

【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24年8月29日提出
【計算期間】 第7計算期間
（自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日）
【ファンド名】 ダイワ・ライフ・バランス 30
【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真
【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）

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

載があるもの

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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産（ ）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、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 >

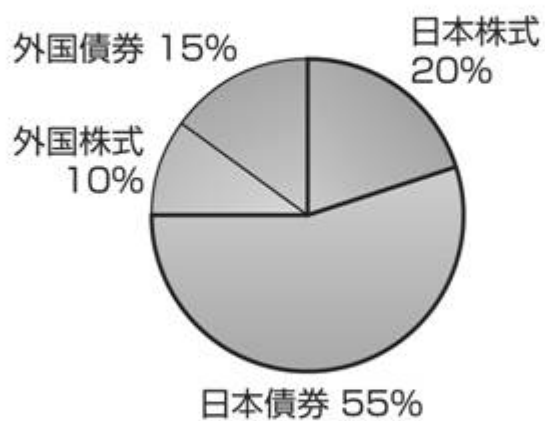
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< 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もあります。

2

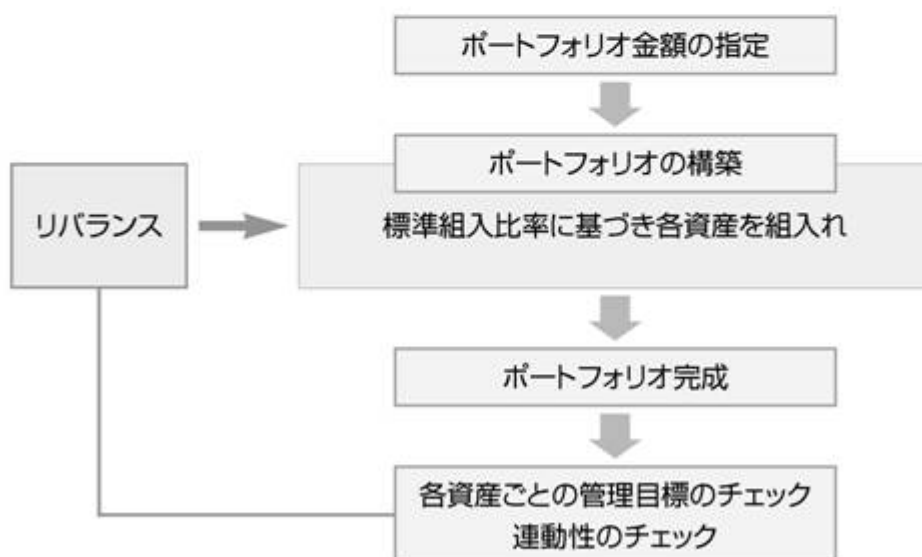
各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

- 合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を標準組入比率に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、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



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

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

3

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

毎年6月5日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。
- 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、分配を行なわないことがあります。

各マザーファンドの運用プロセス

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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。

(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	
お取扱窓口	販売会社	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（ 3 ） 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
		収益分配金、償還金など↑↓お申込金（ 3 ）
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など	
↓ 運用指図 ↑ ↓ 2	損益 ↑ ↓ 信託金（ 3 ）	

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
投資対象	損益↑↓投資 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24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】

主要投資対象

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

投資態度

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

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

< 標準組入比率 >

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

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

外国株式インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の10%

外国債券インデックスマザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の15%

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

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

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

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

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、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から4.までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の5.から24.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
3. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
4. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前5.から前15.までの証券または証書の性質を有するもの
17. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で前23.の有価証券の性質を有するもの

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

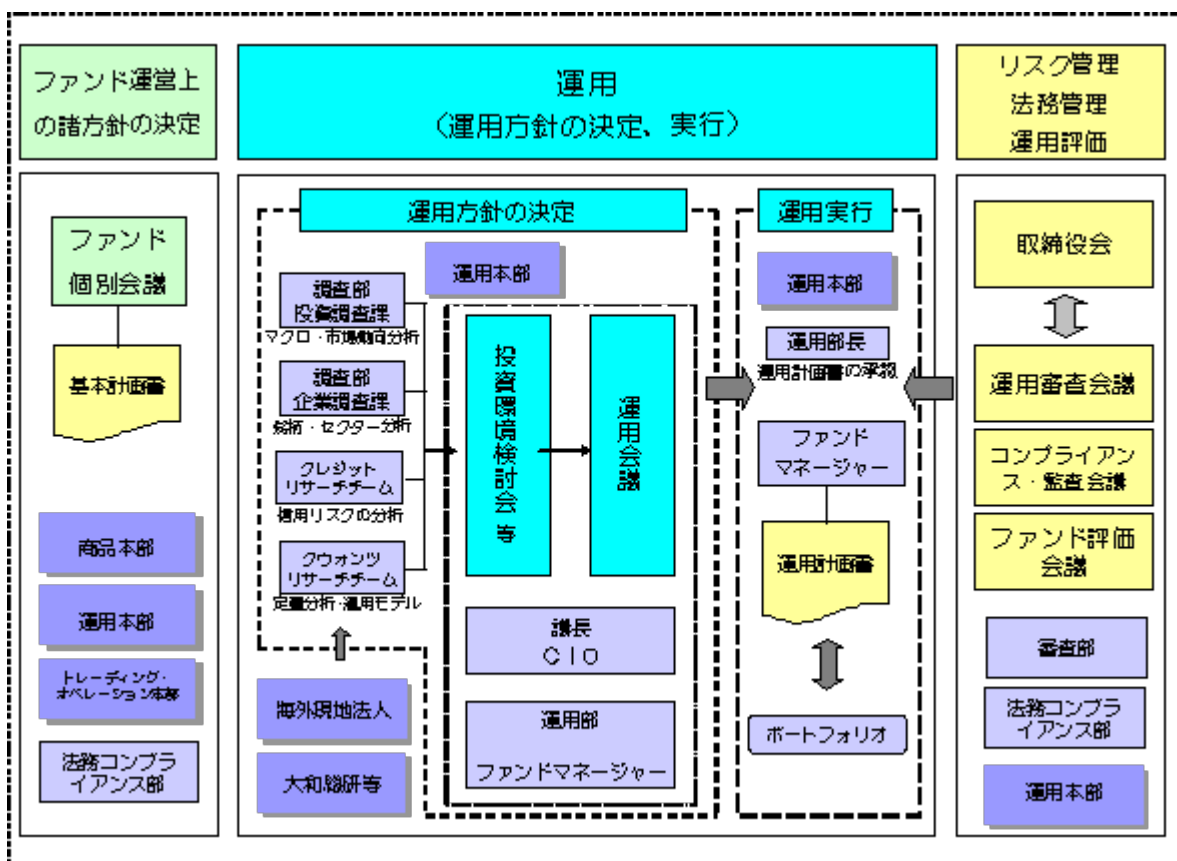
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議にお

いて審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．ＣＩＯ（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は平成24年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保金は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資信託証券（信託約款）

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

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付け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、）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

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) の1. から4. までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

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

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

には、制約されることがあります。

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 参 考 > マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

（注）東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）とは

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

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

株式会社東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

２．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

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

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。

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

（注）NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）MSCIコクサイ指数とは

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

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

4. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

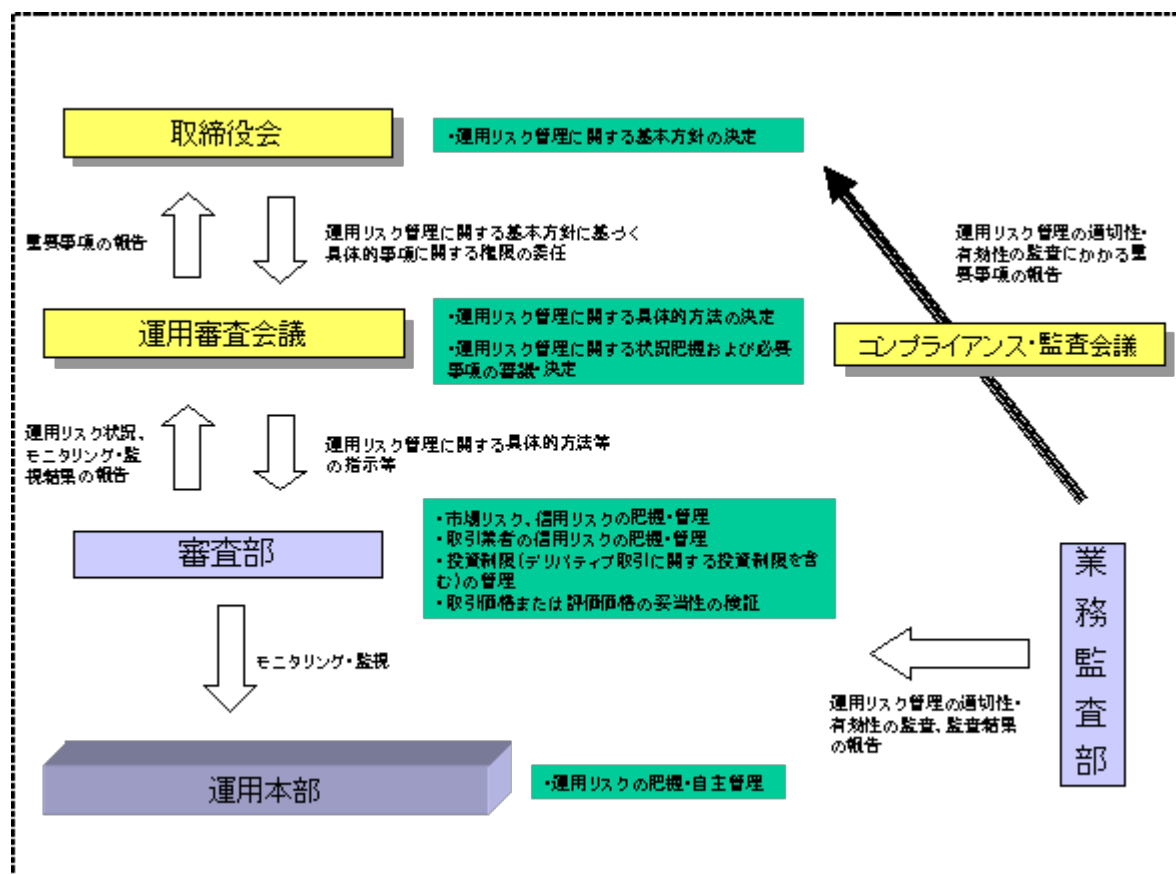
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付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】

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）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.189%（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。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

ハ．損益通算について

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

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金

（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ ）上記は、平成24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24年6月29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	5,705,658,359	99.70
内 日本	5,705,658,359	99.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,011,044	0.30
純資産総額	5,722,669,403	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（平成24年6月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	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	2,802,819,805 3,192,972,326	1.1392	1.1414 3,199,138,525	55.90
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	2,612,559,954 1,028,636,754	0.3937	0.4281 1,118,436,916	19.54
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	471,848,814 834,387,719	1.7683	1.7697 835,030,846	14.59
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	640,328,902 524,891,712	0.8197	0.8637 553,052,072	9.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1 口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1 口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
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
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
第6計算期間末 (平成23年6月6日)	4,508,318,949	4,508,318,949	1.0348	1.0348
平成23年6月末日	4,695,178,869	-	1.0449	-
7月末日	4,669,569,636	-	1.0352	-
8月末日	4,649,502,151	-	1.0132	-
9月末日	4,811,492,796	-	1.0046	-
10月末日	4,881,229,231	-	1.0218	-
11月末日	4,811,697,953	-	0.9985	-
12月末日	5,206,234,792	-	1.0065	-
平成24年1月末日	5,289,143,881	-	1.0180	-
2月末日	5,662,079,609	-	1.0633	-
3月末日	5,853,566,127	-	1.0748	-
4月末日	5,779,482,816	-	1.0611	-
5月末日	5,613,412,346	-	1.0233	-
第7計算期間末 (平成24年6月5日)	5,577,984,123	5,577,984,123	1.0169	1.0169
6月末日	5,722,669,403	-	1.0395	-

【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
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.2
第2計算期間	8.9
第3計算期間	4.4
第4計算期間	10.6
第5計算期間	0.3
第6計算期間	1.5
第7計算期間	1.7

(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
第6計算期間	479,041,156	143,587,339
第7計算期間	1,394,660,786	266,021,278

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	86,224,731,430	96.99
内 日本	86,224,731,430	96.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,677,128,460	3.01
純資産総額	88,901,859,890	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）	2,553,080,000	2.87
内 日本	2,553,080,000	2.87

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

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

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

(2) 投資資産（平成24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,063,400	2,685.27 2,855,522,762	3,190.00 3,392,246,000	3.82
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,125,900	335.24 2,053,707,292	378.00 2,315,590,200	2.60
3	本田技研	日本	株式	輸送用機器	691,600	2,374.98 1,642,536,651	2,749.00 1,901,208,400	2.14
4	キヤノン	日本	株式	電気機器	509,000	3,378.33 1,719,573,077	3,165.00 1,610,985,000	1.81
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	614,600	2,126.64 1,307,037,697	2,612.00 1,605,335,200	1.81
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,406,300	112.82 1,174,058,153	134.00 1,394,444,200	1.57
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	373,300	3,758.12 1,402,906,366	3,700.00 1,381,210,000	1.55
8	武田薬品	日本	株式	医薬品	321,000	3,653.98 1,172,929,267	3,615.00 1,160,415,000	1.31
9	ファナック	日本	株式	電気機器	85,500	11,176.01 955,549,611	12,950.00 1,107,225,000	1.25
10	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	366,100	2,699.02 988,112,095	2,953.00 1,081,093,300	1.22
11	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	408,400	1,853.97 757,163,847	2,361.00 964,232,400	1.08
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	588,700	1,737.64 1,022,950,475	1,596.00 939,565,200	1.06
13	日立	日本	株式	電気機器	1,886,000	392.54 740,336,320	487.00 918,482,000	1.03
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	6,662	146,041.53 972,928,707	132,700.00 884,047,400	0.99
15	三井物産	日本	株式	卸売業	697,400	1,273.53 888,164,242	1,174.00 818,747,600	0.92
16	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	338,100	2,153.56 728,119,762	2,397.00 810,425,700	0.91
17	三菱地所	日本	株式	不動産業	565,000	1,236.32 698,525,760	1,418.00 801,170,000	0.90
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	1,044,200	666.25 695,707,222	748.00 781,061,600	0.88
19	小松製作所	日本	株式	機械	400,200	1,736.74 695,047,097	1,878.00 751,575,600	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	141,500	4,558.72 645,059,572	5,000.00 707,500,000	0.80
21	信越化学	日本	株式	化学	154,000	3,907.80 601,801,836	4,360.00 671,440,000	0.76
22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	190,600	2,897.43 552,250,186	3,465.00 660,429,000	0.74

23	K D D I	日本	株式	情報・通信業	1,252	622,732.95 779,661,664	513,000.00 642,276,000	0.72
24	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	307,900	1,902.53 585,790,079	1,986.00 611,489,400	0.69
25	パナソニック	日本	株式	電気機器	930,300	751.47 699,100,375	643.00 598,182,900	0.67
26	ソニー	日本	株式	電気機器	509,200	1,529.04 778,592,048	1,123.00 571,831,600	0.64
27	三井不動産	日本	株式	不動産業	358,000	1,209.19 432,890,260	1,530.00 547,740,000	0.62
28	デンソー	日本	株式	輸送用機器	201,900	2,424.05 489,416,726	2,693.00 543,716,700	0.61
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	817,000	685.56 560,110,330	660.00 539,220,000	0.61
30	伊藤忠	日本	株式	卸売業	648,100	815.17 528,317,768	832.00 539,219,200	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.99%
合計	96.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.64%
建設業	2.43%
食料品	3.83%
繊維製品	0.88%
パルプ・紙	0.33%
化学	5.61%
医薬品	5.04%
石油・石炭製品	0.74%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.60%
非鉄金属	1.09%
金属製品	0.68%
機械	4.81%
電気機器	12.46%
輸送用機器	10.25%
精密機器	1.42%
その他製品	1.45%
電気・ガス業	2.80%
陸運業	3.98%
海運業	0.38%
空運業	0.28%

倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.49%
卸売業	5.33%
小売業	4.24%
銀行業	9.53%
証券、商品先物取引業	1.07%
保険業	2.22%
その他金融業	0.83%
不動産業	2.59%
サービス業	1.93%
合計	96.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2012年9月	買建	332	2,389,404,7172	553,080,000	2.87%

(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) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		8,639,855,900	67.54
	内 日本	8,639,855,900	67.54
地方債証券		1,163,359,454	9.09
	内 日本	1,163,359,454	9.09
特殊債券		1,271,268,759	9.94
	内 日本	1,271,268,759	9.94
社債券		1,642,998,654	12.84
	内 日本	1,642,998,654	12.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		74,157,267	0.58
純資産総額		12,791,640,034	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	3 1 2 1 0 年国債	日本	国債証券	177,000,000	102.04 180,620,980	104.58 108,370	1.200000 2020/12/20	1.45
2	2 8 8 1 0 年国債	日本	国債証券	148,000,000	106.84 158,129,130	107.60 253,920	1.700000 2017/09/20	1.24
3	3 1 0 1 0 年国債	日本	国債証券	138,000,000	100.66 138,911,960	103.13 322,160	1.000000 2020/09/20	1.11
4	2 9 9 1 0 年国債	日本	国債証券	130,000,000	104.45 135,795,230	105.91 692,100	1.300000 2019/03/20	1.08
5	3 0 3 1 0 年国債	日本	国債証券	125,000,000	104.92 131,157,730	106.63 298,750	1.400000 2019/09/20	1.04
6	2 8 7 1 0 年国債	日本	国債証券	121,000,000	107.95 130,620,830	108.32 078,090	1.900000 2017/06/20	1.02
7	3 0 9 1 0 年国債	日本	国債証券	122,000,000	101.95 124,388,620	104.11 022,740	1.100000 2020/06/20	0.99
8	8 6 5 年国債	日本	国債証券	125,000,000	101.15 126,437,520	101.10 381,250	0.600000 2014/09/20	0.99
9	3 1 8 1 0 年国債	日本	国債証券	115,000,000	99.38 114,295,650	102.24 579,450	1.000000 2021/09/20	0.92
10	9 2 5 年国債	日本	国債証券	114,000,000	100.01 114,020,520	100.64 730,740	0.300000 2015/09/20	0.90
11	3 7 8 東北電力	日本	社債券	100,000,000	113.12 113,126,600	112.13 134,800	3.850000 2016/04/25	0.88
12	9 5 5 年国債	日本	国債証券	109,000,000	101.25 110,366,840	101.77 933,660	0.600000 2016/03/20	0.87
13	2 7 2 1 0 年国債	日本	国債証券	105,000,000	104.18 109,391,100	104.16 375,350	1.400000 2015/09/20	0.86
14	2 0 - 6 北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.97 106,979,000	107.69 699,500	1.720000 2018/08/29	0.84
15	2 9 3 大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.52 107,520,200	107.61 612,000	2.100000 2016/08/30	0.84
16	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	106.14 106,143,400	107.57 571,300	1.600000 2018/11/16	0.84
17	2 1 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	105.74 105,745,200	107.42 421,100	1.570000 2019/05/27	0.84
18	2 6 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.73 106,734,300	107.21 212,800	1.780000 2017/03/24	0.84
19	2 1 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.11 106,116,000	107.00 004,600	1.570000 2019/11/25	0.84
20	1 8 - 2 北九州市債	日本	地方債証券	100,000,000	106.52 106,528,000	106.91 912,400	1.790000 2016/12/20	0.84
21	2 7 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.34 106,344,900	106.85 854,300	1.770000 2017/03/17	0.84
22	1 8 - 4 札幌市公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.46 106,460,200	106.70 707,100	1.800000 2016/09/20	0.83

23	6 5 3 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.24 106,247,000	106.68 106,681,300	1.540000 2017/12/20	0.83
24	5 6 政保道路機構	日本	特殊債券	100,000,000	104.90 104,904,300	106.15 106,158,400	1.400000 2018/04/20	0.83
25	2 成田国際空港	日本	特殊債券	100,000,000	104.38 104,388,500	104.60 104,601,000	1.660000 2015/12/18	0.82
26	6 2 4 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	104.21 104,215,900	104.02 104,029,000	1.500000 2015/06/19	0.81
27	8 7 5 年国債	日本	国債証券	103,000,000	100.94 103,972,700	100.98 100,981,490	0.500000 2014/12/20	0.81
28	1 7 ソニー	日本	社債券	100,000,000	103.89 103,896,000	103.44 103,449,200	1.570000 2015/06/19	0.81
29	1 3 首都高速道路	日本	特殊債券	100,000,000	103.62 103,623,600	103.38 103,388,500	1.480000 2015/03/20	0.81
30	4 住友信託 劣後	日本	社債券	100,000,000	103.25 103,252,900	103.27 103,279,400	1.670000 2015/04/28	0.81

(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	67.54%
地方債証券	9.09%
特殊債券	9.94%
社債券	12.84%
合計	99.42%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		44,785,720,778	96.34
	内 香港	606,889,941	1.31
	内 シンガポール	370,475,380	0.80
	内 イスラエル	123,550,350	0.27

内 ノルウェー	184,037,855	0.40
内 スウェーデン	633,431,819	1.36
内 デンマーク	235,954,426	0.51
内 イギリス	4,805,153,157	10.34
内 アイルランド	60,735,270	0.13
内 オランダ	480,722,843	1.03
内 ベルギー	225,465,995	0.48
内 フランス	1,788,995,201	3.85
内 ドイツ	1,619,783,482	3.48
内 スイス	1,774,076,958	3.82
内 ポルトガル	34,612,990	0.07
内 スペイン	536,652,066	1.15
内 イタリア	431,608,112	0.93
内 フィンランド	145,925,402	0.31
内 オーストリア	52,491,911	0.11
内 ギリシャ	9,299,136	0.02
内 カナダ	2,495,004,529	5.37
内 アメリカ	26,483,945,724	56.97
内 オーストラリア	1,669,647,979	3.59
内 ニュージーランド	17,260,252	0.04
投資証券	1,004,946,741	2.16
内 香港	23,142,168	0.05
内 シンガポール	9,274,225	0.02
内 イギリス	59,123,111	0.13
内 オランダ	5,727,313	0.01
内 フランス	58,717,864	0.13
内 アメリカ	709,433,977	1.53
内 オーストラリア	139,528,083	0.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	698,452,957	1.50
純資産総額	46,489,120,476	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）	681,717,036	1.47
内 アメリカ	681,717,036	1.47
為替予約取引（買建）	79,300,000	0.17
内 日本	79,300,000	0.17

(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24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	30,322.43 25,700 779,288,536	45,131.35 1,159,875,836	2.49	
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	6,113.61 130,655 798,776,467	6,590.66 861,102,813	1.85	
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,982.82 206,100 408,668,806	2,372.16 488,902,609	1.05	
4	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	14,367.87 31,800 456,899,763	15,179.93 482,721,901	1.04	
5	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サー ビス	1,196.47 289,300 346,154,681	1,602.06 463,476,537	1.00	
6	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サー ビス	2,236.14 163,195 364,927,810	2,806.78 458,052,609	0.99	
7	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	7,737.08 54,618 422,588,410	8,205.41 448,163,225	0.96	
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	4,174.54 93,100 388,652,043	4,599.64 428,227,368	0.92	
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,981.77 75,000 373,637,888	5,309.01 398,175,855	0.86	
10	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,542.34 206,963 319,209,751	1,786.85 369,812,726	0.80	
11	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	4,953.46 76,137 377,145,271	4,781.59 364,056,672	0.78	
12	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	1,930.32 136,972 264,406,300	2,575.98 352,838,338	0.76	
13	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	599.84 504,800 302,826,059	687.25 346,926,748	0.75	
14	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	5,257.22 55,100 289,676,333	6,072.76 334,609,445	0.72	
15	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	5,905.42 47,100 278,145,404	6,790.52 319,833,596	0.69	
16	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	46,277.46 7,100 328,570,147	44,755.42 317,763,525	0.68	
17	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サー ビス	209.05 1,379,537 288,402,914	222.60 307,086,260	0.66	
18	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	2,301.02 105,020 241,653,700	2,845.64 298,849,407	0.64	
19	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,014.97 65,800 264,189,909	4,336.57 285,346,800	0.61	
20	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,872.90 136,500 255,662,090	2,048.57 279,630,801	0.60	
21	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	4,613.46 50,700 233,902,559	5,416.87 274,635,461	0.59	

22	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	78,400 229,627,353	2,928.91 627,353	3,487.26 273,401,239	0.59
23	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	538,000 290,643,368	540.12 643,368	507.74 273,167,821	0.59
24	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	102,900 271,040,075	2,633.90 11,669.95	2,613.83 268,963,889	0.58
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	19,950 232,816,370	11,669.95 816,370	13,392.00 267,170,580	0.57
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	82,321 225,961,152	2,744.83 961,152	3,226.33 265,594,778	0.57
27	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	143,402 241,752,522	1,685.75 752,522	1,780.31 255,300,760	0.55
28	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	108,083 253,845,322	2,348.60 845,322	2,234.16 241,475,007	0.52
29	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	42,300 213,903,194	5,056.80 903,194	5,519.97 233,494,985	0.50
30	BHP BILLITON LTD	オーストラリア	株式	素材	89,500 250,028,529	2,793.56 028,529	2,447.64 219,064,183	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.34%
投資証券	2.16%
合計	98.50%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	11.26%
素材	6.69%
資本財・サービス	9.75%
一般消費財・サービス	9.78%
生活必需品	11.38%
ヘルスケア	10.97%
金融	16.14%
情報技術	12.43%
電気通信サービス	4.16%
公益事業	3.77%
その他	0.00%
合計	96.34%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2012年9月	買建	26	681,332,977	681,717,036	1.47%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2012年7月	買建	1,000,000	79,465,000	79,300,000	0.17%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成24年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		108,819,362,904	98.26
	内 ユーロ	42,332,609,270	38.22
	内 シンガポール	450,359,845	0.41
	内 マレーシア	588,724,075	0.53
	内 ノルウェー	268,567,316	0.24
	内 スウェーデン	664,082,991	0.60
	内 デンマーク	971,319,332	0.88
	内 イギリス	9,059,397,112	8.18
	内 スイス	451,801,739	0.41
	内 ポーランド	787,473,002	0.71
	内 カナダ	3,257,513,646	2.94
	内 アメリカ	47,280,304,551	42.69
	内 メキシコ	1,039,221,985	0.94
	内 オーストラリア	1,667,988,040	1.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,931,240,591	1.74
純資産総額		110,750,603,495	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）		940,042,765	0.85
	内 日本	940,042,765	0.85

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

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

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

(2) 投資資産（平成24年6月29日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,999,000	115.52 641,257,032	117.60 792,202	3.750000 2018/11/15	0.59
2	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,947,000	108.55 598,096,050	111.42 914,500	2.750000 2019/02/15	0.55
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	6,144,000	111.15 541,641,556	114.19 450,126	3.125000 2019/05/15	0.50
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,842,000	114.79 531,883,180	117.84 1,000,817	3.625000 2019/08/15	0.49
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	114.97 513,385,321	118.23 932,899	3.625000 2020/02/15	0.48
6	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	113.96 475,350,400	117.44 852,865	3.500000 2020/05/15	0.44
7	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,554,000	128.27 463,293,322	135.57 677,556	4.375000 2039/11/15	0.44
8	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,202,000	133.31 444,276,309	140.85 427,576	4.625000 2040/02/15	0.42
9	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,929,000	106.68 417,059,732	110.67 633,955	2.625000 2020/08/15	0.39
10	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	4,184,000	118.35 392,754,266	125.41 165,088	3.875000 2040/08/15	0.38
11	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.55 410,074,567	112.00 714,072	3.250000 2017/03/31	0.37
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,180,000	100.24 411,836,431	100.12 322,899	0.375000 2013/06/30	0.37
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,930,000	104.74 409,539,409	103.68 398,767	2.250000 2014/05/31	0.37
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,585,000	105.13 372,170,302	113.76 715,725	4.250000 2023/10/25	0.36
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	110.42 386,846,306	114.53 244,170	3.125000 2021/05/15	0.36
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,712,000	102.46 375,560,306	108.71 480,009	3.500000 2020/04/25	0.36
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	102.50 379,763,329	106.69 290,431	3.000000 2015/10/25	0.36
18	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	106.46 380,710,395	110.53 268,571	2.625000 2020/11/15	0.36
19	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	2,873,000	112.27 397,125,000	110.36 369,541	5.000000 2014/09/07	0.35
20	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,537,000	130.65 366,515,388	138.07 313,232	4.500000 2039/08/15	0.35
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,430,000	106.36 360,231,500	113.98 055,893	4.250000 2019/04/25	0.35
22	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.68 386,726,308	104.30 311,297	1.875000 2015/06/30	0.35
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,076,000	114.88 371,376,388	118.69 702,430	3.625000 2021/02/15	0.35

