27,000,000	27,686,070
60	20年国債	8,000,000	7,932,320
61	20年国債	19,000,000	17,885,460
62	20年国債	17,000,000	15,508,760
63	20年国債	15,000,000	15,498,750
64	20年国債	25,000,000	26,078,250
65	20年国債	24,000,000	24,981,120
66	20年国債	11,000,000	11,313,830
67	20年国債	12,000,000	12,455,520
68	20年国債	19,000,000	20,436,590
69	20年国債	17,000,000	18,081,880
70	20年国債	31,000,000	34,094,730
71	20年国債	8,000,000	8,589,200
72	20年国債	37,000,000	39,218,520
73	20年国債	13,000,000	13,588,900
74	20年国債	25,000,000	26,457,750
75	20年国債	16,000,000	16,895,360
76	20年国債	23,000,000	23,682,870
77	20年国債	9,000,000	9,385,290
78	20年国債	5,000,000	5,138,100
79	20年国債	17,000,000	17,695,130
80	20年国債	25,000,000	26,354,500
81	20年国債	14,000,000	14,535,780
82	20年国債	20,000,000	21,021,200
83	20年国債	28,000,000	29,375,920
84	20年国債	18,000,000	18,640,440
85	20年国債	26,000,000	27,225,900
86	20年国債	22,000,000	23,627,120
87	20年国債	5,000,000	5,301,050
88	20年国債	30,000,000	32,186,100
89	20年国債	16,000,000	16,943,520
90	20年国債	39,000,000	41,223,390
91	20年国債	13,000,000	13,932,360
92	20年国債	54,000,000	56,242,620
93	20年国債	3,000,000	3,075,300
94	20年国債	38,000,000	39,494,160
95	20年国債	30,000,000	32,017,500
96	20年国債	25,000,000	25,943,500
97	20年国債	27,000,000	28,385,910
98	20年国債	27,000,000	27,975,240
99	20年国債	55,000,000	56,857,350
100	20年国債	29,000,000	30,377,790
101	20年国債	24,000,000	25,869,360
102	20年国債	25,000,000	26,931,500
103	20年国債	18,000,000	19,120,860

	104	20年国債	18,000,000	18,570,600	
	105	20年国債	45,000,000	46,346,400	
	106	20年国債	20,000,000	20,913,200	
	107	20年国債	12,000,000	12,337,320	
	108	20年国債	42,000,000	41,827,800	
	109	20年国債	22,000,000	21,863,820	
	110	20年国債	38,000,000	38,970,520	
	111	20年国債	24,000,000	24,953,760	
	112	20年国債	47,000,000	48,111,550	
	113	20年国債	69,000,000	70,499,370	
	114	20年国債	44,000,000	44,901,560	
	115	20年国債	25,000,000	25,920,500	
	116	20年国債	28,000,000	28,998,760	
	117	20年国債	51,000,000	51,980,220	
国債証券 合計			6,700,000,000	6,985,465,220	
地方債証券	583	東京都公債	7,400,000	7,572,442	
	595	東京都公債	67,000,000	68,050,091	
	604	東京都公債	10,000,000	10,430,090	
	624	東京都公債	100,000,000	105,255,000	
	144	神奈川県公債	100,000,000	107,453,100	
	293	大阪府公債	100,000,000	108,396,500	
	12	共同発行地方	50,000,000	52,050,700	
	14	共同発行地方	36,400,000	38,070,942	
	18	共同発行地方	100,000,000	105,265,700	
	20	共同発行地方	100,000,000	104,907,300	
	27	共同発行地方	20,000,000	20,843,420	
	30	共同発行地方	50,000,000	52,122,850	
	12-ゆ	名古屋市債	20,000,000	20,820,460	
	14-1	横浜市公債	5,000,000	5,121,075	
	14-5	横浜市公債	20,000,000	20,301,420	
	28	横浜市5年	100,000,000	101,493,200	
	76	川崎市公債	25,000,000	25,384,100	
	16	川崎市5年	60,000,000	61,691,700	
	18	川崎市5年	60,000,000	61,154,460	
地方債証券 合計			1,030,800,000	1,076,384,550	
特殊債券	6	政保政策投資BK	25,000,000	25,406,650	
	47	日本政策投資B	100,000,000	104,641,500	
	317	政保道路債	100,000,000	100,820,500	
	319	政保道路債	40,000,000	40,847,520	
	323	政保道路債	85,000,000	88,706,425	
	328	政保道路債	41,000,000	42,933,519	
	329	政保道路債	100,000,000	105,175,400	
	333	政保道路債	21,000,000	22,143,996	
	334	政保道路債	2,000,000	2,101,004	
	27	政保道路機構	50,000,000	53,727,650	
	809	政保公営企業	15,000,000	15,283,560	
	828	政保公営企業	15,000,000	15,122,880	
	829	政保公営企業	10,000,000	10,269,870	
	831	政保公営企業	4,000,000	4,178,740	
	842	政保公営企業	5,000,000	5,308,410	
	2	政保地方公営機	100,000,000	105,098,100	
	1	公営企業	100,000,000	101,851,400	
	26	公営企業	100,000,000	106,949,400	
	190	政保首都高速	3,000,000	3,126,021	
	13	首都高速道路	100,000,000	104,589,600	
	4	国際協力銀行	100,000,000	102,289,500	

	3 9 政保関西空港	16,000,000	16,131,072	
	5 政保中部空港	121,000,000	122,966,976	
	1 4 政保国民生活	19,000,000	19,942,096	
	2 成田国際空港	100,000,000	105,476,200	
	い 6 8 8 利付商工債	100,000,000	102,404,600	
	い 6 8 6 利付農林債	30,000,000	30,831,150	
	2 1 0 信金中金	100,000,000	102,069,400	
	1 アフリカ開発銀行 S U B	50,000,000	56,913,950	
特殊債券 合計		1,652,000,000	1,717,307,089	
社債券	8 ゴールドマン サックス	100,000,000	98,697,800	
	2 5 三菱化学	100,000,000	103,501,500	
	4 1 三菱電機	100,000,000	102,684,300	
	1 6 ソニー	100,000,000	101,956,300	
	4 6 日産自動車	100,000,000	102,630,000	
	6 トヨタ自動車	100,000,000	102,335,500	
	9 トヨタ自動車	100,000,000	102,579,100	
	4 みずほコーポレート	100,000,000	101,721,600	
	6 東京三菱BK劣後	100,000,000	104,880,800	
	7 三井住友BK劣後	100,000,000	105,350,700	
	3 G E ジャパン	100,000,000	96,823,900	
	2 7 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,749,400	
	1 6 N T T ドコモ	100,000,000	103,244,200	
	4 7 3 東京電力	40,000,000	41,495,080	
	5 1 3 東京電力	57,000,000	60,414,927	
	5 1 6 東京電力	35,000,000	36,593,900	
	3 7 8 東北電力	100,000,000	118,768,400	
	3 9 0 東北電力	130,000,000	133,397,680	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,416,211	
社債券 合計		1,665,000,000	1,724,241,298	
合計		11,047,800,000	11,503,398,157	

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21年6月5日現在	平成22年6月7日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	134,535,893	298,570,952
コール・ローン	69,284,830	319,920,510
株式	38,637,941,300	41,299,666,639
新株予約権証券	—	107,735
投資証券	427,571,778	631,698,091
派生商品評価勘定	79,823,235	—
未収入金	108,260,260	548,602
未収配当金	131,353,147	111,305,618
差入委託証拠金	164,120,496	261,889,486
流動資産合計	39,752,890,939	42,923,707,633
資産合計	39,752,890,939	42,923,707,633
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	44,677,409
未払金	—	286,412,809
未払解約金	108,899,000	1,000,000
その他未払費用	55,389	—
流動負債合計	108,954,389	332,090,218
負債合計	108,954,389	332,090,218
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	50,561,223,631	52,325,116,493
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△10,917,287,081	△9,733,499,078
元本等合計	39,643,936,550	42,591,617,415
純資産合計	39,643,936,550	42,591,617,415
負債純資産合計	39,752,890,939	42,923,707,633

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券	(1)株式及び新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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	30,808,672,404円	50,561,223,631円
同期中における追加設定元本額	25,956,993,314円	10,054,588,431円
同期中における一部解約元本額	6,204,442,087円	8,290,695,569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	1,825,634,080円	1,959,244,981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)	139,917,994円	102,548,347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)	1,888,495,135円	1,554,517,248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)	249,225,404円	212,284,454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)	5,982,787,046円	5,044,742,259円
DCダイワ外国株式インデックス ダイワ・ライフ・バランス3 0	9,437,925,872円	12,046,021,338円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	535,445,531円	476,096,975円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	6,181,105円	47,951,533円
大和DC海外株式インデックス ファンド	5,851,212円	34,226,669円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,147,659,082円	1,347,004,804円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	3,481,202円	4,757,843円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,174,974円	3,468,160円
ダイワ世界分散バランスファンド 1 5 V A	381,816円	264,403円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	168,413,914円	119,872,537円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	2,379,276,845円	1,878,819,767円
	48,857,957円	40,472,676円

ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	501,358,081円	391,641,954円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	7,764,580,427円	6,916,091,802円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	1,758,523,713円	1,655,709,304円
ダイワ・バランスファンド35V A	14,519,374,128円	15,181,658,319円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	－円	717,397,755円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,059,911,632円	2,454,027,230円
ダイワライフスタイル25	23,274,084円	21,447,369円
ダイワライフスタイル50	62,081,104円	61,985,564円
ダイワライフスタイル75	51,411,293円	52,863,202円
計	50,561,223,631円	52,325,116,493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	50,561,223,631口	52,325,116,493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。	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9,733,499,078円でありま す。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年6月5日現在		平成22年6月7日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	38,637,941,300	2,623,385,226	△1,145,827,632
新株予約権証券	—	—	△10,884
投資証券	427,571,778	△4,686,327	24,931,465
合計	39,065,513,078	2,618,698,899	△1,120,907,051

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年12月2日から平成21年6月5日まで、及び平成21年12月1日から平成22年6月7日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成20年6月6日から平成21年6月5日まで)

I 取引の状況に関する事項

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

II 取引の時価等に関する事項

1. 株式関連

種 類	平成21年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)

		1 年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買 建	465,572,715	—	545,395,950	79,823,235
合計	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。

（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成22年6月7日 現在			
	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	626,705,566	—	582,922,158	△43,783,408
合計	626,705,566	—	582,922,158	△43,783,408

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種 類	平成22年6月7日 現在			
	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	15,676,000	—	14,782,000	△894,000
オーストラリア・ドル	15,676,000	—	14,782,000	△894,000
合計	15,676,000	—	14,782,000	△894,000

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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)	0.7841円 (7,841円)	0.8140円 (8,140円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	FIRST SOLAR INC	1,500	109.840	164,760.000	
	AVON PRODUCTS	10,700	25.730	275,311.000	
	ABBOTT LABS	38,500	46.530	1,791,405.000	
	ALCOA	28,100	10.840	304,604.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	7,500	24.250	181,875.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,300	40.790	175,397.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	8,929	27.140	242,333.060	
	LENDER PROCESSING SERVICE	2,800	33.000	92,400.000	
	VALIDUS HOLDINGS LTD	3,400	24.490	83,266.000	
	ALLEGHENY ENERGY INC	4,300	20.330	87,419.000	
	AFLAC INC	11,900	41.330	491,827.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,500	42.270	147,945.000	
	HANSEN NATURAL CORPORATIO	2,200	39.610	87,142.000	

ADOBE SYSTEMS	13,200	31.610	417,252.000
CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,900	60.930	115,767.000
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	13.970	145,288.000
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,800	59.150	106,470.000
GARMIN LTD	3,900	31.950	124,605.000
AETNA INC	11,600	30.210	350,436.000
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,300	66.550	352,715.000
ALTERA CORPORATION	8,000	23.630	189,040.000
FORTUNE BRANDS INC	3,700	45.680	169,016.000
HONEYWELL INTERNATIONAL	18,500	41.070	759,795.000
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,251	14.280	60,704.280
WR BERKLEY CORP	4,700	26.830	126,101.000
AUTOZONE INC	1,000	188.890	188,890.000
DOLLAR TREE INC	2,500	61.000	152,500.000
PINNACLE WEST CAPITAL	3,400	34.740	118,116.000
ALLEGHENY TECHNOLOGIES	3,000	48.220	144,660.000
CELANESE CORP-SERIES A	5,400	27.430	148,122.000
D.R.HORTON INC	7,366	11.340	83,530.440
DENTSPLY INTERNATIONAL IN	4,600	31.510	144,946.000
AUTODESK INC	7,100	27.920	198,232.000
MOODY'S CORP	5,500	18.890	103,895.000
DEVON ENERGY CORPORATION	10,700	65.110	696,677.000
CONSOL ENERGY INC	6,200	35.140	217,868.000
ALLIANT ENERGY CORP	3,200	31.400	100,480.000
CITIGROUP INC	532,233	3.790	2,017,163.070
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,800	40.440	517,632.000
AMERICAN ELEC POWER	12,900	31.120	401,448.000
DUN&BRADSTREET CORP	1,700	70.490	119,833.000
HESS CORP	8,100	50.500	409,050.000
COVIDIEN PLC	12,425	41.190	511,785.750
DAVITA INC	2,800	62.960	176,288.000
DANAHER CORP	6,900	77.780	536,682.000
AVNET INC	5,200	26.580	138,216.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,600	118.090	188,944.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	14,200	24.840	352,728.000
PEABODY ENERGY CORP	6,700	36.690	245,823.000
BUNGE LIMITED	3,400	48.600	165,240.000
TYCO ELECTRONICS LTD	11,325	28.130	318,572.250
APPLE INC	22,800	256.120	5,839,536.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	14,900	12.860	191,614.000
BOEING CO	17,100	61.230	1,047,033.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	26.460	116,820.900
MEADWESTVACO CORP	4,800	22.740	109,152.000
SPECTRA ENERGY CORP	16,196	19.430	314,688.280
BECTON DICKINSON & CO	5,900	70.080	413,472.000
SAIC INC	10,200	17.580	179,316.000
NISOURCE INC	9,100	14.350	130,585.000
JOY GLOBAL INC	3,600	50.760	182,736.000
BMC SOFTWARE INC	5,800	36.390	211,062.000
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,200	55.900	234,780.000
ALPHA NATURAL RESOURCES I	3,400	34.100	115,940.000
BARD(C.R.) INC	2,200	78.970	173,734.000
FURIEX PHARMACEUTICALS-W/	241	12.820	3,089.620
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	2,200	48.830	107,426.000
BANK OF NEW YORK MELLON	29,871	26.000	776,646.000
VERIZON COMMUNICATIONS	71,000	27.210	1,931,910.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	14,000	70.190	982,660.000

