【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25年8月29日提出
【計算期間】	第8計算期間 （自 平成24年6月6日 至 平成25年6月5日）
【ファンド名】	ダイワ・ライフ・バランス５０
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山部 努
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【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ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

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

（注1）商品分類の定義

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

（注2）属性区分の定義

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

載があるもの

・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

・「その他の指数」…日経225、ＴＯＰＩＸにあてはまらないすべてのもの

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

＜信託金の限度額＞

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

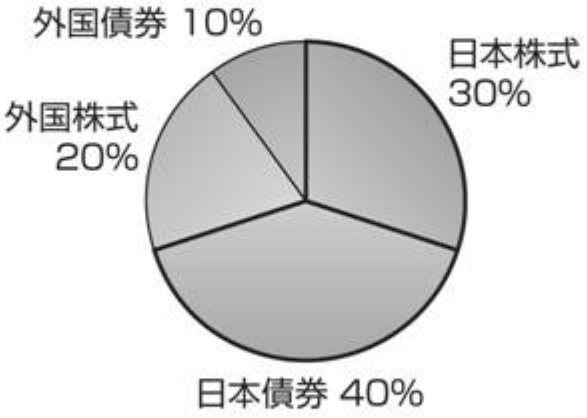
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 内外の株式および債券に投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。

標準組入比率（基準ポートフォリオ）について



	国　内	海　外	合　計
株　式	30%	20%	50%
債　券	40%	10%	50%
合　計	70%	30%	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。

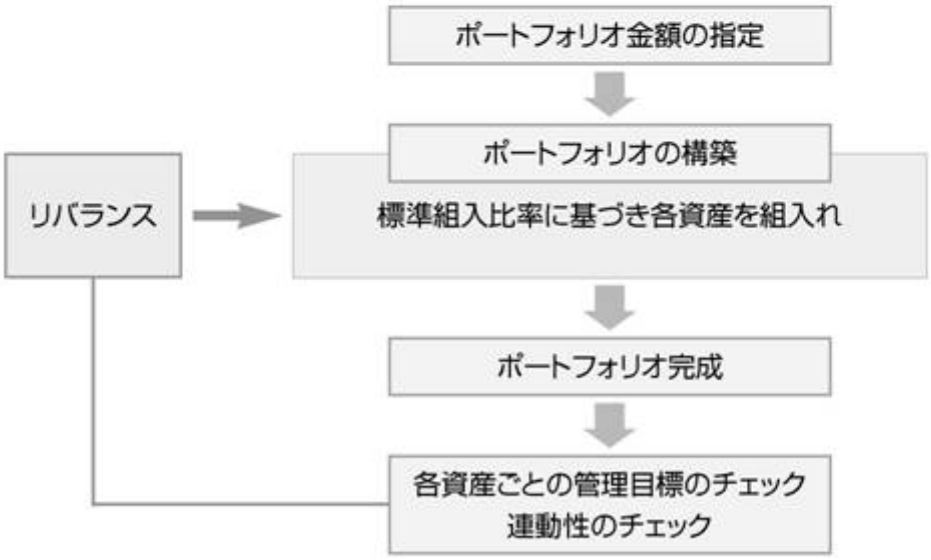
2 各資産を標準組入比率に基づいて組入れることで、合成ベンチマークに連動する投資成果をめざした運用を行ないます。

●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により、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などができます。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・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	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図 ↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

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

損益↑↓投資

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

（注）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25年6月末日現在）＞

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

＜標準組入比率＞

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の30%

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40%

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20%

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10%

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

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

ホ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。

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

(2) 【投資対象】

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑦、⑧および⑨に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、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。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

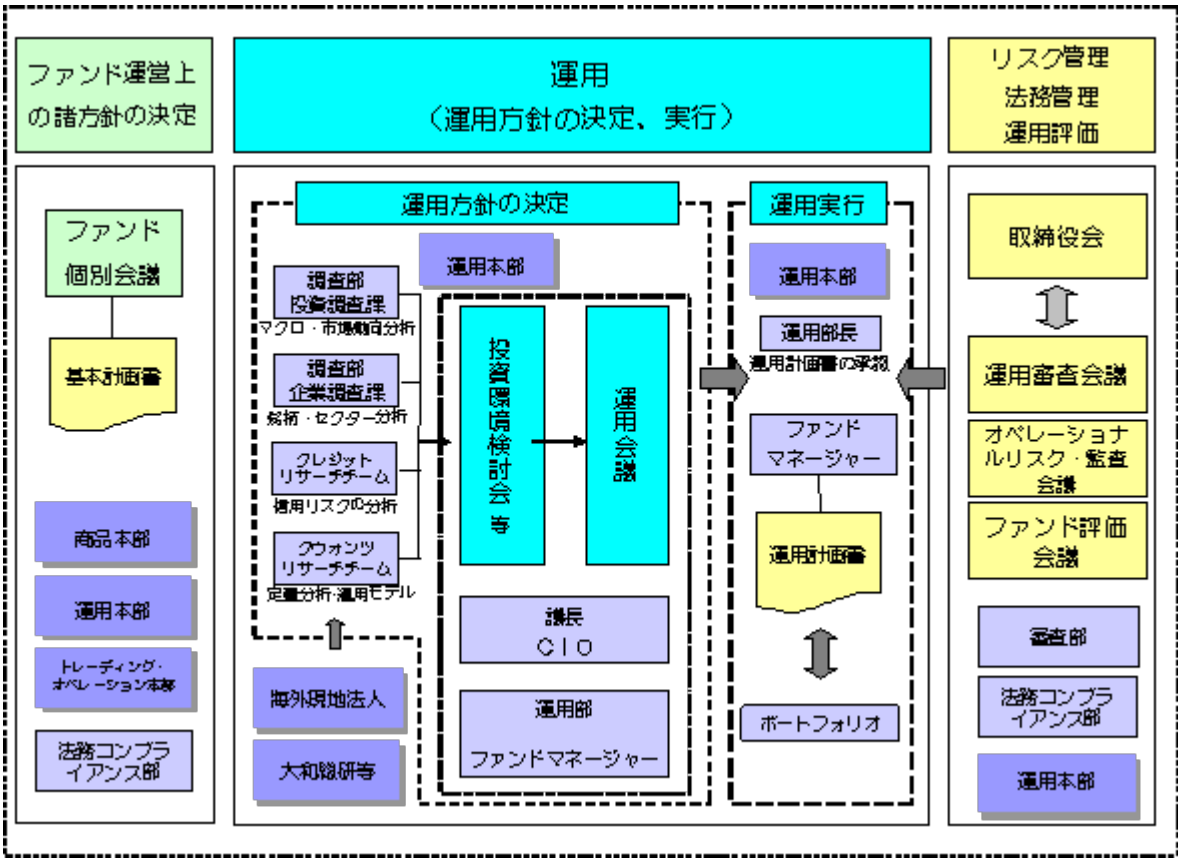
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

いて審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営

・ファンドマネージャーの任命・変更

・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定

・各ファンドの分配政策の決定

・代表取締役に対する随時の的確な状況報告

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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。

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は平成25年7月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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。

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

① 株式（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

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

② 新株引受権証券等（信託約款）

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

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

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

⑥ 信用取引（信託約款）

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6．信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑦ 先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲

で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。

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

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

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

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

1．先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

⑧ スワップ取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」

といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

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

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

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

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

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

⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

⑩ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

⑪ 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

⑫ 外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産総額の100分の75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75を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

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

⑬ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑭ 外国為替予約取引（信託約款）

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

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参 考＞マザーファンドの概要

１．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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

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

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

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

① 主要投資対象

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

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

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. コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有

するもの

9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行ないません。

④ 先物取引等

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

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

行なうことの指図をすることができます。

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引

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

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

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

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

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

(注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数とは
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

３．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）ＭＳＣＩコクサイ指数とは
ＭＳＣＩコクサイ指数は、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）は、ＭＳＣＩコクサイ指数（米ドルベース）をもとに、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．の承諾を得て委託会社が計算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．に帰属します。また、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

４．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

② 株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

③ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

④ その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

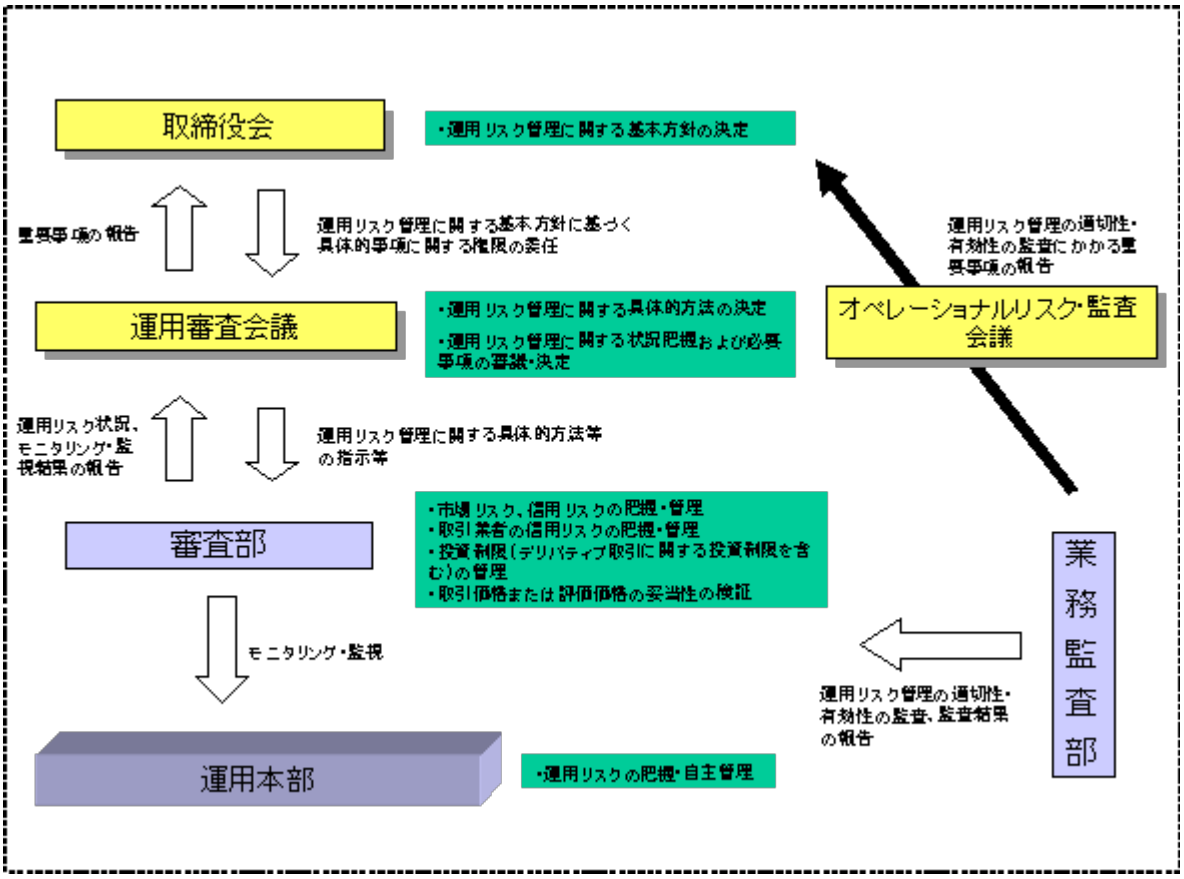
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.21%（税抜0.2%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.084% (税抜0.08%)	年率0.0945% (税抜0.09%)	年率0.0315% (税抜0.03%)

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

(4) 【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

各マザーファンドの投資対象等に応じて、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（配当控除の適用があります。）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