24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,841,000	92.61 351,255,355	100.78 222,363	2.500000 2020/10/25	0.35
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,827,000	99.53 381,034,857	99.76 914,407	0.250000 2014/12/15	0.34
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,722,000	102.20 375,619,306	103.26 524,191	2.500000 2014/01/12	0.34
27	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3,025,000	155.25 372,481,328	158.01 098,131	8.000000 2021/11/15	0.34
28	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,760,000	99.91 377,176,426	99.91 175,835	0.250000 2014/02/28	0.34
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	103.98 371,880,897	105.08 832,813	3.000000 2014/07/12	0.34
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,256,000	110.84 356,370,377	116.79 489,720	3.500000 2019/07/04	0.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.26%
合計	98.26%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2012年7月	買建	3,725,000	363,618,927	367,769,265	0.33%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2012年7月	買建	303,000	6,731,684	6,968,994	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2012 年7月	買建	387,000	29,688,588	29,702,250	0.03%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2012年7月	買建	508,000	5,531,612	5,725,160	0.01%
		英ポンド買/円売 2012年7 月	買建	649,000	79,377,185	79,891,841	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2012年7月	買建	1,618,000	9,009,543	9,432,940	0.01%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2012年7月	買建	669,000	8,816,775	8,884,313	0.01%
		米ドル買/円売 2012年7月	買建	5,209,000	408,356,281	413,073,682	0.37%
		スイス・フラン買/円売 2012年7月	買建	48,000	3,912,931	3,946,080	0.00%
		豪ドル買/円売 2012年7月	買建	184,000	14,107,482	14,648,240	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

(参考情報)

2012年6月29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	10,395円
純資産総額	57億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	-3.3%
6カ月間	3.3%
1年間	-0.5%
3年間	1.7%
5年間	-12.6%
設定来	4.0%



※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	第6期 11年6月	第7期 12年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率	
国内債券	278	55.6%	日本円	75.8%	直接利回り(%)	1.8	トヨタ自動車	日本	0.7%
国内株式・先物	1,299	19.5%	米ドル	12.1%	最終利回り(%)	0.9	TOPIX先物 2409月	日本	0.6%
外国債券	638	14.3%	ユーロ	6.9%	修正デュレーション	7.0	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
外国株式・先物	1,196	9.5%	英ポンド	2.2%	残存年数	8.2	本田技研	日本	0.4%
外国リート	47	0.2%	カナダ・ドル	1.0%	債券格付別構成	比率	キヤノン	日本	0.4%
			豪ドル	0.6%	AAA	16.9%	三井住友フィナンシャルG	日本	0.4%
			スイス・フラン	0.4%	AA	69.2%	みずほフィナンシャルG	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	0.2%	A	9.2%	日本電信電話	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	0.2%	BBB	0.9%	武田薬品	日本	0.3%
コール・ローン、その他	1.6%		その他	0.7%	BB以下・無格付	3.8%	ファナック	日本	0.2%
合計	3,458	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		4.0%

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を3.8%保有しております。

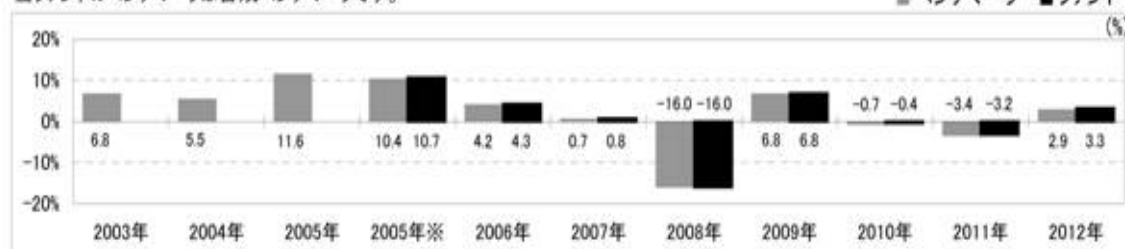
※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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、2012年は6月29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。

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。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えると

きは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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

反対者の買取請求権

前 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 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 の3.または前 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。

運用報告書

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

収益分配金は、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。

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。

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成23年6月7日から平成24年6月5日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

ダイワ・ライフ・バランス30

ダイワ・ライフ・バランス 3 0

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 平成23年6月6日現在	第7期 平成24年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,695,126	22,376,667
親投資信託受益証券	4,494,800,992	5,561,272,715
未収入金	222,000	583,000
流動資産合計	4,512,718,118	5,584,232,382
資産合計	4,512,718,118	5,584,232,382
負債の部		
流動負債		
未払解約金	104,110	895,368
未払受託者報酬	687,198	856,445
未払委託者報酬	3,436,132	4,282,417
その他未払費用	171,729	214,029
流動負債合計	4,399,169	6,248,259
負債合計	4,399,169	6,248,259
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,356,612,549	1 5,485,252,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	151,706,400	92,732,066
（分配準備積立金）	277,090,468	262,783,358
元本等合計	4,508,318,949	5,577,984,123
純資産合計	4,508,318,949	5,577,984,123
負債純資産合計	4,512,718,118	5,584,232,382

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 平成22年6月8日 至 平成23年6月6日	第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
営業収益		
受取利息	13,511	17,091
有価証券売買等損益	65,902,870	76,551,277
営業収益合計	65,916,381	76,534,186
営業費用		
受託者報酬	1,348,580	1,593,832
委託者報酬	6,743,167	7,969,583
その他費用	336,986	398,297
営業費用合計	8,428,733	9,961,712
営業利益又は営業損失（ ）	57,487,648	86,495,898
経常利益又は経常損失（ ）	57,487,648	86,495,898
当期純利益又は当期純損失（ ）	57,487,648	86,495,898
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,967,314	627,228
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	80,533,188	151,706,400
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,617,193	36,777,772
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,617,193	36,777,772
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,964,315	8,628,980
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,964,315	8,628,980
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	151,706,400	92,732,066

(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7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成23年6月5日が休日のため、前計算期間末日を平成23年6月6日としております。このため、当計算期間は365日となっております。

(追加情報)

第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
第7期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第6期 平成23年6月6日現在	第7期 平成24年6月5日現在
1. 1 期首元本額	4,021,158,732円	4,356,612,549円
期中追加設定元本額	479,041,156円	1,394,660,786円
期中一部解約元本額	143,587,339円	266,021,278円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,356,612,549口	5,485,252,057口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期 自 平成22年6月8日 至 平成23年6月6日	第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
-----	-----------------------------------	-----------------------------------

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,825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（387,966,305円）及び分配準備積立金（277,078,643円）より分配対象額は665,056,773円（1万口当たり1,526.55円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（316,793,064円）及び分配準備積立金（262,783,358円）より分配可能額は579,576,422円（1万口当たり1,056.61円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。
------------	--	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期 平成24年6月5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6期 平成23年6月6日現在	第7期 平成24年6月5日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	59,081,142	77,492,880
合計	59,081,142	77,492,880

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第6期 平成23年6月6日現在	第7期 平成24年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第6期 平成23年6月6日現在	第7期 平成24年6月5日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0348円 (10,348円)	1.0169円 (10,169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	2,583,534,320	1,016,620,754	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	2,807,329,293	3,198,109,530	
	外国株式インデックスマザーファンド	629,524,679	515,580,712	
	外国債券インデックスマザーファンド	469,921,235	830,961,719	
親投資信託受益証券 合計			5,561,272,715	
合計			5,561,272,715	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

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

貸借対照表

		平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
		金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,258,693,098	1,838,274,747
株式	3	84,099,148,535	79,319,981,530
派生商品評価勘定		14,165,127	157,088
未収配当金		879,133,526	954,629,086
前払金		156,304,000	450,735,000
差入委託証拠金		49,050,000	-
流動資産合計		87,456,494,286	82,563,777,451
資産合計		87,456,494,286	82,563,777,451
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		209,463,662	260,034,833
未払金		-	936,956,784
未払解約金		57,406,000	8,400,000
流動負債合計		266,869,662	1,205,391,617
負債合計		266,869,662	1,205,391,617
純資産の部			
元本等			
元本	1	198,764,066,393	206,749,163,617
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2	111,574,441,769	125,390,777,783
元本等合計		87,189,624,624	81,358,385,834
純資産合計		87,189,624,624	81,358,385,834
負債純資産合計		87,456,494,286	82,563,777,451

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23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（追加情報）

自 平成23年6月7日

至 平成24年6月5日

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	198,354,719,498円	198,764,066,393円
同期中における追加設定元本額	17,194,088,244円	20,037,509,686円
同期中における一部解約元本額	16,784,741,349円	12,052,412,462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	1,889,859,225円	2,073,128,132円
トピックス・インデックスファンド	10,742,657,262円	10,190,880,260円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	36,086,610,292円	33,020,125,327円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	907,006,522円	806,767,689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)	390,532,446円	399,582,196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)	6,534,869,758円	6,715,313,880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)	385,457,986円	394,843,663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)	8,611,164,520円	8,790,707,274円
D C ダイワ日本株式インデックス	56,961,727,166円	63,016,531,259円
ダイワ・ライフ・バランス 3 0	2,018,920,514円	2,583,534,320円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	456,633,731円	1,799,467,896円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	368,040,391円	1,341,640,945円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,520,260,890円	1,995,740,048円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	16,204,995円	19,170,245円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	16,140,778円	21,518,154円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,219,321円	3,671,527円
ダイワ世界分散バランスファンド 1 5 V A	452,649,821円	465,716,467円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A	3,245,148,656円	3,592,764,232円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 0 V A (国内株式型)	1,908,667,415円	1,933,671,204円
ダイワ世界分散バランスファンド 2 5 V A	112,006,307円	116,412,284円
ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A	756,840,924円	785,168,356円
ダイワ世界分散バランスファンド 3 0 V A (国内株式型)	360,627,955円	354,247,574円

ダイワ世界バランスファンド４０ ＶＡ	4,141,158,465円	4,206,789,190円
ダイワ世界バランスファンド６０ ＶＡ	629,157,680円	620,564,074円
ダイワ・バランスファンド３５ ＶＡ	33,178,537,719円	32,575,018,842円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド５０ ＶＡ	2,473,907,291円	2,602,685,126円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド７５ ＶＡ	5,388,720,628円	5,495,444,871円
ダイワ・バランスファンド２５ ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,882,568,424円	2,923,310,487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）	527,883,207円	558,011,518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）	609,615,536円	627,427,388円
ダイワライフスタイル２５	184,140,349円	216,822,950円
ダイワライフスタイル５０	535,241,424円	613,678,456円
ダイワライフスタイル７５	437,204,108円	468,069,915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）	14,032,684,687円	15,420,737,868円
計	198,764,066,393円	206,749,163,617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	198,764,066,393口	206,749,163,617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111,574,441,769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125,390,777,783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 536,900,000円	株式 494,800,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年6月5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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,042,914,345	5,119,528,262
合計	3,042,914,345	5,119,528,262

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年9月22日から平成23年6月6日まで、及び平成23年9月21日から平成24年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成23年6月6日 現在				平成24年6月5日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	3,282,974,000	-	3,088,470,000	194,504,000	2,305,420,000	-	2,046,230,000	259,190,000
合計	3,282,974,000	-	3,088,470,000	194,504,000	2,305,420,000	-	2,046,230,000	259,190,000

（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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4387円 (4,387円)	0.3935円 (3,935円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額（円）		備考
		単 価	金 額	
極 洋	39,000	177	6,903,000	
日本水産	113,200	212	23,998,400	
マルハニチロホールディングス	192,000	116	22,272,000	
サカタのタネ	14,100	1,055	14,875,500	
ホクト	9,200	1,650	15,180,000	
ショーボンドHD	8,200	2,012	16,498,400	
ミライト・ホールディングス	25,100	525	13,177,500	
住石ホールディングス	55,600	71	3,947,600	
日鉄鉱業	24,000	295	7,080,000	
三井松島	66,000	127	8,382,000	
国際石油開発帝石	1,112	434,500	483,164,000	
日本海洋掘削	3,000	2,183	6,549,000	
関東天然瓦斯	10,000	392	3,920,000	
石油資源開発	13,200	2,921	38,557,200	
東急建設	35,280	147	5,186,160	
コムシスホールディングス	47,100	852	40,129,200	
ミサワホーム	10,800	949	10,249,200	
高松コンストラクションGP	7,500	1,121	8,407,500	
東建コーポレーション	3,700	2,520	9,324,000	
大成建設	470,000	193	90,710,000	
大 林 組	275,000	310	85,250,000	
清水建設	279,000	255	71,145,000	
長谷工コーポレーション	588,500	50	29,425,000	
鹿島建設	435,000	200	87,000,000	
不動テトラ	77,500	99	7,672,500	
鉄建建設	68,000	90	6,120,000	
安藤建設	49,000	82	4,018,000	
太平工業	21,000	337	7,077,000	
西松建設	129,000	115	14,835,000	
前田建設	60,000	318	19,080,000	
奥 村 組	86,000	259	22,274,000	
東鉄工業	13,000	803	10,439,000	
イチケン	23,000	134	3,082,000	
戸田建設	97,000	217	21,049,000	

熊 谷 組	79,000	75	5,925,000
北野建設	30,000	168	5,040,000
三井ホーム	16,000	379	6,064,000
矢作建設	14,100	323	4,554,300
大東建託	35,100	6,740	236,574,000
N I P P O	23,000	731	16,813,000
前田道路	27,000	824	22,248,000
日本道路	30,000	245	7,350,000
東亜建設	89,000	122	10,858,000
東洋建設	157,000	55	8,635,000
五洋建設	123,000	167	20,541,000
福 田 組	21,000	240	5,040,000
住友林業	64,400	646	41,602,400
日本基礎技術	18,400	267	4,912,800
日成ビルド工業	37,000	108	3,996,000
エス・パイ・エル	58,000	135	7,830,000
巴コーポレーション	18,800	267	5,019,600
パナホーム	37,000	455	16,835,000
大和ハウス	230,000	1,012	232,760,000
ライト工業	23,100	299	6,906,900
積水ハウス	257,000	659	169,363,000
ユアテック	15,000	273	4,095,000
四電工	11,000	309	3,399,000
中電工	15,200	765	11,628,000
関 電 工	47,000	347	16,309,000
きんでん	60,000	507	30,420,000
東京エネシス	12,000	352	4,224,000
トーエネック	16,000	409	6,544,000
日本電設工業	17,000	678	11,526,000
協和エクシオ	29,900	719	21,498,100
新日本空調	12,700	411	5,219,700
日本工営	33,000	260	8,580,000
日本電話施設	20,000	234	4,680,000
九電工	18,000	463	8,334,000
三機工業	25,000	377	9,425,000
日 揮	85,000	2,145	182,325,000
中外炉工業	33,000	214	7,062,000
太平電業	14,000	509	7,126,000
高砂熱学	27,500	611	16,802,500
三晃金属	17,000	208	3,536,000
N E C ネットズエスアイ	8,200	1,209	9,913,800
朝日工業社	12,000	289	3,468,000
大 気 社	14,500	1,510	21,895,000
ダイダン	15,000	448	6,720,000
日比谷総合設	12,600	810	10,206,000
東芝プラントシステム	15,000	823	12,345,000
日本製粉	57,000	330	18,810,000
日清製粉 G 本社	81,500	882	71,883,000
昭和産業	45,000	238	10,710,000
鳥越製粉	8,300	600	4,980,000
協同飼料	62,000	80	4,960,000
中部飼料	9,900	495	4,900,500
日本配合飼料	44,000	91	4,004,000
日本甜菜糖	60,000	151	9,060,000
三井製糖	37,000	242	8,954,000

ネクスト	7,800	362	2,823,600
日本M & A センター	4,000	2,188	8,752,000
アコーディア・ゴルフ	356	46,450	16,536,200
パソナグループ	93	51,700	4,808,100
テンプホールディングス	13,400	868	11,631,200
森永製菓	87,000	171	14,877,000
中 村 屋	25,000	361	9,025,000
江崎グリコ	31,000	896	27,776,000
名糖産業	5,500	989	5,439,500
不 二 家	66,000	173	11,418,000
山崎製パン	65,000	1,086	70,590,000
モロゾフ	23,000	272	6,256,000
カルビー	7,200	4,635	33,372,000
森永乳業	75,000	291	21,825,000
ヤクルト	48,500	2,759	133,811,500
明治ホールディングス	27,100	3,370	91,327,000
雪印メグミルク	19,100	1,314	25,097,400
プリマハム	63,000	126	7,938,000
日本ハム	70,000	974	68,180,000
伊藤ハム	53,000	310	16,430,000
丸大食品	45,000	271	12,195,000
米 久	9,700	811	7,866,700
S F o o d s	8,000	650	5,200,000
スタジオアリス	5,100	1,279	6,522,900
シミックホールディングス	3,700	1,182	4,373,400
システナ	131	60,400	7,912,400
N E C フィールドینگ	7,700	924	7,114,800
新日鉄ソリューションズ	6,200	1,398	8,667,600
総合警備保障	30,400	1,021	31,038,400
日本駐車場開発	1,237	4,040	4,997,480
カカクコム	13,600	2,479	33,714,400
新日本科学	16,200	202	3,272,400
エムスリー	70	340,500	23,835,000
ディー・エヌ・エー	38,700	1,580	61,146,000
博報堂 D Y H L D G S	10,830	4,885	52,904,550
ぐるなび	7,400	812	6,008,800
P G M ホールディングス	153	60,800	9,302,400
サッポロホールディングス	155,000	240	37,200,000
アサヒグループホールディン	172,200	1,688	290,673,600
キリン H D	363,000	901	327,063,000
宝ホールディングス	82,000	479	39,278,000
オエノンホールディングス	35,000	182	6,370,000
養 命 酒	11,000	695	7,645,000
三国コカ・コ・ラ	11,100	689	7,647,900
コカ・コーラウエスト	30,700	1,346	41,322,200
コカコーラセントラルジャパン	10,900	1,011	11,019,900
ダイドードリンコ	4,200	3,240	13,608,000
伊 藤 園	24,400	1,357	33,110,800
キーコーヒー	9,100	1,421	12,931,100
日清オイリオグループ	35,000	317	11,095,000
不二製油	20,800	1,006	20,924,800
J - オイルミルズ	35,000	238	8,330,000
ローソン	25,000	5,530	138,250,000
サンエー	2,900	2,994	8,682,600
キリン堂	6,300	508	3,200,400

カワチ薬品	6,000	1,609	9,654,000
エービーシー・マート	11,300	2,834	32,024,200
アスクル	8,100	848	6,868,800
ゲオホールディングス	137	90,900	12,453,300
ポイント	6,920	2,815	19,479,800
伊藤忠食品	2,800	2,820	7,896,000
くらコーポレーション	5,300	1,114	5,904,200
キャンドゥ	77	94,200	7,253,400
エレマテック	7,100	981	6,965,100
パル	2,650	3,730	9,884,500
エディオン	32,400	379	12,279,600
サーラコーポレーション	16,000	446	7,136,000
あみやき亭	19	183,100	3,478,900
ひらまつ	58	71,700	4,158,600
双日	550,100	121	66,562,100
ゲンキー	1,400	1,944	2,721,600
アルフレッサホールディングス	21,200	3,850	81,620,000
ハニーズ	8,530	1,646	14,040,380
キッコーマン	75,000	952	71,400,000
味の素	241,000	1,090	262,690,000
キュービー	46,500	1,118	51,987,000
ハウス食品	30,900	1,255	38,779,500
カゴメ	34,100	1,547	52,752,700
焼津水産化工	8,500	709	6,026,500
アリアケジャパン	9,200	1,635	15,042,000
ニチレイ	104,000	360	37,440,000
横浜冷凍	20,900	550	11,495,000
東洋水産	39,000	2,009	78,351,000
日清食品HD	35,000	2,880	100,800,000
永谷園	9,000	723	6,507,000
フジッコ	10,000	963	9,630,000
ロックフィールド	5,000	1,392	6,960,000
日本たばこ産業	2,042	424,500	866,829,000
わらべや日洋	5,600	1,221	6,837,600
片倉工業	12,000	677	8,124,000
グンゼ	67,000	196	13,132,000
昭栄	18,700	301	5,628,700
アルペン	5,800	1,523	8,833,400
アルコニックス	2,900	1,397	4,051,300
ビックカメラ	292	38,050	11,110,600
DCMホールディングス	41,900	510	21,369,000
MonotaRO	6,400	1,492	9,548,800
あいホールディングス	13,400	429	5,748,600
J. フロントリテイリング	196,000	362	70,952,000
ドトール・日レスHD	13,800	962	13,275,600
マツモトキヨシHLDGS	14,600	1,722	25,141,200
スタートトゥデイ	14,600	1,162	16,965,200
ココカラファイン	8,700	2,550	22,185,000
三越伊勢丹HD	161,300	772	124,523,600
東洋紡績	365,000	102	37,230,000
ユニチカ	241,000	42	10,122,000
富士紡ホールディングス	41,000	166	6,806,000
日清紡ホールディングス	57,000	597	34,029,000
倉敷紡績	83,000	131	10,873,000
ダイワボウHD	85,000	139	11,815,000

シキボウ	70,000	87	6,090,000
日東紡績	70,000	222	15,540,000
トヨタ紡織	29,000	818	23,722,000
クリエイトSDH	3,800	2,003	7,611,400
バイタルKSKHD	17,100	704	12,038,400
UKCホールディングス	6,900	929	6,410,100
TOKAIホールディングス	50,800	321	16,306,800
日本毛織	30,000	544	16,320,000
ダイドーリミテッド	11,700	531	6,212,700
野村不動産HLDGS	38,600	1,189	45,895,400
ヒューリック	28,900	915	26,443,500
帝国繊維	11,000	576	6,336,000
ブックオフコーポレーション	6,000	632	3,792,000
日本コークス工業	80,500	93	7,486,500
あさひ	5,200	1,141	5,933,200
日本調剤	1,260	2,864	3,608,640
コスモス薬品	3,900	4,290	16,731,000
シップヘルスケアHD	11,000	1,763	19,393,000
セブン&アイ・HLDGS	338,100	2,370	801,297,000
ツルハホールディングス	7,100	4,495	31,914,500
サンマルクホールディングス	2,500	2,923	7,307,500
トリドール	9,900	1,105	10,939,500
帝 人	355,000	229	81,295,000
東 レ	617,000	511	315,287,000
ク ラ レ	133,900	1,000	133,900,000
旭 化 成	494,000	418	206,492,000
サカイ オーベックス	43,000	100	4,300,000
稲葉製作所	4,800	1,010	4,848,000
三協・立山HLDGS	123,000	125	15,375,000
トーカロ	5,500	1,087	5,978,500
SUMCO	47,300	656	31,028,800
住江織物	33,000	134	4,422,000
日本バイリ - ン	11,000	323	3,553,000
芦森工業	39,000	92	3,588,000
アツギ	66,000	96	6,336,000
セーレン	21,900	546	11,957,400
小松精練	15,000	352	5,280,000
ワコールホールディングス	51,000	886	45,186,000
ホギメディカル	5,300	3,105	16,456,500
レナウン	34,900	113	3,943,700
TSIホールディングス	43,400	448	19,443,200
ITホールディングス	26,500	868	23,002,000
グリー	41,600	1,253	52,124,800
コーエーテクモHD	16,900	647	10,934,300
三菱総合研究所	4,400	1,664	7,321,600
ボルテージ	2,100	771	1,619,100
ネクソン	53,600	1,256	67,321,600
特種東海製紙	59,000	175	10,325,000
ドワンゴ	51	98,400	5,018,400
マクロミル	10,400	828	8,611,200
ティーガイア	57	136,800	7,797,600
GMOペイメントゲートウェイ	23	265,000	6,095,000
ザッパラス	63	69,000	4,347,000
インターネットイニシアティブ	51	297,000	15,147,000
ソネットエンタテインメント	48	272,900	13,099,200

S R Aホールディングス	5,800	810	4,698,000
王子製紙	370,000	270	99,900,000
三菱製紙	169,000	72	12,168,000
北越紀州製紙	54,000	385	20,790,000
中越パルプ	47,000	138	6,486,000
大王製紙	37,000	398	14,726,000
日本製紙G本社	42,400	1,155	48,972,000
レンゴー	65,000	447	29,055,000
トーモク	39,000	213	8,307,000
ザ・パックス	5,500	1,321	7,265,500
昭和電工	533,000	152	81,016,000
住友化学	588,000	229	134,652,000
住友精化	19,000	287	5,453,000
日産化学	67,300	655	44,081,500
ラサ工業	49,000	80	3,920,000
クレハ	60,000	310	18,600,000
テイカ	18,000	238	4,284,000
石原産業	155,000	65	10,075,000
日本曹達	56,000	280	15,680,000
東ソー	238,000	188	44,744,000
トクヤマ	139,000	179	24,881,000
セントラル硝子	80,000	301	24,080,000
東亜合成	105,000	286	30,030,000
ダイソー	38,000	214	8,132,000
関東電化	24,000	229	5,496,000
電気化学	184,000	254	46,736,000
イビデン	54,100	1,341	72,548,100
信越化学	154,000	3,995	615,230,000
日本カ - バイド	46,000	102	4,692,000
堺 化 学	28,000	244	6,832,000
エア・ウォーター	69,000	887	61,203,000
大陽日酸	110,000	445	48,950,000
日本化学工業	52,000	114	5,928,000
日本パ - カライジング	21,000	1,078	22,638,000
高压ガス	16,000	422	6,752,000
チタン工業	15,000	240	3,600,000
四国化成	15,000	419	6,285,000
戸田工業	14,000	378	5,292,000
ステラ ケミファ	4,900	1,327	6,502,300
保土谷化学	24,000	212	5,088,000
日本触媒	63,000	883	55,629,000
大日精化	33,000	305	10,065,000
カネカ	104,000	427	44,408,000
協和発酵キリン	117,000	773	90,441,000
三菱瓦斯化学	147,000	442	64,974,000
三井化学	370,000	184	68,080,000
J S R	77,200	1,308	100,977,600
東京応化工業	15,100	1,607	24,265,700
三菱ケミカルH L D G S	533,500	331	176,588,500
日本合成化学	20,000	424	8,480,000
ダイセル	111,000	444	49,284,000
住友ベ - クライト	74,000	387	28,638,000
積水化学	177,000	664	117,528,000
日本ゼオン	80,000	564	45,120,000
アイカ工業	23,200	1,106	25,659,200

宇部興産	362,000	168	60,816,000
積水樹脂	14,000	737	10,318,000
タキロン	24,000	247	5,928,000
旭有機材	33,000	191	6,303,000
日立化成	37,000	1,210	44,770,000
大倉工業	25,000	192	4,800,000
積水化成品	23,000	263	6,049,000
日本化薬	60,000	681	40,860,000
イーピーエス	52	192,100	9,989,200
パナソニック電工 I S	2,200	1,840	4,048,000
フェイス	459	7,990	3,667,410
野村総合研究所	45,100	1,676	75,587,600
ケネディクス	1,092	9,260	10,111,920
電通	77,400	2,216	171,518,400
インテージ	2,700	1,460	3,942,000
シンプレクスホールディング	202	23,050	4,656,100
日本精化	8,900	488	4,343,200
A D E K A	36,800	644	23,699,200
日油	69,000	379	26,151,000
ミヨシ油脂	66,000	96	6,336,000
ハリマ化成	7,700	390	3,003,000
花 王	226,600	2,079	471,101,400
第一工業製薬	20,000	211	4,220,000
三洋化成	27,000	463	12,501,000
武田薬品	321,000	3,345	1,073,745,000
アステラス製薬	190,600	3,070	585,142,000
大日本住友製薬	61,800	761	47,029,800
塩野義製薬	134,500	999	134,365,500
田辺三菱製薬	84,400	1,048	88,451,200
わかもと製薬	22,000	168	3,696,000
あすか製薬	12,000	419	5,028,000
日本新薬	18,000	861	15,498,000
中外製薬	99,600	1,403	139,738,800
科研製薬	33,000	1,041	34,353,000
エーザイ	105,500	3,235	341,292,500
ロート製薬	36,000	898	32,328,000
小野薬品	41,700	4,510	188,067,000
久光製薬	26,400	3,530	93,192,000
持田製薬	30,000	837	25,110,000
参天製薬	28,400	2,862	81,280,800
扶桑薬品	40,000	204	8,160,000
日本ケミファ	17,000	387	6,579,000
ツムラ	23,500	1,756	41,266,000
日医工	15,300	1,461	22,353,300
テ ル モ	57,400	2,856	163,934,400
みらかホールディングス	22,100	3,015	66,631,500
キッセイ薬品工業	16,000	1,331	21,296,000
生化学工業	17,700	765	13,540,500
栄研化学	7,400	1,023	7,570,200
日水製薬	4,000	723	2,892,000
鳥居薬品	6,400	1,540	9,856,000
東和薬品	4,700	4,185	19,669,500
沢井製薬	5,700	8,520	48,564,000
ゼリア新薬工業	13,000	1,164	15,132,000
第一三共	286,100	1,260	360,486,000