H&R BLOCK INC	8,800	15.730	138,424.000
BB&T CORPORATION	17,500	29.230	511,525.000
BECKMAN COULTER INC	2,100	56.290	118,209.000
HOSPIRA INC	4,020	50.830	204,336.600
BROADCOM CORP-CL A	11,250	33.570	377,662.500
BAKER HUGHES INC	10,623	38.470	408,666.810
BRISTOL MYERS SQUIBB	42,400	22.440	951,456.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	54.030	102,657.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	13.650	97,433.700
JPMORGAN CHASE & CO	99,720	37.750	3,764,430.000
XTO ENERGY INC	14,166	42.120	596,671.920
LEGG MASON INC	4,950	29.980	148,401.000
PACTIV CORPORATION	3,300	28.350	93,555.000
T ROWE PRICE GROUP INC	6,400	48.000	307,200.000
CIGNA CORP	7,600	34.070	258,932.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,600	47.780	219,788.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,800	54.420	97,956.000
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,400	55.870	134,088.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,260	38.410	240,446.600
WHITE MOUNTAINS INSURANCE	200	319.500	63,900.000
CATERPILLAR INC DEL	15,400	57.760	889,504.000
PETROHAWK ENERGY CORP	7,800	20.170	157,326.000
CHARLES RIVER LABORATORIE	2,000	32.960	65,920.000
VIRGIN MEDIA INC	10,200	16.080	164,016.000
MOAIC CO/THE	4,200	43.060	180,852.000
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	6,100	49.590	302,499.000
CORNING INC	38,400	16.230	623,232.000
CISCO SYSTEMS	144,000	22.960	3,306,240.000
DU PONT	23,100	34.430	795,333.000
MORGAN STANLEY	31,300	25.990	813,487.000
DOW CHEMICAL	31,200	24.840	775,008.000
DELL INC	44,800	13.240	593,152.000
DTE ENERGY COMPANY	5,000	44.420	222,100.000
DEVRY INC	1,800	56.390	101,502.000
TELEPHONE AND DATA SYSTEM	1,500	31.710	47,565.000
AGCO CORP	2,800	26.760	74,928.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,800	39.030	577,644.000
DENBURY RESOURCES INC	11,200	15.640	175,168.000
DEERE & CO	10,500	56.880	597,240.000
AIRGAS INC	1,800	62.370	112,266.000
QUANTA SERVICES INC	5,300	20.870	110,611.000
TIME WARNER INC	29,333	30.490	894,363.170
VMWARE INC-CLASS A	1,800	68.290	122,922.000
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	36.920	136,604.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	18.450	71,955.000
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	4,950	12.140	60,093.000
CONSOLIDATED EDISON INC	7,600	41.660	316,616.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,900	33.260	96,454.000
JEFFERIES GROUP INC(NEW)	3,500	22.010	77,035.000
NYSE EURONEXT	7,100	27.400	194,540.000
COLGATE PALMOLIVE CO	12,300	77.240	950,052.000
AMETEK INC	3,100	40.170	124,527.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,000	65.080	130,160.000
COSTCO WHOLESALE CORP	10,800	56.180	606,744.000
SCANA CORP	3,500	35.540	124,390.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,200	20.420	106,184.000
CUMMINS INC	4,700	66.350	311,845.000

ACTIVISION BLIZZARD INC	17,000	10.690	181,730.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	51.500	180,250.000
LORILLARD INC	4,000	71.590	286,360.000
PROGRESS ENERGY INC	8,000	37.670	301,360.000
CABOT OIL & GAS CORP	3,600	34.970	125,892.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	8.630	62,999.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	66.150	99,225.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,600	34.780	90,428.000
COCA COLA CO	52,600	51.270	2,696,802.000
COCA-COLA ENTERPRISES	7,600	25.470	193,572.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	37.190	211,983.000
EATON VANCE CORP	3,700	28.740	106,338.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	4,200	45.890	192,738.000
FMC TECHNOLOGIES INC	3,000	49.300	147,900.000
FRANKLIN RESOURCES INC	4,100	91.390	374,699.000
CSX CORP	9,700	50.020	485,194.000
FLUOR CORP	4,800	43.990	211,152.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,900	75.050	217,645.000
EXPEDIA INC	6,950	20.150	140,042.500
AMAZON.COM INC	8,800	122.710	1,079,848.000
FLOWSERVE CORP	1,500	88.200	132,300.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,400	52.460	178,364.000
EXXON MOBIL CORP	121,600	59.620	7,249,792.000
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	59.730	95,568.000
FLIR SYSTEMS INC	3,800	27.700	105,260.000
AES CORP	16,500	9.600	158,400.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,800	81.120	227,136.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,900	70.010	133,019.000
EOG RESOURCES INC	6,300	102.790	647,577.000
EQUITABLE RESOURCES INC	3,400	38.100	129,540.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,000	41.940	209,700.000
AMERICAN TOWER CORP-CL A	10,300	41.510	427,553.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	30.770	218,467.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,590	30.370	291,248.300
FORD MOTOR CO	78,323	11.500	900,714.500
MACY'S INC	10,598	21.030	222,875.940
ARCH COAL INC	4,300	21.270	91,461.000
FOSTER WHEELER AG	4,600	22.970	105,662.000
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,840	36.980	178,983.200
FOREST LABORATORIES INC	7,400	25.050	185,370.000
LIBERTY GLOBAL INC	3,735	25.030	93,487.050
DISCOVERY COMMUNICATION-C	4,240	31.080	131,779.200
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	3,300	22.170	73,161.000
NEXTERA ENERGY INC	9,900	48.610	481,239.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER	10,704	62.820	672,425.280
US BANCORP	48,300	22.900	1,106,070.000
FAMILY DOLLAR STORES	4,500	38.170	171,765.000
FASTENAL CO	3,200	49.410	158,112.000
FISERV INC	3,800	46.230	175,674.000
GENERAL ELECTRIC CO	275,200	15.710	4,323,392.000
GENZYME CORP-GENL DIVISIO	6,500	47.770	310,505.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,900	11.490	90,771.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,100	65.180	527,958.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,300	142.400	1,751,520.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	21.770	106,673.000
GOODRICH CORP	3,100	66.720	206,832.000
GOOGLE INC-CL A	6,100	499.200	3,045,120.000

GENERAL MILLS INC	8,000	73.300	586,400.000
FIRSTENERGY CORP	8,300	35.220	292,326.000
GENUINE PARTS CO	4,400	39.510	173,844.000
FIFTH THIRD BANCORP	21,900	12.510	273,969.000
HARRIS CORP	3,700	45.580	168,646.000
HARSCO CORP	3,000	25.880	77,640.000
HALLIBURTON CO	23,900	23.110	552,329.000
HOME DEPOT INC	43,300	32.150	1,392,095.000
ASSURANT INC	3,300	34.310	113,223.000
HERSHEY CO/THE	4,300	48.290	207,647.000
HARLEY-DAVIDSON INC	5,800	27.350	158,630.000
HUMANA INC	4,200	47.390	199,038.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,300	44.070	233,571.000
HELMERICH & PAYNE	3,300	38.740	127,842.000
WINDSTREAM CORP	11,500	10.810	124,315.000
HUMAN GENOME SCIENCES INC	4,800	24.610	118,128.000
HENRY SCHEIN INC	2,900	55.000	159,500.000
HEWLETT-PACKARD CO	59,200	46.050	2,726,160.000
DIRECTV	23,182	37.910	878,829.620
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,500	71.920	107,880.000
HEINZ H J CO	7,900	43.850	346,415.000
INT'L BUSINESS MACHINES	33,100	125.280	4,146,768.000
INTERNATIONAL PAPER	10,200	21.930	223,686.000
ITT CORP	4,000	45.840	183,360.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,929	37.230	332,426.670
LEGGETT & PLATT INC	3,600	22.370	80,532.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,435	25.040	86,012.400
JUNIPER NETWORKS INC	13,100	24.670	323,177.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	55.280	171,368.000
JOHNSON & JOHNSON	71,200	58.010	4,130,312.000
HOLOGIC INC	8,800	14.790	130,152.000
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	60.180	631,890.000
KROGER CO	15,600	19.320	301,392.000
KLA-TENCOR CORPORATION	5,600	29.900	167,440.000
LOCKHEED MARTIN CORP	7,900	77.390	611,381.000
LIMITED BRANDS	8,000	24.700	197,600.000
LOWE'S COS INC	37,800	23.520	889,056.000
ELI LILLY & CO	26,100	32.370	844,857.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	46,400	1.250	58,000.000
LAM RESEARCH CORP	3,200	39.060	124,992.000
LUBRIZOL CORP	2,200	82.980	182,556.000
RANGE RESOURCES CORP	3,900	48.300	188,370.000
LSI CORP	22,500	5.210	117,225.000
LOEWS CORP	8,500	31.600	268,600.000
LINCOLN NATIONAL CORP	8,349	25.310	211,313.190
MCDONALD'S CORP	27,000	66.700	1,800,900.000
3M CO	17,000	76.100	1,293,700.000
MANPOWER INC	2,700	41.940	113,238.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,800	27.340	213,252.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,100	89.180	98,098.000
MCAFEE INC	4,200	32.200	135,240.000
MURPHY OIL CORP	4,500	50.230	226,035.000
MATTEL INC	9,800	20.880	204,624.000
KBR INC	4,500	20.340	91,530.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,800	38.710	147,098.000
MYLAN INC	8,200	18.490	151,618.000
METLIFE INC	20,800	38.480	800,384.000

MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	18.800	272,600.000
MOTOROLA INC	56,800	6.690	379,992.000
MONSANTO CO	13,906	49.120	683,062.720
MCDERMOTT INTL INC	7,400	21.080	155,992.000
ROCKWELL INTL CORP	3,600	51.460	185,256.000
MERCK & CO INC	76,321	33.170	2,531,567.570
MASCO CORP	12,100	12.400	150,040.000
M & T BANK CORP	2,400	75.360	180,864.000
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	11,836	56.810	672,403.160
MARSH & MCLENNAN COS	13,100	20.990	274,969.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,082	32.180	227,898.760
NETAPP INC	8,900	37.910	337,399.000
NIKE INC -CL B	9,400	70.770	665,238.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	53.400	496,620.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,600	27.300	125,580.000
NATIONAL SEMICONDUCTOR	7,700	13.700	105,490.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,300	58.240	425,152.000
NEWMONT MINIG CORP	11,900	53.730	639,387.000
MCKESSON CORP	6,800	68.560	466,208.000
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,900	17.110	169,389.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	48,400	43.740	2,117,016.000
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	5,600	10.690	59,864.000
NUCOR CORP	7,600	40.930	311,068.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,900	19.380	172,482.000
WESTERN UNION CO	18,946	15.630	296,125.980
NEWELL RUBBERMAID INC	7,500	16.360	122,700.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	20,200	78.420	1,584,084.000
OMNICARE INC	3,200	24.680	78,976.000
OLD REPUBLIC INTL CORP	7,675	13.100	100,542.500
PAYCHEX INC	8,400	27.970	234,948.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	6,700	25.480	170,716.000
PATTERSON COS INC	2,900	29.140	84,506.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	49.650	188,670.000
ALTRIA GROUP INC	51,400	20.040	1,030,056.000
OWENS-ILLINOIS INC	5,400	28.990	156,546.000
PG & E CORPORATION	9,700	40.430	392,171.000
PFIZER INC	204,563	14.740	3,015,258.620
XCEL ENERGY INC	11,600	20.180	234,088.000
STRYKER CORP	7,600	51.970	394,972.000
PARKER HANNIFIN CORP	4,300	58.520	251,636.000
PALL CORP	4,000	33.340	133,360.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,200	63.240	202,368.000
PROCTER & GAMBLE CO	73,037	60.800	4,440,649.600
EXELON CORP	16,500	37.630	620,895.000
CONOCOPHILLIPS	37,300	50.060	1,867,238.000
PEPSICO INC	41,100	61.440	2,525,184.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	3,600	21.000	75,600.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,700	55.660	651,222.000
AMERICAN WATER WORKS CO	4,500	19.920	89,640.000
ACCENTURE LTD-CL A	16,000	36.930	590,880.000
QUESTAR CORP	4,600	44.010	202,446.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,600	29.990	137,954.000
PENTAIR INC	2,600	32.870	85,462.000
QUALCOMM INC	42,600	35.400	1,508,040.000
PARTNERRE LTD	1,700	70.550	119,935.000
PHARMACEUTICAL PRODUCT	2,900	25.430	73,747.000
INVESCO LTD	11,750	17.860	209,855.000

ADVANCE AUTO PARTS	3,250	50.160	163,020.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,800	25.870	227,656.000
MDU RESOURCES GROUP INC	5,700	18.080	103,056.000
ENERGEN CORP	2,000	44.820	89,640.000
RAYTHEON CO	9,600	51.470	494,112.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	3,100	44.730	138,663.000
RED HAT INC	5,200	28.620	148,824.000
REPUBLIC SERVICES INC	9,500	28.510	270,845.000
PRICELINE.COM INC	1,200	178.900	214,680.000
ROSS STORES INC	3,700	54.630	202,131.000
QUEST DIAGNOSTICS	3,900	51.530	200,967.000
ROBERT HALF INTL INC	3,200	23.610	75,552.000
REYNOLDS AMERICAN INC	5,000	51.990	259,950.000
POLO RALPH LAUREN CORP	1,400	81.780	114,492.000
ROWAN COS INC	3,300	22.710	74,943.000
AUTONATION INC	3,100	20.860	64,666.000
QWEST COMMUNICATIONS INTL	42,200	5.200	219,440.000
ROCKWELL COLLINS INC.	3,900	56.040	218,556.000
REGIONS FINANCIAL CORP	30,435	7.130	217,001.550
SUNOCO INC	3,200	29.140	93,248.000
CHEVRON CORP	51,018	71.280	3,636,563.040
EDISON INTERNATIONAL	7,800	31.880	248,664.000
SYMANTEC CORP	20,600	13.920	286,752.000
STANLEY BLACK & DECKER IN	3,722	55.070	204,970.540
SYNOPSYS INC	3,900	21.620	84,318.000
TRANSOCEAN LTD	8,122	50.200	407,724.400
SLM CORP	9,500	11.000	104,500.000
SANDISK CORP	5,700	44.890	255,873.000
SOUTHERN CO	20,200	32.130	649,026.000
SYSCO CORP	14,900	29.390	437,911.000
SMITH INTERNATIONAL INC	6,700	37.380	250,446.000
TRAVELERS COS INC	12,723	48.610	618,465.030
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,700	41.700	404,490.000
SPX CORP	1,400	56.600	79,240.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,400	20.970	71,298.000
STERICYCLE INC	2,200	58.290	128,238.000
SCHLUMBERGER LTD	30,000	55.740	1,672,200.000
SUPERVALU INC	6,973	12.680	88,417.640
AT&T INC	150,095	24.170	3,627,796.150
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	12.020	72,120.000
SIGMA-ALDRICH	3,300	50.700	167,310.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,700	74.910	202,257.000
SEMPRA ENERGY	6,300	44.520	280,476.000
TIFFANY & CO	3,100	42.130	130,603.000
SEAGATE TECHNOLOGY	12,300	15.140	186,222.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	31,700	24.200	767,140.000
SALESFORCE.COM INC	3,000	89.640	268,920.000
TIME WARNER CABLE	9,753	53.870	525,394.110
TYCO INTERNATIONAL LTD	13,525	35.720	483,113.000
TRANSATLANTIC HOLDINGS IN	1,700	45.330	77,061.000
UNION PACIFIC CORP	12,700	69.400	881,380.000
MARATHON OIL CORP	18,000	30.700	552,600.000
UNITED TECHNOLOGIES	22,700	65.130	1,478,451.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	17,700	60.560	1,071,912.000
SPRINT NEXTEL CORP	72,422	4.780	346,177.160
UNUM GROUP	8,900	22.280	198,292.000
AMEREN CORPORATION	7,400	24.090	178,266.000