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）上記は、平成25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25年6月28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	3,807,752,116	99.61
内 日本	3,807,752,116	99.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,891,750	0.39
純資産総額	3,822,643,866	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25年6月28日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価簿価(円)	評価単価時価(円)	投資比率(%)
1	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	1,296,295,046	1.1522 1,493,591,158	1.1524 1,493,850,411	39.08
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,831,423,560	0.6192 1,134,163,026	0.6445 1,180,352,484	30.88
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	575,598,256	1.3733 790,482,484	1.3196 759,559,458	19.87
4	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	164,174,611	2.3551 386,660,257	2.2780 373,989,763	9.78

(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	99.61%
合計	99.61%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 （分配落） (円)	純資産総額 （分配付） (円)	１口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	１口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成18年6月5日)	1,152,358	1,152,358	1.1524	1.1524
第2計算期間末 (平成19年6月5日)	1,303,497	1,303,497	1.3035	1.3035
第3計算期間末 (平成20年6月5日)	1,195,229	1,195,229	1.1952	1.1952
第4計算期間末 (平成21年6月5日)	23,530,171	23,530,171	0.9718	0.9718
第5計算期間末 (平成22年6月7日)	201,138,572	201,138,572	0.9766	0.9766
第6計算期間末 (平成23年6月6日)	675,031,030	675,031,030	1.0009	1.0009
第7計算期間末 (平成24年6月5日)	2,513,582,182	2,513,582,182	0.9579	0.9579
平成24年6月末日	2,609,444,956	－	0.9924	－
7月末日	2,625,992,891	－	0.9876	－
8月末日	2,676,609,024	－	0.9914	－
9月末日	2,747,650,645	－	1.0043	－
10月末日	2,814,121,791	－	1.0118	－
11月末日	2,915,914,412	－	1.0411	－
12月末日	3,070,641,631	－	1.0929	－
平成25年1月末日	3,308,352,848	－	1.1558	－
2月末日	3,383,035,554	－	1.1753	－
3月末日	3,582,818,593	－	1.2168	－
4月末日	3,798,735,912	－	1.2862	－
5月末日	3,832,045,024	－	1.2886	－
第8計算期間末 (平成25年6月5日)	3,768,631,160	3,768,631,160	1.2662	1.2662
6月末日	3,822,643,866	－	1.2668	－

② 【分配の推移】

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

第8計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	15.2
第2計算期間	13.1
第3計算期間	△8.3
第4計算期間	△18.7
第5計算期間	0.5
第6計算期間	2.5
第7計算期間	△4.3
第8計算期間	32.2

(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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	0	0
第4計算期間	27,550,110	4,337,659
第5計算期間	191,357,494	9,608,596
第6計算期間	504,180,591	35,734,472
第7計算期間	2,048,718,597	99,116,492
第8計算期間	630,210,873	277,971,974

(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25年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		113,932,297,470	98.13
	内 日本	113,932,297,470	98.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,172,647,295	1.87
純資産総額		116,104,944,765	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）		2,329,860,000	2.01
	内 日本	2,329,860,000	2.01

(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) 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25年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	929,700	3,260.41 3,031,208,500	5,990.00 5,568,903,000	4.80
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,404,000	388.29 2,098,332,000	612.00 3,307,248,000	2.85
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	539,600	2,606.37 1,406,399,800	4,550.00 2,455,180,000	2.11
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	609,600	2,676.29 1,631,471,400	3,685.00 2,246,376,000	1.93
5	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	346,300	3,134.63 1,085,524,498	5,790.00 2,005,077,000	1.73
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	9,212,300	135.09 1,244,522,300	206.00 1,897,733,800	1.63
7	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	448,800	2,430.30 1,090,719,380	3,505.00 1,573,044,000	1.35
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	300,200	3,601.93 1,081,301,600	5,140.00 1,543,028,000	1.33
9	キヤノン	日本	株式	電気機器	448,200	2,861.88 1,282,698,400	3,235.00 1,449,927,000	1.25
10	三菱地所	日本	株式	不動産業	499,000	1,504.00 750,496,000	2,641.00 1,317,859,000	1.14
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	283,200	3,736.81 1,058,267,200	4,480.00 1,268,736,000	1.09
12	日 立	日本	株式	電気機器	1,737,000	479.91 833,607,740	637.00 1,106,469,000	0.95
13	ファナック	日本	株式	電気機器	75,300	13,990.08 1,053,453,600	14,380.00 1,082,814,000	0.93
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	297,800	2,331.21 694,236,400	3,625.00 1,079,525,000	0.93
15	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品先物取引業	1,461,800	305.55 446,657,000	731.00 1,068,575,800	0.92
16	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報・通信業	201,600	2,885.00 581,616,000	5,160.00 1,040,256,000	0.90
17	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	133,000	5,024.09 668,205,425	7,710.00 1,025,430,000	0.88
18	三井不動産	日本	株式	不動産業	336,000	1,610.49 541,126,910	2,917.00 980,112,000	0.84
19	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	455,300	1,055.21 480,439,700	2,078.00 946,113,400	0.81

20	三菱商事	日本	株式	卸売業	555,200	1,549.93 860,523,841	1,699.00 943,284,800	0.81
21	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	912,700	727.61 664,096,400	1,005.00 917,263,500	0.79
22	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	5,860	128,378.26 752,296,614	154,100.00 903,026,000	0.78
23	信越化学	日本	株式	化学	135,500	4,633.97 627,903,500	6,580.00 891,590,000	0.77
24	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	165,000	3,955.00 652,575,000	5,390.00 889,350,000	0.77
25	東京海上ＨＤ	日本	株式	保険業	275,400	2,112.76 581,854,862	3,145.00 866,133,000	0.75
26	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	3,197,000	175.23 560,210,594	268.00 856,796,000	0.74
27	デンソー	日本	株式	輸送用機器	178,200	2,785.82 496,433,400	4,665.00 831,303,000	0.72
28	小松製作所	日本	株式	機械	352,700	1,671.57 589,566,000	2,293.00 808,741,100	0.70
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	237,100	1,912.85 453,537,500	3,380.00 801,398,000	0.69
30	三井物産	日本	株式	卸売業	612,000	1,185.04 725,245,200	1,246.00 762,552,000	0.66

（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
株式	98.13%
合計	98.13%

（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	0.08%
鉱業	0.43%
建設業	2.44%
食料品	3.98%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.26%
化学	5.50%
医薬品	4.45%
石油・石炭製品	0.61%
ゴム製品	0.92%
ガラス・土石製品	0.88%
鉄鋼	1.58%
非鉄金属	0.93%
金属製品	0.66%
機械	4.94%
電気機器	11.39%
輸送用機器	11.69%

精密機器	1.31%
その他製品	1.34%
電気・ガス業	2.60%
陸運業	3.96%
海運業	0.33%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.65%
卸売業	4.30%
小売業	4.28%
銀行業	10.19%
証券、商品先物取引業	1.78%
保険業	2.38%
その他金融業	1.24%
不動産業	3.41%
サービス業	2.04%
合計	98.13%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2013年9月	買建	206	2,223,936,882	2,329,860,000	2.01%

(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) 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25年6月28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		10,228,868,540	72.99
	内 日本	10,228,868,540	72.99
地方債証券		1,236,007,958	8.82
	内 日本	1,236,007,958	8.82
特殊債券		1,245,975,408	8.89
	内 日本	1,245,975,408	8.89
社債券		1,225,218,336	8.74
	内 日本	1,225,218,336	8.74

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	78,914,066	0.56
純資産総額	14,014,984,308	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25年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	８６　５年国債	日本	国債証券	184,000,000	100.88 185,637,365	100.59 185,096,640	0.600000 2014/09/20	1.32
2	３２２　２年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.00 180,015,679	99.98 179,974,800	0.100000 2014/11/15	1.28
3	１０５　５年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.18 180,324,079	99.92 179,857,800	0.200000 2017/06/20	1.28
4	２８８　１０年国債	日本	国債証券	148,000,000	107.30 158,805,457	106.14 157,090,160	1.700000 2017/09/20	1.12
5	３２８　１０年国債	日本	国債証券	150,000,000	98.83 148,252,946	97.84 146,766,000	0.600000 2023/03/20	1.05
6	９２　５年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.58 140,817,840	100.36 140,511,000	0.300000 2015/09/20	1.00
7	３２５　１０年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.68 140,963,539	99.95 139,939,800	0.800000 2022/09/20	1.00
8	３１０　１０年国債	日本	国債証券	130,000,000	104.14 135,383,333	102.66 133,459,300	1.000000 2020/09/20	0.95
9	２８７　１０年国債	日本	国債証券	116,000,000	107.87 125,130,323	106.64 123,712,840	1.900000 2017/06/20	0.88
10	３２７　２年国債	日本	国債証券	120,000,000	99.98 119,985,609	99.97 119,967,600	0.100000 2015/04/15	0.86
11	１０６　５年国債	日本	国債証券	120,000,000	99.93 119,924,809	99.83 119,798,400	0.200000 2017/09/20	0.85
12	１０７　５年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.15 120,183,009	99.73 119,680,800	0.200000 2017/12/20	0.85
13	８８　５年国債	日本	国債証券	118,000,000	100.92 119,088,658	100.65 118,767,000	0.500000 2015/03/20	0.85
14	９５　５年国債	日本	国債証券	117,000,000	101.60 118,872,279	101.23 118,439,100	0.600000 2016/03/20	0.85
15	８９　５年国債	日本	国債証券	115,000,000	100.77 115,888,805	100.53 115,619,850	0.400000 2015/06/20	0.82
16	３２４　１０年国債	日本	国債証券	114,000,000	101.11 115,273,504	100.08 114,094,620	0.800000 2022/06/20	0.81
17	３７８　東北電力	日本	社債券	100,000,000	110.78 110,784,708	108.91 108,912,100	3.850000 2016/04/25	0.78
18	３１９　１０年国債	日本	国債証券	105,000,000	104.26 109,477,307	102.82 107,968,350	1.100000 2021/12/20	0.77

19	２７２　１０年国債	日本	国債証券	105,000,000	103.62 108,803,100	102.79 107,937,900	1.400000 2015/09/20	0.77
20	５　日本政策投資ＣＯ	日本	特殊債券	100,000,000	107.30 107,302,000	107.02 107,027,000	1.745000 2019/03/20	0.76
21	３０　国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.66 106,662,000	106.98 106,987,000	1.870000 2018/03/20	0.76
22	２０－６　北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.93 107,939,400	106.60 106,609,200	1.720000 2018/08/29	0.76
23	２　政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	107.76 107,764,100	106.57 106,578,900	1.600000 2018/11/16	0.76
24	２１－２　埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.80 107,802,800	106.47 106,475,300	1.570000 2019/05/27	0.76
25	２１－６　大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.74 107,746,700	106.40 106,408,700	1.570000 2019/11/25	0.76
26	２９３　大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.04 107,048,200	105.81 105,819,100	2.100000 2016/08/30	0.76
27	２６　公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.75 106,755,200	105.54 105,548,200	1.780000 2017/03/24	0.75
28	６５３　東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.65 106,652,200	105.53 105,532,100	1.540000 2017/12/20	0.75
29	７６　共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	106.78 106,787,600	105.51 105,510,700	1.400000 2019/07/25	0.75
30	２７　国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.46 106,465,300	105.44 105,447,500	1.770000 2017/03/17	0.75