キョーリン製薬HD	21,000	1,607	33,747,000
大幸薬品	6,500	664	4,316,000
大塚ホールディングス	171,500	2,452	420,518,000
大正製薬HD	20,500	6,120	125,460,000
大日本塗料	77,000	79	6,083,000
日本ペイント	79,000	587	46,373,000
関西ペイント	95,000	776	73,720,000
中国塗料	27,000	344	9,288,000
藤倉化成	13,000	382	4,966,000
太陽ホールディングス	7,000	1,884	13,188,000
D I C	329,000	139	45,731,000
サカタインクス	21,000	357	7,497,000
東洋インキSCホールディング	75,000	259	19,425,000
アルプス技研	6,600	594	3,920,400
サニックス	20,400	211	4,304,400
オリエンタルランド	23,000	8,440	194,120,000
ダスキン	24,600	1,460	35,916,000
パーク24	42,500	1,047	44,497,500
明光ネットワークジャパン	10,100	719	7,261,900
ファルコSDホールディングス	6,200	947	5,871,400
フジ・メディア・HD	843	124,900	105,290,700
ラウンドワン	29,700	393	11,672,100
リゾートトラスト	14,500	1,292	18,734,000
オービック	2,510	15,300	38,403,000
ヤフー	5,904	22,690	133,961,760
ビー・エム・エル	5,800	1,871	10,851,800
ワタベウェディング	5,200	691	3,593,200
トレンドマイクロ	36,500	2,132	77,818,000
もしもしホットライン	16,300	722	11,768,600
東急コミュニティー	3,400	2,396	8,146,400
リソー教育	1,068	5,100	5,446,800
日本オラクル	15,500	2,838	43,989,000
アルファシステムズ	5,000	977	4,885,000
フューチャーアーキテクト	141	31,050	4,378,050
ユー・エス・エス	11,300	7,620	86,106,000
オービックビジネスC	2,300	3,700	8,510,000
伊藤忠テクノソリューション	9,600	3,510	33,696,000
テー・オー・ダブリュー	6,000	499	2,994,000
大塚商会	6,500	6,110	39,715,000
総合メディカル	1,800	2,689	4,840,200
セントラルスポーツ	4,200	1,058	4,443,600
電通国際情報S	7,600	597	4,537,200
ウェザーニューズ	3,200	2,343	7,497,600
富士フイルムHLDGS	182,100	1,447	263,498,700
コニカミノルタHLDGS	217,500	553	120,277,500
資生堂	140,800	1,216	171,212,800
ライオン	97,000	434	42,098,000
高砂香料	28,000	358	10,024,000
マンダム	9,000	1,957	17,613,000
ミルボン	4,800	2,352	11,289,600
ファンケル	22,400	958	21,459,200
コーセー	13,200	1,755	23,166,000
ドクターシーラボ	56	241,200	13,507,200
ポーラ・オルビスHD	9,000	2,201	19,809,000
エステー	6,900	906	6,251,400

コ ニ シ	8,300	1,022	8,482,600
長谷川香料	10,800	988	10,670,400
小林製薬	11,800	4,245	50,091,000
荒川化学工業	9,500	632	6,004,000
日本高純度化学	32	180,800	5,785,600
アース製薬	6,500	2,862	18,603,000
イハラケミカル	18,000	284	5,112,000
大成ラミック	2,500	2,250	5,625,000
クミアイ化学	23,000	265	6,095,000
日本農薬	22,000	320	7,040,000
昭和シエル石油	78,300	456	35,704,800
コスモ石油	231,000	190	43,890,000
ニチレキ	14,000	354	4,956,000
東燃ゼネラル石油	125,000	712	89,000,000
ユシロ化学	6,600	750	4,950,000
A O C ホールディングス	21,400	325	6,955,000
出光興産	10,100	6,700	67,670,000
J X ホールディングス	952,100	373	355,133,300
横浜ゴム	106,000	522	55,332,000
東洋ゴム	65,000	214	13,910,000
ブリヂストン	269,000	1,663	447,347,000
住友ゴム	65,000	926	60,190,000
オカモト	32,000	295	9,440,000
アキレス	74,000	99	7,326,000
フ コ ク	4,600	691	3,178,600
ニッタ	8,100	1,203	9,744,300
東海ゴム工業	15,900	750	11,925,000
三ツ星ベルト	24,000	358	8,592,000
バンドー化学	32,000	290	9,280,000
鬼怒川ゴム	21,000	473	9,933,000
旭 硝 子	420,000	516	216,720,000
日本板硝子	367,000	73	26,791,000
有沢製作所	17,800	210	3,738,000
日本山村硝子	35,000	166	5,810,000
日本電気硝子	165,000	467	77,055,000
オハラ	4,500	729	3,280,500
住友大阪セメント	178,000	228	40,584,000
太平洋セメント	507,000	155	78,585,000
東海カーボン	77,000	336	25,872,000
日本カーボン	43,000	178	7,654,000
東洋炭素	4,500	2,199	9,895,500
ノリタケ	44,000	195	8,580,000
T O T O	133,000	529	70,357,000
日本碍子	112,000	781	87,472,000
日本特殊陶業	73,000	996	72,708,000
M A R U W A	2,800	2,181	6,106,800
品川リフラクトリーズ	24,000	169	4,056,000
黒崎播磨	22,000	167	3,674,000
フジミインコーポレーテッド	8,800	1,128	9,926,400
ニチアス	39,000	359	14,001,000
新日本製鐵	2,245,000	165	370,425,000
住友金属工業	1,583,000	120	189,960,000
神戸製鋼所	1,185,000	88	104,280,000
日新製鋼	312,000	94	29,328,000
合同製鐵	52,000	157	8,164,000

ＪＦＥホールディングス	202,400	1,223	247,535,200
東京製鐵	45,300	446	20,203,800
共英製鋼	9,700	1,286	12,474,200
大和工業	19,600	2,122	41,591,200
大阪製鐵	5,700	1,399	7,974,300
淀川製鋼所	63,000	286	18,018,000
東洋鋼鋳	24,000	259	6,216,000
丸一鋼管	26,200	1,599	41,893,800
大同特殊鋼	144,000	458	65,952,000
日本金属工業	88,000	52	4,576,000
日本冶金工	76,500	102	7,803,000
山陽特殊製鋼	44,000	324	14,256,000
愛知製鋼	47,000	319	14,993,000
日立金属	55,000	870	47,850,000
日本金属	29,000	119	3,451,000
大平洋金属	64,000	311	19,904,000
日本電工	34,000	271	9,214,000
栗本鉄工所	53,000	172	9,116,000
日本製鋼所	135,000	394	53,190,000
三菱製鋼	57,000	190	10,830,000
日本精線	10,000	344	3,440,000
日本軽金属	208,000	101	21,008,000
三井金属	241,000	169	40,729,000
東邦亜鉛	56,000	278	15,568,000
三菱マテリアル	534,000	207	110,538,000
住友鉱山	221,000	868	191,828,000
ＤＯＷＡホールディングス	104,000	465	48,360,000
古河機金	172,000	64	11,008,000
大阪チタニウム	8,800	2,400	21,120,000
東邦チタニウム	15,100	848	12,804,800
住友軽金属	222,000	77	17,094,000
古河スカイ	40,000	215	8,600,000
古河電工	278,000	165	45,870,000
住友電工	301,000	876	263,676,000
フジクラ	137,000	215	29,455,000
昭和電線ＨＬＤＧＳ	141,000	62	8,742,000
タツタ電線	21,000	416	8,736,000
日立電線	78,000	168	13,104,000
リョービ	49,000	218	10,682,000
アサヒＨＤ	12,400	1,444	17,905,600
東洋製罐	60,500	877	53,058,500
ホッカンホールディングス	25,000	220	5,500,000
コロナ	4,900	935	4,581,500
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	21,000	469	9,849,000
駒井ハルテック	30,000	216	6,480,000
三和ホールディングス	89,000	311	27,679,000
文化シャツタ -	29,000	311	9,019,000
住生活グループ	111,300	1,488	165,614,400
日本ファイルコン	8,700	378	3,288,600
ノーリツ	17,100	1,422	24,316,200
長府製作所	8,100	1,716	13,899,600
リンナイ	13,700	4,970	68,089,000
ユニプレス	13,300	2,024	26,919,200
日東精工	17,000	206	3,502,000
岡 部	18,900	456	8,618,400

東 プ レ	16,700	628	10,487,600
高周波熱錬	12,900	570	7,353,000
東京製綱	66,000	130	8,580,000
パイオラックス	3,900	1,637	6,384,300
日本発条	61,600	810	49,896,000
三浦工業	13,800	1,921	26,509,800
タ ク マ	33,000	336	11,088,000
ツ ガ ミ	24,000	577	13,848,000
オークマ	56,000	498	27,888,000
東芝機械	50,000	371	18,550,000
ア マ ダ	123,000	444	54,612,000
アイダエンジニア	26,800	430	11,524,000
牧野フライス	46,000	447	20,562,000
オーエスジー	38,500	1,064	40,964,000
旭ダイヤモンド	22,600	763	17,243,800
森精機製作所	46,400	647	30,020,800
ディスコ	8,800	4,145	36,476,000
日東工器	5,800	1,579	9,158,200
豊田自動織機	73,900	2,027	149,795,300
大阪機工	56,000	93	5,208,000
津田駒工業	33,000	132	4,356,000
島精機製作所	11,800	1,233	14,549,400
日阪製作所	12,000	684	8,208,000
ナブテスコ	36,600	1,700	62,220,000
三井海洋開発	7,300	1,338	9,767,400
S M C	25,600	12,390	317,184,000
新川	12,100	374	4,525,400
ホソカワミクロン	18,000	362	6,516,000
ユニオンツール	5,500	1,177	6,473,500
オイレス工業	9,600	1,511	14,505,600
サト - ホールディングス	9,600	1,012	9,715,200
ワイエイシイ	5,200	526	2,735,200
小松製作所	400,200	1,802	721,160,400
住友重機械	222,000	333	73,926,000
日立建機	45,000	1,406	63,270,000
日 工	17,000	258	4,386,000
巴工業	3,800	1,437	5,460,600
井関農機	94,000	171	16,074,000
T O W A	10,900	499	5,439,100
丸山製作所	32,000	143	4,576,000
北川鉄工所	52,000	122	6,344,000
クボタ	393,000	656	257,808,000
東洋エンジニア	50,000	317	15,850,000
三菱化工機	38,000	119	4,522,000
月島機械	13,000	628	8,164,000
帝国電機製作所	3,800	1,386	5,266,800
新東工業	20,000	708	14,160,000
アイチ コーポレーション	16,600	316	5,245,600
小森コーポレーション	28,200	551	15,538,200
住友精密	15,000	386	5,790,000
荏原製作所	145,000	268	38,860,000
西島製作所	10,800	741	8,002,800
千代田化工建	75,000	957	71,775,000
ダイキン工業	103,600	1,949	201,916,400
オルガノ	16,000	447	7,152,000

ト - ヨ - カネツ	57,000	148	8,436,000
栗田工業	46,100	1,702	78,462,200
椿本チエイン	45,000	421	18,945,000
日 機 装	28,000	759	21,252,000
木村化工機	12,600	299	3,767,400
新興プランテック	19,200	626	12,019,200
アネスト岩田	18,000	358	6,444,000
ダイフク	38,500	465	17,902,500
加藤製作所	24,000	365	8,760,000
タダノ	41,000	568	23,288,000
フジテック	28,000	482	13,496,000
シーケーディ	25,000	528	13,200,000
平和	18,300	1,352	24,741,600
理想科学工業	6,700	1,309	8,770,300
SANKYO	24,200	3,815	92,323,000
日本金銭機械	9,100	574	5,223,400
マースエンジニアリング	4,800	1,596	7,660,800
ダイコク電機	7,500	1,413	10,597,500
ア マ ノ	25,200	628	15,825,600
JUKI	59,000	109	6,431,000
サンデン	46,000	271	12,466,000
ブラザー工業	105,500	828	87,354,000
マックス	15,000	883	13,245,000
モリタホールディングス	20,000	522	10,440,000
グローリー	23,900	1,519	36,304,100
大和冷機工業	17,000	376	6,392,000
セガサミーホールディングス	87,600	1,482	129,823,200
日本ピストンリング	39,000	141	5,499,000
リ ケ ン	30,000	294	8,820,000
T P R	9,800	1,254	12,289,200
ホシザキ電機	18,000	1,923	34,614,000
大豊工業	6,800	864	5,875,200
日本精工	182,000	473	86,086,000
N T N	193,000	239	46,127,000
ジェイテクト	79,000	744	58,776,000
不 二 越	87,000	330	28,710,000
ミネベア	127,000	309	39,243,000
日本トムソン	29,000	341	9,889,000
T H K	55,000	1,412	77,660,000
ユーシン精機	4,900	1,564	7,663,600
前澤給装工業	3,600	1,005	3,618,000
イーグル工業	12,000	690	8,280,000
日本ピラ - 工業	10,000	639	6,390,000
キッツ	35,100	295	10,354,500
日 立	1,886,000	443	835,498,000
東 芝	1,712,000	285	487,920,000
三菱電機	817,000	601	491,017,000
富士電機	253,000	174	44,022,000
東洋電機製造	18,000	228	4,104,000
安川電機	100,000	567	56,700,000
シンフォニア テクノロジー	56,000	147	8,232,000
明 電 舎	87,000	266	23,142,000
オリジン電気	17,000	251	4,267,000
デンヨー	8,600	990	8,514,000
日立工機	24,000	621	14,904,000

三桜工業	11,700	618	7,230,600
マキタ	53,500	2,670	142,845,000
東芝テック	51,000	263	13,413,000
芝浦メカトロニクス	19,000	157	2,983,000
マブチモーター	10,700	3,055	32,688,500
日本電産	44,200	6,240	275,808,000
高岳製作所	41,000	155	6,355,000
ダイヘン	51,000	225	11,475,000
J V C ケンウッド	36,800	241	8,868,800
第一精工	2,300	1,352	3,109,600
日新電機	18,000	402	7,236,000
大崎電気	12,000	660	7,920,000
オムロン	90,700	1,555	141,038,500
日東工業	12,000	1,169	14,028,000
I D E C	11,900	694	8,258,600
ジーエス・ユアサ コーポ	161,000	325	52,325,000
メルコホールディングス	4,800	1,547	7,425,600
日本電気	1,126,000	109	122,734,000
富 士 通	787,000	344	270,728,000
沖 電 気	334,000	102	34,068,000
岩崎通信機	66,000	65	4,290,000
電気興業	29,000	355	10,295,000
サンケン電気	46,000	287	13,202,000
アイホン	5,300	1,463	7,753,900
ルネサスエレクトロニクス	25,100	262	6,576,200
セイコーエプソン	55,600	761	42,311,600
ワコム	169	144,700	24,454,300
アルバック	10,200	542	5,528,400
アクセル	4,000	1,445	5,780,000
ナナオ	7,300	1,519	11,088,700
日本信号	20,800	483	10,046,400
京三製作所	18,000	306	5,508,000
能美防災	12,000	437	5,244,000
日本無線	18,000	147	2,646,000
パナソニック	930,300	509	473,522,700
シャープ	397,000	392	155,624,000
アンリツ	41,000	803	32,923,000
富士通ゼネラル	22,000	573	12,606,000
日立国際電気	21,000	617	12,957,000
ソ ニ ー	509,200	1,029	523,966,800
T D K	43,100	3,325	143,307,500
帝国通信工業	37,000	120	4,440,000
ミツミ電機	33,200	530	17,596,000
タムラ製作所	32,000	180	5,760,000
アルプス電気	68,300	575	39,272,500
パイオニア	121,700	282	34,319,400
日本電波工業	7,500	874	6,555,000
ローランド ディー . ジー .	5,200	817	4,248,400
フォスタ - 電機	9,200	1,138	10,469,600
クラリオン	62,000	161	9,982,000
S M K	30,000	229	6,870,000
ヨコオ	9,300	380	3,534,000
東 光	49,000	194	9,506,000
ホシデン	24,800	470	11,656,000
ヒロセ電機	14,100	7,050	99,405,000

日本航空電子	20,000	629	12,580,000
T O A	10,000	597	5,970,000
ユニデン	28,000	197	5,516,000
アルパイン	17,100	841	14,381,100
スミダコーポレーション	7,300	369	2,693,700
アイコム	5,200	1,697	8,824,400
船井電機	8,400	1,104	9,273,600
横河電機	91,600	680	62,288,000
新電元工業	30,000	249	7,470,000
アズビル	20,400	1,524	31,089,600
日本光電工業	16,300	2,177	35,485,100
堀場製作所	15,200	2,576	39,155,200
アドバンテスト	63,600	1,016	64,617,600
エスベック	11,000	724	7,964,000
パナソニック電工SUNX	8,300	334	2,772,200
キーエンス	20,100	17,770	357,177,000
日置電機	4,500	1,409	6,340,500
シスメックス	28,900	3,075	88,867,500
メガチップス	7,600	1,667	12,669,200
日本電産コパル電子	11,400	419	4,776,600
デンソー	201,900	2,311	466,590,900
コーセル	11,900	912	10,852,800
日立メディコ	7,000	1,087	7,609,000
オブテックス	5,700	981	5,591,700
千代田インテグレ	3,600	906	3,261,600
東光電気	10,000	291	2,910,000
スタンレー電気	54,200	1,070	57,994,000
岩崎電気	40,000	136	5,440,000
ウシオ電機	48,200	865	41,693,000
日本セラミック	5,200	1,225	6,370,000
日本デジタル研究所	8,500	790	6,715,000
古河電池	8,000	421	3,368,000
図 研	7,500	553	4,147,500
カ シ オ	82,100	457	37,519,700
ファナック	85,500	13,220	1,130,310,000
日本シイエムケイ	21,700	273	5,924,100
エンプラス	4,700	1,953	9,179,100
ロ ー ム	39,300	2,774	109,018,200
浜松ホトニクス	31,600	2,589	81,812,400
新光電気工業	30,100	582	17,518,200
京 セ ラ	68,000	6,400	435,200,000
太陽誘電	40,400	710	28,684,000
村田製作所	85,600	4,095	350,532,000
ユーシン	12,600	431	5,430,600
双葉電子工業	13,700	1,112	15,234,400
日東電工	70,600	3,055	215,683,000
北陸電気工業	44,000	87	3,828,000
東海理化電機	19,200	1,288	24,729,600
ニチコン	27,300	737	20,120,100
日本ケミコン	54,000	223	12,042,000
K O A	11,300	682	7,706,600
三井造船	329,000	100	32,900,000
日立造船	332,000	89	29,548,000
佐世保重工業	61,000	90	5,490,000
三菱重工業	1,366,000	317	433,022,000

川崎重工業	600,000	199	119,400,000
I H I	556,000	157	87,292,000
日本車輜	32,000	248	7,936,000
近畿車輜	17,000	241	4,097,000
日産自動車	1,044,200	723	754,956,600
いすゞ自動車	516,000	388	200,208,000
トヨタ自動車	1,063,400	2,926	3,111,508,400
日野自動車	119,000	493	58,667,000
三菱自動車工業	1,804,000	75	135,300,000
エフテック	4,000	1,141	4,564,000
武蔵精密工業	7,800	1,455	11,349,000
日産車体	27,000	844	22,788,000
新明和工業	40,000	343	13,720,000
極東開発工業	15,000	663	9,945,000
日信工業	15,100	1,022	15,432,200
トピー工業	63,000	199	12,537,000
ティラド	33,000	254	8,382,000
曙ブレーキ	42,900	344	14,757,600
タチエス	11,300	1,285	14,520,500
N O K	39,800	1,547	61,570,600
フタバ産業	25,200	338	8,517,600
カヤバ工業	59,000	312	18,408,000
シロキ工業	20,000	195	3,900,000
市光工業	29,000	128	3,712,000
大同メタル工業	13,000	699	9,087,000
プレス工業	40,000	357	14,280,000
カルソニックカンセイ	51,000	430	21,930,000
太平洋工業	19,000	460	8,740,000
ケーヒン	17,500	1,122	19,635,000
河西工業	12,000	430	5,160,000
アイシン精機	66,800	2,367	158,115,600
富士機工	15,000	246	3,690,000
マ ツ ダ	1,096,000	94	103,024,000
ダイハツ	74,000	1,271	94,054,000
今仙電機製作所	6,900	998	6,886,200
本田技研	691,600	2,417	1,671,597,200
スズキ	170,700	1,579	269,535,300
富士重工業	260,000	573	148,980,000
ヤマハ発動機	132,600	722	95,737,200
ショーワ	20,100	586	11,778,600
小糸製作所	41,000	999	40,959,000
T B K	12,000	393	4,716,000
エクセディ	10,900	1,556	16,960,400
ミツバ	16,000	567	9,072,000
豊田合成	23,300	1,491	34,740,300
愛三工業	9,400	604	5,677,600
ヨ ロ ズ	5,000	1,173	5,865,000
エフ・シー・シー	13,400	1,314	17,607,600
新家工業	31,000	105	3,255,000
シマノ	30,500	4,720	143,960,000
タカタ	14,900	1,565	23,318,500
テイ・エス テック	17,800	1,336	23,780,800
小 野 建	7,400	642	4,750,800
佐島電機	8,400	381	3,200,400
カッパクリエイト	6,350	1,685	10,699,750

伯東	9,400	723	6,796,200
ナガイレーベン	10,500	1,193	12,526,500
三菱食品	7,600	1,782	13,543,200
良品計画	8,800	4,130	36,344,000
三城ホールディングス	13,400	425	5,695,000
松田産業	7,000	1,099	7,693,000
メディバルHD	87,300	1,013	88,434,900
アズワン	5,200	1,446	7,519,200
シモジマ	7,500	892	6,690,000
ドウシシャ	4,000	2,098	8,392,000
コナカ	8,500	1,012	8,602,000
コジマ	11,500	297	3,415,500
コーナン商事	8,800	984	8,659,200
黒田電気	11,100	791	8,780,100
ネットワンシステムズ	37,200	1,018	37,869,600
ワタミ	9,700	1,593	15,452,100
ドン・キホーテ	21,200	2,813	59,635,600
メガネトップ	12,800	834	10,675,200
西松屋チェーン	19,100	629	12,013,900
ゼンショーホールディングス	30,100	999	30,069,900
幸楽苑	6,000	1,186	7,116,000
サイゼリヤ	12,200	1,174	14,322,800
ガリバーインターナショナル	2,700	2,463	6,650,100
ユナイテッドアローズ	9,200	1,872	17,222,400
ハイデイ日高	4,600	1,177	5,414,200
シークス	6,300	951	5,991,300
京都きもの友禅	6,500	909	5,908,500
コロワイド	28,000	583	16,324,000
田中商事	5,600	442	2,475,200
壱番屋	3,300	2,302	7,596,600
マクニカ	4,800	1,560	7,488,000
トップカルチャー	6,300	365	2,299,500
スギホールディングス	14,500	2,509	36,380,500
島津製作所	97,000	649	62,953,000
J M S	20,000	236	4,720,000
ブイ・テクノロジー	15	175,000	2,625,000
スター精密	14,900	749	11,160,100
東京計器	41,000	124	5,084,000
日本電産トーソク	4,700	646	3,036,200
東京精密	15,100	1,319	19,916,900
ニコン	142,400	2,108	300,179,200
トプコン	21,500	592	12,728,000
オリンパス	97,800	1,331	130,171,800
理研計器	8,200	480	3,936,000
大日本スクリーン	80,000	562	44,960,000
キャノン電子	8,000	1,664	13,312,000
タムロン	7,400	2,213	16,376,200
HOYA	199,800	1,664	332,467,200
エー・アンド・デイ	11,600	254	2,946,400
キャノン	509,000	2,991	1,522,419,000
リコー	246,000	549	135,054,000
日本電産コパル	8,000	798	6,384,000
日本電産サンキョー	21,000	425	8,925,000
シチズンホールディングス	100,500	455	45,727,500
リズム時計	49,000	106	5,194,000

パラマウントベッドHD	7,400	2,345	17,353,000
S H O - B I	5,200	432	2,246,400
ダンロップスポーツ	5,000	921	4,605,000
バンダイナムコHLDGS	87,300	922	80,490,600
フランスベッドHLDGS	69,000	170	11,730,000
パイロットコーポレーション	76	143,800	10,928,800
エイベックス・グループHD	16,300	1,086	17,701,800
トッパン・フォームズ	18,100	614	11,113,400
フジシールインターナショナル	9,600	1,376	13,209,600
タカラトミー	26,500	484	12,826,000
廣済堂	14,100	310	4,371,000
レック	3,600	961	3,459,600
プロネクス	13,000	477	6,201,000
大建工業	38,000	211	8,018,000
き も と	9,200	396	3,643,200
凸版印刷	246,000	473	116,358,000
大日本印刷	246,000	569	139,974,000
共同印刷	37,000	181	6,697,000
日本写真印刷	16,000	776	12,416,000
藤森工業	7,000	1,346	9,422,000
宝印刷	7,600	548	4,164,800
前澤化成工業	7,900	788	6,225,200
アシックス	76,000	850	64,600,000
ツ ツ ミ	4,700	2,008	9,437,600
ジェイ エス ピー	6,200	1,012	6,274,400
ニ チ ハ	10,500	761	7,990,500
ローランド	10,100	598	6,039,800
エフピコ	3,800	4,670	17,746,000
小松ウオール工業	4,900	927	4,542,300
ヤマハ	62,300	692	43,111,600
河合楽器	39,000	174	6,786,000
クリナップ	12,600	460	5,796,000
ピジョン	7,400	3,105	22,977,000
天馬	9,200	798	7,341,600
兼松日産農林	26,000	123	3,198,000
リンテック	15,800	1,329	20,998,200
信越ポリマー	19,000	369	7,011,000
東 リ	32,000	138	4,416,000
イトーキ	26,400	378	9,979,200
任 天 堂	46,700	9,290	433,843,000
三菱鉛筆	7,300	1,324	9,665,200
タカラスタンダ - ド	39,000	544	21,216,000
コ ク ヨ	43,200	548	23,673,600
ナカバヤシ	32,000	161	5,152,000
ニ フ コ	18,700	1,758	32,874,600
グローブライド	69,000	91	6,279,000
岡村製作所	29,000	524	15,196,000
日本バルカー	35,000	203	7,105,000
伊 藤 忠	648,100	823	533,386,300
丸 紅	703,000	485	340,955,000
スクロール	15,100	284	4,288,400
高 島	23,000	326	7,498,000
F & A アクアホールディングス	8,400	960	8,064,000
三陽商会	59,000	251	14,809,000
長瀬産業	46,700	896	41,843,200

蝶 理	50,000	96	4,800,000
豊田通商	90,500	1,426	129,053,000
オンワ - ドホールディングス	53,000	596	31,588,000
三共生興	17,700	253	4,478,100
兼 松	175,000	80	14,000,000
美 津 濃	41,000	390	15,990,000
フアミリーマート	24,300	3,570	86,751,000
三井物産	697,400	1,091	760,863,400
日本紙バルブ	40,000	250	10,000,000
東京エレクトロン	68,500	3,500	239,750,000
日立ハイテクノロジーズ	24,600	1,720	42,312,000
カメイ	13,000	746	9,698,000
東都水産	32,000	117	3,744,000
スターゼン	29,000	223	6,467,000
セイコーHD	54,000	212	11,448,000
山 善	32,800	626	20,532,800
住友商事	479,400	1,042	499,534,800
日本ユニシス	23,800	503	11,971,400
内田洋行	29,000	227	6,583,000
三菱商事	588,700	1,517	893,057,900
第一実業	22,000	355	7,810,000
キャノンマーケティングJPN	26,600	908	24,152,800
西華産業	31,000	222	6,882,000
菱洋エレクトロ	9,900	807	7,989,300
ユアサ商事	95,000	123	11,685,000
神鋼商事	30,000	165	4,950,000
阪和興業	80,000	283	22,640,000
カナデン	10,000	489	4,890,000
菱電商事	13,000	456	5,928,000
ニプロ	34,600	439	15,189,400
岩谷産業	89,000	297	26,433,000
すてきナイスグループ	43,000	187	8,041,000
昭光通商	56,000	110	6,160,000
極東貿易	20,000	128	2,560,000
イ ワ キ	15,000	162	2,430,000
兼松エレクトロニクス	6,400	838	5,363,200
三愛石油	21,000	361	7,581,000
稲畑産業	22,100	440	9,724,000
JFE商事	56,200	325	18,265,000
ゴ - ルドウイン	22,000	474	10,428,000
ユニ・チャ - ム	47,400	4,325	205,005,000
デサント	23,000	444	10,212,000
ヤマトインタ - ナショナル	6,600	362	2,389,200
東邦ホールディングス	27,100	1,522	41,246,200
サンゲツ	14,200	1,901	26,994,200
ミツウロコグループ	16,500	481	7,936,500
シナネン	18,000	331	5,958,000
伊藤忠エネクス	23,900	411	9,822,900
サンリオ	20,600	2,497	51,438,200
リョーサン	14,000	1,439	20,146,000
新光商事	12,600	595	7,497,000
トーホー	23,000	303	6,969,000
三信電気	11,700	493	5,768,100
東陽テクニカ	12,000	788	9,456,000
モスフード サービス	10,200	1,526	15,565,200