UNITEDHEALTH GROUP INC	29,126	30.340	883,682.840
USX-US STEEL GRP	3,800	41.990	159,562.000
VERISIGN INC	5,400	28.260	152,604.000
VALERO ENERGY CORP	14,492	17.270	250,276.840
WEYERHAEUSER CO	5,400	40.120	216,648.000
WELLPOINT INC	11,300	54.140	611,782.000
THE WALT DISNEY CO.	47,900	33.720	1,615,188.000
WELLS FARGO & CO	126,072	27.830	3,508,583.760
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,500	43.340	108,350.000
WASTE MANAGEMENT INC	11,300	31.560	356,628.000
WILLIAMS COMPANY	14,500	19.240	278,980.000
WHIRLPOOL CORP	1,900	95.650	181,735.000
WAL-MART STORES	57,800	50.400	2,913,120.000
ZIMMER HOLDINGS INC	5,100	53.180	271,218.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	20,000	13.250	265,000.000
WYNN RESORTS LTD	2,200	79.840	175,648.000
XEROX CORP	36,944	8.880	328,062.720
TJX COMPANIES INC	10,400	44.490	462,696.000
WATERS CORP	2,500	66.540	166,350.000
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,400	43.700	148,580.000
WHOLE FOODS MARKET INC	4,100	38.720	158,752.000
WASHINGTON POST -CL B	240	449.630	107,911.200
WALGREEN CO	24,800	30.840	764,832.000
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	30.620	143,914.000
WESTERN DIGITAL CORP	5,700	34.410	196,137.000
WISCONSIN ENERGY CORP	3,500	48.090	168,315.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,300	30.670	407,911.000
VISA INC-CLASS A SHS	11,700	72.130	843,921.000
PPL CORPORATION	10,300	25.090	258,427.000
PITNEY BOWES INC	6,300	21.980	138,474.000
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	15.410	98,624.000
PULTE GROUP INC	9,500	9.820	93,290.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	49.500	202,950.000
PPG INDUSTRIES INC	4,300	61.790	265,697.000
NORTHERN TRUST CORP	5,500	49.110	270,105.000
NSTAR	3,300	34.150	112,695.000
PRECISION CASTPARTS CORP	3,500	110.400	386,400.000
NVIDIA CORP	15,250	12.090	184,372.500
PNC FINANCIAL SERVICES	13,193	58.800	775,748.400
LIBERTY MEDIA-INTERACTI A	16,250	12.815	208,243.750
TERADATA CORP	4,700	31.570	148,379.000
TYSON FOODS INC-CL A	7,400	17.500	129,500.000
NII HOLDINGS INC	5,300	36.810	195,093.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	49.530	510,159.000
NRG ENERGY INC	8,300	22.510	186,833.000
TORCHMARK CORP	2,100	49.540	104,034.000
TEXTRON INC	7,500	18.960	142,200.000
NEWS CORP-CL A	46,550	12.660	589,323.000
NEWS CORP-CLASS B	12,100	14.780	178,838.000
OMNICOM GROUP	8,000	36.070	288,560.000
ORACLE CORPORATION	101,583	22.140	2,249,047.620
MASTERCARD INC-CLASS A	2,600	196.670	511,342.000
ONEOK INC	2,900	43.370	125,773.000
CENTURYLINK INC	7,373	33.760	248,912.480
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	56.520	141,300.000
CEPHALON INC	1,900	59.090	112,271.000
YUM! BRANDS INC	12,200	40.860	498,492.000

ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,900	68.610	130,359.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,200	41.640	174,888.000
NOBLE ENERGY INC	4,400	60.600	266,640.000
BANK OF AMERICA CORP	259,101	15.350	3,977,200.350
NORDSTROM INC	4,500	36.470	164,115.000
AMERICAN EXPRESS CO	27,200	38.410	1,044,752.000
ANALOG DEVICES	7,900	29.000	229,100.000
ADVANCED MICRO DEVICES	20,927	8.100	169,508.700
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	17.790	115,635.000
AMERICAN INTL GROUP	1,972	34.750	68,527.000
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,200	45.120	550,464.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	3,700	27.920	103,304.000
HUDSON CITY BANCORP INC	12,300	12.610	155,103.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,700	49.910	184,667.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	32.100	96,300.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,300	50.250	366,825.000
EMERSON ELECTRIC CO	19,200	44.970	863,424.000
AON CORP	6,100	38.420	234,362.000
AMGEN	25,600	54.340	1,391,104.000
ALLERGAN INC	8,400	58.560	491,904.000
COACH INC	7,900	39.590	312,761.000
EATON CORP	3,900	67.180	262,002.000
CROWN CASTLE INTL CORP	7,200	36.130	260,136.000
CELGENE CORP	11,700	51.590	603,603.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	15.860	90,402.000
APPLIED MATERIALS INC	34,300	12.580	431,494.000
CIT GROUP INC	4,300	35.940	154,542.000
CIMAREX ENERGY CO	2,800	74.350	208,180.000
CME GROUP INC	1,700	310.750	528,275.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	10,644	34.660	368,921.040
ECOLAB INC	5,900	46.190	272,521.000
EQUIFAX INC	3,800	28.900	109,820.000
GAP INC	12,100	20.960	253,616.000
GILEAD SCIENCES INC	22,700	34.700	787,690.000
MARSHALL & ILSLEY CORP	12,599	7.380	92,980.620
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	21.030	91,480.500
ST JUDE MEDICAL INC	8,300	36.550	303,365.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	7,448	36.490	271,777.520
HORMEL FOODS CORP	2,200	40.500	89,100.000
SAFeway INC	10,100	21.300	215,130.000
STATE STREET CORP	12,343	36.480	450,272.640
STAPLES INC	17,800	21.140	376,292.000
SUNTRUST BANKS INC	12,448	25.030	311,573.440
SCHWAB(CHARLES) CORP	25,100	16.310	409,381.000
IHS INC-CLASS A	1,400	52.030	72,842.000
BAXTER INTL INC	15,100	41.370	624,687.000
CONSTELLATION ENERGY	5,600	34.570	193,592.000
CAMPBELL SOUP CO	6,000	36.000	216,000.000
CROWN HOLDINGS INC	5,100	23.940	122,094.000
CHUBB CORP	8,300	49.300	409,190.000
CARDINAL HEALTH INC	9,700	34.240	332,128.000
CAREFUSION CORP	4,750	24.800	117,800.000
FEDEX CORP	7,300	79.370	579,401.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	12,254	39.310	481,704.740
FMC CORP	2,100	58.230	122,283.000
FLEXTRONICS INTL LTD	24,600	6.390	157,194.000
CERNER CORP	1,800	81.580	146,844.000

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,100	43.100	90,510.000
CITRIX SYSTEMS INC	4,700	43.380	203,886.000
INTEL CORP	144,600	20.960	3,030,816.000
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,000	33.230	199,380.000
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	16,600	7.840	130,144.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	10,600	23.570	249,842.000
IRON MOUNTAIN INC	5,050	23.390	118,119.500
CREE INC	2,500	64.540	161,350.000
ILLINOIS TOOL WORKS	10,900	44.240	482,216.000
ILLUMINA INC	3,400	41.600	141,440.000
CHESAPEAKE ENERGY CORP	18,600	24.090	448,074.000
SEALED AIR CORP	3,800	20.110	76,418.000
ITT EDUCATIONAL SERVICES	1,000	98.620	98,620.000
INTUITIVE SURGICAL INC	1,000	324.670	324,670.000
SARA LEE CORP	16,300	14.240	232,112.000
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	7,500	24.800	186,000.000
COVANCE INC	1,700	52.050	88,485.000
CARMAX INC	7,700	20.930	161,161.000
COMERICA INC	4,900	36.250	177,625.000
DUKE ENERGY CORP	33,392	15.620	521,583.040
TARGET CORP	18,000	52.800	950,400.000
DOVER CORP	4,600	43.050	198,030.000
RR DONNELLEY & SONS CO	7,200	17.740	127,728.000
WW GRAINGER INC	1,400	99.190	138,866.000
JACOBS ENGINEERING GROUP	4,000	40.140	160,560.000
JOHNSON CONTROLS INC	16,500	27.530	454,245.000
CINTAS CORP	4,600	25.000	115,000.000
CA INC	11,205	19.430	217,713.150
CONAGRA INC	11,000	24.220	266,420.000
CLOROX COMPANY	3,600	63.070	227,052.000
ENTERGY CORP	5,000	71.990	359,950.000
MICROSOFT CORP	199,200	25.830	5,145,336.000
LIFE TECHNOLOGIES CORP	5,300	48.110	254,983.000
CVS CAREMARK CORP	35,274	33.780	1,191,555.720
MEDTRONIC INC	27,900	38.000	1,060,200.000
MILLIPORE CORP	1,900	106.450	202,255.000
MICRON TECHNOLOGY INC	24,400	8.860	216,184.000
BLACKROCK INC-CLASS A	900	159.490	143,541.000
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	13.200	141,240.000
HASBRO INC	3,600	39.140	140,904.000
KELLOGG CO	7,300	53.220	388,506.000
KEYCORP	23,400	7.770	181,818.000
KRAFT FOODS INC-A	45,511	28.550	1,299,339.050
KOHL'S CORP	7,300	50.080	365,584.000
SEARS HOLDING CORP	1,525	80.190	122,289.750
URS CORP	2,100	43.680	91,728.000
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	12,300	15.550	191,265.000
APACHE CORP	8,610	87.570	753,977.700
ACE LTD	8,500	48.440	411,740.000
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	25.380	81,216.000
ALLSTATE	13,600	28.940	393,584.000
EBAY INC	28,900	21.990	635,511.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,900	57.180	108,642.000
XILINX INC	7,200	24.940	179,568.000
EXPRESS SCRIPTS INC CL-A	6,600	99.180	654,588.000
DISH NETWORK CORP	5,400	20.340	109,836.000
YAHOO! INC	32,700	15.020	491,154.000

	ESTEE LAUDER COMPANIES-A	3,100	55.340	171,554.000	
	TOLL BROTHERS INC	3,400	19.500	66,300.000	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,900	27.610	190,509.000	
	NOBLE CORP	7,100	27.560	195,676.000	
	PROGRESSIVE CORP	17,100	18.960	324,216.000	
	PRAXAIR INC	7,600	74.120	563,312.000	
	PACCAR INC	8,837	39.870	352,331.190	
	PETSMART INC	3,700	31.150	115,255.000	
	EL PASO CORPORATION	19,900	11.110	221,089.000	
	EMC CORP/MASS	51,900	18.380	953,922.000	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	5,600	22.900	128,240.000	
	BIOGEN IDEC INC	7,030	47.850	336,385.500	
	INTL GAME TECHNOLOGY	9,300	19.020	176,886.000	
	DEAN FOODS CO	5,100	10.610	54,111.000	
	STARBUCKS CORP	18,700	26.120	488,444.000	
	PERRIGO CO	2,200	56.980	125,356.000	
	NORTHEAST UTILITIES	4,700	25.360	119,192.000	
	INTUIT INC	7,700	35.430	272,811.000	
	BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,900	37.600	146,640.000	
	BEST BUY COMPANY INC	9,000	38.950	350,550.000	
	BALL CORP	3,100	51.150	158,565.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	38,247	5.740	219,537.780	
	BED BATH & BEYOND INC	6,700	43.170	289,239.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,100	15.810	143,871.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,300	47.950	158,235.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,500	34.490	189,695.000	
	VF CORP	2,400	74.430	178,632.000	
	CBS CORP-CL B	16,571	13.930	230,834.030	
	VIACOM INC-CLASS B	14,271	32.730	467,089.830	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	51.000	96,900.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	5,600	16.260	91,056.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,500	49.500	173,250.000	
	CARNIVAL CORP	12,200	35.350	431,270.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	3,600	49.220	177,192.000	
	COMCAST CORP -CL A	52,570	17.800	935,746.000	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	19,500	16.910	329,745.000	
アメリカ・ドル 小計		株 8,261,693		アメリカ・ドル 254,067,822.230 (23,153,200,639)	
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	11.190	66,021.000	
	BP PLC	480,200	4.333	2,080,706.600	
	UNILEVER PLC	33,160	18.660	618,765.600	
	BARCLAYS PLC	311,200	2.886	898,123.200	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	46,400	5.870	272,368.000	
	THOMAS COOK GROUP PLC	22,300	2.002	44,644.600	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	2.280	36,708.000	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	41,900	3.399	142,418.100	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,400	59.000	141,600.000	
	REXAM PLC	32,500	3.158	102,635.000	
	PRUDENTIAL PLC	65,100	5.560	361,956.000	
	LONMIN PLC	4,800	15.940	76,512.000	
	INMARSAT PLC	12,800	7.880	100,864.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	467,215	0.434	202,771.310	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,400	15.170	97,088.000	
	BAE SYSTEMS PLC	89,100	3.210	286,011.000	

AVIVA PLC	71,500	3.291	235,306.500
EURASIAN NATURAL RESOURCE	8,400	9.855	82,782.000
CAIRN ENERGY PLC	37,400	3.966	148,328.400
GLAXOSMITHKLINE PLC	131,802	11.750	1,548,673.500
CABLE&WIRELESS WORLDWIDE	71,100	0.854	60,719.400
INVENSYS PLC	20,500	2.734	56,047.000
REED ELSEVIER PLC	30,646	4.767	146,089.480
BG GROUP PLC	87,400	10.690	934,306.000
DIAGEO PLC	63,600	10.700	680,520.000
RIO TINTO PLC-REG	37,300	31.160	1,162,268.000
BRITISH AIRWAYS PLC	21,300	2.008	42,770.400
STANDARD CHARTERED PLC	51,500	16.215	835,072.500
TESCO PLC	217,700	4.122	897,359.400
FRESNILLO PLC	5,000	9.070	45,350.000
SMITH & NEPHEW PLC	24,300	6.360	154,548.000
SMITHS GROUP PLC	10,333	10.350	106,946.550
PEARSON PLC	21,863	9.395	205,402.880
SAINSBURY (J) PLC	37,825	3.253	123,044.720
NEXT PLC	5,200	20.830	108,316.000
WHITBREAD PLC	6,111	13.930	85,126.230
TOMKINS PLC	31,700	2.453	77,760.100
BUNZL PLC	11,555	7.145	82,560.470
VODAFONE GROUP PLC	1,365,237	1.386	1,892,218.480
BALFOUR BEATTY PLC	17,400	2.554	44,439.600
KINGFISHER PLC	66,111	2.216	146,501.970
WPP PLC	34,500	6.575	226,837.500
UNITED UTILITIES GROUP PL	21,727	5.565	120,910.750
SEVERN TRENT PLC	7,533	12.380	93,258.540
RECKITT BENCKISER PLC	15,600	32.050	499,980.000
SCHRODERS PLC	3,900	13.410	52,299.000
INTERNATIONAL POWER PLC	40,500	2.939	119,029.500
AMEC PLC	11,200	8.120	90,944.000
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	23,800	10.870	258,706.000
ASTRAZENECA PLC	36,900	29.500	1,088,550.000
WOLSELEY PLC	8,290	16.000	132,640.000
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	151,800	0.777	117,948.600
3I GROUP PLC	27,591	2.828	78,027.340
BRITISH SKY BROADCASTING	29,600	5.760	170,496.000
SAGE GROUP PLC (THE)	38,600	2.431	93,836.600
NATIONAL GRID PLC	64,128	4.876	312,688.120
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,083,265	0.554	600,128.810
RSA INSURANCE GROUP PLC	88,900	1.180	104,902.000
IMPERIAL TOBACCO GROUP	26,100	19.170	500,337.000
CENTRICA PLC	133,460	2.815	375,689.900
BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	50,660	21.430	1,085,643.800
ICAP PLC	15,100	3.940	59,494.000
SABMILLER PLC	26,000	19.150	497,900.000
BHP BILLITON PLC	57,177	17.710	1,012,604.670
ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	9.760	96,624.000
HSBC HOLDINGS PLC	447,800	6.301	2,821,587.800
SHIRE PLC	14,600	14.340	209,364.000
OLD MUTUAL PLC	160,200	1.113	178,302.600
ANGLO AMERICAN PLC	34,283	25.175	863,074.520
MORRISON SUPERMARKETS	62,000	2.645	163,990.000
CARNIVAL PLC	4,461	26.080	116,342.880
AUTONOMY CORP PLC	5,900	17.990	106,141.000
FIRSTGROUP PLC	12,800	3.839	49,139.200