（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	72.99%
地方債証券	8.82%
特殊債券	8.89%
社債券	8.74%
合計	99.44%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成25年6月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		60,172,225,426	96.52
	内 香港	814,168,898	1.31
	内 シンガポール	440,678,906	0.71
	内 イスラエル	144,869,856	0.23
	内 ノルウェー	234,398,446	0.38
	内 スウェーデン	879,060,454	1.41
	内 デンマーク	317,284,894	0.51
	内 イギリス	6,051,336,837	9.71
	内 アイルランド	86,796,052	0.14
	内 オランダ	703,047,124	1.13
	内 ベルギー	323,351,333	0.52
	内 フランス	2,592,429,454	4.16
	内 ドイツ	2,446,697,477	3.92
	内 スイス	2,568,672,783	4.12
	内 ポルトガル	50,693,774	0.08
	内 スペイン	803,983,975	1.29
	内 イタリア	555,463,884	0.89
	内 フィンランド	224,808,205	0.36
	内 オーストリア	81,587,206	0.13
	内 ギリシャ	9,010,467	0.01
	内 カナダ	2,855,865,872	4.58
	内 アメリカ	35,862,242,373	57.52
	内 オーストラリア	2,095,283,706	3.36
	内 ニュージーランド	30,493,450	0.05
投資証券		1,300,711,631	2.09
	内 香港	28,826,280	0.05
	内 シンガポール	20,346,428	0.03
	内 イギリス	80,125,622	0.13
	内 オランダ	7,931,813	0.01
	内 フランス	88,598,621	0.14
	内 アメリカ	905,017,502	1.45
	内 オーストラリア	169,865,365	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		870,116,308	1.40
純資産総額		62,343,053,365	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）		831,572,144	1.33
	内 アメリカ	831,572,144	1.33

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
(注2) 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25年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価(円)	評価単価 時価(円)	投資比率(%)
1	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	109,555	8,687.75 951,786,539	8,877.04 972,524,512	1.56
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	23,100	58,105.00 1,342,225,555	38,822.77 896,805,992	1.44
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	196,200	2,678.98 525,620,104	3,413.18 669,667,054	1.07
4	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	254,500	2,083.20 530,176,105	2,299.11 585,125,735	0.94
5	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	68,200	6,824.39 465,424,066	8,548.73 583,023,993	0.94
6	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,500	68,213.43 443,387,328	86,470.33 562,057,153	0.90
7	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	47,618	10,429.83 496,647,935	11,703.61 557,302,925	0.89
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	80,900	6,365.77 514,999,312	6,434.07 520,516,748	0.83
9	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	67,337	6,852.00 461,393,461	7,657.48 515,632,088	0.83
10	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	122,872	3,269.24 401,698,598	4,097.40 503,455,782	0.81
11	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	26,000	18,882.94 490,956,510	19,289.13 501,517,471	0.80
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	94,020	4,063.87 382,085,979	5,240.05 492,670,300	0.79
13	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	175,863	2,449.96 430,857,579	2,778.26 488,594,229	0.78
14	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	464,700	949.29 441,137,294	1,026.09 476,827,787	0.76
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	134,295	3,345.15 449,238,088	3,512.76 471,746,333	0.76
16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	17,700	18,999.81 336,296,743	24,578.79 435,044,689	0.70
17	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	57,350	6,011.74 344,773,404	6,950.26 398,597,526	0.64
18	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	98,500	3,743.46 368,731,037	3,969.23 390,969,490	0.63

19	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	74,523	3,471.35 258,695,707	4,759.92 354,723,906	0.57
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	70,500	4,338.94 305,895,686	5,028.09 354,480,345	0.57
21	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	40,500	8,905.63 360,678,205	8,654.23 350,496,323	0.56
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,921	4,407.95 325,840,730	4,661.33 344,570,559	0.55
23	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,226,737	240.93 295,558,849	280.00 343,497,278	0.55
24	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	265,701	969.13 257,501,387	1,282.65 340,802,955	0.55
25	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	481,500	647.79 311,912,330	686.26 330,438,909	0.53
26	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	129,900	1,874.19 243,458,047	2,428.27 315,432,494	0.51
27	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	29,925	8,928.97 267,199,700	10,283.68 307,739,283	0.49
28	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	37,900	6,931.86 262,717,604	8,058.74 305,426,496	0.49
29	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	41,100	6,983.12 287,006,631	7,419.88 304,957,208	0.49
30	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	122,502	2,030.55 248,746,804	2,477.69 303,522,654	0.49

（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	96.52%
投資証券	2.09%
合計	98.60%

（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	10.43%
素材	5.50%
資本財・サービス	10.08%
一般消費財・サービス	10.77%
生活必需品	10.94%
ヘルスケア	11.71%
金融	18.39%
情報技術	11.66%
電気通信サービス	3.63%
公益事業	3.40%
その他	0.01%
合計	96.52%

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2013年9月	買建	21	837,721,202	831,572,144	1.33%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

（参考）外国債券インデックスマザーファンド

（1）投資状況（平成25年6月28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		134,592,996,110	97.84
	内 ユーロ	56,935,721,097	41.39
	内 シンガポール	528,970,134	0.38
	内 マレーシア	696,858,548	0.51
	内 ノルウェー	438,877,175	0.32
	内 スウェーデン	727,094,091	0.53
	内 デンマーク	1,145,043,030	0.83
	内 イギリス	10,071,342,004	7.32
	内 スイス	506,015,596	0.37
	内 ポーランド	1,032,347,987	0.75
	内 カナダ	3,414,116,572	2.48
	内 アメリカ	55,013,606,722	39.99
	内 メキシコ	1,364,658,003	0.99
	内 南アフリカ	763,799,852	0.56
	内 オーストラリア	1,954,545,299	1.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,972,129,588	2.16
純資産総額		137,565,125,698	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		1,124,131,520	0.82
	内 日本	1,124,131,520	0.82

（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25年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,358,000	120.00 672,213,679	116.91 654,880,362	4.250000 2023/10/25	0.48
2	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,619,000	109.62 650,797,432	107.00 635,261,422	3.000000 2022/04/25	0.46
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	117.84 654,101,619	111.63 619,626,476	3.625000 2020/02/15	0.45
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,843,000	105.14 605,693,968	103.83 598,136,041	2.500000 2015/03/31	0.43
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	117.10 607,150,897	110.71 574,056,011	3.500000 2020/05/15	0.42
6	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,052,000	103.27 537,877,137	103.26 537,781,756	4.250000 2019/02/01	0.39
7	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,963,000	103.43 526,871,244	103.31 526,234,538	3.750000 2016/08/01	0.38
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,590,000	114.26 527,226,197	112.18 517,642,441	3.500000 2020/04/25	0.38
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	107.95 520,626,304	106.02 514,275,682	3.000000 2015/10/25	0.37
10	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,184,000	99.98 511,008,785	99.98 510,988,341	0.250000 2014/09/30	0.37
11	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,156,000	99.98 508,269,548	100.04 509,543,538	0.250000 2014/10/31	0.37
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,921,000	104.67 507,823,272	103.48 502,045,006	2.375000 2015/02/28	0.36
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.67 510,315,472	108.36 498,198,882	3.250000 2017/03/31	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,522,000	109.83 497,194,946	107.51 486,715,342	3.250000 2016/04/25	0.35
15	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,111,000	101.92 513,573,280	95.34 480,447,325	1.750000 2022/05/15	0.35
16	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,191,000	100.40 513,858,479	93.78 479,973,520	1.625000 2022/08/15	0.35
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	104.71 487,462,389	102.92 479,171,199	3.000000 2014/07/12	0.35
18	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,598,000	103.21 477,295,476	103.07 476,657,432	4.250000 2019/09/01	0.35
19	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,827,000	99.96 475,722,476	100.02 476,003,385	0.250000 2014/12/15	0.35
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.02 477,725,503	103.01 473,096,440	1.875000 2015/06/30	0.34
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	116.05 481,783,472	113.71 472,077,528	3.750000 2021/04/25	0.34

22	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,788,000	99.81 471,180,349	99.65 470,406,189	0.250000 2015/08/15	0.34
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	114.42 498,306,269	107.47 468,010,500	3.125000 2021/05/15	0.34
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,288,000	113.39 479,201,367	110.60 467,424,074	3.750000 2017/04/25	0.34
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,527,000	110.68 494,014,860	104.60 466,851,971	2.625000 2020/08/15	0.34
26	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	110.65 491,912,763	104.32 463,746,537	2.625000 2020/11/15	0.34
27	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,437,000	104.90 458,887,326	103.57 453,078,072	2.625000 2014/12/31	0.33
28	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,589,000	100.00 452,464,856	99.94 452,162,576	0.250000 2015/02/28	0.33
29	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,118,000	109.70 439,645,954	112.50 450,859,122	6.000000 2031/05/01	0.33
30	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,076,000	118.44 475,958,542	111.25 447,089,414	3.625000 2021/02/15	0.33

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.84%
合計	97.84%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

（単位：円）

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2013年7月	買建	789,000	75,811,984	74,158,144	0.05%
		メキシコ・ペソ買/円売 2013年7月	買建	1,967,000	15,438,589	14,890,190	0.01%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2013年7月	買建	264,000	4,524,088	4,308,480	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2013年7月	買建	503,000	7,705,557	7,348,830	0.01%
		ユーロ買/円売 2013年7月	買建	3,179,000	416,033,809	408,565,067	0.30%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2013年7月	買建	351,000	10,712,520	10,438,740	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2013年7月	買建	50,000	5,283,225	5,214,000	0.00%

		南アフリカ・ランド買/円売 2013年7月	買建	806,000	7,936,762	7,987,460	0.01%
		豪ドル買/円売 2013年7月	買建	227,000	21,927,927	20,675,160	0.02%
		英ポンド買/円売 2013年7月	買建	919,000	140,116,728	138,116,510	0.10%
		デンマーク・クローネ買/円売 2013年7月	買建	677,000	11,856,165	11,664,710	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2013年7月	買建	70,000	5,591,180	5,446,700	0.00%
		米ドル買/円売 2013年7月	買建	4,213,000	423,771,728	415,317,529	0.30%

(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）

2013年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,668円
純資産総額	38億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−1.7%
3カ月間	4.1%
6カ月間	15.9%
1年間	27.7%
3年間	31.1%
5年間	9.0%
設定来	26.7%

※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	第８期 13年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

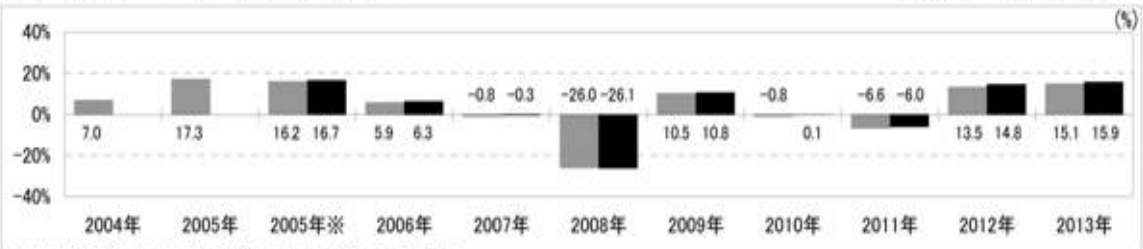
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄（除く債券）	国・地域名	比率
国内債券	285	38.9%	日本円	70.4%	直接利回り(%)	1.7	トヨタ自動車	日本	1.5%
国内株式・先物	1,297	30.9%	米ドル	15.8%	最終利回り(%)	0.9	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.9%
外国株式・先物	1,170	19.4%	ユーロ	6.7%	修正デュレーション	7.1	三井住友フィナンシャルG	日本	0.7%
外国債券	679	9.6%	英ポンド	2.7%	残存年数	8.3	TOPIX先物　2509月	日本	0.6%
外国リート	49	0.4%	カナダ・ドル	1.2%	債券格付別構成	比率	本田技研	日本	0.6%
			豪ドル	0.9%	AAA	13.7%	ソフトバンク	日本	0.5%
			スイス・フラン	0.9%	AA	72.8%	みずほフィナンシャルG	日本	0.5%
			スウェーデン・クローネ	0.3%	A	6.5%	日本たばこ産業	日本	0.4%
			香港ドル	0.3%	BBB	3.0%	日本電信電話	日本	0.4%
コール・ローン、その他		1.7%	その他	0.8%	BB以下・無格付	4.1%	キヤノン	日本	0.4%
合計	3,480	−	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		6.5%

※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4.1%保有しております。
※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは合成ベンチマークです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2005年※は設定日（6月6日）から年末、2013年は6月28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す。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