加賀電子	12,800	779	9,971,200
三益半導体	8,400	613	5,149,200
木曽路	10,300	1,539	15,851,700
千 趣 会	14,800	513	7,592,400
ケーヨー	16,000	464	7,424,000
アデランス	13,100	967	12,667,700
上新電機	19,000	740	14,060,000
日本瓦斯	8,700	830	7,221,000
マルエツ	21,000	281	5,901,000
ロイヤルホールディングス	14,000	927	12,978,000
島 忠	17,800	1,597	28,426,600
チヨダ	11,100	1,610	17,871,000
ライフコーポレーション	5,900	1,430	8,437,000
カ ス ミ	18,100	528	9,556,800
リンガーハット	8,000	1,058	8,464,000
MR M A X	15,600	285	4,446,000
A O K Iホールディングス	8,200	1,571	12,882,200
オークワ	13,000	933	12,129,000
コメリ	11,200	2,037	22,814,400
青山商事	22,700	1,736	39,407,200
しまむら	9,300	9,020	83,886,000
C F Sコーポレーション	11,500	359	4,128,500
高 島 屋	113,000	548	61,924,000
松 屋	20,500	567	11,623,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	43,000	683	29,369,000
ニッセンHD	19,300	344	6,639,200
パ ル コ	16,900	762	12,877,800
丸井グループ	109,700	538	59,018,600
クレディセゾン	67,700	1,509	102,159,300
原信ナルスH L D G S	5,100	1,339	6,828,900
ダイエー	57,350	188	10,781,800
イズミヤ	33,000	390	12,870,000
イオン	283,100	942	266,680,200
ユ ニ ー	63,200	796	50,307,200
イ ズ ミ	24,400	1,586	38,698,400
東武ストア	17,000	275	4,675,000
平 和 堂	15,200	1,072	16,294,400
フ ジ	9,200	1,735	15,962,000
ヤオコー	4,400	2,743	12,069,200
ゼビオ	9,900	1,859	18,404,100
ケースホールディングス	20,100	1,883	37,848,300
P a l t a c	10,200	1,024	10,444,800
新生銀行	656,000	81	53,136,000
あおぞら銀行	254,000	159	40,386,000
三菱U F JフィナンシャルG	6,125,900	337	2,064,428,300
りそなホールディングス	705,700	287	202,535,900
三井住友トラストHD	1,578,000	195	307,710,000
三井住友フィナンシャルG	614,600	2,296	1,411,121,600
第四銀行	102,000	224	22,848,000
北越銀行	86,000	140	12,040,000
西日本シティ銀行	272,000	175	47,600,000
札幌北洋ホール	122,700	229	28,098,300
千葉銀行	315,000	457	143,955,000
横浜銀行	513,000	362	185,706,000
常陽銀行	304,000	333	101,232,000

群馬銀行	177,000	348	61,596,000
武蔵野銀行	12,500	2,214	27,675,000
千葉興業銀行	19,200	385	7,392,000
筑波銀行	39,500	250	9,875,000
東京都民銀行	16,900	707	11,948,300
七十七銀行	132,000	301	39,732,000
青森銀行	64,000	227	14,528,000
秋田銀行	62,000	202	12,524,000
山形銀行	52,000	321	16,692,000
岩手銀行	5,700	3,130	17,841,000
東邦銀行	74,000	226	16,724,000
東北銀行	67,000	107	7,169,000
みちのく銀行	49,000	140	6,860,000
ふくおかフィナンシャルG	326,000	287	93,562,000
静岡銀行	239,000	772	184,508,000
十六銀行	104,000	243	25,272,000
スルガ銀行	78,000	734	57,252,000
八十二銀行	143,000	370	52,910,000
山梨中央銀行	52,000	300	15,600,000
大垣共立銀行	102,000	233	23,766,000
福井銀行	70,000	177	12,390,000
北國銀行	93,000	299	27,807,000
清水銀行	3,200	2,069	6,620,800
滋賀銀行	73,000	410	29,930,000
南都銀行	76,000	328	24,928,000
百五銀行	71,000	308	21,868,000
京都銀行	142,000	576	81,792,000
三重銀行	35,000	165	5,775,000
ほくほくフィナンシャルG	549,000	122	66,978,000
広島銀行	230,000	268	61,640,000
山陰合同銀行	47,000	497	23,359,000
中国銀行	63,000	952	59,976,000
鳥取銀行	34,000	140	4,760,000
伊予銀行	82,000	604	49,528,000
百十四銀行	92,000	285	26,220,000
四国銀行	60,000	193	11,580,000
阿波銀行	69,000	491	33,879,000
鹿児島銀行	48,000	450	21,600,000
大分銀行	54,000	248	13,392,000
宮崎銀行	57,000	175	9,975,000
肥後銀行	59,000	396	23,364,000
佐賀銀行	54,000	184	9,936,000
十八銀行	55,000	186	10,230,000
沖縄銀行	6,300	3,580	22,554,000
琉球銀行	16,300	939	15,305,700
八千代銀行	4,600	1,536	7,065,600
セブン銀行	310,100	180	55,818,000
みずほフィナンシャルG	10,406,300	115	1,196,724,500
紀陽ホールディングス	311,000	104	32,344,000
山口フィナンシャルG	78,000	633	49,374,000
芙蓉総合リース	8,100	2,247	18,200,700
興銀リース	12,200	1,766	21,545,200
東京センチュリーリース	22,100	1,315	29,061,500
S B Iホールディングス	8,878	5,080	45,100,240
日本証券金融	38,600	365	14,089,000

長野銀行	38,000	144	5,472,000
名古屋銀行	78,000	222	17,316,000
愛知銀行	3,100	3,710	11,501,000
第三銀行	55,000	150	8,250,000
中京銀行	42,000	173	7,266,000
東日本銀行	43,000	162	6,966,000
大光銀行	35,000	181	6,335,000
愛媛銀行	49,000	198	9,702,000
トマト銀行	46,000	123	5,658,000
みなと銀行	74,000	128	9,472,000
京葉銀行	65,000	351	22,815,000
関西アーバン銀行	115,000	98	11,270,000
栃木銀行	41,000	240	9,840,000
北日本銀行	3,800	1,955	7,429,000
東和銀行	83,000	66	5,478,000
福島銀行	136,000	52	7,072,000
リコーリース	6,600	1,738	11,470,800
イオン クレジットサービス	37,400	1,275	47,685,000
ア コ ム	17,550	1,409	24,727,950
ジャックス	56,000	211	11,816,000
オ リ コ	137,000	90	12,330,000
日立キャピタル	17,700	1,102	19,505,400
オリックス	41,900	6,500	272,350,000
三菱ＵＦＪリース	20,760	2,868	59,539,680
ジャフコ	11,900	1,385	16,481,500
トモニホールディングス	62,800	295	18,526,000
大和証券Ｇ本社	796,000	247	196,612,000
野村ホールディングス	1,739,900	252	438,454,800
岡三証券グループ	67,000	276	18,492,000
丸三証券	31,200	248	7,737,600
東洋証券	43,000	146	6,278,000
東海東京ＨＤ	91,000	251	22,841,000
水戸証券	37,000	159	5,883,000
いちよし証券	21,200	369	7,822,800
松井証券	49,400	387	19,117,800
ＮＫＳＪホールディングス	168,200	1,439	242,039,800
マネックスＧ	765	12,080	9,241,200
カブドットコム証券	34,100	210	7,161,000
極東証券	12,100	565	6,836,500
岩井コスモホールディング	12,100	290	3,509,000
フィデアホール	53,300	134	7,142,200
池田泉州ＨＤ	320,800	102	32,721,600
ＭＳ＆ＡＤ	240,100	1,190	285,719,000
ＳＯＮＹ ＦＨ	78,800	1,124	88,571,200
第一生命	4,316	79,900	344,848,400
東京海上ＨＤ	307,900	1,744	536,977,600
Ｔ＆Ｄホールディングス	295,300	752	222,065,600
三井不動産	358,000	1,286	460,388,000
三菱地所	565,000	1,212	684,780,000
平和不動産	90,500	160	14,480,000
東京建物	162,000	249	40,338,000
ダイビル	25,900	557	14,426,300
東急不動産	168,000	336	56,448,000
京阪神ビルディング	18,000	342	6,156,000
住友不動産	193,000	1,555	300,115,000

東宝不動産	13,200	408	5,385,600
大京	132,000	162	21,384,000
テーオーシー	33,000	412	13,596,000
レオパレス 2 1	72,400	198	14,335,200
空港施設	14,600	336	4,905,600
住友不動産販売	3,240	3,415	11,064,600
ゴールドクレスト	8,220	1,094	8,992,680
東栄住宅	7,300	719	5,248,700
東急リバブル	9,900	745	7,375,500
飯田産業	9,200	537	4,940,400
アーネストワン	15,700	863	13,549,100
タカラレーベン	11,700	548	6,411,600
イオンモール	36,700	1,521	55,820,700
タクトホーム	90	62,800	5,652,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	527	55,500	29,248,500
東武鉄道	468,000	382	178,776,000
相鉄ホールディングス	130,000	251	32,630,000
東京急行	476,000	350	166,600,000
京浜急行	210,000	687	144,270,000
小田急電鉄	262,000	728	190,736,000
京王電鉄	231,000	545	125,895,000
京成電鉄	136,000	626	85,136,000
富士急行	25,000	448	11,200,000
東日本旅客鉄道	141,500	4,595	650,192,500
西日本旅客鉄道	70,900	3,095	219,435,500
東海旅客鉄道	704	636,000	447,744,000
西日本鉄道	101,000	330	33,330,000
近畿日本鉄道	728,000	289	210,392,000
阪急阪神 H L D G S	540,000	391	211,140,000
南海電鉄	166,000	336	55,776,000
京阪電鉄	178,000	365	64,970,000
名古屋鉄道	278,000	210	58,380,000
日本通運	323,000	306	98,838,000
ヤマトホールディングス	166,200	1,244	206,752,800
山 九	97,000	278	26,966,000
日 新	36,000	195	7,020,000
丸全昭和運輸	34,000	229	7,786,000
センコー	36,000	354	12,744,000
日本梱包運輸	25,700	911	23,412,700
福山通運	50,000	393	19,650,000
セイノーホールディングス	62,000	508	31,496,000
神奈川中央交通	15,000	418	6,270,000
日立物流	17,000	1,358	23,086,000
日本郵船	657,000	199	130,743,000
商船三井	436,000	259	112,924,000
川崎汽船	273,000	141	38,493,000
N S ユナイテッド海運	60,000	103	6,180,000
乾 汽 船	14,800	234	3,463,200
飯野海運	43,500	340	14,790,000
第一中央汽船	72,000	84	6,048,000
全日本空輸	1,093,000	219	239,367,000
三菱倉庫	60,000	794	47,640,000
三井倉庫	41,000	279	11,439,000
住友倉庫	59,000	344	20,296,000
渋沢倉庫	24,000	229	5,496,000

ヤマタネ	58,000	100	5,800,000
東陽倉庫	22,000	174	3,828,000
日本トランスシティ	28,000	263	7,364,000
安田倉庫	8,100	476	3,855,600
東洋埠頭	37,000	129	4,773,000
上 組	88,000	619	54,472,000
郵船ロジスティクス	7,300	1,030	7,519,000
近鉄エクスプレス	7,600	2,518	19,136,800
東京放送HD	48,200	907	43,717,400
日本テレビ放送網	7,070	11,380	80,456,600
テレビ朝日	203	110,600	22,451,800
スカパーJ S A T H D	641	30,600	19,614,600
テレビ東京HD	5,500	897	4,933,500
アイ・ティー・シーネットワーク	12,600	520	6,552,000
イー・アクセス	716	12,780	9,150,480
N E C モバイリング	3,200	2,963	9,481,600
日本電信電話	373,300	3,295	1,230,023,500
K D D I	1,252	485,500	607,846,000
光通信	7,500	2,892	21,690,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	6,662	125,300	834,748,600
G M O インターネット	28,100	345	9,694,500
ゼンリン	13,000	732	9,516,000
昭文社	6,000	522	3,132,000
角川グループH L D G S	7,800	2,043	15,935,400
東京電力	611,600	160	97,856,000
中部電力	271,300	1,224	332,071,200
関西電力	335,900	1,092	366,802,800
中国電力	113,300	1,220	138,226,000
北陸電力	80,700	1,127	90,948,900
東北電力	207,400	697	144,557,800
四国電力	74,300	1,717	127,573,100
九州電力	180,700	929	167,870,300
北海道電力	77,300	905	69,956,500
沖縄電力	5,400	2,428	13,111,200
電源開発	51,100	1,996	101,995,600
東京瓦斯	985,000	374	368,390,000
大阪瓦斯	794,000	309	245,346,000
東邦瓦斯	210,000	463	97,230,000
北海道瓦斯	21,000	229	4,809,000
西部瓦斯	101,000	186	18,786,000
静岡瓦斯	24,000	497	11,928,000
松 竹	55,000	746	41,030,000
東 宝	57,800	1,251	72,307,800
エイチ・アイ・エス	9,200	2,466	22,687,200
東 映	36,000	344	12,384,000
N T T データ	499	221,100	110,328,900
共立メンテナンス	5,200	1,590	8,268,000
建設技術研究所	7,400	453	3,352,200
アインファーマシーズ	4,700	4,205	19,763,500
東京テアトル	59,000	101	5,959,000
よみうりランド	23,000	234	5,382,000
東京都競馬	82,000	107	8,774,000
常磐興産	55,000	85	4,675,000
カナモト	13,000	752	9,776,000
東京ドーム	82,000	210	17,220,000

D T S	9,700	963	9,341,100
スクウェア・エニックス・HD	27,800	1,203	33,443,400
カプコン	16,200	1,568	25,401,600
日本空港ビルデング	26,200	885	23,187,000
トランス・コスモス	11,900	1,090	12,971,000
乃村工藝社	21,000	233	4,893,000
S C S K	17,400	1,061	18,461,400
藤田観光	30,000	242	7,260,000
日本管財	3,200	1,398	4,473,600
トーカイ	4,800	1,727	8,289,600
セコム	82,700	3,470	286,969,000
アイネス	13,200	520	6,864,000
丹青社	15,000	217	3,255,000
メイテック	13,800	1,627	22,452,600
T K C	7,100	1,574	11,175,400
アサツー ディ・ケイ	14,600	2,106	30,747,600
富士ソフト	11,900	1,223	14,553,700
応用地質	10,600	772	8,183,200
船井総合研究所	10,600	540	5,724,000
N S D	19,500	645	12,577,500
コナミ	37,300	1,607	59,941,100
ベネッセホールディングス	26,100	3,495	91,219,500
イオンディライト	10,000	1,768	17,680,000
ニチイ学館	18,100	728	13,176,800
ダイセキ	14,200	1,306	18,545,200
元気寿司	4,700	990	4,653,000
トラスコ中山	10,200	1,625	16,575,000
ヤマダ電機	38,930	3,810	148,323,300
オートバックスセブン	9,300	3,980	37,014,000
アークランドサカモト	6,000	1,199	7,194,000
ニトリホールディングス	15,650	7,100	111,115,000
愛 眼	13,100	288	3,772,800
吉野家ホールディングス	211	101,700	21,458,700
加藤産業	12,900	1,499	19,337,100
イエローハット	8,700	1,349	11,736,300
富士エレクトロニクス	4,600	1,014	4,664,400
J B C Cホールディングス	9,700	520	5,044,000
サガミチェーン	13,000	637	8,281,000
日 伝	3,700	1,995	7,381,500
因幡電機産業	10,200	2,100	21,420,000
住金物産	46,000	182	8,372,000
プレナス	9,200	1,423	13,091,600
ミニストップ	5,900	1,320	7,788,000
アークス	11,900	1,597	19,004,300
バ ロ ー	16,900	1,315	22,223,500
ミスミグループ本社	30,100	1,674	50,387,400
ベ ル ク	6,600	1,091	7,200,600
大 庄	6,500	989	6,428,500
タキヒヨー	14,000	419	5,866,000
ファーストリテイリング	16,100	16,060	258,566,000
ソフトバンク	366,100	2,456	899,141,600
スズケン	31,100	2,457	76,412,700
サンドラッグ	15,000	2,406	36,090,000
ベルーナ	11,700	593	6,938,100
合計			79,319,981,530

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

トヨタ自動車	100,000株	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	600,000株
--------	----------	---------------	----------

（２） 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,185,389	58,247,195
国債証券	7,275,708,640	8,660,337,370
地方債証券	1,324,639,799	1,162,799,054
特殊債券	1,600,246,279	1,281,404,371
社債券	1,552,841,780	1,643,568,579
未収入金	245,480,670	-
未収利息	47,769,211	48,957,641
前払費用	3,666,421	3,212,214
流動資産合計	12,113,538,189	12,858,526,424
資産合計	12,113,538,189	12,858,526,424
負債の部		
流動負債		
未払金	256,463,870	-
未払解約金	1,235,000	12,605,000
流動負債合計	257,698,870	12,605,000
負債合計	257,698,870	12,605,000
純資産の部		
元本等		
元本	10,699,066,048	11,275,890,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,156,773,271	1,570,031,352
元本等合計	11,855,839,319	12,845,921,424
純資産合計	11,855,839,319	12,845,921,424
負債純資産合計	12,113,538,189	12,858,526,424

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23年6月7日 至 平成24年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（追加情報）

自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分		平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,596,073,751円	10,699,066,048円
	同期中における追加設定元本額	1,654,257,770円	3,058,176,610円
	同期中における一部解約元本額	1,551,265,473円	2,481,352,586円
	同期末における元本の内訳		
	ファンド名		
	ダイワ・ライフ・バランス 3 0	2,244,201,821円	2,807,329,293円
	ダイワ・ライフ・バランス 5 0	245,110,900円	936,743,102円
	ダイワ・ライフ・バランス 7 0	64,909,141円	229,933,178円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 安定コース）	176,317,071円	217,433,745円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 6 分散コース）	123,980,783円	140,502,945円
	D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 成長コース）	26,633,942円	32,423,432円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2020	12,303,319円	13,892,393円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	3,705,291円	4,597,593円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	63,887円	175,637円
	ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	4,236,545,967円	3,705,066,112円
	ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	385,503,502円	328,613,496円
	ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 5 0 V A	1,000,498,719円	922,091,459円
	ダイワ・ワールド・バランスファ ンド 7 5 V A	2,179,291,705円	1,937,087,687円
	計	10,699,066,048円	11,275,890,072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	10,699,066,048口	11,275,890,072口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5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。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年6月5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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	47,160,370	116,334,750
地方債証券	74,826	2,566,410
特殊債券	2,775,217	616,959
社債券	6,003,380	1,619,935
合計	38,456,599	117,898,184

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成23年6月6日まで、及び平成23年12月1日から平成24年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1081円 (11,081円)	1.1392円 (11,392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	3 0 8 2 年国債	66,000,000	66,000,000	

3 0 9	2 年国債	40,000,000	40,000,000
3 1 0	2 年国債	40,000,000	40,057,200
3 1 1	2 年国債	53,000,000	53,080,560
3 1 3	2 年国債	70,000,000	70,000,000
3 1 4	2 年国債	40,000,000	40,000,000
3 1 5	2 年国債	5,000,000	5,000,000
3 1 6	2 年国債	20,000,000	20,000,000
7 5	5 年国債	86,000,000	87,105,960
7 6	5 年国債	22,000,000	22,311,080
7 7	5 年国債	65,000,000	65,752,050
7 8	5 年国債	50,000,000	50,613,500
7 9	5 年国債	4,000,000	4,036,800
8 2	5 年国債	100,000,000	101,424,000
8 5	5 年国債	10,000,000	10,136,900
8 6	5 年国債	130,000,000	131,483,300
8 7	5 年国債	103,000,000	104,042,360
8 8	5 年国債	85,000,000	85,943,500
9 1	5 年国債	53,000,000	53,511,980
9 2	5 年国債	114,000,000	114,727,320
9 3	5 年国債	3,000,000	3,040,140
9 4	5 年国債	61,000,000	62,030,900
9 5	5 年国債	109,000,000	110,907,500
9 6	5 年国債	56,000,000	56,768,880
9 7	5 年国債	35,000,000	35,336,700
9 8	5 年国債	100,000,000	100,561,000
9 9	5 年国債	38,000,000	38,355,680
1 0 1	5 年国債	100,000,000	100,899,000
1 0 2	5 年国債	37,000,000	37,166,130
1 0 3	5 年国債	50,000,000	50,189,000
1 0 4	5 年国債	45,000,000	44,957,250
1	4 0 年国債	24,000,000	26,755,440
2	4 0 年国債	25,000,000	26,452,000
3	4 0 年国債	19,000,000	20,033,220
4	4 0 年国債	30,000,000	31,447,800
5	4 0 年国債	6,000,000	5,947,260
2 5 4	1 0 年国債	8,000,000	8,133,680
2 5 6	1 0 年国債	14,000,000	14,279,300
2 5 7	1 0 年国債	15,000,000	15,276,150
2 6 8	1 0 年国債	10,000,000	10,388,600
2 6 9	1 0 年国債	54,000,000	55,798,740
2 7 0	1 0 年国債	8,000,000	8,290,480
2 7 2	1 0 年国債	105,000,000	109,454,100
2 7 4	1 0 年国債	11,000,000	11,534,600
2 7 5	1 0 年国債	30,000,000	31,352,400
2 7 6	1 0 年国債	25,000,000	26,303,000
2 7 7	1 0 年国債	58,000,000	61,209,720
2 7 8	1 0 年国債	20,000,000	21,257,400
2 7 9	1 0 年国債	2,000,000	2,140,800
2 8 0	1 0 年国債	3,000,000	3,209,940
2 8 6	1 0 年国債	51,000,000	54,958,110
2 8 7	1 0 年国債	121,000,000	130,993,390
2 8 8	1 0 年国債	148,000,000	159,114,800
2 8 9	1 0 年国債	77,000,000	82,098,940
2 9 0	1 0 年国債	55,000,000	58,389,100
2 9 1	1 0 年国債	39,000,000	41,169,960
2 9 2	1 0 年国債	60,000,000	64,701,600
2 9 3	1 0 年国債	9,000,000	9,774,180

2 9 4	1 0 年国債	28,000,000	30,243,080
2 9 5	1 0 年国債	35,000,000	37,378,950
2 9 6	1 0 年国債	17,000,000	18,169,090
2 9 7	1 0 年国債	16,000,000	17,008,320
2 9 8	1 0 年国債	44,000,000	46,493,040
2 9 9	1 0 年国債	130,000,000	137,317,700
3 0 0	1 0 年国債	20,000,000	21,396,400
3 0 1	1 0 年国債	50,000,000	53,507,000
3 0 2	1 0 年国債	20,000,000	21,266,600
3 0 3	1 0 年国債	127,000,000	135,083,550
3 0 4	1 0 年国債	48,000,000	50,717,760
3 0 5	1 0 年国債	72,000,000	76,044,960
3 0 6	1 0 年国債	65,000,000	69,072,250
3 0 7	1 0 年国債	90,000,000	94,967,100
3 0 8	1 0 年国債	47,000,000	49,522,020
3 0 9	1 0 年国債	122,000,000	126,627,460
3 1 0	1 0 年国債	138,000,000	141,852,960
3 1 1	1 0 年国債	31,000,000	31,365,490
3 1 2	1 0 年国債	172,000,000	179,287,640
3 1 3	1 0 年国債	95,000,000	99,634,100
3 1 4	1 0 年国債	62,000,000	63,946,180
3 1 5	1 0 年国債	67,000,000	69,550,690
3 1 6	1 0 年国債	85,000,000	87,516,850
3 1 7	1 0 年国債	38,000,000	39,035,880
3 1 8	1 0 年国債	120,000,000	122,180,400
3 1 9	1 0 年国債	90,000,000	92,228,400
3 2 0	1 0 年国債	76,000,000	77,175,720
3 2 1	1 0 年国債	100,000,000	101,309,000
3 2 2	1 0 年国債	50,000,000	50,203,000
2	3 0 年国債	9,000,000	10,133,190
3	3 0 年国債	4,000,000	4,443,120
4	3 0 年国債	8,000,000	9,639,680
5	3 0 年国債	8,000,000	8,729,680
6	3 0 年国債	9,000,000	10,090,620
7	3 0 年国債	12,000,000	13,250,280
8	3 0 年国債	4,000,000	4,073,080
9	3 0 年国債	11,000,000	10,441,970
1 0	3 0 年国債	12,000,000	10,737,600
1 1	3 0 年国債	12,000,000	11,962,920
1 2	3 0 年国債	8,000,000	8,533,520
1 3	3 0 年国債	13,000,000	13,625,560
1 4	3 0 年国債	21,000,000	23,523,780
1 5	3 0 年国債	15,000,000	17,074,050
1 6	3 0 年国債	15,000,000	17,063,700
1 7	3 0 年国債	13,000,000	14,541,930
1 8	3 0 年国債	15,000,000	16,491,450
1 9	3 0 年国債	15,000,000	16,489,650
2 0	3 0 年国債	12,000,000	13,658,520
2 1	3 0 年国債	16,000,000	17,598,880
2 2	3 0 年国債	15,000,000	17,075,550
2 3	3 0 年国債	14,000,000	15,951,880
2 4	3 0 年国債	15,000,000	17,092,050
2 5	3 0 年国債	15,000,000	16,501,050
2 6	3 0 年国債	31,000,000	34,723,100
2 7	3 0 年国債	30,000,000	34,214,100
2 8	3 0 年国債	32,000,000	36,523,520
2 9	3 0 年国債	37,000,000	41,516,960

3 0	3 0 年国債	40,000,000	44,011,600
3 1	3 0 年国債	44,000,000	47,481,280
3 2	3 0 年国債	40,000,000	44,030,400
3 3	3 0 年国債	53,000,000	54,832,210
3 4	3 0 年国債	45,000,000	48,550,500
3 5	3 0 年国債	55,000,000	56,782,550
3 6	3 0 年国債	27,000,000	27,857,790
3 0	利付国債 2 0 年	16,000,000	17,888,960
3 2	利付国債 2 0 年	8,000,000	9,077,760
3 3	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,772,550
3 6	利付国債 2 0 年	33,000,000	37,725,930
3 7	利付国債 2 0 年	5,000,000	5,742,150
3 8	利付国債 2 0 年	11,000,000	12,497,210
3 9	2 0 年国債	32,000,000	36,173,760
4 0	2 0 年国債	51,000,000	57,083,280
4 1	2 0 年国債	40,000,000	42,750,400
4 2	2 0 年国債	13,000,000	14,859,390
4 3	2 0 年国債	14,000,000	16,397,080
4 4	2 0 年国債	24,000,000	27,523,920
4 5	2 0 年国債	20,000,000	22,787,200
4 6	2 0 年国債	19,000,000	21,356,380
4 7	2 0 年国債	23,000,000	25,875,460
4 8	2 0 年国債	9,000,000	10,351,260
4 9	2 0 年国債	4,000,000	4,469,200
5 0	2 0 年国債	30,000,000	32,994,300
5 1	2 0 年国債	25,000,000	27,703,750
5 2	2 0 年国債	19,000,000	21,218,440
5 3	2 0 年国債	13,000,000	14,516,710
5 4	2 0 年国債	14,000,000	15,771,560
5 5	2 0 年国債	41,000,000	45,382,490
5 6	2 0 年国債	12,000,000	13,282,200
5 7	2 0 年国債	24,000,000	26,342,160
5 8	2 0 年国債	19,000,000	20,847,750
5 9	2 0 年国債	27,000,000	29,078,730
6 0	2 0 年国債	12,000,000	12,559,320
6 1	2 0 年国債	25,000,000	25,097,500
6 2	2 0 年国債	12,000,000	11,767,200
6 3	2 0 年国債	24,000,000	26,050,560
6 4	2 0 年国債	24,000,000	26,270,640
6 5	2 0 年国債	27,000,000	29,543,940
6 6	2 0 年国債	6,000,000	6,499,800
6 7	2 0 年国債	10,000,000	10,925,600
6 8	2 0 年国債	27,000,000	30,399,300
6 9	2 0 年国債	22,000,000	24,525,160
7 0	2 0 年国債	16,000,000	18,366,880
7 1	2 0 年国債	25,000,000	28,132,000
7 2	2 0 年国債	37,000,000	41,161,020
7 3	2 0 年国債	10,000,000	10,997,600
7 4	2 0 年国債	27,000,000	29,991,060
7 5	2 0 年国債	14,000,000	15,534,120
7 6	2 0 年国債	21,000,000	22,806,000
7 7	2 0 年国債	9,000,000	9,885,600
7 8	2 0 年国債	17,000,000	18,445,340
7 9	2 0 年国債	12,000,000	13,163,640
8 0	2 0 年国債	15,000,000	16,634,250
8 1	2 0 年国債	10,000,000	10,960,700
8 2	2 0 年国債	38,000,000	42,112,360