	COMPASS GROUP PLC	50,000	5.500	275,000.000	
	BT GROUP PLC	200,800	1.301	261,240.800	
	MAN GROUP PLC	47,925	2.384	114,253.200	
	XSTRATA PLC	55,900	9.512	531,720.800	
	BURBERRY GROUP PLC	15,389	7.290	112,185.810	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	6,700	10.990	73,633.000	
	AGGREKO PLC	7,300	13.300	97,090.000	
	CAPITA GROUP PLC	16,490	7.710	127,137.900	
	SERCO GROUP PLC	13,500	6.105	82,417.500	
	TULLOW OIL PLC	26,000	11.450	297,700.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,600	21.750	78,300.000	
	PETROFAC LTD	7,400	11.900	88,060.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	6.210	27,007.290	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	91,500	18.090	1,655,235.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	69,381	17.400	1,207,229.400	
	G4S PLC	36,600	2.615	95,709.000	
	COBHAM PLC	38,200	2.315	88,433.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,000	13.150	78,900.000	
	INVESTEC PLC	12,500	4.813	60,162.500	
	ANTOFAGASTA PLC	13,900	8.545	118,775.500	
	STANDARD LIFE PLC	57,900	1.790	103,641.000	
	EXPERIAN PLC	27,654	6.210	171,731.340	
	HOME RETAIL GROUP	29,454	2.420	71,278.680	
	RESOLUTION LTD	68,300	0.600	40,980.000	
イギリス・ポンド 小計		株 7,745,275		イギリス・ポンド 33,586,889.840 (4,412,309,719)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM COR	56,400	8.340	470,376.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	42.400	593,600.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	25,200	205.300	5,173,560.000	
	BANK HAPOLIM BM	32,000	14.590	466,880.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	15.020	564,752.000	
イスラエル・シュケル 小計		株 165,200		イスラエル・シュケル 7,269,168.000 (170,898,140)	
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	37.870	3,264,394.000	
	LEND LEASE	12,900	7.860	101,394.000	
	ASCIANO GROUP	85,800	1.605	137,709.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.590	111,141.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	14,500	43.990	637,855.000	
	OZ MINERALS LTD	97,079	1.045	101,447.550	
	FORTESCUE METALS GROUP	30,900	4.150	128,235.000	
	CSR LIMITED	41,700	1.720	71,724.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,000	8.820	88,200.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	52,500	24.360	1,278,900.000	
	WESTPAC BANKING	77,298	22.760	1,759,302.480	
	SANTOS LIMITED	24,200	12.920	312,664.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	68,100	22.640	1,541,784.000	
	ARROW ENERGY LTD	17,200	4.850	83,420.000	
	RIO TINTO LTD	10,700	67.590	723,213.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	22,300	15.310	341,413.000	
	AMCOR	24,100	6.280	151,348.000	
	METCASH LTD	23,500	4.090	96,115.000	

	GOODMAN FIELDER LTD	47,200	1.345	63,484.000	
	FOSTER'S GROUP LTD	48,200	5.650	272,330.000	
	NEWCREST MINING	12,300	32.410	398,643.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	3.100	141,360.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	39,800	51.470	2,048,506.000	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	10.810	51,888.000	
	ORICA LIMITED	9,200	25.430	233,956.000	
	QBE INSURANCE	26,100	19.010	496,161.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,000	31.790	127,160.000	
	WOOLWORTHS	32,300	27.010	872,423.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	11.250	178,875.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	6.560	134,480.000	
	CROWN LTD	16,900	8.000	135,200.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	29,700	2.520	74,844.000	
	TELSTRA CORPORATION	124,600	3.100	386,260.000	
	AMP LIMITED	51,000	5.800	295,800.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES S	15,900	7.550	120,045.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	8,800	44.250	389,400.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,100	4.070	45,177.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	1.495	116,161.500	
	CSL LIMITED	15,300	32.820	502,146.000	
	ONESTEEL LIMITED	44,700	3.090	138,123.000	
	WESFARMERS LIMITED	25,900	29.090	753,431.000	
	WESFARMERS LTD-PPS	4,400	29.100	128,040.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,700	74.820	127,194.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,000	2.280	104,880.000	
	SUNCORP-METWAY LIMITED	31,700	8.210	260,257.000	
	BORAL LIMITED	18,100	5.450	98,645.000	
	ASX LTD	5,300	30.250	160,325.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	11.350	157,765.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	3.420	47,880.000	
	INTOLL GROUP	68,000	1.070	72,760.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	52,300	3.370	176,251.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,100	10.590	106,959.000	
	TRANSURBAN GROUP	33,300	4.430	147,519.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	5.950	111,860.000	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	19.180	103,572.000	
	MACQUARIE AIRPORTS	18,900	2.860	54,054.000	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	31,600	5.980	188,968.000	
	WORLEYPARSONS LTD	5,300	24.260	128,578.000	
	PALADIN ENERGY LTD	18,400	3.890	71,576.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.320	85,608.000	
	AGL ENERGY LTD	14,500	14.380	208,510.000	
	BRAMBLES LTD	38,700	6.490	251,163.000	
オーストラリア・ドル 小計		株 1,983,677		オーストラリア・ドル 21,698,476.530 (1,603,951,385)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,900	40.000	316,000.000	
	SINO-FOREST CORPORATION	6,300	16.340	102,942.000	
	SILVER WHEATON CORP	10,200	19.160	195,432.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,000	45.510	182,040.000	
	BCE INC	8,330	31.550	262,811.500	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,600	31.750	114,300.000	
	SUNCOR ENERGY INC	40,780	32.460	1,323,718.800	
	METRO INC-A	3,300	41.500	136,950.000	

SHERITT INTERNATIONAL CO	9,500	6.290	59,755.000
NATIONAL BANK OF CANADA	4,800	57.260	274,848.000
BANK OF NOVA SCOTIA	26,300	49.230	1,294,749.000
CANADIAN IMPERIAL BANK	10,500	71.240	748,020.000
TORONTO-DOMINION BANK	22,300	70.020	1,561,446.000
GREAT-WEST LIFECO INC	8,100	24.490	198,369.000
ROYAL BANK OF CANADA	36,200	53.540	1,938,148.000
PROGRESS ENERGY RESOURCES	5,700	13.090	74,613.000
TRANSCANADA CORP	17,500	35.280	617,400.000
BOMBARDIER INC 'B'	41,400	4.750	196,650.000
BARRICK GOLD CORP	24,900	43.920	1,093,608.000
CAE INC	9,200	9.410	86,572.000
THOMSON REUTERS CORP	9,504	36.980	351,457.920
POTASH CORP OF SASKATCHEW	7,500	100.560	754,200.000
INMET MINING CRP	1,600	46.180	73,888.000
LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	38.720	135,520.000
CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	44.290	110,725.000
ROGERS COMMUNICATIONS-B	11,700	36.290	424,593.000
AGNICO-EAGLE MINES	4,300	61.020	262,386.000
KINROSS GOLD CORP	17,900	17.860	319,694.000
BANK OF MONTREAL	14,000	61.200	856,800.000
POWER CORP OF CANADA	9,300	26.800	249,240.000
CAMECO CORP	10,500	24.420	256,410.000
TELUS CORP	900	39.420	35,478.000
POWER FINANCIAL CORP	7,400	28.370	209,938.000
TECK RESOURECES LIMITED-B	13,900	32.770	455,503.000
NEXEN INC	15,500	22.950	355,725.000
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,500	56.660	141,650.000
VITERRA INC	10,500	7.470	78,435.000
TALISMAN ENERGY INC	26,800	17.630	472,484.000
IVANHOE MINES LTD	9,100	14.010	127,491.000
AGRIUM INC	4,000	54.670	218,680.000
CANADIAN NATURAL RESOURCE	28,200	36.540	1,030,428.000
GERDAU AMERISTEEL CORP	5,200	11.630	60,476.000
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	600	390.570	234,342.000
MAGNA INTERNATIONAL INC-A	3,600	71.160	256,176.000
TRANSALTA CORP	6,700	20.600	138,020.000
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	73.720	103,208.000
PAN AMERICAN SILVER CORP	3,400	25.600	87,040.000
RESEARCH IN MOTION	13,100	63.230	828,313.000
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	14,600	30.010	438,146.000
ENBRIDGE INC	10,500	48.410	508,305.000
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	14,200	24.560	348,752.000
BROOKFIELD PROPERTIES COR	8,750	14.890	130,287.500
MANULIFE FINANCIAL CORP	47,900	17.160	821,964.000
BIOVAIL CORPORATION	5,200	14.960	77,792.000
GOLDCORP INC	19,159	44.750	857,365.250
ENCANA CORP	19,100	34.760	663,916.000
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,500	58.060	261,270.000
IAMGOLD CORPORATION	9,900	17.500	173,250.000
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	34.250	95,900.000
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	31.570	107,338.000
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,200	59.990	731,878.000
CGI GROUP INC - CL A	8,300	16.120	133,796.000
HUSKY ENERGY INC	8,200	26.040	213,528.000
ONEX CORPORATION	3,500	25.870	90,545.000
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,600	19.210	203,626.000

	TELUS CORPORATION-NON VOT	4,400	37.740	166,056.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	6,100	17.460	106,506.000	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	6,600	35.210	232,386.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	44.260	199,170.000	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	14,600	17.840	260,464.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,900	39.940	155,766.000	
	TMX GROUP INC	2,700	27.280	73,656.000	
	OPEN TEXT CORP	2,000	42.970	85,940.000	
	CI FINANCIAL CORP	5,600	18.120	101,472.000	
	SAPUTO INC	4,800	29.200	140,160.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LT	2,100	54.460	114,366.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	19.220	90,334.000	
	ENSIGN ENERGY SERVICES IN	4,400	13.000	57,200.000	
	YAMANA GOLD INC	21,500	11.100	238,650.000	
	FORTIS INC	5,800	27.220	157,876.000	
	NIKO RESOURCES LTD	1,500	109.540	164,310.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	21.000	71,400.000	
	CRESCENT POINT ENERGY COR	5,000	38.610	193,050.000	
	CENOVUS ENERGY INC	20,800	28.610	595,088.000	
	TIM HORTONS INC	5,000	34.410	172,050.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	7,000	21.610	151,270.000	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,400	23.320	55,968.000	
	PETROBANK ENERGY&RESOURCE	2,600	41.250	107,250.000	
カナダ・ドル 小計		株 890,123		カナダ・ドル 28,954,719.970 (2,470,995,802)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK	33,000	19.280	636,240.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	48,000	13.780	661,440.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	14.440	237,826.800	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	4.850	160,050.000	
	KEPPEL CORP	43,000	8.670	372,810.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	3.740	72,556.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	10.640	180,880.000	
	CAPITALAND LIMITED	51,000	3.600	183,600.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.790	185,710.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	29.920	89,760.000	
	O.C.B.C.	75,000	8.550	641,250.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	105,000	1.030	108,150.000	
	SINGAPORE TELECOM	236,450	2.960	699,892.000	
	NOBLE GROUP LTD	57,181	1.820	104,069.420	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	3.180	152,640.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	4.010	144,360.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	194,400	0.505	98,172.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	7.450	201,150.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	34,000	2.500	85,000.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	20,000	1.440	28,800.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	36,000	5.800	208,800.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	33,000	2.140	70,620.000	
シンガポール・ドル 小計		株 1,214,901		シンガポール・ドル 5,323,776.220 (341,520,244)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,950	53.750	212,312.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	18,000	161.900	2,914,200.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	77.500	62,000.000	

	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	27,500.000	110,000.000	
	ABB LTD	55,850	19.450	1,086,282.500	
	ARYZTA AG	2,300	37.200	85,560.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	89,250	53.350	4,761,487.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,700	89.850	152,745.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	28,500	42.900	1,222,650.000	
	GAM HOLDING LTD	5,900	12.190	71,921.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	32.730	193,107.000	
	SGS SA	150	1,410.000	211,500.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	750	305.800	229,350.000	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES	3,732	236.700	883,364.400	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	81.250	130,000.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	55,550	52.550	2,919,152.500	
	SWISS RE-REG	10,050	46.010	462,400.500	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	13,450	38.650	519,842.500	
	UBS AG-REGISTERED	98,600	14.650	1,444,490.000	
	SWISSCOM AG-REG	720	370.200	266,544.000	
	GEBERIT AG-REG	1,100	173.700	191,070.000	
	GIVAUDAN REG	240	930.500	223,320.000	
	ACTELION LTD-REG	2,700	41.850	112,995.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	245.000	61,250.000	
	SYNGENTA AG	2,462	258.600	636,673.200	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,250	127.700	159,625.000	
	LOGITECH INTL-REG	5,350	16.760	89,666.000	
	SYNTHES INC	1,750	119.900	209,825.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,350	75.850	102,397.500	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	56.500	84,750.000	
	HOLCIM LTD-REG	6,400	72.600	464,640.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	118.700	112,765.000	
	NOBEL BIO CARE HOLDING AG	3,350	21.020	70,417.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,750	108.000	189,000.000	
スイス・フラン 小計		株 427,158		スイス・フラン 20,647,303.100 (1,614,619,103)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ERICSSON LM-B SHS	81,430	80.600	6,563,258.000	
	VOLVO AB-B SHS	27,400	83.550	2,289,270.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,000	638.000	1,276,000.000	
	S.K.F. AB-B SHS	11,400	139.300	1,588,020.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	177.800	1,137,920.000	
	NORDEA AB	85,100	64.350	5,476,185.000	
	SCANIA AB-B SHS	7,700	116.400	896,280.000	
	SWEDISH MATCH AB	7,650	168.500	1,289,025.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	114.900	1,028,355.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	155.200	962,240.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	36,700	39.640	1,454,788.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	12,050	188.500	2,271,425.000	
	SWEDBANK AB	20,450	67.450	1,379,352.500	
	HENNES & MAURITZ AB-B	27,400	228.900	6,271,860.000	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	14,250	92.650	1,320,262.500	
	SKANSKA AB-B	10,800	114.200	1,233,360.000	
	SANDVIK AB	25,600	93.550	2,394,880.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	129.600	1,594,080.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,050	113.200	2,043,260.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	69.900	643,080.000	
	TELIASONERA AB	63,100	48.100	3,035,110.000	