２ 【換金（解約）手続等】

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

＜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なることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス http://www.daiwa-am.co.jp/

委託会社は、金融商品取引所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。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

・外国の株式：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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

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

きは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金にかかる請求権

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

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

② 償還金にかかる請求権

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

③ 換金請求権

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

第３ 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）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8期計算期間（平成24年6月6日から平成25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５０

ダイワ・ライフ・バランス５０
(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成24年6月5日現在	第8期 平成25年6月5日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,978,414	21,230,409
親投資信託受益証券	2,503,459,052	3,753,467,500
未収入金	1,425,000	4,768,000
流動資産合計	2,518,862,466	3,779,465,909
資産合計	2,518,862,466	3,779,465,909
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,812,345	7,075,703
未払受託者報酬	356,790	543,460
未払委託者報酬	2,022,025	3,079,797
その他未払費用	89,124	135,789
流動負債合計	5,280,284	10,834,749
負債合計	5,280,284	10,834,749
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,624,009,573	※1 2,976,248,472
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △110,427,391	※2 792,382,688
（分配準備積立金）	198,733	763,845,347
元本等合計	2,513,582,182	3,768,631,160
純資産合計	2,513,582,182	3,768,631,160
負債純資産合計	2,518,862,466	3,779,465,909

(2) 【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日	第8期 自 平成24年6月6日 至 平成25年6月5日
営業収益		
受取利息	7,185	13,236
有価証券売買等損益	△55,537,584	875,090,448
営業収益合計	△55,530,399	875,103,684
営業費用		
受託者報酬	521,308	970,336
委託者報酬	2,954,558	5,499,002
その他費用	130,174	242,432
営業費用合計	3,606,040	6,711,770
営業利益又は営業損失（△）	△59,136,439	868,391,914
経常利益又は経常損失（△）	△59,136,439	868,391,914
当期純利益又は当期純損失（△）	△59,136,439	868,391,914
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,223,295	49,718,481
期首剰余金又は期首欠損金（△）	623,562	△110,427,391
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,968,130	84,136,646
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,968,130	8,057,502
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	―	76,079,144
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,659,349	―
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	52,659,349	―
分配金	― ※1	― ※1
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△110,427,391	792,382,688

(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8期 自 平成24年6月6日 至 平成25年6月5日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第7期 平成24年6月5日現在	第8期 平成25年6月5日現在
1. ※1 期首元本額	674,407,468円	2,624,009,573円
期中追加設定元本額	2,048,718,597円	630,210,873円
期中一部解約元本額	99,116,492円	277,971,974円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,624,009,573口	2,976,248,472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110,427,391円であります。	―――――――

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第7期 自 平成23年6月7日 至 平成24年6月5日	第8期 自 平成24年6月6日 至 平成25年6月5日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（796,186,320円）及び分配準備積立金（198,733円）より分配可能額は796,385,053円（1万口当たり3,034.99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。	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（12,749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（763,652,414円）、投資信託約款に規定される収益調整金（903,110,593円）及び分配準備積立金（180,184円）より分配可能額は1,666,955,940円（1万口当たり5,600.86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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	第8期 自 平成24年6月6日 至 平成25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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	第8期 平成25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7期 平成24年6月5日現在	第8期 平成25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	△55,843,990	795,978,884
合計	△55,843,990	795,978,884

（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7期 平成24年6月5日現在	第8期 平成25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8期 自　平成24年6月6日 至　平成25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7期 平成24年6月5日現在	第8期 平成25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）	0.9579円 (9,579円)	1.2662円 (12,662円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	1,759,846,594	1,089,521,026	
	外国株式インデックスマザーファンド	557,571,221	767,218,000	
	外国債券インデックスマザーファンド	161,108,965	379,814,384	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	1,316,537,138	1,516,914,090	
親投資信託受益証券 合計			3,753,467,500	
合計			3,753,467,500	

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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

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24年6月5日現在 金 額（円）	平成25年6月5日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,838,274,747	949,653,006
株式	※3	79,319,981,530	109,362,132,770
派生商品評価勘定		157,088	―
未収入金		―	982,523,567
未収配当金		954,629,086	952,117,760
前払金		450,735,000	60,325,000
流動資産合計		82,563,777,451	112,306,752,103
資産合計		82,563,777,451	112,306,752,103
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		260,034,833	135,979,500
未払金		936,956,784	―
未払解約金		8,400,000	426,290,000
流動負債合計		1,205,391,617	562,269,500
負債合計		1,205,391,617	562,269,500
純資産の部			
元本等			
元本	※1	206,749,163,617	180,501,788,648
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△125,390,777,783	△68,757,306,045
元本等合計		81,358,385,834	111,744,482,603
純資産合計		81,358,385,834	111,744,482,603
負債純資産合計		82,563,777,451	112,306,752,103

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24年6月6日 至 平成25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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成24年6月5日現在	平成25年6月5日現在
1. ※1 期首	平成23年6月7日	平成24年6月6日
期首元本額	198,764,066,393円	206,749,163,617円
期中追加設定元本額	20,037,509,686円	13,982,531,832円
期中一部解約元本額	12,052,412,462円	40,229,906,801円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信１号	2,073,128,132円	1,858,039,037円
トピックス・インデックスファンド	10,190,880,260円	8,796,777,937円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	33,020,125,327円	25,852,002,103円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	806,767,689円	683,890,219円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	399,582,196円	288,500,715円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	6,715,313,880円	5,509,154,079円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	394,843,663円	288,354,016円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	8,790,707,274円	7,421,806,945円
ダイワ・スマートアロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	―円	2,541,771円
スマート・ミックス・Ｄガード(為替ヘッジあり)	―円	14,599,617円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	63,016,531,259円	63,904,134,191円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,583,534,320円	2,145,855,384円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,799,467,896円	1,759,846,594円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,341,640,945円	1,469,341,665円
年金ダイワ日本株式インデックス	1,995,740,048円	2,365,979,066円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	19,170,245円	16,132,337円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	21,518,154円	31,089,378円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	3,671,527円	5,423,454円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	465,716,467円	353,754,525円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	3,592,764,232円	2,547,379,926円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	1,933,671,204円	1,423,916,223円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	116,412,284円	86,670,169円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	785,168,356円	593,324,737円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	354,247,574円	272,106,638円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	4,206,789,190円	3,019,562,406円

ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	620,564,074円	455,781,351円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	32,575,018,842円	25,004,284,725円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	2,602,685,126円	1,344,720,094円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	5,495,444,871円	2,912,573,304円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,923,310,487円	2,042,862,770円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	558,011,518円	372,052,175円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	627,427,388円	440,857,099円
ダイワライフスタイル２５	216,822,950円	176,445,220円
ダイワライフスタイル５０	613,678,456円	532,426,001円
ダイワライフスタイル７５	468,069,915円	442,709,084円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	15,420,737,868円	16,066,893,693円
計	206,749,163,617円	180,501,788,648円
2.　期末日における受益権の総数	206,749,163,617口	180,501,788,648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125,390,777,783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68,757,306,045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。 株式　494,800,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　920,400,000円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年6月6日 至 平成25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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成25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24年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成25年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△5,119,528,262	32,499,774,272
合計	△5,119,528,262	32,499,774,272

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年9月21日から平成24年6月5日まで、及び平成24年9月20日から平成25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24年6月5日 現在				平成25年6月5日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	2,305,420,000	－	2,046,230,000	△259,190,000	2,518,045,000	－	2,382,600,000	△135,445,000
合計	2,305,420,000	－	2,046,230,000	△259,190,000	2,518,045,000	－	2,382,600,000	△135,445,000

（注）　1．　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成24年6月5日現在	平成25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）	0.3935円 (3,935円)	0.6191円 (6,191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	43,000	236	10,148,000	
日本水産	100,000	198	19,800,000	
マルハニチロホールディングス	175,000	176	30,800,000	
サカタのタネ	11,500	1,285	14,777,500	
ホクト	7,100	1,731	12,290,100	
ショーボンドＨＤ	7,900	3,760	29,704,000	
ミライト・ホールディングス	23,900	924	22,083,600	
日鉄鉱業	24,000	399	9,576,000	
三井松島	66,000	150	9,900,000	
国際石油開発帝石	973	435,500	423,741,500	
日本海洋掘削	2,400	8,870	21,288,000	
関東天然瓦斯	12,000	634	7,608,000	
石油資源開発	12,000	4,000	48,000,000	
安藤・間	57,300	220	12,606,000	
東急建設	38,950	229	8,919,550	
コムシスホールディングス	40,500	1,236	50,058,000	
ミサワホーム	10,600	1,995	21,147,000	
高松コンストラクションＧＰ	5,900	1,594	9,404,600	
東建コーポレーション	3,310	4,890	16,185,900	
大成建設	415,000	317	131,555,000	
大　林　組	246,000	481	118,326,000	
清水建設	250,000	344	86,000,000	
長谷工コーポレーシヨン	527,000	127	66,929,000	
鹿島建設	360,000	292	105,120,000	
不動テトラ	71,800	160	11,488,000	
鉄建建設	68,000	111	7,548,000	
太平工業	18,000	359	6,462,000	
西松建設	110,000	213	23,430,000	
前田建設	52,000	456	23,712,000	
奥　村　組	72,000	348	25,056,000	
東鉄工業	12,200	1,546	18,861,200	
戸田建設	95,000	269	25,555,000	
熊　谷　組	79,000	99	7,821,000	
北野建設	31,000	195	6,045,000	
三井ホーム	13,000	478	6,214,000	
矢作建設	12,500	399	4,987,500	
大東建託	30,400	8,690	264,176,000	
ＮＩＰＰＯ	20,000	1,361	27,220,000	
東亜道路	20,000	440	8,800,000	
前田道路	24,000	1,340	32,160,000	
日本道路	28,000	524	14,672,000	
東亜建設	83,000	140	11,620,000	
東洋建設	31,400	254	7,975,600	

五洋建設	105,000	238	24,990,000	
福　田　組	17,000	356	6,052,000	
住友林業	56,200	1,182	66,428,400	
日本基礎技術	13,500	303	4,090,500	
日成ビルド工業	32,000	167	5,344,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	58,000	162	9,396,000	
巴コーポレーション	16,300	322	5,248,600	
パナホーム	30,000	645	19,350,000	
大和ハウス	202,000	1,838	371,276,000	
ライト工業	22,500	532	11,970,000	
積水ハウス	242,000	1,294	313,148,000	
ユアテック	13,000	277	3,601,000	
中電工	11,500	950	10,925,000	
関　電　工	34,000	436	14,824,000	
きんでん	52,000	803	41,756,000	
東京エネシス	8,000	420	3,360,000	
トーエネック	11,000	447	4,917,000	
住友電設	7,500	1,271	9,532,500	
日本電設工業	16,000	1,026	16,416,000	
協和エクシオ	29,800	1,100	32,780,000	
新日本空調	9,000	557	5,013,000	
日本工営	30,000	375	11,250,000	
ＮＤＳ	16,000	281	4,496,000	
九電工	13,000	418	5,434,000	
三機工業	21,000	559	11,739,000	
日　揮	81,000	3,300	267,300,000	
中外炉工業	29,000	265	7,685,000	
太平電業	9,000	600	5,400,000	
高砂熱学	22,800	765	17,442,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	7,700	2,117	16,300,900	
朝日工業社	11,000	319	3,509,000	
大　氣　社	11,900	2,222	26,441,800	
ダイダン	11,000	515	5,665,000	
日比谷総合設備	10,100	901	9,100,100	
東芝プラントシステム	14,000	1,409	19,726,000	
日本製粉	50,000	454	22,700,000	
日清製粉Ｇ本社	72,000	1,125	81,000,000	
昭和産業	36,000	290	10,440,000	
鳥越製粉	7,600	606	4,605,600	
協同飼料	57,000	113	6,441,000	
中部飼料	9,900	515	5,098,500	
日本配合飼料	42,000	123	5,166,000	
日本甜菜糖	49,000	168	8,232,000	
三井製糖	37,000	301	11,137,000	
日本Ｍ＆Ａセンター	4,300	5,230	22,489,000	
アコーディア・ゴルフ	359	102,100	36,653,900	
パソナグループ	93	62,300	5,793,900	
ＧＣＡサヴィアン	3,400	1,012	3,440,800	
エス・エム・エス	5,400	1,353	7,306,200	
テンプホールディングス	11,400	2,295	26,163,000	
クックパッド	3,800	2,768	10,518,400	
森永製菓	72,000	196	14,112,000	
中　村　屋	21,000	395	8,295,000	
江崎グリコ	26,000	948	24,648,000	
名糖産業	3,600	980	3,528,000	