8 3	2 0 年国債	33,000,000	36,522,420
8 4	2 0 年国債	21,000,000	22,983,030
8 5	2 0 年国債	38,000,000	41,994,940
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,780,600
8 7	2 0 年国債	15,000,000	16,754,250
8 8	2 0 年国債	29,000,000	32,733,460
8 9	2 0 年国債	23,000,000	25,670,300
9 0	2 0 年国債	43,000,000	47,893,830
9 1	2 0 年国債	13,000,000	14,654,640
9 2	2 0 年国債	51,000,000	56,056,650
9 3	2 0 年国債	3,000,000	3,252,330
9 4	2 0 年国債	54,000,000	59,283,360
9 5	2 0 年国債	30,000,000	33,709,500
9 6	2 0 年国債	20,000,000	21,929,600
9 7	2 0 年国債	16,000,000	17,734,560
9 8	2 0 年国債	41,000,000	44,896,640
9 9	2 0 年国債	50,000,000	54,675,500
1 0 0	2 0 年国債	32,000,000	35,377,920
1 0 1	2 0 年国債	14,000,000	15,871,240
1 0 2	2 0 年国債	28,000,000	31,729,040
1 0 3	2 0 年国債	18,000,000	20,134,620
1 0 4	2 0 年国債	14,000,000	15,253,280
1 0 5	2 0 年国債	45,000,000	48,982,950
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	17,650,720
1 0 7	2 0 年国債	38,000,000	41,321,960
1 0 8	2 0 年国債	27,000,000	28,563,300
1 0 9	2 0 年国債	25,000,000	26,411,500
1 1 0	2 0 年国債	25,000,000	27,156,750
1 1 1	2 0 年国債	14,000,000	15,392,300
1 1 2	2 0 年国債	52,000,000	56,386,200
1 1 3	2 0 年国債	72,000,000	77,983,920
1 1 4	2 0 年国債	54,000,000	58,376,700
1 1 5	2 0 年国債	19,000,000	20,832,170
1 1 6	2 0 年国債	30,000,000	32,878,800
1 1 7	2 0 年国債	44,000,000	47,539,360
1 1 8	2 0 年国債	18,000,000	19,141,560
1 1 9	2 0 年国債	29,000,000	29,937,280
1 2 0	2 0 年国債	32,000,000	32,022,400
1 2 1	2 0 年国債	66,000,000	69,045,240
1 2 2	2 0 年国債	10,000,000	10,304,800
1 2 3	2 0 年国債	41,000,000	44,119,690
1 2 4	2 0 年国債	33,000,000	34,961,850
1 2 5	2 0 年国債	27,000,000	29,445,930
1 2 6	2 0 年国債	19,000,000	20,112,070
1 2 7	2 0 年国債	20,000,000	20,851,400
1 2 8	2 0 年国債	28,000,000	29,140,440
1 2 9	2 0 年国債	38,000,000	38,938,220
1 3 0	2 0 年国債	45,000,000	46,054,800
1 3 1	2 0 年国債	25,000,000	25,164,250
1 3 2	2 0 年国債	30,000,000	30,154,500
1 3 3	2 0 年国債	32,000,000	32,709,120
1 3 4	2 0 年国債	25,000,000	25,521,000
1 3 5	2 0 年国債	20,000,000	20,089,200
1 3 6	2 0 年国債	25,000,000	24,703,000
国債証券 合計			8,660,337,370
地方債証券	6 0 4 東京都公債	10,000,000	10,210,700

	6 2 4 東京都公債	100,000,000	104,117,800	
	6 5 3 東京都公債	100,000,000	106,591,700	
	2 0 - 6 北海道公債	100,000,000	107,507,500	
	2 9 3 大阪府公債	100,000,000	107,619,800	
	2 1 - 2 埼玉県公債	100,000,000	107,116,700	
	1 2 共同発行地方	50,000,000	51,123,650	
	1 4 共同発行地方	36,400,000	37,360,232	
	2 0 共同発行地方	100,000,000	103,327,500	
	2 7 共同発行地方	34,000,000	35,188,742	
	3 0 共同発行地方	50,000,000	51,871,550	
	2 1 - 6 大阪市公債	100,000,000	106,758,300	
	1 2 - ゆ 名古屋市債	20,000,000	20,447,680	
	1 8 - 4 札幌市公債	100,000,000	106,678,800	
	1 8 - 2 北九州市債	100,000,000	106,878,400	
地方債証券 合計			1,162,799,054	
特殊債券	4 7 日本政策投資 B	100,000,000	102,416,600	
	3 1 9 政保道路債	40,000,000	40,371,240	
	3 2 3 政保道路債	85,000,000	86,791,205	
	3 2 8 政保道路債	41,000,000	42,105,729	
	3 3 3 政保道路債	21,000,000	21,736,680	
	3 3 4 政保道路債	2,000,000	2,067,742	
	2 7 政保道路機構	50,000,000	53,636,150	
	5 6 政保道路機構	100,000,000	105,978,100	
	8 2 9 政保公営企業	10,000,000	10,109,740	
	8 3 1 政保公営企業	4,000,000	4,076,656	
	8 4 2 政保公営企業	5,000,000	5,184,875	
	2 政保地方公営機	100,000,000	107,369,000	
	2 6 公営企業	100,000,000	107,150,100	
	1 9 0 政保首都高速	3,000,000	3,067,107	
	1 3 首都高速道路	100,000,000	103,466,900	
	2 7 国際協力銀行	100,000,000	106,792,500	
	1 4 政保国民生活	19,000,000	19,592,097	
	2 成田国際空港	100,000,000	104,649,900	
	い 7 1 5 利付商工債	100,000,000	101,139,000	
	い 7 2 8 利付農林債	100,000,000	100,803,600	
	1 アフリカ開発銀行 S U B	50,000,000	52,899,450	
特殊債券 合計			1,281,404,371	
社債券	2 サントリーホールディング	100,000,000	101,787,900	
	7 小松製作所	100,000,000	101,899,200	
	5 0 東芝	100,000,000	101,493,100	
	1 7 ソニー	100,000,000	103,518,400	
	1 明治安田 2 0 1 1 基	100,000,000	100,679,700	
	9 トヨタ自動車	100,000,000	101,729,100	
	6 ドン・キホーテ	100,000,000	100,469,800	
	5 8 伊藤忠商事	100,000,000	101,110,000	
	4 住友信託 劣後	100,000,000	103,348,600	
	7 三井住友 B K 劣後	100,000,000	102,506,000	
	1 4 0 オリックス	100,000,000	101,119,500	
	3 1 三井不動産	100,000,000	103,167,500	
	2 7 東日本旅客鉄道	100,000,000	101,597,600	
	1 6 N T T ドコモ	100,000,000	101,628,400	
	3 7 8 東北電力	100,000,000	112,291,400	
	2 6 1 北海道電力	3,000,000	3,323,379	
	1 0 電源開発	100,000,000	101,899,000	
社債券 合計			1,643,568,579	
合計			12,748,109,374	

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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	383,408,028	407,354,173
コール・ローン	165,851,123	148,072,034
株式	46,071,403,748	42,251,287,547
投資証券	790,594,842	923,164,743
派生商品評価勘定	-	103,620
未収入金	1,723,158	11,925,435
未収配当金	127,969,257	116,581,940
差入委託証拠金	235,078,193	302,898,864
流動資産合計	47,776,028,349	44,161,388,356
資産合計	47,776,028,349	44,161,388,356
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,977,402	49,303,708
未払金	153,673,336	215,947,471
未払解約金	40,957,000	18,500,000
その他未払費用	-	41,544
流動負債合計	198,607,738	283,792,723
負債合計	198,607,738	283,792,723
純資産の部		
元本等		
元本	1 50,681,256,369	53,572,819,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 3,103,835,758	9,695,223,726
元本等合計	47,577,420,611	43,877,595,633
純資産合計	47,577,420,611	43,877,595,633
負債純資産合計	47,776,028,349	44,161,388,356

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23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（追加情報）

自 平成23年6月7日

至 平成24年6月5日

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,325,116,493円	50,681,256,369円
同期中における追加設定元本額	5,939,295,708円	8,391,607,266円
同期中における一部解約元本額	7,583,155,832円	5,500,044,276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	1,991,720,152円	1,933,735,710円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	92,958,863円	97,361,825円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,426,352,025円	1,392,514,397円

ダイワ国際分散バランスファンド 30VA(一般投資家私募)	180,636,714円	187,349,099円
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA(一般投資家私募)	4,483,608,597円	4,429,602,679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30	14,561,733,831円	17,171,129,893円
ダイワ・ライフ・バランス50	471,074,325円	629,524,679円
ダイワ・ライフ・バランス70	141,047,483円	579,094,011円
大和DC海外株式インデックス ファンド	93,855,221円	354,144,496円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,489,527,257円	1,554,480,215円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	5,167,713円	6,017,239円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	4,230,057円	5,519,967円
ダイワ世界分散バランスファンド 15VA	370,165円	1,141,917円
ダイワ世界分散バランスファンド 20VA	117,564,605円	114,546,775円
ダイワ世界分散バランスファンド 25VA	1,687,853,140円	1,730,766,631円
ダイワ世界分散バランスファンド 30VA	37,835,240円	39,443,846円
ダイワ世界バランスファンド40 VA	383,157,274円	388,924,885円
ダイワ世界バランスファンド60 VA	5,864,302,913円	5,860,266,833円
ダイワ・バランスファンド35V A	1,482,423,643円	1,440,427,526円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	12,584,485,773円	11,845,270,700円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	633,449,781円	607,085,949円
ダイワライフスタイル25	2,812,949,577円	3,050,766,038円
ダイワライフスタイル50	21,517,255円	25,733,487円
ダイワライフスタイル75	62,319,596円	72,670,714円
計	51,115,169円	55,299,848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	50,681,256,369円	53,572,819,359円
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3,103,835,758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9,695,223,726円でありま す。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用 の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年6月5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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	2,855,227,907	1,132,474,965
投資証券	78,802,745	76,510,379
合計	2,934,030,652	1,208,985,344

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成23年6月6日まで、及び平成23年12月1日から平成24年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	平成23年6月6日 現在			平成24年6月5日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買 建	653,990,833	-	650,013,431	3,977,402	697,000,227	-	647,727,859	49,272,368
合計	653,990,833	-	650,013,431	3,977,402	697,000,227	-	647,727,859	49,272,368

(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23年6月6日 現在				平成24年6月5日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	-	-	-	-	58,076,920	-	58,149,200	72,280
アメリカ・ドル	-	-	-	-	23,449,200	-	23,481,000	31,800
イギリス・ポンド	-	-	-	-	24,139,340	-	24,108,000	31,340
カナダ・ドル	-	-	-	-	10,488,380	-	10,560,200	71,820
合計	-	-	-	-	58,076,920	-	58,149,200	72,280

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9388円 (9,388円)	0.8190円 (8,190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	
	AVON PRODUCTS	11,900	15.700	186,830.000	
	ABBOTT LABS	43,500	60.220	2,619,570.000	
	ALCOA	30,200	8.390	253,378.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	4,000	46.550	186,200.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,200	42.690	478,128.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,800	52.220	250,656.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	6,629	31.240	207,089.960	
	AFLAC INC	12,800	38.450	492,160.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,900	49.170	191,763.000	
	MONSTER BEVERAGE CORP	4,300	73.110	314,373.000	
	ADOBE SYSTEMS	13,200	30.310	400,092.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,900	159.750	303,525.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,800	69.340	194,152.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	11.360	118,144.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	57.340	114,680.000	
	GARMIN LTD	3,200	41.580	133,056.000	
	AETNA INC	9,600	40.500	388,800.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,600	77.480	433,888.000	
	ALTERA CORPORATION	8,800	32.390	285,032.000	
	BEAM INC	4,000	58.690	234,760.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	19,600	53.200	1,042,720.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,951	22.550	111,645.050	
	WR BERKLEY CORP	3,600	37.440	134,784.000	
	AUTOZONE INC	900	377.000	339,300.000	
	DOLLAR TREE INC	3,350	102.000	341,700.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	49.840	159,488.000	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES	2,900	29.800	86,420.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	4,200	37.380	156,996.000	
	D.R.HORTON INC	8,766	14.480	126,931.680	
	CONTINENTAL RESOURCES	1,200	67.280	80,736.000	
	DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,800	36.200	137,560.000	
	AUTODESK INC	6,100	30.830	188,063.000	
	MOODY'S CORP	5,500	35.260	193,930.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	10,200	58.360	595,272.000	
	CONSOL ENERGY INC	6,100	28.200	172,020.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	3,200	43.470	139,104.000	
	CITIGROUP INC	80,823	24.820	2,006,026.860	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,000	51.550	670,150.000	
	AMERICAN ELEC POWER	13,000	38.420	499,460.000	
	DUN&BRADSTREET CORP	1,400	64.390	90,146.000	
	HESS CORP	8,500	42.680	362,780.000	
	COVIDIEN PLC	13,325	50.800	676,910.000	
	DAVITA INC	2,500	81.060	202,650.000	
	DANAHER CORP	15,500	50.030	775,465.000	

AVNET INC	4,600	29.230	134,458.000
INTERCONTINENTALEXCHANGE	2,100	119.290	250,509.000
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17,700	30.880	546,576.000
PEABODY ENERGY CORP	7,400	23.800	176,120.000
BUNGE LIMITED	4,200	57.830	242,886.000
TE CONNECTIVITY LTD	11,925	30.570	364,547.250
APPLE INC	25,400	564.290	14,332,966.000
DISCOVER FINANCIAL SERVIC	15,200	30.800	468,160.000
BOEING CO	19,600	67.500	1,323,000.000
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,415	34.990	154,480.850
MEADWESTVACO CORP	4,800	26.560	127,488.000
SPECTRA ENERGY CORP	17,696	27.740	490,887.040
BECTON DICKINSON & CO	5,900	72.180	425,862.000
SAIC INC	8,600	11.040	94,944.000
NISOURCE INC	7,600	24.730	187,948.000
JOY GLOBAL INC	3,100	54.530	169,043.000
BMC SOFTWARE INC	4,800	41.710	200,208.000
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,400	56.690	249,436.000
ALPHA NATURAL RESOURCES I	6,000	10.110	60,660.000
BARD(C.R.) INC	2,300	95.460	219,558.000
BANK OF NEW YORK MELLON	33,171	19.510	647,166.210
VERIZON COMMUNICATIONS	78,400	41.340	3,241,056.000
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,500	79.040	1,936,480.000
H&R BLOCK INC	8,800	15.350	135,080.000
BB&T CORPORATION	19,200	27.640	530,688.000
HOSPIRA INC	4,520	32.000	144,640.000
BROADCOM CORP-CL A	13,350	32.020	427,467.000
BAKER HUGHES INC	11,623	40.840	474,683.320
BRISTOL MYERS SQUIBB	45,300	33.660	1,524,798.000
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,900	70.070	133,133.000
FIDELITY NATIONAL FINL-A	7,138	18.510	132,124.380
JPMORGAN CHASE & CO	102,220	31.000	3,168,820.000
LEGG MASON INC	3,850	24.140	92,939.000
T ROWE PRICE GROUP INC	6,900	55.220	381,018.000
CIGNA CORP	8,000	42.650	341,200.000
COMPUTER SCIENCES CORP	4,200	25.500	107,100.000
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,600	75.190	120,304.000
FRONTIER COMMUNICATIONS	26,442	3.530	93,340.260
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,200	84.000	184,800.000
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,860	45.460	266,395.600
DOLLAR GENERAL CORP	5,200	48.490	252,148.000
CATERPILLAR INC DEL	18,000	83.260	1,498,680.000
GENWORTH FINANCIAL INC-A	12,900	5.050	65,145.000
VIRGIN MEDIA INC	8,400	21.780	182,952.000
HERBALIFE LTD	3,400	44.640	151,776.000
MOAIC CO/THE	8,600	45.620	392,332.000
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,600	79.020	442,512.000
CORNING INC	43,700	12.240	534,888.000
CISCO SYSTEMS	149,100	16.110	2,402,001.000
DU PONT	24,800	47.020	1,166,096.000
MORGAN STANLEY	39,700	12.360	490,692.000
DOW CHEMICAL	31,500	30.490	960,435.000
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,200	30.530	189,286.000
DELL INC	44,800	12.000	537,600.000
DTE ENERGY COMPANY	4,600	56.800	261,280.000
AGCO CORP	2,800	38.900	108,920.000
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,300	51.530	788,409.000

DENBURY RESOURCES INC	11,300	14.390	162,607.000
DEERE & CO	11,200	70.590	790,608.000
AIRGAS INC	2,100	84.220	176,862.000
WALTER ENERGY INC	1,700	46.500	79,050.000
QUANTA SERVICES INC	6,400	21.370	136,768.000
TIME WARNER INC	26,733	34.120	912,129.960
VMWARE INC-CLASS A	2,400	88.330	211,992.000
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	26.640	98,568.000
NASDAQ STOCK MARKET INC	3,900	21.390	83,421.000
KINDER MORGAN MANAGEMENT	2,636	69.170	182,332.120
CONSOLIDATED EDISON INC	8,200	60.700	497,740.000
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	3,500	47.590	166,565.000
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,900	53.880	156,252.000
NYSE EURONEXT	6,900	23.410	161,529.000
COLGATE PALMOLIVE CO	13,100	97.170	1,272,927.000
AMETEK INC	4,350	48.740	212,019.000
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,000	53.020	212,080.000
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,900	36.760	327,164.000
COSTCO WHOLESALE CORP	11,900	86.560	1,030,064.000
SCANA CORP	3,500	46.700	163,450.000
GREEN MOUNTAIN COFFEE	3,800	23.480	89,224.000
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	900	397.090	357,381.000
LEUCADIA NATIONAL CORP	5,800	19.840	115,072.000
CUMMINS INC	4,900	91.680	449,232.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,500	11.650	157,275.000
APOLLO GROUP INC-CL A	3,500	32.420	113,470.000
LORILLARD INC	3,700	120.340	445,258.000
PROGRESS ENERGY INC	7,500	55.830	418,725.000
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	3,200	51.240	163,968.000
KINDER MORGAN INC	7,300	33.000	240,900.000
HCA HOLDINGS INC	5,100	24.400	124,440.000
CABOT OIL & GAS CORP	5,600	31.130	174,328.000
METROPCS COMMUNICATIONS	7,300	6.080	44,384.000
DOLBY LABORATORIES-A	1,500	40.780	61,170.000
ABERCROMBIE & FITCH -CL A	2,500	31.780	79,450.000
COCA COLA CO	55,100	73.640	4,057,564.000
COCA-COLA ENTERPRISES	8,800	26.250	231,000.000
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,700	37.640	214,548.000
EATON VANCE CORP	3,700	23.210	85,877.000
COOPER INDUSTRIES LTD-A	4,500	67.710	304,695.000
FMC TECHNOLOGIES INC	6,700	38.680	259,156.000
FRANKLIN RESOURCES INC	4,200	102.730	431,466.000
CSX CORP	27,800	20.340	565,452.000
FLUOR CORP	4,700	46.220	217,234.000
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,700	83.840	226,368.000
EXPEDIA INC	2,675	44.930	120,187.750
AUTOLIV INC	2,600	54.930	142,818.000
AMAZON.COM INC	10,100	214.570	2,167,157.000
FLOWERVE CORP	1,500	100.160	150,240.000
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,200	84.180	269,376.000
EXXON MOBIL CORP	130,655	77.830	10,168,878.650
RALCORP HOLDINGS INC	1,600	62.520	100,032.000
EQUINIX INC	1,200	157.830	189,396.000
FLIR SYSTEMS INC	4,500	21.110	94,995.000
AES CORP	17,900	11.820	211,578.000
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,800	67.200	188,160.000
EVEREST RE GROUP LTD	1,700	100.940	171,598.000

EOG RESOURCES INC	7,200	90.400	650,880.000
EQUITABLE RESOURCES INC	4,200	44.000	184,800.000
AKAMAI TECHNOLOGIES	5,100	28.360	144,636.000
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,100	36.410	258,511.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,790	37.840	370,453.600
FORD MOTOR CO	94,423	10.040	948,006.920
MACY'S INC	11,698	36.420	426,041.160
DISCOVERY COMMUNICATION-A	4,140	48.500	200,790.000
FOREST LABORATORIES INC	7,500	34.490	258,675.000
LIBERTY GLOBAL INC	4,135	45.680	188,886.800
DISCOVERY COMMUNICATION-C	3,240	44.980	145,735.200
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	5,200	17.740	92,248.000
FOSSIL INC	1,500	69.480	104,220.000
NEXTERA ENERGY INC	10,700	64.730	692,611.000
FREEPORT-MCMORAN COPPER	25,408	32.330	821,440.640
US BANCORP	51,500	28.790	1,482,685.000
FAMILY DOLLAR STORES	2,900	67.830	196,707.000
F5 NETWORKS INC	2,100	97.510	204,771.000
FASTENAL CO	7,400	43.380	321,012.000
FISERV INC	3,800	66.410	252,358.000
GENERAL ELECTRIC CO	289,300	18.150	5,250,795.000
GOODYEAR TIRE&RUBBER	7,100	9.440	67,024.000
GENERAL MOTORS CO	21,700	21.110	458,087.000
GENERAL DYNAMICS CORP	8,500	61.960	526,660.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,500	91.000	1,137,500.000
LIBERTY MEDIA CO-LIBER-A	3,100	81.970	254,107.000
GAMESTOP CORP-CLASS A	4,900	19.200	94,080.000
GOODRICH CORP	3,300	125.380	413,754.000
GOOGLE INC-CL A	7,100	578.590	4,107,989.000
GENERAL MILLS INC	17,300	37.840	654,632.000
FIRSTENERGY CORP	11,668	46.800	546,062.400
GENUINE PARTS CO	4,200	61.140	256,788.000
FIFTH THIRD BANCORP	25,800	12.090	311,922.000
HARRIS CORP	3,400	39.600	134,640.000
HALLIBURTON CO	24,500	29.520	723,240.000
HOME DEPOT INC	42,000	48.760	2,047,920.000
ASSURANT INC	3,300	32.570	107,481.000
HERSHEY CO/THE	4,300	66.010	283,843.000
HARLEY-DAVIDSON INC	6,200	46.000	285,200.000
HUMANA INC	4,600	77.120	354,752.000
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,600	48.460	271,376.000
HELMERICH & PAYNE	3,000	45.120	135,360.000
WINDSTREAM CORP	17,100	9.120	155,952.000
HENRY SCHEIN INC	2,600	73.020	189,852.000
HEWLETT-PACKARD CO	53,100	21.060	1,118,286.000
DIRECTV	18,782	44.510	835,986.820
HOLLYFRONTIER CORP	6,000	28.570	171,420.000
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	37.340	134,424.000
HEINZ H J CO	9,100	52.620	478,842.000
INT'L BUSINESS MACHINES	31,800	188.540	5,995,572.000
INTERNATIONAL PAPER	11,600	27.810	322,596.000
INGERSOLL-RAND CO-CL A	8,129	39.110	317,925.190
LEGGETT & PLATT INC	4,200	19.780	83,076.000
LIBERTY GLOBAL INC-C	3,535	43.980	155,469.300
JUNIPER NETWORKS INC	14,600	16.710	243,966.000
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3,100	75.420	233,802.000
JOHNSON & JOHNSON	75,000	62.340	4,675,500.000

HOLOGIC INC	7,100	16.340	116,014.000
KIMBERLY-CLARK CORP	10,500	78.860	828,030.000
KROGER CO	15,600	21.910	341,796.000
KLA-TENCOR CORPORATION	4,600	44.650	205,390.000
LOCKHEED MARTIN CORP	7,300	81.050	591,665.000
LIMITED BRANDS	7,200	42.280	304,416.000
LOWE'S COS INC	34,200	26.660	911,772.000
ELI LILLY & CO	27,700	40.150	1,112,155.000
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	4,300	19.720	84,796.000
LAM RESEARCH CORP	3,600	35.990	129,564.000
RANGE RESOURCES CORP	4,400	54.630	240,372.000
LSI CORP	17,000	6.350	107,950.000
LOEWS CORP	8,500	38.300	325,550.000
LINCOLN NATIONAL CORP	8,349	19.340	161,469.660
MCDONALD'S CORP	27,500	86.320	2,373,800.000
3M CO	17,900	82.620	1,478,898.000
FACEBOOK INC-A	8,000	26.900	215,200.000
MANPOWER INC	2,300	33.990	78,177.000
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	7,700	42.870	330,099.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	65.170	84,721.000
CONCHO RESOURCES INC	2,700	85.010	229,527.000
PHILLIPS 66	16,900	29.530	499,057.000
MURPHY OIL CORP	4,900	45.010	220,549.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	8,500	10.410	88,485.000
MATTEL INC	9,000	30.580	275,220.000
KBR INC	4,200	23.670	99,414.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,600	55.320	199,152.000
MYLAN INC	12,200	20.900	254,980.000
METLIFE INC	28,200	27.820	784,524.000
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	12.020	174,290.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,328	46.840	343,243.520
MONSANTO CO	14,306	76.060	1,088,114.360
ROCKWELL INTL CORP	4,000	66.920	267,680.000
MERCK & CO INC	82,321	37.460	3,083,744.660
MASCO CORP	9,700	11.730	113,781.000
M & T BANK CORP	3,100	77.350	239,785.000
MARSH & MCLENNAN COS	15,000	31.550	473,250.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	7,482	36.330	271,821.060
NETAPP INC	10,200	29.900	304,980.000
NIKE INC -CL B	10,200	104.700	1,067,940.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,300	63.690	592,317.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,300	30.510	161,703.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,500	57.110	371,215.000
NEWMONT MINIG CORP	13,200	51.550	680,460.000
MCKESSON CORP	6,600	87.310	576,246.000
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,900	24.500	193,550.000
XYLEM INC	5,700	24.510	139,707.000
PHILIP MORRIS INTERNATION	47,100	81.910	3,857,961.000
NUCOR CORP	8,800	35.670	313,896.000
NABORS INDUSTRIES LTD	8,300	12.890	106,987.000
WESTERN UNION CO	16,746	15.940	266,931.240
NEWELL RUBBERMAID INC	8,200	17.640	144,648.000
OCCIDENTAL PETROLEUM	21,700	80.160	1,739,472.000
OMNICARE INC	3,200	30.770	98,464.000
PAYCHEX INC	9,300	29.380	273,234.000
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	4,400	25.270	111,188.000
PATTERSON COS INC	2,900	32.390	93,931.000

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,600	94.010	338,436.000
ALTRIA GROUP INC	55,300	31.930	1,765,729.000
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	18.160	83,536.000
PG & E CORPORATION	11,200	43.800	490,560.000
PFIZER INC	206,963	21.610	4,472,470.430
XCEL ENERGY INC	13,800	28.120	388,056.000
STRYKER CORP	8,500	49.840	423,640.000
PARKER HANNIFIN CORP	4,200	77.830	326,886.000
PALL CORP	3,100	53.870	166,997.000
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,100	86.820	269,142.000
PROCTER & GAMBLE CO	74,137	61.400	4,552,011.800
EXELON CORP	22,722	37.270	846,848.940
ALEXION PHARMACEUTICALS	5,200	88.390	459,628.000
CONOCOPHILLIPS	33,800	51.300	1,733,940.000
PEPSICO INC	42,300	67.480	2,854,404.000
PLAINS EXPLORATION&PRODUC	4,100	32.580	133,578.000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,500	44.750	559,375.000
AMERICAN WATER WORKS CO	5,300	33.870	179,511.000
ACCENTURE LTD-CL A	17,200	56.120	965,264.000
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,800	31.940	121,372.000
PENTAIR INC	2,600	39.130	101,738.000
QUALCOMM INC	44,700	55.850	2,496,495.000
PARTNERRE LTD	1,800	70.790	127,422.000
INVESCO LTD	12,650	20.790	262,993.500
ADVANCE AUTO PARTS	2,050	70.780	145,099.000
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,700	23.230	202,101.000
MDU RESOURCES GROUP INC	5,200	21.830	113,516.000
ENERGEN CORP	2,000	42.780	85,560.000
RAYTHEON CO	9,700	49.300	478,210.000
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	2,800	53.910	150,948.000
RED HAT INC	5,200	50.480	262,496.000
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,800	125.940	226,692.000
REPUBLIC SERVICES INC	9,100	25.830	235,053.000
PRICELINE.COM INC	1,400	616.540	863,156.000
ROSS STORES INC	6,400	61.960	396,544.000
QEP RESOURCES INC	5,200	25.310	131,612.000
QUEST DIAGNOSTICS	4,400	55.200	242,880.000
ROBERT HALF INTL INC	3,700	26.300	97,310.000
REYNOLDS AMERICAN INC	9,700	40.760	395,372.000
RALPH LAUREN CORP	1,700	142.860	242,862.000
ROWAN COS PLC	3,700	29.410	108,817.000
ROCKWELL COLLINS INC.	4,400	49.090	215,996.000
REGIONS FINANCIAL CORP	40,435	5.550	224,414.250
SUNOCO INC	3,200	45.650	146,080.000
CHEVRON CORP	53,418	96.580	5,159,110.440
EDISON INTERNATIONAL	8,600	44.940	386,484.000
SYMANTEC CORP	20,000	14.430	288,600.000
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,522	62.070	280,680.540
SYNOPSYS INC	3,900	28.380	110,682.000
CBRE GROUP INC	8,500	15.270	129,795.000
COBALT INT'L ENERGY	5,200	21.320	110,864.000
SLM CORP	14,900	13.790	205,471.000
SANDISK CORP	6,800	31.660	215,288.000
SOUTHERN CO	23,700	46.060	1,091,622.000
SYSCO CORP	16,400	27.750	455,100.000
TRAVELERS COS INC	11,323	60.380	683,682.740
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,800	27.220	266,756.000