	ALFA LAVAL AB	9,000	99.750	897,750.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,700	102.600	1,405,620.000	
	ASSA ABLOY AB-B	8,450	159.000	1,343,550.000	
	SSAB AB-A SHARES	6,100	112.200	684,420.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	10,650	48.500	516,525.000	
	RATOS AB-B SHS	2,100	196.000	411,600.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	4,700	123.750	581,625.000	
スウェーデン・クローナ 小計		株 548,830		スウェーデン・クローナ 51,989,101.000 (585,917,168)	
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	489.900	5,633,850.000	
	DANSKE BANK A/S	12,300	128.400	1,579,320.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	44,730.000	849,870.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,450	283.500	1,545,075.000	
	CARLSBERG AS-B	3,050	474.700	1,447,835.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,600	647.500	1,036,000.000	
	COLOPLAST-B	550	620.000	341,000.000	
	DSV A/S	5,600	90.400	506,240.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	443.200	365,640.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	25	46,350.000	1,158,750.000	
デンマーク・クローネ 小計		株 40,919		デンマーク・クローネ 14,463,580.000 (210,878,997)	
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	1.860	108,975.540	
	FLETCHER BUILDING LTD	16,800	8.180	137,424.000	
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 246,399.540 (14,889,923)	
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	37.660	819,105.000	
	DNB NOR ASA	27,700	63.900	1,770,030.000	
	ORKLA ASA	20,750	45.040	934,580.000	
	TELENOR ASA	21,100	80.400	1,696,440.000	
	STATOIL ASA	29,273	133.000	3,893,309.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,110	182.200	931,042.000	
	SEADRILL LTD	9,650	135.600	1,308,540.000	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	13,900	15.970	221,983.000	
ノルウェー・クローネ 小計		株 149,233		ノルウェー・クローネ 11,575,029.000 (158,114,897)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	21,600	46.480	1,003,968.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	17,050	47.030	801,861.500	
	COMMERZBANK AG	21,600	5.553	119,944.800	
	VOLKSWAGEN AG	1,650	68.000	112,200.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,450	70.030	241,603.500	
	TUI AG	4,950	7.289	36,080.550	
	M.A.N.	2,900	69.840	202,536.000	
	SIEMENS AG	21,100	72.700	1,533,970.000	
	E.ON AG	48,750	24.530	1,195,837.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	8,150	38.105	310,555.750	
	GEA GROUP AG	5,050	16.160	81,608.000	

BASF SE	23,550	42.740	1,006,527.000
LINDE	4,650	85.110	395,761.500
K+S AG	4,150	37.040	153,716.000
ALLIANZ SE-REG	11,700	79.590	931,203.000
THYSSENKRUPP AG	8,850	21.395	189,345.750
HENKEL AG & CO KGAA	5,100	38.830	198,033.000
R.W.E. AG	11,000	58.270	640,970.000
LUFTHANSA	6,750	10.800	72,900.000
FRAPORT AG	1,100	34.905	38,395.500
FRESENIUS SE	850	54.270	46,129.500
UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	9.841	40,348.100
HOCHTIEF AG	1,450	50.800	73,660.000
SAP AG	22,342	36.245	809,785.790
MUNCHENER RUECK AG-REG	5,100	101.500	517,650.000
HEIDELBERGCEMENT AG	3,900	43.705	170,449.500
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	2,350	34.500	81,075.000
BEIERSDORF AG	2,600	44.700	116,220.000
CELESIO AG	2,800	20.015	56,042.000
MERCK KGAA	1,750	59.820	104,685.000
ADIDAS-SALOMON AG	5,070	40.885	207,286.950
FRESENIUS SE-PFD	2,600	53.650	139,490.000
PUMA AG	230	236.300	54,349.000
HENKEL KGAA	3,750	33.190	124,462.500
METRO AG	3,450	42.500	146,625.000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	72,800	9.203	669,978.400
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,400	42.960	231,984.000
DAIMLER AG	23,150	40.380	934,797.000
QIAGEN N.V.	6,800	17.605	119,714.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	30,700	4.561	140,022.700
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	34.920	64,602.000
DEUTSCHE POST AG	21,800	11.895	259,311.000
DEUTSCHE BOERSE AG	5,150	49.755	256,238.250
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	54.860	63,089.000
SUEDZUCKER AG	1,800	14.895	26,811.000
DEUTSCHE POSTBANK AG	2,400	24.360	58,464.000
SALZGITTER AG	1,050	49.855	52,347.750
WACKER CHEMIE AG	400	105.350	42,140.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	24,826	24.280	602,775.280
ARCELORMITTAL	22,100	23.285	514,598.500
UNILEVER NV-CVA	42,450	22.815	968,496.750
HEINEKEN NV	6,200	35.480	219,976.000
REED ELSEVIER NV	18,927	8.750	165,611.250
AEGON NV	44,644	4.465	199,335.460
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	29,460	10.550	310,803.000
AKZO NOBEL	5,600	42.605	238,588.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,200	32.815	137,823.000
WOLTERS KLUWER	8,150	15.175	123,676.250
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	31.540	66,234.000
ING GROEP N.V.	105,150	6.260	658,239.000
KONINKLIJKE KPN NV	42,500	10.630	451,775.000
ASML HOLDING NV	10,638	23.935	254,620.530
TNT NV	10,195	20.510	209,099.450
VOPAK	1,700	31.370	53,329.000
RANDSTAD HOLDING NV	2,850	32.495	92,610.750
SBM OFFSHORE NV	5,407	12.750	68,939.250
FUGRO NV-CVA	2,200	41.405	91,091.000
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	31.205	95,175.250

TOTAL SA	53,900	38.185	2,058,171.500
MICHELIN (CGDE) - B	3,900	54.710	213,369.000
AIR LIQUIDE	6,760	80.380	543,368.800
PPR	2,050	98.050	201,002.500
SCHNEIDER ELECTRIC SA	6,050	85.030	514,431.500
BOUYGUES	6,250	33.765	211,031.250
LAFARGE SA	5,150	46.225	238,058.750
BNP PARIBAS	24,700	43.125	1,065,187.500
PEUGEOT SA	4,900	20.270	99,323.000
NATIXIS	34,600	3.511	121,480.600
THALES SA	2,650	27.835	73,762.750
GROUPE DANONE	15,550	42.840	666,162.000
CARREFOUR	16,250	33.960	551,850.000
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	14.050	113,453.750
VIVENDI SA	31,550	17.115	539,978.250
L'OREAL	6,100	76.180	464,698.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,000	30.610	306,100.000
LEGRAND SA	3,650	23.915	87,289.750
ALCATEL-LUCENT	63,600	2.130	135,468.000
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,750	63.450	111,037.500
PERNOD-RICARD	5,667	61.370	347,783.790
EURAZEO	750	49.350	37,012.500
SOCIETE GENERALE-A	15,950	31.585	503,780.750
LVMH	6,250	87.270	545,437.500
ACCOR SA	3,700	39.170	144,929.000
CAP GEMINI SA	4,400	38.430	169,092.000
PUBLICIS GROUPE	4,700	33.445	157,191.500
VALLOUREC	1,500	146.700	220,050.000
BUREAU VERITAS SA	1,550	43.945	68,114.750
EIFPAGE	1,300	34.415	44,739.500
SODEXO	2,650	46.810	124,046.500
ESSILOR INTERNATIONAL	5,450	47.105	256,722.250
AXA	43,850	12.535	549,659.750
TELEVISION FRANCAISE	4,200	11.510	48,342.000
CHRISTIAN DIOR	1,850	79.450	146,982.500
LAGARDERE S.C.A.	3,800	26.145	99,351.000
TECHNIP S.A.	2,800	50.250	140,700.000
RENAULT	4,950	29.195	144,515.250
HERMES INTERNATIONAL	1,300	108.000	140,400.000
ERAMET	200	212.050	42,410.000
STMICROELECTRONICS NV	21,650	6.611	143,128.150
ATOS ORIGIN	1,600	36.805	58,888.000
DASSAULT SYSTEMS SA	2,150	48.635	104,565.250
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	16.665	77,492.250
FRANCE TELECOM SA	50,550	15.435	780,239.250
ALSTOM	5,250	38.045	199,736.250
CNP ASSURANCES	1,000	54.850	54,850.000
AIR FRANCE-KLM	4,000	10.035	40,140.000
NEOPOST SA	1,000	60.660	60,660.000
SANOFI-AVENTIS	26,775	48.955	1,310,770.120
VINCI	11,200	36.160	404,992.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	10,750	16.090	172,967.500
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,750	20.740	202,215.000
CREDIT AGRICOLE SA	25,600	8.352	213,811.200
GDF SUEZ	32,323	25.070	810,337.610
IMERYS SA	1,100	41.250	45,375.000
PAGESJAUNES GROUPE SA	3,550	9.254	32,851.700

ELECTRICITE DE FRANCE	6,500	35.265	229,222.500
SES	7,950	17.655	140,357.250
SAFRAN SA	5,250	22.170	116,392.500
ILIAD SA	450	67.000	30,150.000
ADP	950	54.300	51,585.000
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,800	27.105	75,894.000
SCOR SE	5,900	15.740	92,866.000
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	10,200	6.040	61,608.000
UCB SA	3,350	27.165	91,002.750
KBC GROUPE	4,000	29.895	119,580.000
COLRUYT SA	500	185.900	92,950.000
DELHAIZE GROUP	2,400	66.000	158,400.000
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	1,950	58.090	113,275.500
SOLVAY SA	1,750	70.930	124,127.500
UMICORE	4,250	24.310	103,317.500
DEXIA	18,176	3.126	56,818.170
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	18,600	39.120	727,632.000
AGEAS	42,400	2.012	85,308.800
BELGACOM SA	4,900	24.890	121,961.000
MOBISTAR SA	1,050	41.410	43,480.500
BANCO POPOLARE SCARL	18,150	4.152	75,358.800
FIAT SPA	19,450	8.605	167,367.250
PARMALAT SPA	48,350	1.947	94,137.450
PRYSMIAN SPA	2,550	12.100	30,855.000
ASSICURAZIONI GENERALI	30,143	14.290	430,743.470
SAIPEM	6,650	24.510	162,991.500
MEDIOBANCA SPA	17,115	5.880	100,636.200
TENARIS SA	11,300	14.980	169,274.000
UNICREDIT SPA	421,499	1.560	657,538.440
TELECOM ITALIA SPA	248,082	0.926	229,723.930
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.750	128,212.500
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	1.581	33,754.350
INTESA SANPAOLO	200,097	1.993	398,793.320
ATLANTIA SPA	8,300	15.030	124,749.000
BANCA POPOLARE DI MILANO	13,850	3.227	44,693.950
ENI SPA	66,200	14.950	989,690.000
MEDIASET SPA	18,200	4.830	87,906.000
A2A SPA	42,800	1.205	51,574.000
FINMECCANICA SPA	11,225	8.680	97,433.000
MONTE DEI PASCHI SIENA	77,300	0.839	64,854.700
ENEL SPA	161,400	3.675	593,145.000
SNAM RETE GAS	42,000	3.307	138,894.000
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	20.300	76,125.000
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	16,100	6.760	108,836.000
TERNA SPA	39,000	3.052	119,028.000
PIRELLI & C.	84,100	0.450	37,845.000
TELEFONICA S.A.	108,027	15.445	1,668,477.010
BANCO POPULAR ESPANOL	24,072	3.960	95,325.120
BANCO BILIBAO VIZCAYA	91,112	7.696	701,197.950
ACERINOX SA	4,900	12.700	62,230.000
IBERDROLA SA	104,000	5.139	534,456.000
IBERDROLA RENOVABLES SA	23,400	2.509	58,710.600
BANCO DE SABADELL SA	29,969	3.246	97,279.370
BANKINTER SA	8,850	4.311	38,152.350
REPSOL YPF SA	18,200	16.215	295,113.000
GRIFOLS SA	3,700	9.267	34,287.900
BANCO SANTANDER SA	213,550	7.550	1,612,302.500

ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	7,500	11.400	85,500.000
ABERTIS INFRAESTRUCTURA-R	7,500	0.561	4,207.500
GAS NATURAL SDG SA	6,300	11.925	75,127.500
MAPFRE SA	17,100	2.131	36,440.100
MAPFRE SA-RTS	17,100	0.010	171.000
CRITERIA CAIXACORP SA	24,750	3.300	81,675.000
ZARDOYA OTIS SA	3,700	10.730	39,701.000
BANCO DE VALENCIA SA	5,800	3.505	20,329.000
FOMENTO DE CONSTRUC Y CO	1,300	19.055	24,771.500
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	4,726	29.490	139,369.740
ACCIONA SA	750	62.080	46,560.000
INDRA SISTEMAS SA	2,400	13.985	33,564.000
INDITEX	5,350	44.850	239,947.500
GAMESA CORP TECNOLOGICA	4,950	7.556	37,402.200
ENAGAS	4,900	13.345	65,390.500
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	31.795	96,974.750
GESTEVISION TELECINCO SA	3,500	7.786	27,251.000
FERROVIAL SA	14,500	5.203	75,443.500
UPM-KYMMENE OYJ	15,450	10.610	163,924.500
NOKIA OYJ	97,650	8.080	789,012.000
WARTSILA OYJ	2,350	35.170	82,649.500
RAUTARUUKKI OYJ	2,650	12.610	33,416.500
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,350	6.105	118,131.750
METSO OYJ	4,450	25.810	114,854.500
ELISA OYJ-A SHARES	3,550	14.050	49,877.500
SAMPO OYJ-A SHS	10,650	17.300	184,245.000
FORTUM OYJ	10,750	18.430	198,122.500
KESKO OYJ-B SHS	1,950	27.150	52,942.500
KONE OYJ-B	4,250	32.260	137,105.000
OUTOKUMPU OYJ	3,400	12.630	42,942.000
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	19.430	73,834.000
NESTE OIL OYJ	4,300	12.010	51,643.000
POHJOLA BANK PLC	4,800	8.030	38,544.000
VERBUND AG	1,700	25.700	43,690.000
OMV AG	5,450	25.310	137,939.500
ERSTE GROUP BANK AG	5,950	26.000	154,700.000
TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	9.320	102,520.000
VOESTALPINE AG	2,450	21.900	53,655.000
RAIFFEISEN INTL BANK HOLD	1,900	31.150	59,185.000
VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	31.240	31,240.000
PORTUGAL TELECOM SGPS SA	18,600	8.520	158,472.000
BRISA	7,950	4.810	38,239.500
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,050	2.484	134,260.200
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	75,750	0.610	46,207.500
GALP ENERGIA SGPS SA-B	5,900	12.000	70,800.000
EDP RENOVAVEIS SA	7,700	4.658	35,866.600
HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	7,600	6.500	49,400.000
NATIONAL BANK OF GREECE	15,713	9.740	153,044.620
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO	15,400	3.400	52,360.000
ELAN CORPORATION PLC	8,800	4.694	41,307.200
KERRY GROUP PLC-A	4,600	22.800	104,880.000
CRH PLC	18,400	18.360	337,824.000
PUBLIC POWER CORP	3,400	12.100	41,140.000
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,500	3.054	22,905.000
COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	18.130	87,024.000
EFG EUROBANK ERGASIAS	9,008	3.840	34,590.720
OPAP SA	6,100	11.500	70,150.000