不　二　家	57,000	189	10,773,000	
山崎製パン	55,000	1,131	62,205,000	
モロゾフ	24,000	300	7,200,000	
亀田製菓	5,100	2,712	13,831,200	
カルビー	7,700	9,300	71,610,000	
森永乳業	56,000	277	15,512,000	
ヤクルト	47,200	4,130	194,936,000	
明治ホールディングス	22,900	4,280	98,012,000	
雪印メグミルク	13,000	1,405	18,265,000	
プリマハム	59,000	206	12,154,000	
日本ハム	62,000	1,413	87,606,000	
伊藤ハム	48,000	429	20,592,000	
丸大食品	35,000	296	10,360,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,000	857	5,999,000	
スタジオアリス	4,500	1,472	6,624,000	
シミックホールディングス	3,800	2,183	8,295,400	
システナ	8,900	756	6,728,400	
ＮＥＣフィールディング	7,100	1,189	8,441,900	
新日鉄住金ＳＯＬ	5,400	1,732	9,352,800	
綜合警備保障	28,400	1,585	45,014,000	
日本駐車場開発	1,030	7,510	7,735,300	
カカクコム	21,400	2,780	59,492,000	
ツクイ	8,400	1,051	8,828,400	
エムスリー	186	211,200	39,283,200	
ディー・エヌ・エー	38,000	2,075	78,850,000	
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	10,460	6,530	68,303,800	
ぐるなび	6,700	1,044	6,994,800	
ＰＧＭホールディングス	133	94,400	12,555,200	
サッポロホールディングス	140,000	347	48,580,000	
アサヒグループホールディン	161,600	2,380	384,608,000	
キリンＨＤ	346,000	1,594	551,524,000	
宝ホールディングス	67,000	930	62,310,000	
オエノンホールディングス	34,000	228	7,752,000	
養　命　酒	9,000	821	7,389,000	
三国コカ・コーラ	8,900	1,141	10,154,900	
コカ・コーラウエスト	26,400	1,736	45,830,400	
コカコーラセントラルジャパン	10,300	1,460	15,038,000	
ダイドードリンコ	4,000	3,780	15,120,000	
伊　藤　園	22,500	2,076	46,710,000	
キーコーヒー	6,600	1,520	10,032,000	
日清オイリオグループ	34,000	352	11,968,000	
不二製油	20,300	1,536	31,180,800	
Ｊ－オイルミルズ	37,000	293	10,841,000	
ローソン	26,500	7,160	189,740,000	
サンエー	3,000	4,305	12,915,000	
カワチ薬品	5,600	2,005	11,228,000	
エービーシー・マート	7,800	3,745	29,211,000	
アスクル	5,800	1,668	9,674,400	
ゲオホールディングス	134	93,500	12,529,000	
ポイント	6,840	4,380	29,959,200	
伊藤忠食品	1,900	3,425	6,507,500	
くらコーポレーション	5,200	1,538	7,997,600	
キャンドゥ	5,500	1,568	8,624,000	
エレマテック	2,100	1,272	2,671,200	
パル	4,700	3,090	14,523,000	

エディオン	34,000	447	15,198,000	
あらた	18,000	367	6,606,000	
サーラコーポレーション	7,000	471	3,297,000	
あみやき亭	18	275,100	4,951,800	
ひらまつ	10,600	690	7,314,000	
双日	470,900	171	80,523,900	
アルフレッサホールディングス	18,300	4,820	88,206,000	
大黒天物産	1,500	2,752	4,128,000	
ハニーズ	6,250	1,085	6,781,250	
キッコーマン	68,000	1,595	108,460,000	
味　の　素	198,000	1,391	275,418,000	
キユーピー	37,000	1,358	50,246,000	
ハウス食品	26,500	1,496	39,644,000	
カ　ゴ　メ	25,900	1,627	42,139,300	
焼津水産化工	7,400	820	6,068,000	
アリアケジャパン	7,700	2,156	16,601,200	
ニチレイ	90,000	492	44,280,000	
横浜冷凍	20,800	770	16,016,000	
東洋水産	37,000	3,190	118,030,000	
日清食品ＨＤ	30,700	3,800	116,660,000	
永　谷　園	7,000	865	6,055,000	
フジッコ	6,000	1,111	6,666,000	
ロックフィールド	5,200	1,639	8,522,800	
日本たばこ産業	448,800	3,380	1,516,944,000	
わらべや日洋	5,900	1,511	8,914,900	
片倉工業	10,700	1,280	13,696,000	
グ　ン　ゼ	59,000	240	14,160,000	
ヒューリック	93,300	839	78,278,700	
アルペン	5,300	1,830	9,699,000	
アルコニックス	3,000	1,991	5,973,000	
ビックカメラ	246	41,000	10,086,000	
ＤＣＭホールディングス	37,000	705	26,085,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,500	2,707	28,423,500	
あい　ホールディングス	13,400	929	12,448,600	
Ｊ．　フロント　リテイリング	172,000	699	120,228,000	
ドトール・日レスＨＤ	12,400	1,292	16,020,800	
マツモトキヨシＨＬＤＧＳ	12,300	2,481	30,516,300	
スタートトゥデイ	16,300	1,497	24,401,100	
ココカラファイン	7,300	3,035	22,155,500	
三越伊勢丹ＨＤ	142,500	1,218	173,565,000	
東洋紡	335,000	154	51,590,000	
ユニチカ	241,000	54	13,014,000	
富士紡ホールディングス	41,000	236	9,676,000	
日清紡ホールディングス	49,000	688	33,712,000	
倉敷紡績	86,000	174	14,964,000	
ダイワボウＨＤ	72,000	163	11,736,000	
シキボウ	65,000	117	7,605,000	
日東紡績	60,000	302	18,120,000	
トヨタ紡織	25,800	1,381	35,629,800	
ウエルシアＨＤ	2,800	4,265	11,942,000	
クリエイトＳＤＨ	3,400	3,455	11,747,000	
バイタルＫＳＫＨＤ	13,400	735	9,849,000	
ＵＫＣホールディングス	5,200	1,705	8,866,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	26,900	301	8,096,900	
日本毛織	25,000	713	17,825,000	

ダイドーリミテツド	9,900	620	6,138,000	
野村不動産ＨＬＤＧＳ	34,600	2,170	75,082,000	
フージャースＨＤ	11,000	963	10,593,000	
帝国繊維	9,000	740	6,660,000	
ブックオフコーポレーション	5,500	693	3,811,500	
日本コークス工業	80,500	108	8,694,000	
あさひ	4,500	1,523	6,853,500	
コスモス薬品	3,600	10,000	36,000,000	
シップヘルスケアＨＤ	10,900	3,585	39,076,500	
セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ	297,500	3,410	1,014,475,000	
ツルハホールディングス	6,600	8,040	53,064,000	
サンマルクホールディングス	2,600	4,535	11,791,000	
トリドール	7,100	1,083	7,689,300	
クスリのアオキ	1,300	5,860	7,618,000	
帝　人	288,000	221	63,648,000	
東　レ	582,000	650	378,300,000	
ク　ラ　レ	128,700	1,394	179,407,800	
旭　化　成	471,000	660	310,860,000	
サカイ　オーベックス	34,000	126	4,284,000	
稲葉製作所	4,400	1,354	5,957,600	
宮地エンジニアリングＧ	34,000	146	4,964,000	
トーカロ	4,900	1,372	6,722,800	
ＳＵＭＣＯ	48,200	1,227	59,141,400	
住江織物	31,000	230	7,130,000	
日本バイリーン	13,000	458	5,954,000	
芦森工業	26,000	142	3,692,000	
アツギ	66,000	109	7,194,000	
ダイニック	25,000	173	4,325,000	
セーレン	21,200	643	13,631,600	
小松精練	16,000	475	7,600,000	
ワコールホールディングス	42,000	992	41,664,000	
ホギメディカル	5,100	5,340	27,234,000	
ＴＳＩホールディングス	40,700	628	25,559,600	
ＩＴホールディングス	25,100	1,450	36,395,000	
グリー	37,600	989	37,186,400	
コーエーテクモＨＤ	15,900	827	13,149,300	
三菱総合研究所	3,800	2,051	7,793,800	
ネクソン	58,300	1,053	61,389,900	
特種東海製紙	41,000	192	7,872,000	
ドワンゴ	37	524,000	19,388,000	
マクロミル	7,600	1,243	9,446,800	
ティーガイア	9,600	865	8,304,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	3,100	2,140	6,634,000	
ザッパラス	63	81,500	5,134,500	
インターネットイニシアティブ	8,900	3,460	30,794,000	
ＳＲＡホールディングス	5,800	1,093	6,339,400	
朝日ネット	10,000	422	4,220,000	
王子ホールディングス	332,000	342	113,544,000	
日本製紙	37,100	1,221	45,299,100	
三菱製紙	138,000	89	12,282,000	
北越紀州製紙	47,000	425	19,975,000	
中越パルプ	38,000	148	5,624,000	
大王製紙	33,000	537	17,721,000	
レンゴー	56,000	475	26,600,000	
トーモク	33,000	307	10,131,000	

ザ・パック	5,700	1,563	8,909,100	
昭和電工	475,000	147	69,825,000	
住友化学	523,000	311	162,653,000	
住友精化	19,000	372	7,068,000	
日産化学	53,900	1,227	66,135,300	
クレハ	52,000	342	17,784,000	
テイカ	20,000	273	5,460,000	
石原産業	168,000	77	12,936,000	
日本曹達	51,000	463	23,613,000	
東ソー	211,000	313	66,043,000	
トクヤマ	117,000	300	35,100,000	
セントラル硝子	66,000	295	19,470,000	
東亜合成	87,000	414	36,018,000	
ダイソー	35,000	287	10,045,000	
電気化学	156,000	320	49,920,000	
イビデン	44,200	1,578	69,747,600	
信越化学	135,200	6,260	846,352,000	
日本カーバイド	29,000	532	15,428,000	
堺　化　学	33,000	282	9,306,000	
エア・ウォーター	63,000	1,414	89,082,000	
大陽日酸	99,000	680	67,320,000	
日本パーカライジング	18,000	1,749	31,482,000	
高圧ガス	13,000	495	6,435,000	
四国化成	14,000	619	8,666,000	
ステラ　ケミファ	4,300	1,634	7,026,200	
日本触媒	54,000	963	52,002,000	
大日精化	32,000	401	12,832,000	
カネカ	91,000	612	55,692,000	
協和発酵キリン	91,000	1,050	95,550,000	
三菱瓦斯化学	121,000	723	87,483,000	
三井化学	330,000	221	72,930,000	
ＪＳＲ	69,300	1,951	135,204,300	
東京応化工業	14,900	2,226	33,167,400	
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	472,000	460	217,120,000	
日本合成化学	18,000	1,084	19,512,000	
ダイセル	92,000	780	71,760,000	
住友ベークライト	59,000	368	21,712,000	
積水化学	155,000	1,014	157,170,000	
日本ゼオン	67,000	1,019	68,273,000	
アイカ工業	21,900	1,888	41,347,200	
宇部興産	363,000	188	68,244,000	
積水樹脂	12,000	1,238	14,856,000	
タキロン	23,000	412	9,476,000	
旭有機材	28,000	208	5,824,000	
日立化成	32,300	1,582	51,098,600	
大倉工業	24,000	355	8,520,000	
積水化成品	20,000	252	5,040,000	
群栄化学	26,000	374	9,724,000	
日本カーリツト	10,500	565	5,932,500	
日本化薬	55,000	1,109	60,995,000	
イーピーエス	96	125,000	12,000,000	
パナソニック　インフォシス	2,200	2,212	4,866,400	
フェイス	426	11,400	4,856,400	
アミューズ	3,400	2,153	7,320,200	
野村総合研究所	40,500	2,856	115,668,000	