SPX CORP	1,400	66.010	92,414.000
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,100	17.390	71,299.000
STERICYCLE INC	2,400	85.840	206,016.000
SCHLUMBERGER LTD	35,967	62.210	2,237,507.070
AT&T INC	159,595	34.150	5,450,169.250
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	8.600	51,600.000
SIGMA-ALDRICH	3,300	67.800	223,740.000
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,500	125.870	314,675.000
SEMPRA ENERGY	6,500	64.340	418,210.000
TIFFANY & CO	3,600	54.700	196,920.000
SEAGATE TECHNOLOGY	10,900	22.140	241,326.000
TEXAS INSTRUMENT INC	31,200	27.090	845,208.000
SALESFORCE.COM INC	3,500	131.220	459,270.000
SUPERIOR ENERGY SERVICES	4,200	19.580	82,236.000
TRW INC	3,000	36.220	108,660.000
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,000	50.080	100,160.000
TIME WARNER CABLE	8,453	73.990	625,437.470
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,525	51.670	647,166.750
UNION PACIFIC CORP	13,100	106.450	1,394,495.000
MARATHON OIL CORP	19,500	23.840	464,880.000
MARATHON PETROLEUM CORP	9,900	34.280	339,372.000
UNITED TECHNOLOGIES	23,900	71.450	1,707,655.000
UNITED PARCEL SERVICE-B	19,500	72.990	1,423,305.000
SPRINT NEXTEL CORP	86,322	2.540	219,257.880
UNUM GROUP	8,600	19.050	163,830.000
AMEREN CORPORATION	6,500	32.100	208,650.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	28,526	54.910	1,566,362.660
USX-US STEEL GRP	4,400	19.090	83,996.000
VERISIGN INC	4,200	37.770	158,634.000
VALERO ENERGY CORP	15,892	20.370	323,720.040
WEYERHAEUSER CO	15,194	19.130	290,661.220
WELLPOINT INC	9,600	65.450	628,320.000
THE WALT DISNEY CO.	45,800	44.410	2,033,978.000
WELLS FARGO & CO	136,972	30.050	4,116,008.600
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,200	53.650	118,030.000
WASTE MANAGEMENT INC	12,400	32.150	398,660.000
WILLIAMS COMPANY	15,900	28.670	455,853.000
WHITING PETROLEUM CORP	3,300	40.080	132,264.000
WHIRLPOOL CORP	2,100	57.270	120,267.000
WAL-MART STORES	50,700	65.990	3,345,693.000
ZIMMER HOLDINGS INC	5,100	58.740	299,574.000
WEATHERFORD INTERNATIONAL	21,600	11.620	250,992.000
WYNN RESORTS LTD	2,300	98.170	225,791.000
XEROX CORP	37,044	7.090	262,641.960
TJX COMPANIES INC	20,600	41.130	847,278.000
WATERS CORP	2,500	76.150	190,375.000
WATSON PHARMACEUTICALS IN	3,600	69.030	248,508.000
WHOLE FOODS MARKET INC	4,700	86.550	406,785.000
WASHINGTON POST -CL B	200	351.630	70,326.000
WALGREEN CO	24,000	30.510	732,240.000
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,700	35.010	164,547.000
WESTERN DIGITAL CORP	6,300	29.900	188,370.000
WISCONSIN ENERGY CORP	6,400	37.800	241,920.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	14,100	31.210	440,061.000
VISA INC-CLASS A SHS	14,600	114.160	1,666,736.000
PPL CORPORATION	15,700	27.550	432,535.000
PITNEY BOWES INC	5,500	13.240	72,820.000

PEPCO HOLDINGS INC	6,400	19.270	123,328.000
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	18.300	75,030.000
PPG INDUSTRIES INC	4,300	97.770	420,411.000
NORTHERN TRUST CORP	6,100	41.590	253,699.000
PRECISION CASTPARTS CORP	3,900	159.560	622,284.000
NVIDIA CORP	17,050	11.730	199,996.500
PNC FINANCIAL SERVICES	14,193	56.840	806,730.120
LIBERTY INTERACTIVE CORP	14,550	16.180	235,419.000
TERADATA CORP	4,700	65.210	306,487.000
TYSON FOODS INC-CL A	8,800	18.590	163,592.000
NETFLIX.COM INC	1,500	65.000	97,500.000
NII HOLDINGS INC	4,500	10.870	48,915.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC	10,300	48.630	500,889.000
NRG ENERGY INC	6,900	15.140	104,466.000
TORCHMARK CORP	3,150	45.290	142,663.500
TEXTRON INC	7,500	22.700	170,250.000
NEWS CORP-CL A	46,050	18.590	856,069.500
NEWS CORP-CLASS B	11,600	18.810	218,196.000
OMNICOM GROUP	7,200	46.380	333,936.000
ORACLE CORPORATION	108,083	26.200	2,831,774.600
MASTERCARD INC-CLASS A	2,900	400.260	1,160,754.000
ONEOK INC	5,600	39.490	221,144.000
CENTURYLINK INC	17,195	37.420	643,436.900
ROPER INDUSTRIES INC	2,800	95.910	268,548.000
YUM! BRANDS INC	12,700	64.230	815,721.000
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,400	121.470	170,058.000
MOLSON COORS BREWING CO-B	4,600	38.280	176,088.000
NOBLE ENERGY INC	4,800	81.320	390,336.000
BANK OF AMERICA CORP	287,501	6.900	1,983,756.900
NORDSTROM INC	4,800	47.470	227,856.000
AMERICAN EXPRESS CO	27,900	53.510	1,492,929.000
ANALOG DEVICES INC	7,900	35.680	281,872.000
ADVANCED MICRO DEVICES	16,527	5.630	93,047.010
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	16.240	105,560.000
AMERICAN INTL GROUP	16,772	27.530	461,733.160
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,200	57.120	753,984.000
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	4,300	22.460	96,578.000
HUDSON CITY BANCORP INC	14,800	5.880	87,024.000
NEWFIELD EXPLORATION COMP	3,600	28.060	101,016.000
AVERY DENNISON CORP	3,000	27.360	82,080.000
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	8,500	57.930	492,405.000
EMERSON ELECTRIC CO	19,800	45.070	892,386.000
AON CORP	8,500	45.340	385,390.000
AMGEN	21,200	68.700	1,456,440.000
ALLERGAN INC	8,100	88.580	717,498.000
COACH INC	7,800	64.060	499,668.000
EATON CORP	9,000	39.210	352,890.000
CROWN CASTLE INTL CORP	8,000	53.550	428,400.000
CELGENE CORP	12,100	64.890	785,169.000
CONSTELLATION BRANDS INC-	5,700	18.690	106,533.000
APPLIED MATERIALS INC	36,100	10.100	364,610.000
CIT GROUP INC	5,100	33.180	169,218.000
CIMAREX ENERGY CO	2,500	50.200	125,500.000
CME GROUP INC	1,700	260.800	443,360.000
NATIONAL OILWELL VARCO IN	11,444	64.120	733,789.280
ECOLAB INC	8,300	62.270	516,841.000
EQUIFAX INC	3,500	43.620	152,670.000

GAP INC	8,900	25.480	226,772.000
GILEAD SCIENCES INC	20,700	49.210	1,018,647.000
COVENTRY HEALTH CARE INC	4,350	30.460	132,501.000
ST JUDE MEDICAL INC	8,900	37.730	335,797.000
DR PEPPER SNAPPLE GROUP	6,148	40.830	251,022.840
HORMEL FOODS CORP	4,400	29.390	129,316.000
SAFEWAY INC	10,100	18.420	186,042.000
STATE STREET CORP	13,043	39.520	515,459.360
STAPLES INC	19,900	12.760	253,924.000
SUNTRUST BANKS INC	15,048	21.100	317,512.800
SCHWAB(CHARLES) CORP	29,800	11.830	352,534.000
IHS INC-CLASS A	1,200	97.450	116,940.000
BAXTER INTL INC	15,000	50.060	750,900.000
CAMPBELL SOUP CO	5,700	31.550	179,835.000
CROWN HOLDINGS INC	4,300	33.110	142,373.000
CHUBB CORP	7,800	69.640	543,192.000
CARDINAL HEALTH INC	9,500	40.540	385,130.000
CAREFUSION CORP	6,650	23.980	159,467.000
FEDEX CORP	8,300	85.200	707,160.000
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	13,654	48.680	664,676.720
FMC CORP	3,800	48.960	186,048.000
FLEXTRONICS INTL LTD	22,600	6.230	140,798.000
CERNER CORP	4,000	76.470	305,880.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,400	54.310	130,344.000
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	72.280	368,628.000
INTEL CORP	136,500	25.040	3,417,960.000
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,900	44.440	306,636.000
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	13,800	10.020	138,276.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS	12,000	16.100	193,200.000
IRON MOUNTAIN INC	5,050	27.410	138,420.500
CREE INC	3,300	23.000	75,900.000
ILLINOIS TOOL WORKS	11,700	54.410	636,597.000
SIRIUS XM RADIO INC	109,600	1.900	208,240.000
ILLUMINA INC	3,400	40.500	137,700.000
CHESAPEAKE ENERGY CORP	17,900	16.520	295,708.000
SEALED AIR CORP	5,500	14.940	82,170.000
INTUITIVE SURGICAL INC	1,100	516.210	567,831.000
SARA LEE CORP	15,600	20.440	318,864.000
CALPINE CORP	9,300	16.780	156,054.000
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	11.010	67,161.000
CARMAX INC	6,500	27.380	177,970.000
COMERICA INC	5,800	27.980	162,284.000
DUKE ENERGY CORP	35,692	22.480	802,356.160
TARGET CORP	17,100	57.570	984,447.000
DOVER CORP	4,900	53.590	262,591.000
WW GRAINGER INC	1,600	187.500	300,000.000
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,500	34.400	120,400.000
JOHNSON CONTROLS INC	18,600	28.600	531,960.000
CINTAS CORP	3,700	35.810	132,497.000
CA INC	10,805	24.520	264,938.600
CONAGRA INC	11,000	24.360	267,960.000
CLOROX COMPANY	3,600	69.980	251,928.000
ENTERGY CORP	4,700	64.540	303,338.000
MICROSOFT CORP	206,100	28.550	5,884,155.000
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,800	40.160	192,768.000
CVS CAREMARK CORP	34,774	44.110	1,533,881.140
MEDTRONIC INC	28,700	35.890	1,030,043.000

MICRON TECHNOLOGY INC	28,500	5.390	153,615.000
BLACKROCK INC-CLASS A	2,900	165.000	478,500.000
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	19.780	211,646.000
HASBRO INC	3,600	34.540	124,344.000
KELLOGG CO	7,100	48.260	342,646.000
KEYCORP	26,000	6.890	179,140.000
KANSAS CITY SOUTHERN	3,200	62.540	200,128.000
KRAFT FOODS INC-A	46,511	37.650	1,751,139.150
KOHL'S CORP	6,800	44.000	299,200.000
SEARS HOLDING CORP	1,225	47.900	58,677.500
URS CORP	2,100	34.010	71,421.000
NEW YORK COMMUNITY BANCOR	13,200	11.570	152,724.000
APACHE CORP	10,210	79.560	812,307.600
ACE LTD	9,200	70.000	644,000.000
ARROW ELECTRONICS INC	3,200	32.800	104,960.000
ALLSTATE	13,700	33.010	452,237.000
EBAY INC	30,800	39.160	1,206,128.000
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,800	43.260	164,388.000
XILINX INC	7,500	31.040	232,800.000
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	22,110	50.790	1,122,966.900
DISH NETWORK CORP	6,200	26.850	166,470.000
YAHOO! INC	31,900	15.010	478,819.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	6,600	53.150	350,790.000
TOLL BROTHERS INC	4,500	23.960	107,820.000
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,000	45.300	135,900.000
LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,300	28.690	180,747.000
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	7,500	11.990	89,925.000
NOBLE CORP	7,400	30.050	222,370.000
PROGRESSIVE CORP	16,000	21.100	337,600.000
PRAXAIR INC	8,100	103.980	842,238.000
PACCAR INC	9,637	35.930	346,257.410
PETSMART INC	3,300	63.190	208,527.000
EMC CORP/MASS	57,000	22.850	1,302,450.000
BIOGEN IDEC INC	6,130	130.790	801,742.700
INTL GAME TECHNOLOGY	8,100	13.380	108,378.000
STARBUCKS CORP	20,100	53.900	1,083,390.000
PERRIGO CO	2,400	103.390	248,136.000
NORTHEAST UTILITIES	8,980	36.220	325,255.600
INTUIT INC	7,700	54.920	422,884.000
BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,100	64.780	200,818.000
BEST BUY COMPANY INC	9,000	18.220	163,980.000
BALL CORP	4,200	39.540	166,068.000
BOSTON SCIENTIFIC CORP	42,947	5.590	240,073.730
BED BATH & BEYOND INC	6,700	71.020	475,834.000
XL GROUP PLC	8,400	19.600	164,640.000
ELECTRONIC ARTS INC	9,100	13.070	118,937.000
VULCAN MATERIALS CO	3,700	32.570	120,509.000
VERTEX PHARMACEUTICALS IN	6,100	57.700	351,970.000
VF CORP	2,400	136.160	326,784.000
CBS CORP-CL B	16,571	30.620	507,404.020
VIACOM INC-CLASS B	13,271	45.750	607,148.250
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,700	62.930	106,981.000
NUANCE COMMUNICATIONS INC	7,200	19.540	140,688.000
VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	3,200	57.480	183,936.000
CARNIVAL CORP	12,400	31.020	384,648.000
CLIFFS NATURAL RESOURCES	4,100	45.740	187,534.000
COMCAST CORP -CL A	55,970	28.950	1,620,331.500

	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	17,900	28.560	511,224.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 319,317,000.960 (24,996,134,836)	
イギリス・ボンド		株	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	KAZAKHMY S PLC	5,900	6.650	39,235.000	
	BP PLC	521,300	4.020	2,095,626.000	
	UNILEVER PLC	35,260	20.130	709,783.800	
	BARCLAYS PLC	319,700	1.735	554,679.500	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	52,900	7.960	421,084.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C EN	5,607,400	0.001	5,607.400	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	1.586	25,534.600	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	45,600	3.291	150,069.600	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,600	55.550	144,430.000	
	REXAM PLC	24,200	3.939	95,323.800	
	PRUDENTIAL PLC	72,100	6.600	475,860.000	
	LONMIN PLC	4,800	6.990	33,552.000	
	INMARSAT PLC	12,800	4.360	55,808.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	500,915	0.199	99,682.080	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,400	21.000	134,400.000	
	BAE SYSTEMS PLC	91,400	2.709	247,602.600	
	AVIVA PLC	83,100	2.553	212,154.300	
	EURASIAN NATURAL RESOURCE	7,400	4.169	30,850.600	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	143,402	14.150	2,029,138.300	
	INVENSYS PLC	23,500	2.104	49,444.000	
	REED ELSEVIER PLC	35,646	4.694	167,322.320	
	BG GROUP PLC	92,800	12.005	1,114,064.000	
	DIAGEO PLC	68,500	15.165	1,038,802.500	
	RIO TINTO PLC-REG	38,500	27.715	1,067,027.500	
	STANDARD CHARTERED PLC	65,100	12.915	840,766.500	
	TESCO PLC	228,600	2.992	683,971.200	
	FRESNILLO PLC	5,000	13.710	68,550.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	25,700	5.905	151,758.500	
	GLENORE INTERNATIONAL PL	39,100	3.343	130,711.300	
	SMITHS GROUP PLC	11,433	9.795	111,986.230	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	10,000	8.405	84,050.000	
	PEARSON PLC	23,263	11.220	261,010.860	
	SAINSBURY (J) PLC	36,125	2.866	103,534.250	
	NEXT PLC	5,100	29.910	152,541.000	
	WHITBREAD PLC	4,911	18.400	90,362.400	
	IMI PLC	8,300	8.465	70,259.500	
	BUNZL PLC	10,255	9.995	102,498.720	
	GKN PLC	45,700	1.755	80,203.500	
	VODAFONE GROUP PLC	1,379,537	1.736	2,394,876.230	
	BALFOUR BEATTY PLC	21,400	2.661	56,945.400	
	KINGFISHER PLC	67,511	2.709	182,887.290	
	WPP PLC	36,400	7.435	270,634.000	
	UNITED UTILITIES GROUP PL	20,627	6.625	136,653.870	
	SEVERN TRENT PLC	6,633	17.600	116,740.800	
	RECKITT BENCKISER PLC	18,800	33.810	635,628.000	
	SCHRODERS PLC	3,200	11.800	37,760.000	
	TATE&LYLE PLC	15,000	6.535	98,025.000	
	INTERNATIONAL POWER PLC	43,300	4.143	179,391.900	
	AMEC PLC	9,600	9.230	88,608.000	
	SSE PLC	26,600	13.320	354,312.000	
	WEIR GROUP PLC (THE)	6,300	14.820	93,366.000	

	ASTRAZENECA PLC	35,700	25.920	925,344.000	
	WOLSELEY PLC	8,190	21.200	173,628.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	170,800	1.060	181,048.000	
	3I GROUP PLC	27,591	1.742	48,063.520	
	BRITISH SKY BROADCASTING	31,900	6.765	215,803.500	
	SAGE GROUP PLC (THE)	39,200	2.488	97,529.600	
	NATIONAL GRID PLC	100,328	6.500	652,132.000	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,139,965	0.257	292,971.000	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	102,300	0.976	99,844.800	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP	27,600	23.530	649,428.000	
	CENTRICA PLC	146,560	3.063	448,913.280	
	ARM HOLDINGS PLC	37,800	4.979	188,206.200	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	54,160	30.300	1,641,048.000	
	ICAP PLC	16,900	3.345	56,530.500	
	SABMILLER PLC	27,000	23.485	634,095.000	
	BHP BILLITON PLC	57,877	16.945	980,725.760	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,900	11.670	115,533.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	504,800	5.032	2,540,153.600	
	SHIRE PLC	15,500	17.840	276,520.000	
	OLD MUTUAL PLC	137,725	1.387	191,024.570	
	ANGLO AMERICAN PLC	37,783	19.555	738,846.560	
	MORRISON SUPERMARKETS	66,700	2.763	184,292.100	
	CARNIVAL PLC	5,061	20.620	104,357.820	
	COMPASS GROUP PLC	52,500	6.220	326,550.000	
	BT GROUP PLC	215,500	2.032	437,896.000	
	MAN GROUP PLC	51,525	0.755	38,901.370	
	XSTRATA PLC	58,400	8.941	522,154.400	
	BURBERRY GROUP PLC	12,189	13.080	159,432.120	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	8,300	14.820	123,006.000	
	AGGREKO PLC	7,671	21.270	163,162.170	
	CAPITA PLC	18,190	6.055	110,140.450	
	SERCO GROUP PLC	15,300	5.165	79,024.500	
	INTERTEK GROUP PLC	4,700	26.140	122,858.000	
	ITV PLC	112,200	0.694	77,866.800	
	TULLOW OIL PLC	25,400	13.640	346,456.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,500	8.835	30,922.500	
	PETROFAC LTD	7,000	14.860	104,020.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	9.650	41,967.850	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	102,900	19.840	2,041,536.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	73,581	20.680	1,521,655.080	
	MEGGITT PLC	23,600	3.666	86,517.600	
	G4S PLC	40,800	2.720	110,976.000	
	COBHAM PLC	31,500	2.196	69,174.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,700	10.450	59,565.000	
	INVESTEC PLC	16,400	3.265	53,546.000	
	ANTOFAGASTA PLC	10,800	9.910	107,028.000	
	STANDARD LIFE PLC	67,400	2.040	137,496.000	
	EXPERIAN PLC	28,054	8.960	251,363.840	
	RESOLUTION LTD	42,476	1.924	81,723.820	
イギリス・ボンド 小計				イギリス・ボンド 37,216,092.660 (4,486,399,970)	
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	4.700	265,080.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	39.200	548,800.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	800	128.600	102,880.000	

	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	27,200	153.000	4,161,600.000	
	BANK HAPOLIM BM	36,300	12.840	466,092.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	10.000	376,000.000	
	NICE SYSTEMS LTD	2,100	142.300	298,830.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 6,219,282.000 (125,380,725)	
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	89,500	30.750	2,752,125.000	
	LEND LEASE	16,100	7.020	113,022.000	
	ASCIANO LTD	28,600	4.380	125,268.000	
	ALUMINA LTD	69,900	0.955	66,754.500	
	WOODSIDE PETROLEUM	17,800	30.870	549,486.000	
	OZ MINERALS LTD	9,707	8.350	81,053.450	
	FORTESCUE METALS GROUP	39,700	4.350	172,695.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	7.000	82,600.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	61,800	22.030	1,361,454.000	
	WESTPAC BANKING	85,198	20.200	1,720,999.600	
	SANTOS LIMITED	26,800	11.220	300,696.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	76,100	20.870	1,588,207.000	
	RIO TINTO LTD	12,200	52.900	645,380.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	30,600	12.870	393,822.000	
	AMCOR	35,600	7.350	261,660.000	
	METCASH LTD	23,500	3.870	90,945.000	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP	20,500	4.310	88,355.000	
	QR NATIONAL LTD	46,800	3.310	154,908.000	
	NEWCREST MINING	21,400	24.530	524,942.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.630	119,928.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	42,600	49.050	2,089,530.000	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	13.210	63,408.000	
	ORICA LIMITED	10,300	23.660	243,698.000	
	QBE INSURANCE	33,200	12.030	399,396.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,600	16.570	76,222.000	
	WOOLWORTHS	33,300	26.530	883,449.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	12.800	203,520.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	2.890	59,245.000	
	CROWN LTD	16,900	8.060	136,214.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,700	1.420	54,954.000	
	TELSTRA CORPORATION	121,200	3.660	443,592.000	
	AMP LIMITED	79,400	3.730	296,162.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	15,900	6.990	111,141.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	9,800	26.050	255,290.000	
	FAIRFAX MEDIA LTD	77,700	0.620	48,174.000	
	CSL LIMITED	15,100	37.780	570,478.000	
	WESFARMERS LIMITED	28,400	28.630	813,092.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,700	62.150	105,655.000	
	SUNCORP GROUP LTD	36,300	7.450	270,435.000	
	BORAL LIMITED	22,700	3.360	76,272.000	
	ASX LTD	5,000	28.850	144,250.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	7.570	105,223.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	1.885	26,390.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	58,400	3.250	189,800.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	11,300	12.150	137,295.000	
	TRANSURBAN GROUP	37,500	5.730	214,875.000	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,000	11.880	142,560.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	4.350	81,780.000	

	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	5,400	10.210	55,134.000	
	SYDNEY AIRPORT	18,900	2.840	53,676.000	
	WORLEYPARSONS LTD	6,100	24.470	149,267.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	2.600	95,940.000	
	AGL ENERGY LTD	12,800	15.200	194,560.000	
	AGL ENERGY LTD-RIGHTS	2,133	3.580	7,636.140	
	BRAMBLES LTD	42,700	6.790	289,933.000	
	LYNAS CORP LTD	49,900	0.970	48,403.000	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	1,900	50.530	96,007.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 20,426,956.690 (1,559,393,873)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,500	39.980	339,830.000	
	SILVER WHEATON CORP	10,200	28.020	285,804.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,700	62.730	232,101.000	
	BCE INC	7,530	41.120	309,633.600	
	FRANCO-NEVADA CORP	4,000	47.170	188,680.000	
	SUNCOR ENERGY INC	43,380	27.710	1,202,059.800	
	METRO INC-A	3,000	50.440	151,320.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,300	71.590	307,837.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	30,400	51.260	1,558,304.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	10,900	69.700	759,730.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	24,200	76.500	1,851,300.000	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	8,100	19.820	160,542.000	
	MEG ENERGY CORP	3,800	34.420	130,796.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	39,300	49.570	1,948,101.000	
	TOURMALINE OIL CORP	3,800	23.090	87,742.000	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES	5,700	11.120	63,384.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,800	42.810	119,868.000	
	TRANSCANADA CORP	19,400	42.150	817,710.000	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,400	42.780	145,452.000	
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,600	17.000	78,200.000	
	PENGROWTH ENERGY CORP	10,700	7.350	78,645.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,300	26.800	222,440.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	41,400	3.680	152,352.000	
	BARRICK GOLD CORP	27,000	43.770	1,181,790.000	
	CAE INC	9,200	9.750	89,700.000	
	THOMSON REUTERS CORP	10,804	28.360	306,401.440	
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	23,500	38.890	913,915.000	
	INMET MINING CRP	1,600	44.290	70,864.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	31.900	111,650.000	
	OSISKO MINING CORP	10,900	8.350	91,015.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	2,500	65.750	164,375.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	10,900	35.200	383,680.000	
	AGNICO-EAGLE MINES	4,800	42.240	202,752.000	
	ATHABASCA OIL CORP	9,000	10.110	90,990.000	
	KINROSS GOLD CORP	32,100	8.910	286,011.000	
	BANK OF MONTREAL	17,300	53.480	925,204.000	
	POWER CORP OF CANADA	10,400	22.080	229,632.000	
	CAMECO CORP	11,700	19.210	224,757.000	
	TELUS CORP	900	59.630	53,667.000	
	POWER FINANCIAL CORP	6,700	24.320	162,944.000	
	NEW GOLD INC	14,000	10.100	141,400.000	
	TECK RESOURCES LIMITED-B	15,800	30.490	481,742.000	
	NEXEN INC	14,500	15.930	230,985.000	

CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,300	66.950	153,985.000	
VITERRA INC	10,500	16.010	168,105.000	
TALISMAN ENERGY INC	29,700	10.620	315,414.000	
IVANHOE MINES LTD	8,500	9.680	82,280.000	
AGRIUM INC	4,400	78.300	344,520.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCE	29,900	28.690	857,831.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS L	600	413.000	247,800.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,500	39.040	253,760.000	
TRANSALTA CORP	6,700	16.700	111,890.000	
WESTON (GEORGE) LTD	1,400	58.110	81,354.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,600	18.260	83,996.000	
RESEARCH IN MOTION	13,800	10.030	138,414.000	
SUN LIFE FINANCIAL SVSC	16,000	19.980	319,680.000	
ENBRIDGE INC	20,400	39.340	802,536.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	15,400	31.470	484,638.000	
BROOKFIELD OFFICE PROPERT	8,750	16.560	144,900.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	48,800	10.580	516,304.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS I	8,400	48.350	406,140.000	
GOLDCORP INC	22,659	41.150	932,417.850	
ENCANA CORP	19,800	19.670	389,466.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,900	72.950	357,455.000	
IAMGOLD CORPORATION	11,000	12.140	133,540.000	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	22.210	62,188.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	24.120	82,008.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	12,200	82.560	1,007,232.000	
CGI GROUP INC - CL A	6,400	23.160	148,224.000	
HUSKY ENERGY INC	9,700	22.460	217,862.000	
ONEX CORPORATION	3,500	37.890	132,615.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,300	19.270	217,751.000	
TELUS CORPORATION-NON VOT	5,400	58.170	314,118.000	
FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	22.000	114,400.000	
SHOPPERS DRUG MART CORP	5,700	40.600	231,420.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,400	37.140	163,416.000	
ELDORADO GOLD CORPORATION	19,100	12.450	237,795.000	
CENTERRA GOLD INC	4,600	11.450	52,670.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	39.380	122,078.000	
TMX GROUP INC	2,700	46.070	124,389.000	
OPEN TEXT CORP	2,000	49.000	98,000.000	
CI FINANCIAL CORP	5,600	21.340	119,504.000	
SAPUTO INC	4,000	41.720	166,880.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LT	13,600	17.750	241,400.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD	4,700	40.020	188,094.000	
YAMANA GOLD INC	21,500	16.460	353,890.000	
FORTIS INC	5,700	32.740	186,618.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,400	19.700	66,980.000	
CRESCENT POINT ENERGY COR	8,200	38.490	315,618.000	
CENOVUS ENERGY INC	20,900	30.520	637,868.000	
TIM HORTONS INC	4,400	53.210	234,124.000	
SXC HEALTH SOLUTIONS CORP	1,500	91.690	137,535.000	
CANADIAN OIL SANDS LTD	13,500	18.890	255,015.000	
ENERPLUS CORP	5,300	13.780	73,034.000	
PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	13.240	180,064.000	
ARC RESOURCES LTD	8,400	20.020	168,168.000	
PACIFIC RUBIALES ENERGY C	8,400	25.520	214,368.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 31,727,057.690	

				(2,393,489,233)	
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	38,000	16.970	644,860.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	52,000	12.950	673,400.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.250	168,817.500	
	FRASER & NEAVE LTD	33,000	6.240	205,920.000	
	KEPPEL CORP	41,500	9.640	400,060.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	4.200	81,480.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	9.560	162,520.000	
	CAPITALAND LIMITED	79,000	2.470	195,130.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	25,000	4.270	106,750.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	3.780	185,220.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	40.380	121,140.000	
	O.C.B.C.	74,000	8.180	605,320.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	175,000	1.465	256,375.000	
	SINGAPORE TELECOM LTD	236,450	3.050	721,172.500	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.065	122,667.760	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	2.920	140,160.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	4.740	170,640.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.620	136,028.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	6.060	163,620.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	50,000	1.530	76,500.000	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	28,000	0.975	27,300.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.510	196,560.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	45,000	1.370	61,650.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 5,623,290.760 (342,683,339)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,850	36.330	139,870.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	19,950	149.200	2,976,540.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	51.700	41,360.000	
	SIKA AG-BR	60	1,746.000	104,760.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	34,070.000	136,280.000	
	ABB LTD	60,650	14.930	905,504.500	
	ARYZTA AG	2,700	43.350	117,045.000	
	TRANSOCEAN LTD	9,900	37.970	375,903.000	
	SWISS RE LTD	9,800	52.550	514,990.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	90,850	54.200	4,924,070.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,500	104.000	156,000.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	32,550	18.380	598,269.000	
	GAM HOLDING LTD	5,900	10.300	60,770.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,900	30.150	177,885.000	
	SULZER AG-REG	800	108.500	86,800.000	
	SGS SA	160	1,687.000	269,920.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	850	350.100	297,585.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,032	194.200	783,014.400	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	59.050	94,480.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	65,800	49.490	3,256,442.000	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	14,700	51.000	749,700.000	
	UBS AG-REGISTERED	102,400	10.690	1,094,656.000	
	SWISSCOM AG-REG	670	348.900	233,763.000	
	GEBERIT AG-REG	1,150	181.600	208,840.000	
	GIVAUDAN REG	250	881.500	220,375.000	
	ACTELION LTD-REG	3,450	34.910	120,439.500	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	250	146.500	36,625.000	