	PIRAEUS BANK S.A.	6,791	3.920	26,620.720	
	ALPHA BANK A.E.	12,051	4.500	54,229.500	
ユーロ 小計		株 4,716,495		ユーロ 55,808,017.460 (6,051,821,414)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONGKONG ELECTRIC	43,500	45.750	1,990,125.000	
	MTR CORP	42,500	26.150	1,111,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	35,000	103.600	3,626,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	20.850	437,850.000	
	SINO LAND	60,000	12.860	771,600.000	
	CHEUNG KONG	36,000	87.950	3,166,200.000	
	WHARF HOLDINGS	36,000	37.950	1,366,200.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	85.500	1,710,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	54.550	2,863,875.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	15.680	642,880.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	55,300	48.300	2,670,990.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	46.700	1,681,200.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	38.250	956,250.000	
	HK & CHINA GAS	107,756	17.540	1,890,040.240	
	HANG SENG BANK	19,200	103.100	1,979,520.000	
	WHEELOK & CO	25,000	21.000	525,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	73,000	12.180	889,140.000	
	MONGOLIA ENERGY CO LTD	94,000	2.810	264,140.000	
	WING HANG BANK LIMITED	4,500	71.850	323,325.000	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	52.400	340,600.000	
	HONG KONG EX & CL	24,900	119.000	2,963,100.000	
	LI & FUNG LTD	55,000	35.250	1,938,750.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	28.400	1,789,200.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	64.600	419,900.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	23.600	495,600.000	
	NWS HOLDINGS LTD	23,000	13.140	302,220.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	32.100	722,250.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	28.250	1,441,880.000	
	SANDS CHINA LTD	52,000	11.400	592,800.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	56,000	5.990	335,440.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	13.940	585,480.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	92,500	17.340	1,603,950.000	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	29,225	43.700	1,277,132.500	
香港・ドル 小計		株 1,372,421		香港・ドル 43,674,012.740 (510,549,208)	
合計		株 27,591,314		41,299,666,639 [41,299,666,639]	

(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
新株予約 権証券	香港・ドル			香港・ドル	
		HENDERSON L-CW11	7,200	9,216.000	
	香港・ドル 小計		7,200	香港・ドル 9,216.000 (107,735)	
新株予約権証券 合計			7,200	107,735 [107,735]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,447	225,295.290	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,687	626,490.500	
	BOSTON PROPERTIES INC	3,400	244,154.000	
	VORNADO REALTY TRUST	4,427	319,186.700	
	EQUITY RESIDENTIAL	6,900	284,487.000	
	HOST HOTELS&RESORTS INC	17,493	238,779.450	
	KIMCO REALTY CORP	10,500	139,755.000	
	PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	5,100	172,941.000	
	RAYONIER INC	2,200	94,908.000	
	VENTAS INC	4,300	195,521.000	
	AMB PROPERTY CORP	4,100	99,015.000	
	DUKE REALTY CORP	6,400	72,384.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000	140,160.000	
	HEALTH CARE REIT INC	3,200	131,872.000	
	HCP INC	7,200	217,296.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	95,370.000	
	MACERICH CO/THE	3,300	124,773.000	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	14,300	244,673.000	
	PROLOGIS	13,000	131,300.000	
	PUBLIC STORAGE	3,300	289,476.000	
	REGENCY CENTERS CORP	2,300	78,292.000	
アメリカ・ドル 小計		126,854	アメリカ・ドル 4,166,128.940 (379,659,330)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES PLC	20,000	121,300.000	
	SEGRO PLC	19,850	54,686.750	
	HAMMERSON PLC	20,400	73,623.600	
	BRITISH LAND CO PLC	24,700	112,681.400	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES	13,400	43,938.600	
	イギリス・ポンド 小計	98,350	イギリス・ポンド 406,230.350 (53,366,481)	
オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200	97,792.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	117,115.500	
	GPT GROUP	53,960	145,152.400	
	MIRVAC GROUP	79,500	104,145.000	
	STOCKLAND	59,300	234,828.000	
	WESTFIELD GROUP	57,196	736,112.520	
	GOODMAN GROUP	156,900	105,907.500	
	オーストラリア・ドル 小計	601,756	オーストラリア・ドル 1,541,052.920 (113,914,632)	
シンガポール・ドル	CAPITAMALL TRUST	79,000	シンガポール・ドル 146,150.000	
	シンガポール・ドル 小計	79,000	シンガポール・ドル 146,150.000 (9,375,523)	
ユーロ	CORIO NV	1,500	ユーロ 57,645.000	
	ICADE	600	39,654.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,300	291,525.000	
	GECINA SA	550	37,031.500	

	KLEPIERRE	2,800	60,998.000	
	FONCIERE DES REGIONS	750	56,167.500	
ユーロ 小計		8,500	ユーロ 543,021.000 (58,885,197)	
香港・ドル	LINK REIT	72,000	香港・ドル 1,411,200.000	
香港・ドル 小計		72,000	香港・ドル 1,411,200.000 (16,496,928)	
投資証券 合計			631,698,091 [631,698,091]	
合計			631,805,826 [631,805,826]	

新株予約権証券及び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	組入新株予 約権証券 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 562銘柄 投資証券 21銘柄	98.4%	-%	1.6%	56.1%
イギリス・ポンド	株式 97銘柄 投資証券 5銘柄	98.8%	-%	1.2%	10.6%
イスラエル・シェケル	株式 5銘柄	100%	-%	-%	0.4%
オーストラリア・ドル	株式 62銘柄 投資証券 7銘柄	93.4%	-%	6.6%	4.1%
カナダ・ドル	株式 88銘柄	100%	-%	-%	5.9%
シンガポール・ドル	株式 22銘柄 投資証券 1銘柄	97.3%	-%	2.7%	0.8%
スイス・フラン	株式 34銘柄	100%	-%	-%	3.9%
スウェーデン・クローナ	株式 28銘柄	100%	-%	-%	1.4%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	100%	-%	-%	0.4%
ユーロ	株式 241銘柄 投資証券 6銘柄	99.0%	-%	1.0%	14.6%
香港・ドル	株式 33銘柄 新株予約 権証券 1銘柄 投資証券 1銘柄	96.9%	0.0%	3.1%	1.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成21年6月5日現在	平成22年6月7日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	64,502,253	92,245,160
コール・ローン	1,093,953,722	1,105,186,179
国債証券	92,580,737,887	98,952,014,948
派生商品評価勘定	9,056,882	262,844
未収利息	1,274,271,980	1,246,447,498
前払費用	120,140,338	47,883,155
流動資産合計	95,142,663,062	101,444,039,784
資産合計	95,142,663,062	101,444,039,784
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	96,213	18,519,239
未払解約金	9,000,000	6,005,000
流動負債合計	9,096,213	24,524,239
負債合計	9,096,213	24,524,239
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	49,199,465,313	57,010,882,453
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	45,934,101,536	44,408,633,092
元本等合計	95,133,566,849	101,419,515,545
純資産合計	95,133,566,849	101,419,515,545
負債純資産合計	95,142,663,062	101,444,039,784

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引	為替予約取引

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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	36,568,278,437円	49,199,465,313円
同期中における追加設定元本額	18,326,125,160円	9,970,704,727円
同期中における一部解約元本額	5,694,938,284円	2,159,287,587円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスVA	3,611,906,985円	3,400,500,468円
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	101,447,195円	97,732,610円
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	745,935,929円	746,551,607円
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	227,332,124円	239,151,475円
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	2,081,324,444円	2,235,317,065円
DCダイワ外国債券インデックス	19,274,497,140円	22,547,835,434円
ダイワ・ライフ・バランス30	307,421,429円	335,672,311円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,212,583円	11,144,991円

ダイワ・ライフ・バランス70	907,060円	6,272,576円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／安定コース）	44,341,875円	69,813,568円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	38,389,959円	55,034,230円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	7,264,561円	11,656,917円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,054,345円	3,961,295円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	263,804円	1,043,915円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	23,419円	19,843円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	3,583,489,811円	3,721,934,251円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	347,818,359円	381,892,955円
ダイワ・バランスファンド35V A	11,137,980,114円	14,092,688,104円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド50VA	2,352,432,612円	2,462,509,927円
ダイワ・ワールド・バランスファ ンド75VA	2,064,944,904円	2,093,537,308円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	－円	787,144,824円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	3,221,864,643円	3,652,693,322円
ダイワライフスタイル25	16,087,038円	19,577,760円
ダイワライフスタイル50	23,776,154円	28,829,149円
ダイワライフスタイル75	6,748,826円	8,366,548円
計	49,199,465,313円	57,010,882,453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	49,199,465,313口	57,010,882,453口

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間（平成21年6月6日から平成22年6月7日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成21年6月6日 至 平成22年6月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成22年6月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成21年6月5日現在		平成22年6月7日現在
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	92,580,737,887	△1,930,989,733	310,887,912
合計	92,580,737,887	△1,930,989,733	310,887,912

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年12月2日から平成21年6月5日まで、及び平成21年12月1日から平成22年6月7日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成20年6月6日から平成21年6月5日まで）

I 取引の状況に関する事項

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

II 取引の時価等に関する事項

通貨関連

種 類	平成21年6月5日 現在		
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)
			評価損益 (円)

		1 年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,133,796,065	—	1,142,756,734	8,960,669
アメリカ・ドル	390,689,593	—	393,146,780	2,457,187
イギリス・ポンド	43,488,143	—	43,814,164	326,021
カナダ・ドル	40,098,737	—	40,271,940	173,203
スイス・フラン	10,924,943	—	11,038,560	113,617
スウェーデン・クローナ	8,535,571	—	8,513,450	△22,121
デンマーク・クローネ	11,332,361	—	11,438,580	106,219
ポーランド・ズロチ	10,194,410	—	10,224,580	30,170
ユーロ	618,532,307	—	624,308,680	5,776,373
合計	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。

- ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(平成21年6月6日から平成22年6月7日まで)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成22年6月7日 現在			
	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	990,475,015	—	972,218,620	△18,256,395
アメリカ・ドル	399,350,576	—	399,338,560	△12,016
イギリス・ポンド	72,375,035	—	71,963,360	△411,675

オーストラリア・ドル	8,876,896	—	8,473,200	△403,696
カナダ・ドル	30,075,791	—	29,510,340	△565,451
スイス・フラン	5,214,738	—	5,161,860	△52,878
スウェーデン・クローナ	6,398,829	—	6,175,960	△222,869
デンマーク・クローネ	7,850,297	—	7,581,600	△268,697
ポーランド・ズロチ	5,482,405	—	5,238,000	△244,405
ユーロ	454,850,448	—	438,775,740	△16,074,708
合計	990,475,015	—	972,218,620	△18,256,395

(注) 1. 時価の算定方法

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

- ① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成21年6月5日現在	平成22年6月7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)	1.9336円 (19,336円)	1.7790円 (17,790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	5% U.S. TREASURY NOTE 20110815	アメリカ・ドル 2,202,000.000	アメリカ・ドル 2,320,863.960	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120215	1,872,000.000	2,008,450.080	
		4.375% U.S. TREASURY NOTE 20120815	1,316,000.000	1,420,964.160	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20121115	1,732,000.000	1,862,973.840	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20130215	1,539,000.000	1,658,626.470	

3.625% U.S. TREASURY NOTE 20130515	1,766,000.000	1,894,723.740	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,878,471.860	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,355,814.770	
4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,125,431.680	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	3,061,533.840	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,867,814.570	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,095,237.500	
4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,903,422.920	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,085,437.320	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,350,165.040	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,053,776.280	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,046,398.200	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,239,477.800	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	1,286,000.000	1,342,403.960	
5.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	1,392,000.000	1,461,210.240	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20110731	1,891,000.000	1,987,762.470	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,286,975.940	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20110831	1,160,000.000	1,219,264.400	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20110930	1,261,000.000	1,329,068.780	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111031	1,150,000.000	1,217,332.500	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,632,905.600	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20111130	1,176,000.000	1,245,125.280	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20111231	1,041,000.000	1,108,217.370	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120131	1,240,000.000	1,326,018.800	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,304,375.850	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120229	1,375,000.000	1,470,810.000	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120331	1,923,000.000	2,057,975.370	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20120430	1,650,000.000	1,770,582.000	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,016,700.450	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20120531	1,162,000.000	1,255,180.780	
4.875% U.S. TREASURY NOTE 20120630	1,301,000.000	1,413,159.210	
4.625% U.S. TREASURY NOTE 20120731	1,100,000.000	1,191,608.000	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,735,075.140	
4.125% U.S. TREASURY NOTE 20120831	1,187,000.000	1,275,787.600	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20120930	1,056,000.000	1,141,462.080	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20121031	1,079,000.000	1,157,605.150	

4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,860,382.980	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20121130	1,000,000.000	1,061,870.000	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20121231	1,263,000.000	1,351,498.410	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20130131	1,319,000.000	1,385,464.410	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,022,542.590	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20130228	1,500,000.000	1,569,600.000	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20130331	1,890,000.000	1,966,998.600	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130430	1,432,000.000	1,515,227.840	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,169,035.200	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,564,106.080	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,461,305.000	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,567,433.680	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,417,638.300	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,652,050.000	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,778,967.670	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,268,409.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20111115	2,083,000.000	2,120,098.230	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	7,381,145.400	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,520,128.700	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20111215	2,476,000.000	2,497,739.280	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,148,668.120	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20120115	2,825,000.000	2,850,368.500	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,475,529.000	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120215	2,353,000.000	2,382,859.570	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	6,789,580.980	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,766,203.160	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,228,078.650	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120315	2,326,000.000	2,358,331.400	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,359,728.000	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,462,408.880	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120415	2,241,000.000	2,272,329.180	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,426,598.140	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,029,754.370	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120515	2,454,000.000	2,486,687.280	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	3,246,000.000	3,250,284.720	