ケネディクス	760	51,200	38,912,000	
電通	68,600	3,290	225,694,000	
インテージ	3,200	2,265	7,248,000	
シンプレクスホールディング	184	35,950	6,614,800	
イオンファンタジー	3,600	1,583	5,698,800	
日本精化	8,400	570	4,788,000	
ＡＤＥＫＡ	32,400	915	29,646,000	
日油	60,000	518	31,080,000	
ミヨシ油脂	44,000	143	6,292,000	
花　王	199,500	3,130	624,435,000	
第一工業製薬	23,000	240	5,520,000	
三洋化成	24,000	576	13,824,000	
武田薬品	282,400	4,345	1,227,028,000	
アステラス製薬	167,600	4,950	829,620,000	
大日本住友製薬	55,100	1,313	72,346,300	
塩野義製薬	111,200	1,925	214,060,000	
田辺三菱製薬	60,800	1,252	76,121,600	
あすか製薬	13,000	665	8,645,000	
日本新薬	17,000	1,514	25,738,000	
中外製薬	87,200	1,944	169,516,800	
科研製薬	31,000	1,451	44,981,000	
エーザイ	92,200	3,750	345,750,000	
ロート製薬	32,000	1,477	47,264,000	
小野薬品	36,800	6,450	237,360,000	
久光製薬	23,300	4,730	110,209,000	
持田製薬	29,000	1,225	35,525,000	
参天製薬	26,000	4,305	111,930,000	
扶桑薬品	34,000	336	11,424,000	
日本ケミファ	15,000	569	8,535,000	
ツムラ	21,400	2,697	57,715,800	
日医工	11,200	2,075	23,240,000	
テ　ル　モ	55,500	4,605	255,577,500	
みらかホールディングス	19,900	4,285	85,271,500	
キッセイ薬品工業	14,700	1,875	27,562,500	
生化学工業	15,800	1,222	19,307,600	
栄研化学	7,400	1,801	13,327,400	
日水製薬	5,900	1,091	6,436,900	
鳥居薬品	5,600	2,226	12,465,600	
東和薬品	4,000	4,125	16,500,000	
沢井製薬	5,100	10,710	54,621,000	
ゼリア新薬工業	11,000	1,422	15,642,000	
第一三共	236,800	1,593	377,222,400	
キョーリン製薬ＨＤ	20,600	2,153	44,351,800	
大幸薬品	4,900	1,490	7,301,000	
ダイト	3,100	1,295	4,014,500	
大塚ホールディングス	148,100	3,165	468,736,500	
大正製薬ＨＤ	17,600	6,470	113,872,000	
大日本塗料	60,000	141	8,460,000	
日本ペイント	67,000	1,043	69,881,000	
関西ペイント	86,000	1,251	107,586,000	
中国塗料	26,000	433	11,258,000	
藤倉化成	13,000	425	5,525,000	
太陽ホールディングス	6,700	3,205	21,473,500	
ＤＩＣ	281,000	220	61,820,000	
サカタインクス	20,000	669	13,380,000	

東洋インキＳＣホールディン	70,000	451	31,570,000	
アルプス技研	5,700	984	5,608,800	
サニックス	13,500	1,093	14,755,500	
オリエンタルランド	22,400	14,020	314,048,000	
ダスキン	20,100	1,710	34,371,000	
パーク２４	37,900	1,813	68,712,700	
明光ネットワークジャパン	9,200	1,197	11,012,400	
ファルコＳＤホールディングス	5,800	1,350	7,830,000	
フジ・メディア・ＨＤ	695	182,500	126,837,500	
ラウンドワン	26,600	593	15,773,800	
リゾートトラスト	13,500	2,622	35,397,000	
オービック	2,490	24,480	60,955,200	
ヤフー	5,146	45,400	233,628,400	
ビー・エム・エル	4,900	2,476	12,132,400	
トレンドマイクロ	28,800	2,932	84,441,600	
もしもしホットライン	13,800	1,101	15,193,800	
東急コミュニティー	2,400	4,370	10,488,000	
リソー教育	984	9,730	9,574,320	
日本オラクル	13,600	3,870	52,632,000	
アルファシステムズ	3,400	1,144	3,889,600	
フューチャーアーキテクト	141	46,000	6,486,000	
シーエーシー	6,000	896	5,376,000	
ユー・エス・エス	8,310	11,390	94,650,900	
オービックビジネスＣ	2,400	5,590	13,416,000	
伊藤忠テクノソリュー	8,500	4,215	35,827,500	
アイティフォー	13,700	418	5,726,600	
大塚商会	6,500	9,480	61,620,000	
総合メディカル	2,100	3,490	7,329,000	
サイボウズ	175	24,620	4,308,500	
セントラルスポーツ	4,200	1,501	6,304,200	
電通国際情報Ｓ	6,500	1,241	8,066,500	
ウェザーニューズ	2,700	2,101	5,672,700	
ＷＯＷＯＷ	31	279,300	8,658,300	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	161,600	2,007	324,331,200	
コニカミノルタ	191,500	717	137,305,500	
資　生　堂	134,300	1,410	189,363,000	
ライオン	86,000	555	47,730,000	
高砂香料	27,000	480	12,960,000	
マンダム	9,100	3,080	28,028,000	
ミルボン	4,600	3,250	14,950,000	
ファンケル	18,200	1,144	20,820,800	
コーセー	13,900	2,363	32,845,700	
ドクターシーラボ	48	291,300	13,982,400	
ポーラ・オルビスＨＤ	9,000	3,175	28,575,000	
ノエビアホールディングス	5,500	1,445	7,947,500	
エステー	5,900	998	5,888,200	
コ　ニ　シ	6,900	1,670	11,523,000	
長谷川香料	10,300	1,375	14,162,500	
小林製薬	10,800	4,700	50,760,000	
荒川化学工業	7,600	813	6,178,800	
日本高純度化学	29	216,000	6,264,000	
アース製薬	4,900	3,375	16,537,500	
イハラケミカル	17,000	632	10,744,000	
大成ラミック	2,100	2,316	4,863,600	
クミアイ化学	20,000	593	11,860,000	

日本農薬	20,000	910	18,200,000	
昭和シエル石油	71,100	751	53,396,100	
コスモ石油	212,000	179	37,948,000	
ニチレキ	12,000	696	8,352,000	
東燃ゼネラル石油	110,000	967	106,370,000	
ユシロ化学	6,600	920	6,072,000	
ＡＯＣホールディングス	21,500	313	6,729,500	
出光興産	9,000	7,750	69,750,000	
ＪＸホールディングス	832,800	472	393,081,600	
横浜ゴム	86,000	981	84,366,000	
東洋ゴム	67,000	502	33,634,000	
ブリヂストン	236,600	3,220	761,852,000	
住友ゴム	59,100	1,561	92,255,100	
オカモト	22,000	304	6,688,000	
アキレス	76,000	133	10,108,000	
ニッタ	8,100	1,869	15,138,900	
東海ゴム工業	14,000	830	11,620,000	
三ツ星ベルト	21,000	476	9,996,000	
バンドー化学	28,000	359	10,052,000	
鬼怒川ゴム	17,000	553	9,401,000	
旭　硝　子	371,000	704	261,184,000	
日本板硝子	369,000	102	37,638,000	
日本山村硝子	29,000	169	4,901,000	
日本電気硝子	136,000	497	67,592,000	
住友大阪セメント	138,000	283	39,054,000	
太平洋セメント	425,000	281	119,425,000	
日本ヒユーム	10,000	590	5,900,000	
日本コンクリート	17,000	263	4,471,000	
東海カーボン	68,000	276	18,768,000	
日本カーボン	48,000	195	9,360,000	
東洋炭素	4,100	1,920	7,872,000	
ノリタケ	41,000	258	10,578,000	
ＴＯＴＯ	118,000	989	116,702,000	
日本碍子	99,000	1,204	119,196,000	
日本特殊陶業	65,000	1,750	113,750,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,100	3,445	7,234,500	
品川リフラクトリーズ	23,000	197	4,531,000	
黒崎播磨	22,000	203	4,466,000	
フジミインコーポレーテッド	7,700	1,075	8,277,500	
ニチアス	36,000	605	21,780,000	
新日鐵住金	3,190,000	254	810,260,000	
神戸製鋼所	1,057,000	129	136,353,000	
合同製鐵	49,000	160	7,840,000	
ＪＦＥホールディングス	193,100	2,066	398,944,600	
日新製鋼ＨＤ	32,800	863	28,306,400	
東京製鐵	44,700	333	14,885,100	
共英製鋼	7,600	1,506	11,445,600	
大和工業	15,400	3,075	47,355,000	
東京鐵鋼	19,000	346	6,574,000	
大阪製鐵	3,800	1,601	6,083,800	
淀川製鋼所	54,000	400	21,600,000	
東洋鋼鈑	19,000	326	6,194,000	
住友鋼管	6,200	949	5,883,800	
丸一鋼管	24,400	2,438	59,487,200	
大同特殊鋼	116,000	497	57,652,000	

日本冶金工	75,000	118	8,850,000	
山陽特殊製鋼	39,000	468	18,252,000	
愛知製鋼	39,000	437	17,043,000	
日立金属	54,000	1,027	55,458,000	
大平洋金属	53,000	446	23,638,000	
日本電工	35,000	288	10,080,000	
栗本鉄工所	41,000	270	11,070,000	
日本製鋼所	117,000	564	65,988,000	
三菱製鋼	52,000	212	11,024,000	
日本軽金属ＨＤ	176,600	112	19,779,200	
三井金属	197,000	222	43,734,000	
東邦亜鉛	49,000	304	14,896,000	
三菱マテリアル	445,000	316	140,620,000	
住友鉱山	195,000	1,255	244,725,000	
ＤＯＷＡホールディングス	85,000	803	68,255,000	
古河機金	147,000	150	22,050,000	
大阪チタニウム	7,600	1,885	14,326,000	
東邦チタニウム	13,700	774	10,603,800	
住友軽金属	194,000	98	19,012,000	
古河スカイ	30,000	289	8,670,000	
古河電工	246,000	232	57,072,000	
住友電工	264,900	1,184	313,641,600	
フジクラ	130,000	355	46,150,000	
昭和電線ＨＬＤＧＳ	125,000	88	11,000,000	
タツタ電線	17,000	940	15,980,000	
日立電線	64,000	173	11,072,000	
リョービ	47,000	267	12,549,000	
アサヒＨＤ	11,700	1,594	18,649,800	
東洋製罐グループＨＤ	53,600	1,349	72,306,400	
ホッカンホールディングス	21,000	293	6,153,000	
コロナ	3,400	1,037	3,525,800	
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	16,000	895	14,320,000	
駒井ハルテック	22,000	211	4,642,000	
三和ホールディングス	74,000	538	39,812,000	
文化シヤツター	23,000	563	12,949,000	
三協立山	10,600	2,191	23,224,600	
ＬＩＸＩＬグループ	104,900	2,330	244,417,000	
ノーリツ	15,200	1,625	24,700,000	
長府製作所	6,900	1,977	13,641,300	
リンナイ	12,100	7,760	93,896,000	
ユニプレス	12,800	1,752	22,425,600	
ダイニチ工業	4,600	740	3,404,000	
岡　部	18,300	887	16,232,100	
東　プ　レ	14,700	898	13,200,600	
高周波熱錬	11,500	672	7,728,000	
東京製綱	63,000	141	8,883,000	
パイオラックス	3,500	2,449	8,571,500	
日本発条	54,700	1,083	59,240,100	
三浦工業	10,200	2,204	22,480,800	
タ　ク　マ	29,000	786	22,794,000	
ツ　ガ　ミ	24,000	565	13,560,000	
オークマ	53,000	784	41,552,000	
東芝機械	41,000	487	19,967,000	
ア　マ　ダ	119,000	690	82,110,000	
アイダエンジニア	20,500	707	14,493,500	