	SYNGENTA AG	2,712	297.000	805,464.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,450	87.700	127,165.000	
	SYNTHESE INC	1,800	157.800	284,040.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,550	32.810	50,855.500	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	60.650	90,975.000	
	HOLCIM LTD-REG	7,100	49.570	351,947.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	75.850	72,057.500	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,650	101.300	167,145.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 20,631,535.900 (1,684,977,537)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ERICSSON LM-B SHS	82,430	60.300	4,970,529.000	
	VOLVO AB-B SHS	38,900	77.600	3,018,640.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	2,200	602.000	1,324,400.000	
	S.K.F. AB-B SHS	10,900	138.600	1,510,740.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	129.100	826,240.000	
	NORDEA AB	74,900	52.900	3,962,210.000	
	SCANIA AB-B SHS	9,250	116.200	1,074,850.000	
	SWEDISH MATCH AB	6,250	272.900	1,705,625.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	105.600	945,120.000	
	GETINGE AB-B SHS	6,200	172.800	1,071,360.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	40,050	39.310	1,574,365.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	13,600	200.500	2,726,800.000	
	SWEDBANK AB	22,550	101.200	2,282,060.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	27,900	207.700	5,794,830.000	
	SVENSKA CELLULOSEA AB-B	16,450	98.750	1,624,437.500	
	SKANSKA AB-B	10,800	94.400	1,019,520.000	
	SANDVIK AB	27,950	85.300	2,384,135.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,300	123.600	1,520,280.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	19,250	139.800	2,691,150.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	51.450	473,340.000	
	TELIASONERA AB	60,650	43.280	2,624,932.000	
	ALFA LAVAL AB	9,400	114.200	1,073,480.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,300	123.300	1,393,290.000	
	ASSA ABLOY AB-B	9,300	179.000	1,664,700.000	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,450	281.900	408,755.000	
	SSAB AB-A SHARES	6,100	53.450	326,045.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	121.700	778,880.000	
	BOLIDEN AB	7,900	88.850	701,915.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	31.310	392,940.500	
	RATOS AB-B SHS	5,900	62.850	370,815.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,650	126.800	843,220.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,000	119.900	839,300.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 53,918,904.500 (590,412,004)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,700	774.000	9,055,800.000	
	DANSKE BANK A/S	17,100	76.900	1,314,990.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	33,600.000	638,400.000	
	TDC A/S	11,500	37.060	426,190.000	
	CARLSBERG AS-B	3,050	416.000	1,268,800.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,000	155.500	1,244,000.000	
	COLOPLAST-B	750	990.500	742,875.000	

	DSV A/S	5,600	111.200	622,720.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	514.000	424,050.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	32	35,220.000	1,127,040.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 16,864,865.000 (222,616,218)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	TELECOM CORP OF NZ	65,589	2.540	166,596.060	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	6.020	121,002.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 287,598.060 (17,089,077)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	24,700	24.830	613,301.000	
	DNB ASA	27,600	54.000	1,490,400.000	
	ORKLA ASA	23,350	40.080	935,868.000	
	TELENOR ASA	21,100	88.050	1,857,855.000	
	STATOIL ASA	30,973	135.000	4,181,355.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,460	225.100	1,229,046.000	
	SEADRILL LTD	9,850	192.900	1,900,065.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	4,250	75.050	318,962.500	
	SUBSEA 7 SA	8,000	111.800	894,400.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 13,421,252.500 (173,402,582)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	23,400	48.430	1,133,262.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	25,600	27.435	702,336.000	
	COMMERZBANK AG	104,850	1.297	135,990.450	
	VOLKSWAGEN AG	900	114.200	102,780.000	
	VOLKSWAGEN AG PFD	4,100	119.750	490,975.000	
	M.A.N.	1,800	77.940	140,292.000	
	SIEMENS AG	22,400	64.400	1,442,560.000	
	E.ON AG	49,700	14.405	715,928.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	9,050	56.850	514,492.500	
	GEA GROUP AG	5,050	19.690	99,434.500	
	CONTINENTAL AG	2,400	62.890	150,936.000	
	BASF SE	25,150	53.480	1,345,022.000	
	LINDE	4,850	116.050	562,842.500	
	K+S AG	4,850	30.600	148,410.000	
	ALLIANZ SE-REG	12,400	70.330	872,092.000	
	THYSSENKRUPP AG	10,600	12.670	134,302.000	
	HENKEL AG & CO KGAA	5,250	49.245	258,536.250	
	R.W.E. AG	13,900	28.480	395,872.000	
	LUFTHANSA	6,750	8.197	55,329.750	
	FRAPORT AG	1,100	40.050	44,055.000	
	BRENNTAG AG	1,400	86.000	120,400.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	3,600	73.700	265,320.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	12.645	51,844.500	
	HOCHTIEF AG	1,450	36.550	52,997.500	
	SAP AG	25,192	44.155	1,112,352.760	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	5,050	96.570	487,678.500	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,200	33.075	138,915.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	4,450	39.390	175,285.500	
	BEIERSDORF AG	3,000	50.200	150,600.000	

CELESIO AG	2,800	10.875	30,450.000
MERCK KGAA	1,950	73.000	142,350.000
ADIDAS AG	5,970	55.820	333,245.400
HENKEL KGAA	3,750	41.780	156,675.000
METRO AG	3,850	22.270	85,739.500
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	80,900	7.800	631,020.000
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,950	51.650	307,317.500
DAIMLER AG	24,800	34.850	864,280.000
QIAGEN N.V.	6,800	12.675	86,190.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,500	5.832	183,708.000
HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	41.565	76,895.250
DEUTSCHE POST AG	23,550	12.800	301,440.000
DEUTSCHE BOERSE AG	5,650	37.280	210,632.000
RWE AG-NON VTG PFD	1,150	25.780	29,647.000
SUEDZUCKER AG	2,250	23.935	53,853.750
LANXESS	2,450	49.960	122,402.000
SALZGITTER AG	1,250	34.060	42,575.000
WACKER CHEMIE AG	500	53.700	26,850.000
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	2,800	43.985	123,158.000
PHILIPS ELECTRONICS NV	28,276	13.920	393,601.920
ARCELORMITTAL	26,900	10.985	295,496.500
UNILEVER NV-CVA	45,400	24.590	1,116,386.000
HEINEKEN NV	7,200	37.320	268,704.000
REED ELSEVIER NV	20,077	8.170	164,029.090
AEGON NV	48,744	3.234	157,638.090
AHOLD (KONINKLIJKE) NV	31,260	9.362	292,656.120
AKZO NOBEL	6,600	36.065	238,029.000
KONINKLIJKE DSM NV	4,400	37.390	164,516.000
WOLTERS KLUWER	8,850	11.560	102,306.000
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	24.305	51,040.500
ING GROEP N.V.	104,150	4.664	485,755.600
KONINKLIJKE KPN NV	41,500	7.655	317,682.500
ASML HOLDING NV	12,038	35.165	423,316.270
TNT EXPRESS NV	10,195	8.885	90,582.570
VOPAK	2,000	45.270	90,540.000
RANDSTAD HOLDING NV	3,250	21.725	70,606.250
SBM OFFSHORE NV	5,407	10.030	54,232.210
FUGRO NV-CVA	1,900	42.830	81,377.000
HEINEKEN HOLDING NV	3,050	31.445	95,907.250
TOTAL SA	59,550	33.960	2,022,318.000
MICHELIN (CGDE) - B	4,900	46.280	226,772.000
AIR LIQUIDE	8,426	84.670	713,429.420
PPR	2,200	108.900	239,580.000
SCHNEIDER ELECTRIC SA	14,900	42.210	628,929.000
BOUYGUES	5,550	19.140	106,227.000
LAFARGE SA	5,850	29.200	170,820.000
BNP PARIBAS	26,500	26.785	709,802.500
PEUGEOT SA	6,800	7.853	53,400.400
NATIXIS	28,050	1.848	51,836.400
THALES SA	3,050	23.260	70,943.000
GROUPE DANONE	15,800	50.370	795,846.000
CARREFOUR	16,550	13.785	228,141.750
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	8.685	70,131.370
VIVENDI SA	35,391	12.975	459,198.220
L'OREAL	6,500	88.130	572,845.000
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,350	27.885	316,494.750
LEGRAND SA	6,500	23.630	153,595.000

ALCATEL-LUCENT	66,800	1.200	80,160.000
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	65.100	100,905.000
PERNOD-RICARD	6,117	75.680	462,934.560
EURAZEO	1,077	30.310	32,643.870
SOCIETE GENERALE-A	20,050	16.525	331,326.250
LVMH	6,900	111.700	770,730.000
ACCOR SA	4,450	23.230	103,373.500
CAP GEMINI SA	4,300	25.250	108,575.000
PUBLICIS GROUPE	4,250	36.670	155,847.500
VALLOUREC	3,350	29.480	98,758.000
BUREAU VERITAS SA	1,550	67.800	105,090.000
SODEXO	2,550	56.840	144,942.000
ESSILOR INTERNATIONAL	5,800	67.930	393,994.000
AXA	50,600	8.961	453,426.600
CHRISTIAN DIOR	1,600	99.100	158,560.000
LAGARDERE S.C.A.	3,800	18.710	71,098.000
TECHNIP S.A.	2,850	70.510	200,953.500
EDENRED	5,050	20.595	104,004.750
RENAULT	5,350	32.885	175,934.750
STMICROELECTRONICS NV	19,150	4.006	76,714.900
ATOS	1,600	43.115	68,984.000
DASSAULT SYSTEMS SA	1,750	70.740	123,795.000
WENDEL	850	52.000	44,200.000
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	16.740	77,841.000
FRANCE TELECOM SA	51,650	10.270	530,445.500
ALSTOM	5,650	23.155	130,825.750
CNP ASSURANCES	5,150	8.701	44,810.150
SANOFI	33,175	53.720	1,782,161.000
VINCI	12,850	32.100	412,485.000
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	11,700	25.605	299,578.500
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,000	9.166	100,826.000
CREDIT AGRICOLE SA	29,200	2.933	85,643.600
GDF SUEZ	34,873	16.030	559,014.190
IMERYS SA	1,100	38.000	41,800.000
ELECTRICITE DE FRANCE	6,850	15.130	103,640.500
SES	8,700	17.745	154,381.500
SAFRAN SA	6,550	26.685	174,786.750
ILIAD SA	750	103.300	77,475.000
ARKEMA	1,850	50.740	93,869.000
ADP	950	56.750	53,912.500
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	21.140	85,617.000
GEMALTO	1,950	49.835	97,178.250
SCOR SE	5,900	17.355	102,394.500
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	15,550	6.053	94,124.150
UCB SA	3,350	36.755	123,129.250
KBC GROUPE	5,100	13.035	66,478.500
COLRUYT SA	2,500	31.440	78,600.000
DELHAIZE GROUP	2,950	29.315	86,479.250
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,300	50.190	115,437.000
SOLVAY SA	1,550	80.490	124,759.500
UMICORE	3,450	37.235	128,460.750
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	22,050	52.770	1,163,578.500
AGEAS	66,400	1.254	83,265.600
BELGACOM SA	4,900	20.920	102,508.000
MOBISTAR SA	1,050	23.275	24,438.750
BANCO POPOLARE SCARL	50,150	0.945	47,391.750
FIAT SPA	23,700	3.732	88,448.400

PRYSMIAN SPA	5,700	10.900	62,130.000
ASSICURAZIONI GENERALI	33,343	8.680	289,417.240
SAIPEM	7,550	29.720	224,386.000
FIAT INDUSTRIAL	24,750	7.570	187,357.500
MEDIOBANCA SPA	17,115	2.990	51,173.850
TENARIS SA	13,400	12.100	162,140.000
UNICREDIT SPA	113,569	2.610	296,415.090
TELECOM ITALIA SPA	269,882	0.694	187,298.100
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.573	97,954.350
INTESA SANPAOLO-RNC	21,350	0.885	18,894.750
INTESA SANPAOLO	272,297	1.055	287,273.330
ATLANTIA SPA	9,607	9.310	89,441.170
ENI SPA	66,200	15.360	1,016,832.000
MEDIASET SPA	24,100	1.248	30,076.800
FINMECCANICA SPA	11,225	2.776	31,160.600
MONTE DEI PASCHI SIENA	131,900	0.202	26,643.800
ENEL SPA	178,600	2.348	419,352.800
SNAM SPA	47,150	3.256	153,520.400
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	24.770	92,887.500
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	26,800	2.358	63,194.400
TERNA SPA	37,300	2.722	101,530.600
PIRELLI & C.	7,645	7.565	57,834.420
ENEL GREEN POWER SPA	55,400	1.073	59,444.200
TELEFONICA S.A.	113,177	9.385	1,062,166.140
BANCO POPULAR ESPANOL	28,015	1.642	46,000.630
BANCO BILBAO VIZCAYA	128,312	4.850	622,313.200
ACERINOX SA	3,900	8.510	33,189.000
IBERDROLA SA	106,184	3.210	340,850.640
BANCO DE SABADELL SA	58,786	1.301	76,480.580
REPSOL YPF SA	22,550	12.230	275,786.500
GRIFOLS SA	4,400	18.065	79,486.000
BANCO SANTANDER SA	257,750	4.530	1,167,607.500
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	10,800	9.809	105,937.200
ABERTIS INFRAESTRUCTUR-RT	10,800	0.495	5,346.000
AMADEUS IT HOLDING SA-A	8,700	14.615	127,150.500
GAS NATURAL SDG SA	9,100	8.960	81,536.000
GAS NATURAL SDG SA-RTS	9,100	0.467	4,249.700
MAPFRE SA	21,450	1.581	33,912.450
CAIXABANK	24,750	2.118	52,420.500
CAIXABANK-RTS	24,750	0.048	1,188.000
ZARDOYA OTIS SA	3,700	8.820	32,634.000
INTL CONSOLIDATED AIRLINE	26,300	1.780	46,814.000
ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,876	14.000	54,264.000
ACCIONA SA	750	40.275	30,206.250
INDITEX	6,050	65.020	393,371.000
ENAGAS	5,650	12.760	72,094.000
RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	30.375	92,643.750
FERROVIAL SA	9,800	7.569	74,176.200
DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	3.417	63,897.900
BANKIA SA	22,200	1.015	22,533.000
UPM-KYMMENE OYJ	15,050	7.845	118,067.250
NOKIA OYJ	101,250	2.098	212,422.500
WARTSILA OYJ	4,700	25.140	118,158.000
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,750	4.160	73,840.000
METSO OYJ	3,750	25.140	94,275.000
ELISA OYJ-A SHARES	4,550	15.250	69,387.500
SAMPO OYJ-A SHS	11,150	18.060	201,369.000

	FORTUM OYJ	12,150	14.410	175,081.500	
	KESKO OYJ-B SHS	1,950	19.300	37,635.000	
	KONE OYJ-B	4,250	42.590	181,007.500	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,800	27.670	105,146.000	
	NESTE OIL OYJ	4,300	7.280	31,304.000	
	POHJOLA BANK PLC	4,800	8.095	38,856.000	
	VERBUND AG	2,100	18.525	38,902.500	
	IMMOFINANZ AG	31,200	2.222	69,326.400	
	OMV AG	4,850	21.550	104,517.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	6,550	14.140	92,617.000	
	TELEKOM AUSTRIA AG	11,000	7.260	79,860.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	20.025	57,071.250	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	23.145	43,975.500	
	VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	28.480	28,480.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	13.935	83,610.000	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	20,300	3.141	63,762.300	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	57,950	1.700	98,515.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	7,450	9.204	68,569.800	
	ELAN CORPORATION PLC	14,200	10.970	155,774.000	
	KERRY GROUP PLC-A	4,600	34.365	158,079.000	
	CRH PLC	20,400	13.240	270,096.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	52,300	0.462	24,162.600	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLI	4,800	13.500	64,800.000	
	OPAP SA	6,100	4.000	24,400.000	
ユーロ 小計				ユーロ 52,044,401.200 (5,104,514,870)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	43,500	54.400	2,366,400.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT	35,000	17.480	611,800.000	
	MTR CORP	42,500	24.950	1,060,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,000	86.400	3,456,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	19.520	409,920.000	
	SINO LAND	88,000	10.260	902,880.000	
	CHEUNG KONG	40,000	86.300	3,452,000.000	
	WHARF HOLDINGS	43,000	39.200	1,685,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	20,000	81.300	1,626,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	52,500	63.600	3,339,000.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	12.320	505,120.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	55,300	62.450	3,453,485.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	36,000	38.600	1,389,600.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	25,000	44.350	1,108,750.000	
	HK & CHINA GAS	137,531	18.260	2,511,316.060	
	HANG SENG BANK	22,400	99.500	2,228,800.000	
	WHEELLOCK & CO	25,000	23.250	581,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	115,000	8.210	944,150.000	
	WING HANG BANK LIMITED	6,000	74.050	444,300.000	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	39.000	253,500.000	
	HONG KONG EX & CL	28,900	101.500	2,933,350.000	
	LI & FUNG LTD	150,000	14.080	2,112,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	63,000	24.300	1,530,900.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	91.250	593,125.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	23.450	492,450.000	
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	10.760	500,340.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	30.350	682,875.000	
	BANK OF EAST ASIA	51,040	25.800	1,316,832.000	

	SJM HOLDINGS LTD	51,000	12.620	643,620.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	12,000	42.900	514,800.000	
	AIA GROUP LTD	232,000	24.650	5,718,800.000	
	SANDS CHINA LTD	68,000	25.050	1,703,400.000	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLD	75,000	3.020	226,500.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	14.460	607,320.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	106,500	21.100	2,247,150.000	
	WYNN MACAU LTD	46,000	18.060	830,760.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 54,984,468.060 (554,793,283)	
合計				42,251,287,547 [42,251,287,547]	

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,547	344,812.860	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,187	1,173,442.710	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,000	401,080.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	12,200	194,712.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,527	359,443.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,000	472,400.000	
		AMERICAN TOWER CORP	10,800	681,372.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	19,493	278,944.830	
		KIMCO REALTY CORP	11,700	203,229.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,500	161,010.000	
		RAYONIER INC	3,300	137,346.000	
		VENTAS INC	8,100	456,273.000	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY	7,900	254,538.000	
		PROLOGIS INC	12,262	373,010.040	
		DUKE REALTY CORP	8,000	105,920.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,700	163,761.000	
		HEALTH CARE REIT INC	5,900	317,538.000	
		HCP INC	11,200	440,384.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	111,672.000	
		MACERICH CO/THE	3,700	203,944.000	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	27,000	443,340.000	
		PUBLIC STORAGE	3,900	517,374.000	
		REGENCY CENTERS CORP	2,700	114,021.000	
		SL GREEN REALTY CORP	2,200	156,002.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,100	214,334.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 8,279,904.240 (648,150,904)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES PLC	21,700	153,202.000	
		SEGRO PLC	25,350	53,082.900	
		HAMMERSON PLC	20,400	84,558.000	
		BRITISH LAND CO PLC	26,000	123,604.000	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES	15,900	48,495.000	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 462,941.900 (55,807,646)	
	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	

	WESTFIELD RETAIL TRUST	81,396	221,397.120	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,200	96,256.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	135,078.000	
	GPT GROUP	50,460	161,976.600	
	MIRVAC GROUP	93,400	114,882.000	
	STOCKLAND	69,500	220,315.000	
	WESTFIELD GROUP	61,796	567,905.240	
	GOODMAN GROUP	47,100	151,662.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,669,471.960 (127,447,490)	
シンガポール・ドル	CAPITAMALL TRUST	79,000	シンガポール・ドル 141,015.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 141,015.000 (8,593,454)	
ユーロ	CORIO NV	1,724	ユーロ 55,667.960	
	ICADE	800	49,008.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,650	350,992.500	
	GECINA SA	650	44,076.500	
	KLEPIERRE	3,200	79,664.000	
	FONCIERE DES REGIONS	950	48,535.500	
ユーロ 小計			ユーロ 627,944.460 (61,588,793)	
香港・ドル	LINK REIT	72,000	香港・ドル 2,138,400.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,138,400.000 (21,576,456)	
投資証券 合計			923,164,743 [923,164,743]	
合計			923,164,743 [923,164,743]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 558銘柄 投資証券 25銘柄	97.5%	2.5%	59.5%
イギリス・ポンド	株式 100銘柄 投資証券 5銘柄	98.8%	1.2%	10.5%
イスラエル・シェケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄 投資証券 8銘柄	92.4%	7.6%	3.9%
カナダ・ドル	株式 97銘柄	100%	-%	5.5%
シンガポール・ドル	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	97.6%	2.4%	0.8%
スイス・フラン	株式 35銘柄	100%	-%	3.9%
スウェーデン・クローナ	株式 32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	9銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 投資証券	224銘柄 6銘柄	98.8%	1.2%	12.0%
香港・ドル	株式 投資証券	36銘柄 1銘柄	96.3%	3.7%	1.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	430,749,257	1,829,355,222
コール・ローン	1,080,135,214	903,090,345
国債証券	106,450,013,329	108,656,179,461
派生商品評価勘定	3,275,094	1,814,063
未収入金	1,407,344	-
未収利息	1,299,900,713	1,110,585,291
前払費用	58,576,761	38,529,165
流動資産合計	109,324,057,712	112,539,553,547
資産合計	109,324,057,712	112,539,553,547
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,762,372	4,174,925
未払金	325,950,581	1,793,454,315
未払解約金	44,400,000	28,010,000
流動負債合計	381,112,953	1,825,639,240
負債合計	381,112,953	1,825,639,240
純資産の部		
元本等		
元本 1	60,637,063,976	62,609,509,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	48,305,880,783	48,104,404,422
元本等合計	108,942,944,759	110,713,914,307
純資産合計	108,942,944,759	110,713,914,307
負債純資産合計	109,324,057,712	112,539,553,547

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23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として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。

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。
----------------------------	---

（追加情報）

自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。
--

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	57,010,882,453円	60,637,063,976円
同期中における追加設定元本額	6,677,890,076円	7,079,923,542円
同期中における一部解約元本額	3,051,708,553円	5,107,477,633円
同期末における元本の内訳 ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	3,235,442,035円	3,058,339,660円
ダイワ国内重視バランスファンド 30 V A（一般投資家私募）	100,680,782円	98,485,796円
ダイワ国内重視バランスファンド 50 V A（一般投資家私募）	737,796,419円	695,829,639円
ダイワ国際分散バランスファンド 30 V A（一般投資家私募）	226,521,190円	213,133,558円
ダイワ国際分散バランスファンド 50 V A（一般投資家私募）	2,358,193,024円	2,202,869,768円
D Cダイワ外国債券インデックス	26,198,217,419円	30,146,074,810円
ダイワ・ライフ・バランス30	378,523,851円	469,921,235円
ダイワ・ライフ・バランス50	37,816,239円	143,614,036円
ダイワ・ライフ・バランス70	20,105,991円	70,218,674円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽ノ安定コース）	109,724,774円	139,479,045円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽ノ分散コース）	74,329,690円	91,081,729円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽ノ成長コース）	16,356,923円	20,485,475円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2020	4,950,368円	5,522,897円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	1,691,176円	2,202,787円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	33,021円	110,328円

ダイワ世界バランスファンド40VA	3,668,681,840円	3,331,696,893円
ダイワ世界バランスファンド60VA	397,411,920円	349,428,019円
ダイワ・バランスファンド35VA	13,513,318,326円	11,935,483,748円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	2,471,994,153円	2,353,443,946円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	2,017,725,314円	1,865,565,833円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	784,808,766円	717,840,202円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,216,560,282円	4,628,615,912円
ダイワライフスタイル25	23,351,990円	25,039,861円
ダイワライフスタイル50	33,607,688円	35,950,157円
ダイワライフスタイル75	9,220,795円	9,075,877円
計	60,637,063,976円	62,609,509,885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	60,637,063,976口	62,609,509,885口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資するため、および外貨建資産の売買代金、利金、償還金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年6月5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23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	671,095,244	4,630,890,939
合計	671,095,244	4,630,890,939

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間（平成22年12月1日から平成23年6月6日まで、及び平成23年12月1日から平成24年6月5日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成23年6月6日 現在				平成24年6月5日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,312,504,219	-	1,305,016,941	7,487,278	992,891,776	-	990,530,914	2,360,862
アメリカ・ドル	532,373,431	-	524,077,271	8,296,160	422,858,801	-	422,134,422	724,379
イギリス・ポンド	32,564,891	-	32,049,270	515,621	99,243,813	-	96,511,270	2,732,543
オーストラリア・ドル	16,591,613	-	16,431,730	159,883	14,107,482	-	14,004,240	103,242
カナダ・ドル	43,114,212	-	42,066,000	1,048,212	29,688,588	-	29,168,190	520,398
スイス・フラン	7,941,391	-	7,992,900	51,509	3,912,931	-	3,920,640	7,709
スウェーデン・クローナ	16,847,586	-	16,689,750	157,836	5,531,612	-	5,557,520	25,908
デンマーク・クローネ	12,507,771	-	12,513,440	5,669	8,816,775	-	8,830,794	14,019
ポーランド・ズロチ	3,708,175	-	3,695,000	13,175	6,731,684	-	6,756,893	25,209
メキシコ・ペソ	22,313,385	-	21,741,900	571,485	9,009,543	-	8,915,180	94,363
ユーロ	624,541,764	-	627,759,680	3,217,916	392,990,547	-	394,731,765	1,741,218
合計	1,312,504,219	-	1,305,016,941	7,487,278	992,891,776	-	990,530,914	2,360,862

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	平成23年6月6日現在	平成24年6月5日現在
本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7966円 (17,966円)	1.7683円 (17,683円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20130815	2,631,000.000	2,757,182.760	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20131115	3,059,000.000	3,235,473.710	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20140215	2,868,000.000	3,049,601.760	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20140515	2,732,000.000	2,968,891.720	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,599,000.000	2,823,865.480	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,075,028.520	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,913,269.260	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	4,114,990.080	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,404,618.660	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,079,477.960	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,092,048.200	
		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,285,320.000	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,353,822.500	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,744,870.080	

4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,411,749.590	
4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,125,585.150	
4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,893,469.110	
4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,997,235.600	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,411,548.460	
3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,483,061.600	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	1,462,000.000	1,509,339.560	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	2,310,000.000	2,387,870.100	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,408,000.000	2,495,193.680	
4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,778,820.890	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,500,000.000	2,589,150.000	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	2,621,000.000	2,721,227.040	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20131031	2,170,000.000	2,246,709.500	
3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	6,999,000.000	8,260,149.810	
2% U.S. TREASURY NOTE 20131130	2,466,000.000	2,530,140.660	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,139,000.000	3,200,053.550	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140131	2,450,000.000	2,510,466.000	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	6,947,000.000	7,765,981.830	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140228	3,716,000.000	3,819,899.360	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,364,761.300	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20140331	2,341,000.000	2,404,089.950	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,633,291.820	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,386,000.000	3,489,137.560	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,159,899.410	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	6,144,000.000	7,036,293.120	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	4,930,000.000	5,123,108.100	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	686,590.020	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	2,833,000.000	2,971,873.660	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,347,331.910	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,400,515.220	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	2,032,192.110	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	5,842,000.000	6,908,165.000	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,141,176.240	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,736,974.160	

2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,162,997.850	
3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,751,823.830	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,283,038.500	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,569,104.150	
3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	4,020,000.000	4,689,892.800	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,753,897.060	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,535,686.800	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,698,871.740	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,479,444.690	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,431,652.850	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,207,988.560	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,682,978.900	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	2,275,000.000	2,399,943.000	
3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,687,000.000	2,976,981.040	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,317,000.000	2,456,089.510	
3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	5,197,132.800	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,354,096.480	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,845,921.630	
3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	6,199,414.380	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,709,926.240	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	3,118,273.200	
1.125% U.S. TREASURY NOTE 20130615	3,097,000.000	3,125,895.010	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,869,752.680	
2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,774,536.520	
1% U.S. TREASURY NOTE 20130715	2,440,000.000	2,460,959.600	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,487,118.680	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,919,059.740	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130815	3,043,000.000	3,062,353.480	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	4,929,000.000	5,470,401.360	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,588,171.740	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	3,069,574.140	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20130915	1,878,000.000	1,890,526.260	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,638,106.400	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,994,207.150	