0.875% U.S. TREASURY NOTE 20110531	3,037,000.000	3,051,942.040	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,054,975.500	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	649,963.440	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20120615	2,550,000.000	2,609,848.500	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20110630	3,231,000.000	3,255,103.260	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	5,267,000.000	5,470,885.570	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,217,929.700	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20120715	4,765,000.000	4,841,859.450	
1% U.S. TREASURY NOTE 20110731	4,102,000.000	4,126,488.940	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,358,032.660	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	1,916,328.180	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20120815	3,247,000.000	3,316,226.040	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,061,075.000	
1% U.S. TREASURY NOTE 20110831	4,909,000.000	4,938,110.370	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,063,718.180	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,558,733.840	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20120915	3,272,000.000	3,314,045.200	
1% U.S. TREASURY NOTE 20110930	5,235,000.000	5,271,173.850	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,071,347.170	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,568,872.040	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20121015	5,247,000.000	5,314,633.830	
1% U.S. TREASURY NOTE 20111031	4,093,000.000	4,121,118.910	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,180,376.200	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,398,332.990	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20121115	4,113,000.000	4,161,327.750	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	4,526,000.000	4,598,461.260	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20111130	4,132,000.000	4,143,941.480	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,642,842.460	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,192,730.460	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20121215	3,851,000.000	3,869,330.760	
1% U.S. TREASURY NOTE 20111231	2,313,000.000	2,327,618.160	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,587,769.260	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,169,233.950	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130115	4,644,000.000	4,689,696.960	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20120131	2,296,000.000	2,305,321.760	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,352,340.950	

3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	2,975,682.360	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130215	4,445,000.000	4,484,382.700	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	5,830,090.200	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20120229	4,612,000.000	4,630,355.760	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	2,275,000.000	2,324,299.250	
3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	4,687,000.000	4,797,191.370	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130315	2,898,000.000	2,921,647.680	
1% U.S. TREASURY NOTE 20120331	4,608,000.000	4,636,062.720	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,317,000.000	2,379,350.470	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	4,821,466.050	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20130415	2,877,000.000	2,928,124.290	
1% U.S. TREASURY NOTE 20120430	4,519,000.000	4,545,436.150	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,275,002.600	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,705,036.440	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20130515	2,259,000.000	2,273,638.320	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	2,761,000.000	2,832,178.580	
11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,333,746.210	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,353,829.000	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,014,930.560	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,126,576.550	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,061,952.800	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,310,800.000	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,215,163.860	
8.5% U.S. TREASURY BOND 20200215	743,000.000	1,071,249.970	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,032,367.400	
7.875% U.S. TREASURY BOND 20210215	795,000.000	1,117,094.250	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210515	732,000.000	1,048,816.920	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20210815	677,000.000	972,551.120	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,321,484.750	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,048,972.800	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,173,705.740	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,116,469.740	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,122,658.390	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	986,703.750	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,108,244.160	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,075,624.200	
6.75% U.S. TREASURY BOND 20260815	1,135,000.000	1,537,925.000	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	834,844.500	

	6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	923,474.880	
	6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,005,493.050	
	6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	2,961,256.320	
	5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	978,388.590	
	5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,099,654.920	
	5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	1,739,422.440	
	6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	857,079.990	
	6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,773,514.080	
	5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,581,862.240	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	2,424,290.880	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,031,106.450	
	5% U.S. TREASURY BOND 20370515	2,877,000.000	3,312,807.960	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	3,089,035.040	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	2,939,052.060	
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	3,045,568.960	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	2,769,735.780	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	3,762,483.750	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	1,160,000.000	1,210,112.000	
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	1,749,000.000	1,898,347.110	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,264,219.100	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 417,452,000.000 (38,042,400,760)	アメリカ・ドル 444,379,541.100 (40,496,307,580)	
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	480,216.000	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,194,628.400	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	715,432.000	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	782,000.000	1,006,590.400	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	440,000.000	617,232.000	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	1,868,000.000	2,319,869.200	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	1,822,986.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120307	2,452,000.000	2,629,034.400	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	1,910,000.000	2,143,784.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	1,840,332.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,480,601.300	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,149,666.200	

	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,814,000.000	3,036,868.800	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,778,000.000	1,958,111.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,339,000.000	1,342,749.200	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,661,615.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,056,671.900	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,379,000.000	1,396,651.200	
	5.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20120607	3,335,000.000	3,616,140.500	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	902,000.000	1,018,899.200	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	1,866,692.300	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,380,000.000	1,480,188.000	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130307	2,025,000.000	2,197,327.500	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	2,495,000.000	2,492,255.500	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	1,978,886.000	
	3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20111207	1,798,000.000	1,865,425.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	125,000.000	124,175.000	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,191,000.000	1,216,487.400	
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	1,914,000.000	1,947,112.200	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	343,000.000	354,627.700	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	1,433,000.000	1,466,962.100	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	363,000.000	344,523.300	
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	1,426,000.000	1,460,794.400	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 51,392,000.000 (6,751,367,040)	イギリス・ポンド 55,283,536.100 (7,262,598,137)	
オーストラリア ・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20110615	255,000.000	258,526.650	
	6.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20130515	2,426,000.000	2,539,973.480	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,455,150.250	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	986,000.000	1,027,214.800	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	780,000.000	773,705.400	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	1,741,000.000	1,778,727.470	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	272,000.000	278,647.680	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	475,000.000	496,859.500	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	1,793,020.720	

	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20121115	733,000.000	733,139.270	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	187,000.000	190,831.630	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	327,000.000	332,454.360	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 11,495,000.000 (849,710,400)	オーストラリア・ドル 11,658,251.210 (861,777,929)	
カナダ・ドル	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	カナダ・ドル 424,000.000	カナダ・ドル 623,992.320	
	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	372,000.000	605,058.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,357,000.000	2,094,923.030	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,645,369.200	
	6% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	907,000.000	950,536.000	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	1,069,000.000	1,144,674.510	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	930,895.960	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	1,795,805.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,319,820.800	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,130,213.840	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	1,939,238.550	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	983,000.000	1,048,831.510	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	735,000.000	757,740.900	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	940,000.000	1,001,006.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	631,000.000	657,129.710	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	1,471,000.000	1,589,945.060	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,422,513.870	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,041,000.000	2,127,497.580	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,642,941.840	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	606,000.000	641,754.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110601	1,235,000.000	1,237,235.350	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,622,169.860	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,245,000.000	1,242,024.450	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120901	346,000.000	347,695.400	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20111201	1,529,000.000	1,526,874.690	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	695,000.000	707,127.750	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120301	311,000.000	311,059.090	

	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	251,000.000	250,277.120	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130301	359,000.000	356,537.260	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20120601	212,000.000	211,463.640	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	433,000.000	439,676.860	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	418,000.000	421,904.120	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 31,461,000.000 (2,684,881,740)	カナダ・ドル 34,743,933.270 (2,965,047,266)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20130701	486,000.000	510,372.900	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20120701	347,000.000	368,638.920	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20110701	255,000.000	263,856.150	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	582,257.900	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	486,000.000	538,745.580	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	539,143.920	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	406,000.000	424,257.820	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	320,000.000	331,065.600	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20120401	730,000.000	758,243.700	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	302,770.710	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20121001	104,000.000	108,612.400	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20130401	338,000.000	347,457.240	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	304,000.000	327,943.040	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	236,000.000	235,230.640	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	182,463.650	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	117,000.000	115,436.880	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	142,000.000	145,136.780	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,748,000.000 (368,734,200)	シンガポール・ドル 6,081,633.830 (390,136,810)	
スイス・フラン	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20130211	スイス・フラン 2,037,000.000	スイス・フラン 2,230,963.140	
	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	917,000.000	1,037,292.060	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	763,000.000	959,304.640	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	410,000.000	536,259.500	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	721,000.000	784,736.400	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,332,000.000	1,501,004.160	
スイス・フラン 小計		スイス・フラン	スイス・フラン	

		6,180,000.000 (483,276,000)	7,049,559.900 (551,275,585)	
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	7,755,148.800	
	5.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20121008	8,315,000.000	9,152,320.500	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	4,550,000.000	5,079,301.500	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,550,000.000	6,751,519.500	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,403,297.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,649,806.250	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	10,010,000.000	11,325,514.200	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,680,000.000	4,860,741.600	
スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 49,050,000.000 (552,793,500)	スウェーデン・クローナ 54,977,649.850 (619,598,114)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	2,323,000.000	3,431,628.520	
	6% DANISH GOVERNMENT BOND 20111115	5,212,000.000	5,615,096.080	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	7,728,000.000	8,740,290.720	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	6,810,000.000	7,586,271.900	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	8,535,000.000	9,533,338.950	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	9,889,000.000	12,176,029.030	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	4,509,000.000	5,039,303.490	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20121115	6,175,000.000	6,651,648.250	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 51,181,000.000 (746,218,980)	デンマーク・クローネ 58,773,606.940 (856,919,189)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	6.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20130515	5,884,000.000	6,594,375.320	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	4,898,000.000	5,485,613.060	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	4,132,000.000	4,523,465.680	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	2,431,000.000	2,693,791.100	
ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 17,345,000.000 (236,932,700)	ノルウェー・クローネ 19,297,245.160 (263,600,369)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	2,383,000.000	2,387,813.660	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,344,911.870	

	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,283,808.810	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	2,855,000.000	2,788,592.700	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20120425	2,697,000.000	2,712,507.750	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20130425	3,317,000.000	3,358,396.160	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,753,000.000	3,831,212.520	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,403,604.460	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20110725	1,665,000.000	1,591,223.850	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20120125	2,210,000.000	2,062,769.800	
	Poland Governmet Bond 20120725	1,974,000.000	1,796,734.800	
	5.5% Poland Governmet Bond 20150425	1,162,000.000	1,169,773.780	
	Poland Governmet Bond 20121025	546,000.000	490,433.580	
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 30,550,000.000 (801,937,500)	ポーランド・ズロチ 30,221,783.740 (793,321,824)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	1,600,000.000	1,647,232.000	
	3.702% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130225	2,262,000.000	2,294,437.080	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	700,000.000	736,309.000	
	3.833% MALAYSIAN GOVERNMENT 20110928	2,582,000.000	2,616,831.180	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	1,576,000.000	1,670,402.400	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,159,793.560	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,060,446.520	
	3.718% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120615	1,356,000.000	1,376,082.360	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,017,760.800	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	512,107.290	
	3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	767,600.890	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	593,766.420	
	2.509% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120827	327,000.000	323,481.480	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,122,292.400	
	2.711% MALAYSIAN GOVERNMENT 20120214	573,000.000	571,487.280	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,063,898.880	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	371,632.160	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 19,432,000.000 (531,659,520)	マレーシア・リンギット 19,905,561.700 (544,616,169)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	356,747.380	

6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,699,000.000	2,331,571.680	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,530,814.230	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,152,838.800	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	962,000.000	1,161,932.460	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,274,000.000	1,819,858.040	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,567,000.000	2,076,149.640	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110704	2,633,000.000	2,764,018.080	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120104	3,326,000.000	3,568,964.300	
5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120704	2,935,000.000	3,208,630.050	
4.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130104	2,774,000.000	3,047,017.080	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	2,080,428.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	2,666,178.120	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,440,711.200	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	3,049,669.480	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,306,364.570	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	2,866,412.670	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,165,980.000	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,752,691.900	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,946,479.760	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,427,076.150	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,527,803.330	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,397,183.940	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,019,279.860	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,113,990.080	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,346,516.480	
3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	2,959,265.160	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,523,350.160	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	394,000.000	418,546.200	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	640,000.000	663,507.200	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110610	1,146,000.000	1,160,313.540	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20110916	2,710,000.000	2,741,625.700	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111216	2,200,000.000	2,230,206.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120316	423,000.000	427,606.470	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120615	826,000.000	826,338.660	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20111014	2,029,000.000	2,115,557.140	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20120413	1,815,000.000	1,938,329.250	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20121012	1,219,000.000	1,326,527.990	
3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130412	1,914,000.000	2,070,775.740	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,260,338.960	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,508,892.990	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,483,034.740	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	203,000.000	212,969.330	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	688,000.000	713,407.840	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121226	840,000.000	1,001,809.200	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	955,130.040	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	1,990,105.200	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,569,814.400	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,694,000.000	2,121,548.660	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20111025	1,324,000.000	1,406,855.920	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,387,354.750	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120425	1,980,000.000	2,142,399.600	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,637,000.000	2,152,785.960	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20121025	1,748,000.000	1,909,340.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130425	1,700,000.000	1,843,939.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,209,708.800	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,280,107.970	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,726,225.130	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,949,043.600	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,805,619.300	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	1,889,573.800	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	1,585,000.000	1,699,373.600	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,937,911.600	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	1,752,000.000	1,853,458.320	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,332,000.000	2,469,611.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	3,264,000.000	3,427,167.360	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,378,821.280	

4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	2,117,000.000	2,329,652.650	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,082,843.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,472,471.330	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,473,000.000	1,635,854.880	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,710,000.000	1,944,577.800	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,354,000.000	2,494,580.880	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	1,647,000.000	1,711,776.510	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	339,000.000	358,350.120	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110712	2,680,000.000	2,769,726.400	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120112	1,466,000.000	1,540,883.280	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120712	2,183,000.000	2,352,247.990	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130112	1,789,000.000	1,918,774.060	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	861,000.000	947,978.220	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	2,289,000.000	2,384,680.200	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20110912	1,157,000.000	1,172,897.180	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	1,388,000.000	1,464,992.360	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	1,115,000.000	1,150,691.150	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20120920	1,367,000.000	1,367,273.400	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,022,735.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,091,000.000	1,403,866.070	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20110715	1,032,000.000	1,083,176.880	
5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120715	1,033,000.000	1,124,844.030	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,187,197.920	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,996,192.820	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	838,000.000	894,565.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	838,000.000	923,827.960	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	739,000.000	817,710.890	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	683,000.000	729,464.490	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	974,000.000	1,105,373.120	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,303,346.500	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20120115	1,766,000.000	1,821,452.400	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,559,507.690	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,573,468.800	

1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130115	410,000.000	418,655.100	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	846,000.000	887,792.400	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	438,000.000	464,227.440	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,921,368.240	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	734,000.000	929,016.460	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	3,385,674.000	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,727,887.360	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,487,264.740	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110801	1,816,000.000	1,889,620.640	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120201	3,012,000.000	3,150,461.640	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	2,034,084.800	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130201	2,876,000.000	3,045,310.120	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,770,359.360	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,570,681.310	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,837,794.440	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,642,279.860	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,969,735.770	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,335,528.260	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,605,490.380	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,224,432.080	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	1,864,000.000	1,599,778.000	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	3,026,684.080	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	4,041,150.360	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110915	1,569,000.000	1,607,832.750	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,343,110.400	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120415	2,317,000.000	2,392,024.460	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	2,048,786.400	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121015	1,506,000.000	1,567,505.040	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,961,590.160	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	2,104,280.630	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	1,865,000.000	1,938,891.300	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130415	1,694,000.000	1,772,466.080	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20110901	1,524,000.000	1,570,314.360	

4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	3,213,000.000	3,316,972.680	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	2,615,000.000	2,696,352.650	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120301	1,954,000.000	1,985,127.220	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,776,854.620	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,742,847.000	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,341,000.000	1,370,890.890	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20120701	1,037,000.000	1,041,614.650	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,436,000.000	1,414,072.280	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	1,527,000.000	1,533,230.160	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20121215	411,000.000	406,363.920	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	818,000.000	809,885.440	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	430,000.000	424,182.100	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,650,227.500	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	478,930.010	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20121224	791,000.000	921,942.140	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20110928	842,000.000	887,038.580	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120928	910,000.000	988,869.700	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	935,469.000	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,343,384.680	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	872,000.000	944,794.560	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	1,827,003.600	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,166,929.540	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,226,244.150	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	852,000.000	879,059.520	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,105,599.550	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130328	1,341,000.000	1,433,435.130	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,588,242.370	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	630,000.000	676,279.800	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,617,958.940	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,966,667.080	
2% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20120328	1,080,000.000	1,097,906.400	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	413,000.000	420,752.010	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	514,261.080	