牧野フライス	39,000	631	24,609,000	
オーエスジー	31,300	1,456	45,572,800	
旭ダイヤモンド	19,400	941	18,255,400	
森精機製作所	41,500	1,137	47,185,500	
ディスコ	8,600	6,420	55,212,000	
日東工器	3,700	1,720	6,364,000	
豊田自動織機	65,000	3,905	253,825,000	
大阪機工	49,000	150	7,350,000	
島精機製作所	10,800	2,152	23,241,600	
日阪製作所	11,000	854	9,394,000	
やまびこ	3,500	3,210	11,235,000	
ナブテスコ	37,600	1,998	75,124,800	
三井海洋開発	7,100	2,991	21,236,100	
ＳＭＣ	22,400	19,520	437,248,000	
新川	9,100	778	7,079,800	
ホソカワミクロン	16,000	717	11,472,000	
ユニオンツール	4,500	1,836	8,262,000	
オイレス工業	8,000	2,039	16,312,000	
サトーホールディングス	8,500	1,771	15,053,500	
小松製作所	351,700	2,514	884,173,800	
住友重機械	208,000	414	86,112,000	
日立建機	38,800	2,261	87,726,800	
日　工	10,000	346	3,460,000	
巴工業	3,800	1,649	6,266,200	
井関農機	79,000	325	25,675,000	
ＴＯＷＡ	9,000	741	6,669,000	
丸山製作所	24,000	271	6,504,000	
北川鉄工所	44,000	154	6,776,000	
クボタ	394,000	1,477	581,938,000	
東洋エンジニア	46,000	450	20,700,000	
三菱化工機	33,000	182	6,006,000	
月島機械	12,000	992	11,904,000	
帝国電機製作所	3,400	1,895	6,443,000	
新東工業	16,500	766	12,639,000	
アイチ　コーポレーション	13,400	489	6,552,600	
小森コーポレーション	20,400	1,126	22,970,400	
鶴見製作所	7,000	835	5,845,000	
住友精密	13,000	418	5,434,000	
酒井重工業	19,000	275	5,225,000	
荏原製作所	157,000	494	77,558,000	
西島製作所	10,200	850	8,670,000	
千代田化工建	59,000	1,132	66,788,000	
ダイキン工業	98,900	4,320	427,248,000	
オルガノ	13,000	519	6,747,000	
トーヨーカネツ	48,000	292	14,016,000	
栗田工業	39,300	2,155	84,691,500	
椿本チエイン	39,000	588	22,932,000	
大同工業	26,000	227	5,902,000	
日　機　装	27,000	1,251	33,777,000	
新興プランテック	16,100	695	11,189,500	
アネスト岩田	16,000	460	7,360,000	
ダイフク	34,500	830	28,635,000	
加藤製作所	19,000	425	8,075,000	
タダノ	36,000	1,250	45,000,000	
フジテック	21,000	868	18,228,000	

ＣＫＤ	22,000	736	16,192,000	
平和	16,200	1,663	26,940,600	
理想科学工業	5,400	2,142	11,566,800	
ＳＡＮＫＹＯ	21,900	4,330	94,827,000	
日本金銭機械	8,200	1,342	11,004,400	
マースエンジニアリング	4,800	1,879	9,019,200	
ダイコク電機	3,700	1,908	7,059,600	
ア　マ　ノ	21,600	971	20,973,600	
ＪＵＫＩ	60,000	157	9,420,000	
サンデン	45,000	351	15,795,000	
ブラザー工業	93,500	1,101	102,943,500	
マックス	10,000	1,063	10,630,000	
モリタホールディングス	12,000	819	9,828,000	
グローリー	21,600	2,520	54,432,000	
大和冷機工業	15,000	528	7,920,000	
セガサミーホールディングス	78,400	2,347	184,004,800	
日本ピストンリング	39,000	170	6,630,000	
リ　ケ　ン	27,000	383	10,341,000	
ＴＰＲ	8,400	1,498	12,583,200	
ホシザキ電機	16,000	2,982	47,712,000	
大豊工業	6,300	1,246	7,849,800	
日本精工	162,000	891	144,342,000	
Ｎ　Ｔ　Ｎ	161,000	297	47,817,000	
ジェイテクト	77,400	1,015	78,561,000	
不　二　越	71,000	420	29,820,000	
ミネベア	102,000	352	35,904,000	
日本トムソン	27,000	471	12,717,000	
Ｔ　Ｈ　Ｋ	48,500	2,206	106,991,000	
ユーシン精機	4,300	1,711	7,357,300	
イーグル工業	11,000	1,169	12,859,000	
日本ピラー工業	9,000	690	6,210,000	
キッツ	33,800	485	16,393,000	
日　立	1,734,000	655	1,135,770,000	
東　芝	1,427,000	457	652,139,000	
三菱電機	721,000	946	682,066,000	
富士電機	223,000	314	70,022,000	
東洋電機製造	19,000	267	5,073,000	
安川電機	82,000	1,249	102,418,000	
シンフォニア　テクノロジー	49,000	162	7,938,000	
明　電　舎	76,000	320	24,320,000	
オリジン電気	15,000	338	5,070,000	
デンヨー	8,400	1,298	10,903,200	
日立工機	19,600	753	14,758,800	
三桜工業	9,900	717	7,098,300	
マキタ	44,100	5,250	231,525,000	
東芝テック	48,000	499	23,952,000	
マブチモーター	10,200	4,880	49,776,000	
日本電産	38,600	6,390	246,654,000	
ダイヘン	44,000	398	17,512,000	
ＪＶＣケンウッド	51,500	251	12,926,500	
日新電機	17,000	620	10,540,000	
大崎電気	12,000	529	6,348,000	
オムロン	76,500	3,025	231,412,500	
日東工業	10,800	1,702	18,381,600	
ＩＤＥＣ	9,300	877	8,156,100	

ジーエス・ユアサ　コーポ	143,000	424	60,632,000	
メルコホールディングス	4,700	1,471	6,913,700	
日本電気	944,000	228	215,232,000	
富　士　通	695,000	397	275,915,000	
沖　電　気	277,000	186	51,522,000	
電気興業	23,000	520	11,960,000	
サンケン電気	41,000	500	20,500,000	
アイホン	3,900	1,500	5,850,000	
ルネサスエレクトロニクス	20,800	432	8,985,600	
セイコーエプソン	50,700	1,147	58,152,900	
ワコム	55,800	1,169	65,230,200	
アルバック	14,100	1,016	14,325,600	
アクセル	4,200	1,801	7,564,200	
ＥＩＺＯ	6,700	1,860	12,462,000	
日本信号	20,200	696	14,059,200	
京三製作所	17,000	327	5,559,000	
能美防災	11,000	802	8,822,000	
日本無線	21,000	337	7,077,000	
パナソニック	825,500	750	619,125,000	
シャープ	377,000	422	159,094,000	
アンリツ	40,700	1,217	49,531,900	
富士通ゼネラル	19,000	946	17,974,000	
日立国際電気	19,000	1,010	19,190,000	
ソ　ニ　ー	455,200	1,908	868,521,600	
Ｔ　Ｄ　Ｋ	41,000	3,725	152,725,000	
帝国通信工業	30,000	184	5,520,000	
ミツミ電機	30,500	656	20,008,000	
タムラ製作所	36,000	210	7,560,000	
アルプス電気	56,600	673	38,091,800	
パイオニア	93,800	209	19,604,200	
日本電波工業	8,200	940	7,708,000	
ローランド　ディー．ジー．	4,300	2,190	9,417,000	
フオスター電機	8,500	1,621	13,778,500	
クラリオン	51,000	126	6,426,000	
Ｓ　Ｍ　Ｋ	27,000	285	7,695,000	
東　光	46,000	294	13,524,000	
ホシデン	20,800	516	10,732,800	
ヒロセ電機	12,400	13,150	163,060,000	
日本航空電子	19,000	954	18,126,000	
Ｔ　Ｏ　Ａ	10,000	708	7,080,000	
ユニデン	28,000	272	7,616,000	
アルパイン	14,400	944	13,593,600	
アイコム	4,600	2,399	11,035,400	
船井電機	7,600	1,059	8,048,400	
横河電機	74,000	1,132	83,768,000	
新電元工業	27,000	478	12,906,000	
アズビル	19,300	2,042	39,410,600	
日本光電工業	14,700	3,485	51,229,500	
チ　ノ　ー	24,000	210	5,040,000	
堀場製作所	14,800	3,405	50,394,000	
アドバンテスト	50,900	1,508	76,757,200	
小野測器	13,000	451	5,863,000	
エスペック	9,900	704	6,969,600	
キーエンス	17,700	30,250	535,425,000	
日置電機	4,800	1,528	7,334,400	

シスメックス	25,700	6,330	162,681,000	
メガチップス	6,900	1,476	10,184,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,500	2,862	15,741,000	
日本電産コパル電子	6,000	445	2,670,000	
デンソー	177,600	4,140	735,264,000	
コーセル	9,300	1,140	10,602,000	
日立メディコ	6,000	1,320	7,920,000	
オプテックス	5,900	1,469	8,667,100	
千代田インテグレ	4,500	1,338	6,021,000	
スタンレー電気	55,800	1,813	101,165,400	
岩崎電気	38,000	192	7,296,000	
ウシオ電機	41,400	1,190	49,266,000	
日本セラミック	5,200	1,500	7,800,000	
日本デジタル研究所	8,000	1,033	8,264,000	
図　研	6,200	739	4,581,800	
カ　シ　オ	71,700	874	62,665,800	
ファナック	75,000	14,220	1,066,500,000	
日本シイエムケイ	20,100	323	6,492,300	
エンプラス	3,600	6,190	22,284,000	
ロ　ー　ム	37,800	3,675	138,915,000	
浜松ホトニクス	27,800	3,385	94,103,000	
三井ハイテック	12,600	651	8,202,600	
新光電気工業	26,600	1,158	30,802,800	
京　セ　ラ	59,900	9,630	576,837,000	
太陽誘電	37,700	1,584	59,716,800	
村田製作所	75,600	8,010	605,556,000	
ユーシン	12,700	753	9,563,100	
双葉電子工業	13,800	1,267	17,484,600	
日東電工	62,400	6,010	375,024,000	
北陸電気工業	44,000	154	6,776,000	
東海理化電機	17,200	1,905	32,766,000	
ニチコン	24,000	938	22,512,000	
日本ケミコン	48,000	347	16,656,000	
Ｋ　Ｏ　Ａ	10,400	944	9,817,600	
三井造船	287,000	158	45,346,000	
日立造船	302,500	149	45,072,500	
佐世保重工業	61,000	104	6,344,000	
三菱重工業	1,209,000	614	742,326,000	
川崎重工業	565,000	331	187,015,000	
ＩＨＩ	499,000	362	180,638,000	
日本車輌	28,000	518	14,504,000	
近畿車輌	13,000	327	4,251,000	
全国保証	6,100	3,130	19,093,000	
日産自動車	910,400	1,057	962,292,800	
いすゞ自動車	419,000	788	330,172,000	
トヨタ自動車	927,800	5,730	5,316,294,000	※
日野自動車	91,000	1,396	127,036,000	
三菱自動車工業	1,812,000	148	268,176,000	
エフテック	3,700	1,571	5,812,700	
武蔵精密工業	8,500	2,299	19,541,500	
日産車体	23,000	1,090	25,070,000	
新明和工業	33,000	764	25,212,000	
極東開発工業	14,000	1,070	14,980,000	
日信工業	15,400	1,823	28,074,200	
トピー工業	55,000	199	10,945,000	