0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131015	1,937,000.000	1,943,953.830	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20151031	1,265,000.000	1,299,585.100	
1.875% U.S. TREASURY NOTE 20171031	382,000.000	404,037.580	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20131115	885,000.000	888,247.950	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20201115	4,509,000.000	5,000,571.180	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20151130	3,151,000.000	3,249,941.400	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20171130	883,000.000	952,324.330	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20131215	3,091,000.000	3,114,769.790	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	2,515,000.000	2,661,473.600	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	253,000.000	280,017.870	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140115	2,967,000.000	3,002,099.610	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160131	635,000.000	669,448.750	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180131	255,000.000	280,658.100	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140215	631,000.000	641,499.840	
3.625% U.S. TREASURY NOTE 20210215	4,076,000.000	4,857,124.640	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,590,000.000	2,744,467.600	
2.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	1,234,000.000	1,367,753.260	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140315	2,588,000.000	2,633,781.720	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20160331	1,300,000.000	1,385,007.000	
2.875% U.S. TREASURY NOTE 20180331	1,300,000.000	1,451,216.000	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20140415	1,439,000.000	1,465,189.800	
2% U.S. TREASURY NOTE 20160430	260,000.000	274,653.600	
2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	260,000.000	286,678.600	
1% U.S. TREASURY NOTE 20140515	3,661,000.000	3,712,876.370	
3.125% U.S. TREASURY NOTE 20210515	4,417,000.000	5,074,691.300	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20130531	659,000.000	660,924.280	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,832,000.000	4,013,406.880	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180531	1,322,000.000	1,438,798.700	
0.75% U.S. TREASURY NOTE 20140615	4,416,000.000	4,458,923.520	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130630	5,180,000.000	5,188,857.800	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160630	3,406,000.000	3,533,588.760	
2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180630	3,782,000.000	4,118,522.360	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20140715	4,093,000.000	4,122,551.460	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20130731	2,307,000.000	2,311,037.250	

1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160731	2,053,000.000	2,130,131.210	
2.25% U.S. TREASURY NOTE 20180731	1,341,000.000	1,450,787.670	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,097,000.000	2,107,065.600	
2.125% U.S. TREASURY NOTE 20210815	1,418,000.000	1,504,186.040	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130831	2,249,000.000	2,246,436.140	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,108,000.000	2,144,299.760	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20180831	2,730,000.000	2,830,027.200	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140915	3,109,000.000	3,106,077.540	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20130930	4,193,000.000	4,187,087.870	
1% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,793,000.000	2,839,894.470	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20180930	2,835,000.000	2,916,052.650	
0.5% U.S. TREASURY NOTE 20141015	2,784,000.000	2,796,806.400	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131031	4,295,000.000	4,295,987.850	
1% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,718,000.000	2,763,227.520	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20181031	1,920,000.000	2,019,283.200	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20141115	4,179,000.000	4,185,352.080	
2% U.S. TREASURY NOTE 20211115	1,353,000.000	1,416,942.780	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20131130	4,521,000.000	4,521,135.630	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161130	3,027,000.000	3,061,628.880	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181130	2,165,000.000	2,226,377.750	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141215	4,827,000.000	4,818,697.560	
0.125% U.S. TREASURY NOTE 20131231	3,052,000.000	3,045,896.000	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,265,000.000	4,310,123.700	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181231	1,861,000.000	1,913,554.640	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150115	4,162,000.000	4,153,676.000	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140131	3,738,000.000	3,738,112.140	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,970,000.000	3,000,947.400	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190131	1,426,000.000	1,453,179.560	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150215	3,983,000.000	3,973,799.270	
2% U.S. TREASURY NOTE 20220215	3,224,000.000	3,369,176.720	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140228	4,760,000.000	4,760,142.800	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,408,000.000	2,433,187.680	
1.375% U.S. TREASURY NOTE 20190228	1,843,000.000	1,892,595.130	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150315	3,557,000.000	3,560,023.450	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140331	3,693,000.000	3,692,556.840	

1% U.S. TREASURY NOTE 20170331	3,856,000.000	3,917,117.600	
1.5% U.S. TREASURY NOTE 20190331	2,821,000.000	2,916,519.060	
0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150415	3,410,000.000	3,412,796.200	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140430	3,658,000.000	3,657,853.680	
0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170430	2,375,000.000	2,398,560.000	
1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190430	559,000.000	568,385.610	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150515	2,261,000.000	2,254,895.300	
1.75% U.S. TREASURY NOTE 20220515	2,813,000.000	2,870,779.020	
0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	3,589,000.000	3,588,856.440	
0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,125,000.000	2,119,347.500	
11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,213,619.940	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,333,164.500	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	2,019,540.000	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,125,858.860	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20170815	755,000.000	1,070,235.150	
8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,373,510.480	
8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,368,665.320	
8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,197,650.000	
8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,803,821.000	
7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,187,819.520	
7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,482,843.680	
6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,454,084.640	
7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,300,388.180	
7.625% U.S. TREASURY BOND 20250215	687,000.000	1,144,926.720	
6.875% U.S. TREASURY BOND 20250815	817,000.000	1,301,644.400	
6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,279,353.600	
6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	993,673.800	
6.625% U.S. TREASURY BOND 20270215	688,000.000	1,100,421.600	
6.375% U.S. TREASURY BOND 20270815	765,000.000	1,207,498.950	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	2,308,000.000	3,576,661.440	
5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,201,841.640	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,356,798.240	
5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	1,486,000.000	2,155,041.780	
6.125% U.S. TREASURY BOND 20290815	663,000.000	1,052,870.520	

	6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	2,185,601.790	
	5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,985,682.240	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	2,273,000.000	3,154,833.080	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	1,835,000.000	2,645,409.400	
	5% U.S. TREASURY BOND 20370515	1,830,000.000	2,732,116.800	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	2,968,000.000	4,075,182.720	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	2,767,000.000	3,874,436.410	
	3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	3,416,000.000	4,093,563.600	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	2,709,000.000	3,661,782.390	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	3,537,000.000	4,965,311.340	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	4,554,000.000	6,285,567.420	
	4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	4,202,000.000	6,016,717.740	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,994,564.780	
	3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	4,184,000.000	5,336,524.640	
	4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	3,269,000.000	4,430,998.740	
	4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	3,086,000.000	4,514,478.540	
	4.375% U.S. TREASURY BOND 20410515	3,356,000.000	4,642,287.680	
	3.75% U.S. TREASURY BOND 20410815	1,367,000.000	1,708,750.000	
	3.125% U.S. TREASURY BOND 20411115	1,289,000.000	1,437,634.590	
	3.125% U.S. TREASURY BOND 20420215	703,000.000	784,006.690	
	3% U.S. TREASURY BOND 20420515	272,000.000	296,224.320	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 598,509,186.770 (46,851,299,141)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170825	868,000.000	1,228,393.600	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20130927	592,000.000	652,324.800	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	641,000.000	812,082.900	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	942,000.000	1,475,077.800	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	909,000.000	1,388,133.900	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	2,301,420.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	2,873,000.000	3,179,836.400	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	2,250,846.600	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	2,217,000.000	2,533,809.300	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,737,448.700	

	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	2,194,000.000	3,010,168.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	2,236,000.000	2,832,117.600	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,708,000.000	2,256,268.000	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,835,855.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,667,346.200	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,465,000.000	1,863,480.000	
	5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	1,604,000.000	1,983,185.600	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,395,448.000	
	4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,806,000.000	2,437,919.400	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	1,915,000.000	2,487,393.500	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,244,424.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	364,000.000	463,335.600	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,579,000.000	1,932,222.300	
	2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140307	2,468,000.000	2,554,626.800	
	4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	1,300,000.000	1,705,210.000	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	2,483,000.000	2,948,314.200	
	4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	1,011,000.000	1,288,418.400	
	2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,690,856.000	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	2,316,000.000	2,764,377.600	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	2,133,000.000	2,720,214.900	
	2% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160122	2,338,000.000	2,466,356.200	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210907	2,437,000.000	2,923,181.500	
	1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170122	1,814,000.000	1,906,695.400	
	3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20520722	665,000.000	787,493.000	
	1% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170907	90,000.000	91,098.000	
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 72,815,379.200 (8,777,893,963)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	1,385,000.000	1,550,327.450	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,411,000.000	1,655,709.730	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,178,000.000	2,561,175.540	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,755,000.000	2,184,150.150	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	1,215,000.000	1,315,942.200	

	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	2,192,444.480	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	909,000.000	1,146,912.570	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	790,000.000	830,250.500	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,221,000.000	1,348,997.430	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	1,385,000.000	1,465,122.250	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	1,441,000.000	1,681,661.410	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	625,000.000	778,143.750	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20151021	368,000.000	400,906.560	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	866,000.000	951,197.080	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	399,000.000	476,326.200	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 20,539,267.300 (1,567,967,665)	
カナダ・ドル	9% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	カナダ・ドル 372,000.000	カナダ・ドル 676,322.040	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	946,000.000	1,683,520.520	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,965,250.500	
	5.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	853,000.000	888,834.530	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	2,191,007.500	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,279,143.680	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,141,040.040	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,593,000.000	2,422,586.610	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	571,000.000	635,026.230	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,983,718.500	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	2,018,000.000	2,361,019.640	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130601	1,367,000.000	1,401,010.960	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	1,341,000.000	1,551,362.670	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,672,014.480	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,224,000.000	1,685,533.680	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,697,530.220	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,211,000.000	1,393,703.570	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,394,000.000	1,453,509.860	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,036,410.410	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130901	1,087,000.000	1,107,457.340	

	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,431,898.980	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	650,618.730	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140301	1,501,000.000	1,527,492.650	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20130801	376,000.000	380,534.560	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	811,682.600	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140801	268,000.000	275,278.880	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20131101	606,000.000	610,557.120	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,359,000.000	1,492,562.520	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	379,000.000	492,222.460	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140201	283,000.000	283,135.840	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,457,000.000	1,480,341.140	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150201	803,000.000	802,783.190	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140501	450,000.000	448,105.500	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150801	430,000.000	435,826.500	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	216,000.000	219,138.480	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 42,568,182.130 (3,211,343,660)	
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	496,589.940	
	3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	591,799.460	
	3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	343,000.000	367,243.240	
	4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	483,000.000	579,039.720	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	801,694.560	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	412,000.000	486,032.280	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	297,000.000	341,820.270	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	759,000.000	819,537.840	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	434,000.000	477,057.140	
	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	183,915.340	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	340,000.000	383,907.600	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	439,000.000	477,728.580	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	246,000.000	272,112.900	
	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	303,000.000	312,338.460	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	117,000.000	125,872.110	

	0.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20140201	178,000.000	178,090.780	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	160,000.000	165,291.200	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,060,071.420 (430,240,753)	
スイス・フラン	4.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20140106	156,000.000	167,180.520	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	1,094,000.000	1,483,234.260	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	324,000.000	477,174.240	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	943,000.000	1,036,375.860	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	1,578,000.000	1,835,261.340	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	136,000.000	161,597.920	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	281,000.000	323,793.490	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 5,484,617.630 (447,928,722)	
スウェーデン・ク ローナ	6.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20140505	7,275,000.000	8,103,622.500	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	7,460,000.000	8,326,329.800	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	9,365,000.000	12,334,360.550	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,250,000.000	4,618,942.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,926,875.750	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	7,950,000.000	9,648,120.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,560,000.000	6,480,900.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	3,285,000.000	4,012,167.600	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 59,451,318.700 (650,991,940)	
デンマーク・ク ローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	4,337,000.000	7,203,973.850	
	5% DANISH GOVERNMENT BOND 20131115	10,238,000.000	10,999,809.580	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	8,732,000.000	9,932,126.080	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	9,491,000.000	11,342,883.920	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,250,000.000	20,349,945.000	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	9,663,000.000	11,989,173.990	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	943,000.000	1,112,928.600	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20141115	1,395,000.000	1,465,308.000	

デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 74,396,149.020 (982,029,167)	
ノルウェー・クローネ	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	ノルウェー・クローネ 5,939,000.000	ノルウェー・クローネ 6,583,381.500	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	6,885,000.000	7,851,929.400	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	3,110,000.000	3,722,670.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	2,253,000.000	2,644,571.400	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 20,802,552.300 (268,768,976)	
ポーランド・ズロチ	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20131024	ポーランド・ズロチ 2,383,000.000	ポーランド・ズロチ 2,390,268.150	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	3,221,000.000	3,363,915.770	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,367,140.620	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	3,637,000.000	3,686,463.200	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20140425	3,090,000.000	3,145,589.100	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,506,225.960	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	1,780,000.000	1,814,710.000	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20150425	3,068,000.000	3,126,292.000	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,012,000.000	2,007,291.920	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	2,218,000.000	2,232,638.800	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20130725	2,383,000.000	2,263,468.720	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	739,000.000	760,431.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20140125	484,000.000	448,774.480	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	2,921,000.000	2,910,484.400	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 33,023,694.120 (739,070,275)	
マレーシア・リンギット	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	マレーシア・リンギット 2,614,000.000	マレーシア・リンギット 2,726,506.560	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	1,107,000.000	1,161,929.340	
	5.094% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140430	2,959,000.000	3,069,962.500	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	2,108,000.000	2,207,265.720	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,071,608.720	
	8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20131030	350,000.000	373,499.000	

	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,041,318.950	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	549,862.260	
	3.461% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130731	763,000.000	766,387.720	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	542,000.000	628,774.200	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,157,825.830	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,073,445.120	
	3.21% MALAYSIAN GOVERNMENT 20130531	1,617,000.000	1,619,231.460	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	368,000.000	375,805.280	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,477,601.420	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,885,000.000	1,978,684.500	
	3.434% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140815	192,000.000	193,501.440	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	946,000.000	1,006,912.940	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	738,000.000	745,741.620	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	214,000.000	211,098.160	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	44,000.000	44,052.800	
マレーシア・リンギット 小計			マレーシア・リンギット 23,481,015.540 (576,928,552)	
メキシコ・ペソ	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	メキシコ・ペソ 2,516,000.000	メキシコ・ペソ 2,909,754.000	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20131219	6,720,000.000	7,059,696.000	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	8,291,000.000	11,058,204.160	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	9,403,000.000	10,485,285.300	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	15,233,000.000	16,766,810.770	
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	9,303,391.440	
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	10,474,000.000	11,440,959.680	
	9% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20130620	7,121,000.000	7,440,732.900	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,894,400.400	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	8,986,380.200	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	5,579,000.000	6,496,076.020	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	6,960,000.000	8,191,293.600	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	9,694,000.000	11,008,797.220	
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,705,402.880	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	15,980,000.000	18,439,801.400	

	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	5,171,000.000	5,360,879.120	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20210610	812,000.000	850,854.200	
	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	11,839,000.000	12,431,660.340	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20310529	8,456,000.000	9,093,666.960	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20220609	3,212,000.000	3,330,458.560	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20421113	1,732,000.000	1,809,143.280	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 174,063,648.430 (962,571,975)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	355,195.450	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,223,000.000	1,859,718.260	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,753,539.810	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,630,000.000	2,494,095.600	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,121,000.000	1,592,414.130	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,592,497.050	
	5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,706,107.800	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130704	1,909,000.000	1,985,531.810	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	3,305,248.380	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140104	2,190,000.000	2,336,160.600	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,954,574.480	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,285,557.180	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,559,000.000	3,696,680.220	
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,195,500.000	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,814,237.100	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	3,023,033.130	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,528,853.450	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,999,428.840	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,506,101.050	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,145,103.900	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	1,851,000.000	2,255,443.500	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	3,079,821.360	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,210,649.020	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	3,256,000.000	3,865,881.360	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,442,544.750	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,639,000.000	3,062,585.890	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,047,000.000	1,420,297.380	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,281,230.560	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,860,000.830	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,455,636.050	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,563,000.000	1,718,877.990	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,956,000.000	2,106,807.600	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	825,000.000	865,260.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	248,000.000	296,248.400	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130614	559,000.000	568,530.950	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20130913	1,157,000.000	1,167,389.860	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131213	102,000.000	102,351.900	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140314	977,000.000	981,269.490	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20140613	503,000.000	502,974.850	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20131011	2,046,000.000	2,155,133.640	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140411	2,393,000.000	2,492,405.220	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,488,391.600	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,561,098.680	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	2,471,000.000	2,623,683.090	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	2,786,000.000	2,939,898.640	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	1,926,000.000	2,058,239.160	
2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	1,642,000.000	1,804,377.380	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,039,980.670	
0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	428,000.000	436,294.640	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	502,000.000	506,101.340	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	955,946.290	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,037,958.600	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,968,000.000	2,700,115.680	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,519,751.240	
5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,419,676.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	3,566,232.570	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20131025	2,028,000.000	2,131,042.680	

4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,518,452.090	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140425	2,491,000.000	2,661,533.860	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,926,338.540	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	3,430,000.000	3,991,834.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,787,000.000	2,175,243.620	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	2,232,000.000	2,417,523.840	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	4,031,936.720	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,659,299.300	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	2,984,000.000	3,249,068.720	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,558,000.000	3,011,277.600	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	2,204,000.000	2,465,725.000	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,585,000.000	4,230,192.450	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,151,976.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,584,164.730	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,897,000.000	2,200,235.450	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	3,031,882.700	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,610,000.000	2,956,816.800	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,712,000.000	4,137,283.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	905,000.000	1,112,652.250	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,426,591.740	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,841,000.000	3,976,817.760	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	2,872,000.000	3,130,767.200	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	417,000.000	443,262.660	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130712	1,920,000.000	2,009,587.200	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140112	3,722,000.000	3,851,935.020	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	3,622,000.000	3,820,123.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,289,927.420	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	2,614,000.000	2,723,134.500	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,553,243.350	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20130925	2,071,000.000	2,117,348.980	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	930,000.000	987,036.900	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	427,000.000	437,435.880	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140925	1,032,000.000	1,039,791.600	

7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,097,355.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,838,242.350	
4.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20130715	1,993,000.000	2,083,980.450	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,831,000.000	1,965,413.710	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	1,536,000.000	1,669,985.280	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,105,000.000	1,547,773.500	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,589,400.180	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,132,000.000	1,360,222.520	
4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,659,543.850	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,456,868.050	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	1,417,000.000	1,685,734.050	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,601,103.900	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,848,000.000	2,152,143.840	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,095,000.000	1,551,877.800	
1% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140115	2,377,000.000	2,409,303.430	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,240,000.000	1,427,041.600	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	1,615,000.000	1,741,939.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150415	1,280,000.000	1,294,604.800	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	750,000.000	796,402.500	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	600,000.000	652,620.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,682,519.080	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,613,000.000	1,815,592.800	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,868,000.000	2,974,402.800	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,485,816.020	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,101,661.680	
5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	1,817,584.000	
5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,546,429.120	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	3,521,000.000	3,341,992.360	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,710,789.240	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130801	2,519,000.000	2,549,051.670	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	1,827,754.660	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,216,219.850	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,611,000.000	1,425,896.100	

3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,125,801.560	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	2,589,000.000	2,002,436.160	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	2,781,855.520	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	3,815,893.440	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,203,848.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	1,968,000.000	1,910,022.720	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	2,984,000.000	2,606,434.480	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	2,063,000.000	1,932,412.100	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	2,928,000.000	2,822,064.960	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	2,347,000.000	2,242,793.200	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131215	1,425,000.000	1,423,161.750	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	1,754,000.000	1,650,934.960	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,687,762.110	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	2,403,000.000	2,246,805.000	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	2,029,000.000	1,762,653.170	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	2,560,000.000	2,396,620.800	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,774,637.250	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	2,000,000.000	1,835,060.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20130601	2,000,000.000	1,973,420.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	797,630.820	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,361,000.000	2,088,304.500	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	2,144,000.000	1,923,296.640	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20131101	1,206,000.000	1,181,867.940	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151101	186,000.000	176,610.720	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,687,000.000	2,568,718.260	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140401	1,389,000.000	1,363,970.220	
3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160415	2,034,000.000	1,969,481.520	
4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140701	383,000.000	383,245.120	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160915	986,000.000	981,040.420	
5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,089,000.000	1,053,455.040	
6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20141115	2,210,000.000	2,297,361.300	
4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170501	314,000.000	309,604.000	
5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,088,000.000	1,084,855.680	

2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150301	1,330,000.000	1,263,832.500	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,385,000.000	1,778,090.700	
8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	455,601.480	
5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	952,446.600	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20130928	1,243,000.000	1,298,972.290	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	2,025,000.000	2,178,414.000	
5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	2,038,157.400	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,193,517.780	
3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,286,132.650	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,542,000.000	1,695,721.980	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,149,374.600	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,659,312.490	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140328	1,569,000.000	1,657,460.220	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,702,947.380	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,876,000.000	1,993,212.480	
3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,792,000.000	1,945,574.400	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	540,876.360	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	485,000.000	567,964.100	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	1,850,795.280	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,290,575.380	
4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	928,126.710	
4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	364,000.000	406,249.480	
4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	864,000.000	951,842.880	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	431,000.000	446,972.860	
4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	608,771.020	
4.5% IRISH TREASURY 20181018	561,000.000	482,628.300	
4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	678,400.000	
4% IRISH TREASURY 20140115	1,163,000.000	1,117,712.780	
5.9% IRISH TREASURY 20191018	911,000.000	840,579.700	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,241,000.000	1,064,331.240	
5% IRISH TREASURY 20201018	918,000.000	790,857.000	
4.5% IRISH TREASURY 20150218	538,000.000	507,877.380	
4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,389,000.000	1,163,259.720	
6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	887,000.000	1,313,460.730	
4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	2,084,009.750	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	1,345,000.000	1,450,515.250	

3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	1,421,000.000	1,642,334.960	
3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20131020	1,132,000.000	1,186,720.880	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	996,000.000	1,082,114.160	
3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,594,000.000	1,802,734.300	
4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	1,022,834.070	
4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	843,000.000	1,070,820.750	
4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	509,000.000	585,538.330	
4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,525,475.280	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,762,000.000	1,879,824.940	
4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,201,280.610	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,244,821.710	
3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	635,576.500	
3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	686,000.000	771,887.200	
5.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20130704	725,000.000	765,759.500	
4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	1,280,000.000	1,432,051.200	
3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	452,605.960	
4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	667,210.500	
3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	1,280,000.000	1,365,017.600	
4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	498,000.000	621,827.700	
3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	880,000.000	1,011,727.200	
1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	881,377.890	
3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	459,000.000	534,528.450	
1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170415	252,000.000	266,159.880	
2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20280704	270,000.000	299,195.100	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,006,000.000	1,892,460.400	
4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	2,167,000.000	2,156,121.660	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,277,296.680	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,620,440.340	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20130730	1,734,000.000	1,730,393.280	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	2,565,000.000	2,518,547.850	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,725,000.000	1,963,280.750	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,731,103.110	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	934,191.680	

	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	903,602.870	
	4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,350,717.100	
	4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	1,537,993.500	
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140131	1,304,000.000	1,295,067.600	
	4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	1,517,000.000	1,391,999.200	
	4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,591,269.750	
	3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	1,189,000.000	1,143,806.110	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	685,957.950	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,491,000.000	2,164,330.260	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	956,578.000	
	3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,694,714.500	
	2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20131031	1,748,000.000	1,701,712.960	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,531,643.150	
	3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	863,000.000	791,457.300	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,386,860.750	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,074,000.000	1,008,013.440	
	3.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140430	1,196,000.000	1,169,723.880	
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,446,000.000	1,363,433.400	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	775,000.000	747,100.000	
	4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150730	1,293,000.000	1,240,801.590	
	ユーロ 小計		ユーロ 440,346,091.690 (43,189,144,672)	
国債証券 合計			108,656,179,461 [108,656,179,461]	
合計			108,656,179,461 [108,656,179,461]	

- (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 206銘柄	100%	43.2%
イギリス・ポンド	国債証券 35銘柄	100%	8.1%
オーストラリア・ドル	国債証券 15銘柄	100%	1.4%
カナダ・ドル	国債証券 35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 7銘柄	100%	0.4%
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%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券	21銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	21銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	245銘柄	100%	39.7%

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24年6月29日

資産総額	5,727,604,688円
負債総額	4,935,285円
純資産総額（ - ）	5,722,669,403円
発行済数量	5,505,185,912口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0395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24年6月29日

資産総額	89,136,263,890円
負債総額	234,404,000円
純資産総額（ - ）	88,901,859,890円
発行済数量	207,654,434,485口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.4281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24年6月29日

資産総額	12,812,432,034円
負債総額	20,792,000円
純資産総額（ - ）	12,791,640,034円
発行済数量	11,206,947,244口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1414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24年6月29日

資産総額	46,693,119,428円
負債総額	203,998,952円
純資産総額（ - ）	46,489,120,476円
発行済数量	53,827,245,046口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8637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24年6月29日

資産総額	111,458,734,206円
負債総額	708,130,711円
純資産総額（ - ）	110,750,603,495円
発行済数量	62,583,206,175口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7697円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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24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

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議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24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	4	11,343
追加型株式投資信託	408	6,873,121
株式投資信託 合計	412	6,884,463
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,358,384
公社債投資信託 合計	17	2,358,384
総合計	429	9,242,847

3 【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 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、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 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23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	967,190	1,003,450
器具備品（純額）	332,407	513,162
建設仮勘定	634,782	484,571
	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132
その他	596	471
投資その他の資産	18,825,476	16,375,520
投資有価証券	12,339,547	10,034,136
関係会社株式	5,141,069	5,141,069
出資金	142,215	136,315
従業員に対する長期貸付金	99,889	112,674
差入保証金	609,781	542,920

長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産（純額）	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

（単位：千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2,627,872	3,702,277
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414
株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663

純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)		当事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）	当事業年度 （自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	2,800,000	-
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
当期変動額合計	2,800,000	-
当期末残高	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）	当事業年度 （自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．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。

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。

4．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

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

（２）賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（３）退職給付引当金

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

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（４）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

たため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

（会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用）

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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つのグループピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により

評価しております。

当事業年度（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）

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つのグループ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（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円であります。

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22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額 9,182百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 3,520円

基準日 平成23年 3 月31日

効力発生日 平成23年 6月27日

当事業年度（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（１）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成23年 6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

（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24年 6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額 7,022百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 2,692円
 基準日 平成24年 3月31日
 効力発生日 平成24年 6月26日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

おります。

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に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株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用していましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「５．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用していましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。

（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

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

前事業年度（平成23年３月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
(2) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
(1) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
(2) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
(3) 未払費用（*1）	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引（*2）	(87,535)	(87,535)	-

（*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	前事業年度 （平成23年３月31日現在）	当事業年度 （平成24年３月31日現在）
（１）其他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
（２）子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
（３）差入保証金	609,781	542,920

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

<注３>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 １０年以内	１０年超
現金・預金	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

当事業年度（平成24年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 １０年以内	１０年超
現金・預金	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年３月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成24年３月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（平成23年３月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
（１）株式	54,283	55,101	818
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	25,277,982	25,890,888	612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724
合計	30,154,565	30,329,983	175,417

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

当事業年度（平成24年３月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
（１）株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

当事業年度（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

4．減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っております。

（デリバティブ取引関係）

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。

前事業年度（平成23年 3 月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年 3 月31日現在）

株式関連

（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	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表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。

前事業年度（平成23年３月31日現在）

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
				うち1年超	
原則的 処理 方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430
合計			2,435,030	-	183,430

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年３月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

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

	前事業年度 （平成23年３月31日現在）	当事業年度 （平成24年３月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

３．退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）	当事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度（平成23年 3 月31日 現在）	当事業年度（平成24年 3 月31日 現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：％）

	前事業年度 （平成23年 3 月31日現在）	当事業年度 （平成24年 3 月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21	-
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25	-
住民税均等割	0.02	-
評価性引当額	4.14	-

その他	0.07	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60	-

（注）当事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

１．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

２．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を１年１ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

３．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

４．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度（自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

当事業年度（自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業 の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India) Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有) 直接 91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

- （１）シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。
- （２）インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management (India) Private Limited社の行った増資を１株につき72円86銭で引き受けております。

当事業年度（自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業 の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,372,770	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金 または 出資金 (百万円)	事業 の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット㈱	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-

同一の親会社をもつ会社	(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	1,085,626	未払費用	129,623
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	-----------	------	---------

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

（１）証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

（２）為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

（３）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度（自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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	19,792,278	未払手数料	2,376,978
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	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

（１）証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

（２）ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

（３）大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年４月１日をもって合併いたしました。

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22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円	1株当たり純資産額 13,358.92円 1株当たり当期純利益 2,692.30円

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

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(追加情報)

前事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インド共和国においてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited(以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited(以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得いたしました。

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

(単位：千円)

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

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成24年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	（ ）100,000	（注1）
日本生命保険相互会社	1,200,000	（注2）
三井住友信託銀行株式会社	（ ）342,037	（注3）
株式会社りそな銀行	279,928	

（ ）資本金の額は、平成24年4月1日現在のものです。

（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24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23年8月30日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第6期）・同添付書類
平成24年2月28日	半期報告書（第7期中）、有価証券届出書の訂正届出書
平成24年3月30日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成24年7月13日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス30の平成23年6月7日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス30の平成24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。

利害関係

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

以上

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

（注2）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24年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公高 印
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典 印
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男 印
--------------------	-------	---------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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。

利害関係

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

以 上

(注)上記は、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。