4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	435,000.000	438,584.400	
5% IRISH TREASURY 20130418	607,000.000	637,052.570	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	678,097.820	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	550,470.030	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	775,832.000	
4% IRISH TREASURY 20111111	278,000.000	284,716.480	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,182,026.680	
3.9% IRISH TREASURY 20120305	282,000.000	288,361.920	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000	977,694.310	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	784,000.000	754,607.840	
5% IRISH TREASURY 20201018	245,000.000	240,460.150	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,310,952.090	
5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20120715	866,000.000	941,255.400	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	578,000.000	766,959.760	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	1,975,078.000	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,478,087.750	
3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	831,000.000	873,031.980	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,191,000.000	1,285,327.200	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	664,000.000	706,509.280	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	844,000.000	849,789.840	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	992,800.710	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	333,000.000	352,666.980	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	559,767.660	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	587,000.000	641,825.800	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,051,000.000	1,114,911.310	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,069,241.840	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,176,567.600	
5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	821,736.750	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	350,000.000	392,140.000	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	429,220.250	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20120915	559,000.000	603,608.200	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	621,560.500	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	687,000.000	735,612.120	
4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	391,000.000	422,002.390	
3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	431,000.000	448,567.560	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,302,000.000	1,398,933.900	
6.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130131	1,255,000.000	1,357,546.050	

4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	998,000.000	1,052,171.440	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20110730	2,743,000.000	2,858,754.600	
5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120730	953,000.000	997,123.900	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,088,000.000	1,130,606.080	
5.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20111031	1,411,000.000	1,474,847.750	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,788,486.740	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,030,000.000	1,064,762.500	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	1,240,000.000	1,288,050.000	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	2,215,752.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,818,099.360	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,002,192.560	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20121031	993,000.000	1,020,228.060	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,034,565.090	
4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,460,706.410	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	708,000.000	702,017.400	
4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,866,000.000	1,930,955.460	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20120430	2,036,000.000	2,042,515.200	
4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,530,304.090	
4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,751,090.750	
3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,180,367.860	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	457,000.000	397,265.530	
2.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130430	1,704,000.000	1,673,992.560	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	1,245,000.000	1,192,635.300	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	835,000.000	806,067.250	
3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	427,000.000	416,769.080	
5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20120615	380,000.000	396,435.000	
5.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20130923	1,233,000.000	1,316,104.200	
5.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20110615	580,000.000	601,808.000	
4.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20140616	604,000.000	625,810.440	
3.85% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20210415	654,000.000	586,467.960	
3.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20151015	305,000.000	295,862.200	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	424,000.000	333,637.120	
4.2% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20161015	625,000.000	623,625.000	

	4.35% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20171016	563,000.000	556,581.800	
	4.45% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20180615	440,000.000	433,395.600	
	4.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20231025	661,000.000	639,517.500	
	4.75% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20190614	1,520,000.000	1,512,339.200	
	3.6% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20141015	711,000.000	707,373.900	
	4.8% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20200615	416,000.000	411,016.320	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20140111	250,000.000	241,185.000	
	5.25% HELLENIC REPUBLIC 20120518	781,000.000	760,334.740	
	4.6% HELLENIC REPUBLIC 20130520	552,000.000	516,230.400	
	6.5% HELLENIC REPUBLIC 20191022	823,000.000	729,671.800	
	5.9% HELLENIC REPUBLIC 20221022	1,575,000.000	1,267,654.500	
	4.5% HELLENIC REPUBLIC 20370920	972,000.000	587,058.840	
	4.5% HELLENIC REPUBLIC 20140520	639,000.000	566,441.550	
	3.7% HELLENIC REPUBLIC 20150720	789,000.000	637,291.080	
	3.6% HELLENIC REPUBLIC 20160720	533,000.000	418,868.710	
	3.9% HELLENIC REPUBLIC 20110820	755,000.000	736,079.700	
	4.3% HELLENIC REPUBLIC 20170720	875,000.000	698,503.750	
	4.6% HELLENIC REPUBLIC 20400920	811,000.000	490,257.610	
	4.7% HELLENIC REPUBLIC 20240320	1,016,000.000	716,584.800	
	4.1% HELLENIC REPUBLIC 20120820	610,000.000	568,898.200	
	4.6% HELLENIC REPUBLIC 20180720	760,000.000	608,349.600	
	4% HELLENIC REPUBLIC 20130820	765,000.000	692,937.000	
	5.5% HELLENIC REPUBLIC 20140820	1,194,000.000	1,080,713.280	
	4.3% HELLENIC REPUBLIC 20120320	2,491,000.000	2,413,729.180	
	6% HELLENIC REPUBLIC 20190719	1,330,000.000	1,118,051.200	
	5.3% HELLENIC REPUBLIC 20260320	242,000.000	175,958.200	
	6.1% HELLENIC REPUBLIC 20150820	1,435,000.000	1,316,655.550	
	6.25% HELLENIC REPUBLIC 20200619	431,000.000	372,146.950	
	5.9% HELLENIC REPUBLIC 20170420	103,000.000	91,311.560	
	ユーロ 小計	ユーロ 376,080,000.000 (40,782,115,200)	ユーロ 399,730,874.000 (43,346,815,976)	
国債証券 合計		92,832,027,540 [92,832,027,540]	98,952,014,948 [98,952,014,948]	
合計		92,832,027,540 [92,832,027,540]	98,952,014,948 [98,952,014,948]	

- (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 170銘柄	100%	40.9%
イギリス・ポンド	国債証券 33銘柄	100%	7.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 12銘柄	100%	0.9%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	100%	3.0%
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券 6銘柄	100%	0.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.6%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	0.3%

ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	100%	0.8%
マレーシア・リンギット	国債証券	17銘柄	100%	0.6%
ユーロ	国債証券	265銘柄	100%	43.7%

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（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成22年6月30日

I 資産総額	4,115,681,541円
II 負債総額	807,426円
III 純資産総額（I－II）	4,114,874,115円
IV 発行済数量	4,051,836,693口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.0156円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド
純資産額計算書

平成22年6月30日

I 資産総額	89,267,513,384円
II 負債総額	62,031,826円
III 純資産総額（I－II）	89,205,481,558円
IV 発行済数量	199,464,688,577口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.4472円

（参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
純資産額計算書

平成22年6月30日

I 資産総額	11,714,497,425円
II 負債総額	194,198,150円
III 純資産総額（I－II）	11,520,299,275円
IV 発行済数量	10,437,243,976口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	1.1038円

（参考）外国株式インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成22年6月30日

I 資産総額	41,681,771,176円
II 負債総額	313,483,010円
III 純資産総額（I－II）	41,368,288,166円
IV 発行済数量	52,658,068,861口
V 1単位当たり純資産額（III／IV）	0.7856円

（参考）外国債券インデックスマザーファンド
純資産額計算書

平成22年6月30日

I 資産総額	101,711,236,491円
II 負債総額	520,927,214円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	101,190,309,277円
Ⅳ 発行済数量	57,408,984,751口
Ⅴ 1 単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7626円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

- ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成22年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成22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（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	14	37,461
追加型株式投資信託	349	6,401,142
株式投資信託 合計	363	6,438,602
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,835,119
公社債投資信託 合計	17	2,835,119
総合計	380	9,273,722

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20年4月1日から平成21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21年4月1日から平成22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20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び当事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

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21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,961,462	4,783,803
有価証券	28,233,112	26,970,072
前払金	453	136
前払費用	84,549	77,248
未収入金	20,722	3,858
未収消費税等	27,138	—
未収委託者報酬	5,273,080	7,030,430
未収収益	25,476	90,787
貯蔵品	38,909	30,324
繰延税金資産	227,536	566,334
その他	2,030	256,955
流動資産計	37,894,473	39,809,953
固定資産		
有形固定資産	※1 1,252,162	※1 1,186,818
建物（純額）	349,484	318,162
器具備品（純額）	900,893	757,333
建設仮勘定	1,785	111,322
無形固定資産	1,980,730	1,751,209
ソフトウェア	1,967,944	1,558,342
ソフトウェア仮勘定	—	179,630
電話加入権	11,850	11,850
商標権	—	660
その他	936	725
投資その他の資産	8,317,769	10,657,920

投資有価証券		7,780,508		10,018,677
関係会社株式		737,012		737,012
出資金		178,806		178,806
従業員に対する長期貸付金		155,692		104,419
差入保証金		618,264		617,615
長期前払費用		8,394		8,402
投資不動産（純額）	※1	579,162	※1	489,861
貸倒引当金	※3	△1,740,069	※3	△1,496,873
固定資産計		11,550,663		13,595,948
資産合計		49,445,137		53,405,901

(単位:千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	48,999	46,289
未払金	5,335,193	7,304,929
未払収益分配金	32,233	31,110
未払償還金	278,950	261,645
未払手数料	2,896,691	3,847,895
その他未払金	※2 2,127,318	※2 3,164,277
未払費用	1,528,570	2,212,051
未払法人税等	442,052	692,446
未払消費税等	—	104,897
賞与引当金	223,000	838,400
その他	1,951	168,621
流動負債計	7,579,766	11,367,635
固定負債		
退職給付引当金	1,150,011	1,179,482
役員退職慰労引当金	62,520	39,300
繰延税金負債	1,767,537	1,963,856
固定負債計	2,980,068	3,182,638
負債合計	10,559,835	14,550,274
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	9,659,553	9,085,103
利益剰余金合計	12,833,851	12,259,401

株主資本合計	39,503,851	38,929,401
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△618,549	△18,061
繰延ヘッジ損益	—	△55,712
評価・換算差額等合計	△618,549	△73,774
純資産合計	38,885,301	38,855,627
負債・純資産合計	49,445,137	53,405,901

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

重要な会計方針

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

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

会計方針の変更

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

（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。	-----
---	-------

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)																
※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建物</td><td>776,838千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,691,069千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>675,647千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>26,929千円</td></tr> </table> ※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 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711,260千円に対して保証を行っております。	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	※1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建物</td><td>815,365千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>1,938,369千円</td></tr> <tr> <td>投資建物</td><td>688,305千円</td></tr> <tr> <td>投資器具備品</td><td>27,339千円</td></tr> </table> ※2 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払金 3,002,391千円 ※3 同左 4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。	建物	815,365千円	器具備品	1,938,369千円	投資建物	688,305千円	投資器具備品	27,339千円
建物	776,838千円																
器具備品	1,691,069千円																
投資建物	675,647千円																
投資器具備品	26,929千円																
建物	815,365千円																
器具備品	1,938,369千円																
投資建物	688,305千円																
投資器具備品	27,339千円																

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

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

- ①剰余金の配当の総額 6,495百万円
- ②配当の原資 利益剰余金
- ③1株当たり配当額 2,490円
- ④基準日 平成21年3月31日
- ⑤効力発生日 平成21年6月22日

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

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

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

⑤効力発生日

平成22年6月28日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																				
(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 器具備品 <table> <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>3,613千円</td></tr> <tr> <td>期末残高相当額</td><td>985千円</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>- 千円</td></tr> <tr> <td>合計</td><td>985千円</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。 (3)支払リース料及び減価償却費相当額 <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>1,314千円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>1,314千円</td></tr> </table> (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りしております。	取得価額相当額	4,599千円	減価償却累計額相当額	3,613千円	期末残高相当額	985千円	1年以内	985千円	1年超	- 千円	合計	985千円	支払リース料	1,314千円	減価償却費相当額	1,314千円	(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 (1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額 該当事項はありません。 (2)未経過リース料期末残高相当額 該当事項はありません。 (3)支払リース料及び減価償却費相当額 <table> <tr> <td>支払リース料</td><td>985千円</td></tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td><td>985千円</td></tr> </table> (4)減価償却費相当額の算定方法 同左	支払リース料	985千円	減価償却費相当額	985千円
取得価額相当額	4,599千円																				
減価償却累計額相当額	3,613千円																				
期末残高相当額	985千円																				
1年以内	985千円																				
1年超	- 千円																				
合計	985千円																				
支払リース料	1,314千円																				
減価償却費相当額	1,314千円																				
支払リース料	985千円																				
減価償却費相当額	985千円																				

(金融商品関係)

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 為替変動リスクの管理

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

(ii) 価格変動リスクの管理

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

(iii) デリバティブ取引

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

②信用リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：千円)

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

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

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

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

資 産

（1）現金・預金、及び（2）未収委託者報酬

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

（3）有価証券及び投資有価証券

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

負 債

（1）未払手数料、（2）その他未払金、並びに（3）未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
(1) その他有価証券	

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

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

（*1）外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

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

（追加情報）

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

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

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

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

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

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

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

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

当事業年度（平成22年3月31日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 取引の状況に関する事項

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

2. 取引の時価等に関する事項（平成21年3月31日現在）

通貨関連

(単位：千

円)

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

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

通貨関連

(単位：千円)

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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

株式関連

(単位：千円)

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

(退職給付関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。 2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,150,011千円 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 168,703千円 その他 141,642千円 退職給付費用 310,345千円 なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 1,179,482千円 退職給付引当金 1,179,482千円 3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 175,249千円 その他 128,723千円 退職給付費用 303,972千円 なお、「その他」の128,723千円は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
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	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 915,392 貸倒引当金 609,077 退職給付引当金 479,931 賞与引当金 302,163 株式譲渡損繰延 287,965 投資有価証券評価損 225,062 外貨建有価証券換算差額 176,654 未払事業税 163,956 出資金評価損 126,163 その他有価証券評価差額金 65,652 未払社会保険料 44,836 繰延ヘッジ損益 38,221 器具備品 38,093 役員退職慰労引当金 15,991 その他 27,316 繰延税金資産小計 3,516,480 評価性引当額 △2,139,543 繰延税金資産合計 1,376,937 繰延税金負債 株式譲渡益繰延 2,772,301 その他 2,156 繰延税金負債合計 2,774,458 繰延税金負債の純額 1,397,521

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率 (調整) 40.69% 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 △0.74 税効果会計適用後の法人税等の負担率 42.52	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
---	---

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

(追加情報)

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

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

(注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として、代行手数料を支払っております。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

3. 大和証券エスエムビーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常の利用の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

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

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称 住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 （平成22年3月 末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
中央三井信託銀行株式会社	399,697	(注3)
日本生命保険相互会社	1,050,000	(注2)
株式会社りそな銀行	279,928	(注3)

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注3) 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22年3月末日現在）

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

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

第3 【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21年8月28日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第4期）・同添付書類
平成21年11月11日	有価証券届出書の訂正届出書
平成21年11月30日	有価証券届出書の訂正届出書
平成22年2月26日	半期報告書（第5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22年7月23日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有 限 責 任 あ ず さ 監 査 法 人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス30の平成21年6月6日から平成22年6月7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22年6月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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

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（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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