ティラド	28,000	354	9,912,000	
曙ブレーキ	35,200	471	16,579,200	
タチエス	10,200	1,346	13,729,200	
Ｎ　Ｏ　Ｋ	33,200	1,621	53,817,200	
フタバ産業	25,000	461	11,525,000	
カヤバ工業	57,000	531	30,267,000	
シロキ工業	21,000	208	4,368,000	
大同メタル工業	11,000	661	7,271,000	
プレス工業	33,000	468	15,444,000	
カルソニックカンセイ	49,000	415	20,335,000	
太平洋工業	16,300	708	11,540,400	
ケーヒン	15,600	1,456	22,713,600	
河西工業	11,000	536	5,896,000	
アイシン精機	65,500	3,505	229,577,500	
マ　ツ　ダ	1,151,000	365	420,115,000	
ダイハツ	74,000	2,009	148,666,000	
今仙電機製作所	6,300	1,500	9,450,000	
本田技研	608,100	3,670	2,231,727,000	
スズキ	150,100	2,451	367,895,100	
富士重工業	229,000	2,180	499,220,000	
ヤマハ発動機	110,400	1,455	160,632,000	
ショーワ	18,700	1,211	22,645,700	
小糸製作所	36,000	1,877	67,572,000	
ＴＢＫ	11,000	509	5,599,000	
エクセディ	9,700	2,418	23,454,600	
ミツバ	15,000	1,432	21,480,000	
豊田合成	20,200	2,387	48,217,400	
愛三工業	8,600	901	7,748,600	
ヨ　ロ　ズ	5,900	1,711	10,094,900	
エフ・シー・シー	12,200	2,310	28,182,000	
シマノ	29,000	8,060	233,740,000	
タカタ	13,000	2,133	27,729,000	
テイ・エス　テック	15,900	3,075	48,892,500	
小　野　建	7,500	979	7,342,500	
カッパ・クリエイトＨＤ	5,500	1,758	9,669,000	
伯東	4,500	934	4,203,000	
ライトオン	7,100	813	5,772,300	
ナガイレーベン	9,000	1,488	13,392,000	
三菱食品	7,400	2,401	17,767,400	
良品計画	7,900	7,660	60,514,000	
三城ホールディングス	8,400	484	4,065,600	
松田産業	6,200	1,194	7,402,800	
メディパルＨＤ	70,800	1,323	93,668,400	
アズワン	5,500	2,163	11,896,500	
シモジマ	4,700	942	4,427,400	
ドウシシャ	8,100	1,332	10,789,200	
コナカ	10,000	1,025	10,250,000	
コーナン商事	11,400	1,126	12,836,400	
黒田電気	10,800	1,240	13,392,000	
ネットワンシステムズ	26,300	788	20,724,400	
ワタミ	7,700	1,707	13,143,900	
ドン・キホーテ	21,100	4,325	91,257,500	
西松屋チェーン	14,700	986	14,494,200	
ゼンショーホールディングス	27,300	1,105	30,166,500	
ハピネット	5,300	770	4,081,000	

幸楽苑	5,600	1,206	6,753,600	
トーメンエレクトロニクス	3,700	1,175	4,347,500	
サイゼリヤ	9,800	1,283	12,573,400	
エクセル	5,500	1,163	6,396,500	
マルカキカイ	4,000	1,200	4,800,000	
ガリバーインターナショナル	26,500	592	15,688,000	
ユナイテッドアローズ	8,400	3,525	29,610,000	
ハイデイ日高	4,500	1,951	8,779,500	
シークス	5,700	1,123	6,401,100	
京都きもの友禅	6,500	1,007	6,545,500	
コロワイド	26,000	881	22,906,000	
壱番屋	3,500	3,570	12,495,000	
マクニカ	3,800	2,098	7,972,400	
スギホールディングス	11,300	3,290	37,177,000	
島津製作所	87,000	772	67,164,000	
Ｊ　Ｍ　Ｓ	17,000	349	5,933,000	
スター精密	15,300	1,006	15,391,800	
東京計器	38,000	278	10,564,000	
東京精密	14,000	2,009	28,126,000	
マニー	2,700	3,310	8,937,000	
ニコン	135,000	2,467	333,045,000	
トプコン	17,600	995	17,512,000	
オリンパス	85,900	3,045	261,565,500	
理研計器	9,300	751	6,984,300	
大日本スクリーン	79,000	517	40,843,000	
キヤノン電子	5,300	1,819	9,640,700	
タムロン	6,200	2,400	14,880,000	
ＨＯＹＡ	173,900	1,939	337,192,100	
キヤノン	447,100	3,305	1,477,665,500	
リ　コ　ー	219,000	1,142	250,098,000	
日本電産コパル	7,300	762	5,562,600	
シチズンホールディングス	83,500	541	45,173,500	
リズム時計	42,000	149	6,258,000	
パラマウントベッドＨＤ	6,600	3,270	21,582,000	
永大産業	14,000	400	5,600,000	
ダンロップスポーツ	4,700	1,109	5,212,300	
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	75,700	1,513	114,534,100	
共立印刷	14,100	274	3,863,400	
フランスベッドＨＬＤＧＳ	51,000	195	9,945,000	
パイロットコーポレーション	71	309,000	21,939,000	
エイベックス・グループＨＤ	14,600	2,938	42,894,800	
トッパン・フォームズ	13,500	835	11,272,500	
フジシールインターナショナル	10,000	2,703	27,030,000	
タカラトミー	23,300	444	10,345,200	
アーク	33,400	258	8,617,200	
プロネクサス	12,000	601	7,212,000	
ウッドワン	18,000	292	5,256,000	
大建工業	35,000	251	8,785,000	
き　も　と	8,900	761	6,772,900	
凸版印刷	202,000	646	130,492,000	
大日本印刷	219,000	825	180,675,000	
共同印刷	30,000	290	8,700,000	
日本写真印刷	12,300	1,741	21,414,300	
藤森工業	7,000	2,955	20,685,000	
宝印刷	7,600	672	5,107,200	

前澤化成工業	6,700	961	6,438,700	
アシックス	68,200	1,432	97,662,400	
ツ　ツ　ミ	3,800	2,275	8,645,000	
ジェイ　エス　ピー	6,100	1,406	8,576,600	
ニ　チ　ハ	10,300	1,428	14,708,400	
ローランド	8,600	875	7,525,000	
エフピコ	3,600	6,080	21,888,000	
小松ウオール工業	4,000	1,967	7,868,000	
ヤマハ	55,300	1,004	55,521,200	
河合楽器	39,000	157	6,123,000	
クリナップ	9,400	723	6,796,200	
ピジョン	5,900	7,690	45,371,000	
天馬	7,000	1,165	8,155,000	
キングジム	5,800	770	4,466,000	
リンテック	14,800	1,828	27,054,400	
信越ポリマー	16,600	342	5,677,200	
東　リ	30,000	200	6,000,000	
イトーキ	18,700	505	9,443,500	
任　天　堂	41,300	9,660	398,958,000	
三菱鉛筆	7,300	1,844	13,461,200	
松　風	5,300	845	4,478,500	
タカラスタンダード	33,000	665	21,945,000	
コ　ク　ヨ	37,800	681	25,741,800	
ナカバヤシ	30,000	197	5,910,000	
ニ　フ　コ	16,800	2,118	35,582,400	
グローブライド	58,000	114	6,612,000	
岡村製作所	29,000	610	17,690,000	
日本バルカー	35,000	238	8,330,000	
伊　藤　忠	567,600	1,240	703,824,000	
丸　紅	585,000	691	404,235,000	
スクロール	15,100	264	3,986,400	
高　島	19,000	281	5,339,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	6,500	1,540	10,010,000	
三陽商会	48,000	252	12,096,000	
長瀬産業	39,600	1,287	50,965,200	
蝶　理	6,200	1,011	6,268,200	
豊田通商	79,500	2,577	204,871,500	
オンワードホールディングス	51,000	835	42,585,000	
三共生興	17,400	328	5,707,200	
兼　松	188,000	116	21,808,000	
美　津　濃	32,000	463	14,816,000	
フアミリーマート	21,400	4,080	87,312,000	
ルック	15,000	339	5,085,000	
三井物産	611,400	1,263	772,198,200	
日本紙パルプ	30,000	284	8,520,000	
東京エレクトロン	60,800	4,685	284,848,000	
日立ハイテクノロジーズ	21,900	2,253	49,340,700	
カメイ	9,800	791	7,751,800	
東都水産	32,000	149	4,768,000	
スターゼン	30,000	244	7,320,000	
セイコーＨＤ	50,000	396	19,800,000	
山　善	26,600	585	15,561,000	
住友商事	418,700	1,265	529,655,500	
日本ユニシス	22,400	831	18,614,400	
内田洋行	23,000	259	5,957,000	

三菱商事	553,700	1,756	972,297,200	
第一実業	22,000	420	9,240,000	
キヤノンマーケティングＪＰＮ	23,200	1,302	30,206,400	
西華産業	24,000	265	6,360,000	
菱洋エレクトロ	9,000	852	7,668,000	
ユアサ商事	89,000	178	15,842,000	
神鋼商事	30,000	180	5,400,000	
阪和興業	74,000	352	26,048,000	
カナデン	10,000	568	5,680,000	
菱電商事	13,000	633	8,229,000	
ニプロ	41,300	1,270	52,451,000	
岩谷産業	82,000	367	30,094,000	
すてきナイスグループ	33,000	202	6,666,000	
昭光通商	47,000	135	6,345,000	
兼松エレクトロニクス	6,400	1,238	7,923,200	
三愛石油	21,000	380	7,980,000	
稲畑産業	20,600	775	15,965,000	
ゴールドウイン	19,000	459	8,721,000	
ユニ・チャーム	41,200	5,830	240,196,000	
デサント	21,000	657	13,797,000	
ヤマトインターナシヨナル	10,200	435	4,437,000	
東邦ホールディングス	22,900	1,587	36,342,300	
サンゲツ	12,800	2,402	30,745,600	
ミツウロコグループ	12,300	465	5,719,500	
シナネン	19,000	375	7,125,000	
伊藤忠エネクス	17,800	503	8,953,400	
サンリオ	18,400	4,995	91,908,000	
リョーサン	11,600	1,776	20,601,600	
新光商事	9,500	871	8,274,500	
トーホー	19,000	335	6,365,000	
三信電気	11,600	608	7,052,800	
東陽テクニカ	11,900	1,263	15,029,700	
モスフード　サービス	9,300	1,770	16,461,000	
加賀電子	5,200	795	4,134,000	
三益半導体	8,500	888	7,548,000	
木曽路	9,300	1,792	16,665,600	
千　趣　会	15,500	792	12,276,000	
ケーヨー	11,700	477	5,580,900	
アデランス	11,000	1,267	13,937,000	
上新電機	16,000	761	12,176,000	
日本瓦斯	10,300	1,060	10,918,000	
マルエツ	21,000	303	6,363,000	
ロイヤルホールディングス	13,300	1,419	18,872,700	
いなげや	5,800	960	5,568,000	
島　忠	16,300	2,416	39,380,800	
チヨダ	8,900	2,462	21,911,800	
ライフコーポレーション	4,300	1,221	5,250,300	
カ　ス　ミ	16,700	606	10,120,200	
リンガーハツト	8,200	1,323	10,848,600	
ＭＲ　ＭＡＸ	10,400	319	3,317,600	
ＡＯＫＩホールディングス	6,900	2,867	19,782,300	
オークワ	11,000	991	10,901,000	
コメリ	11,200	2,532	28,358,400	
青山商事	20,200	2,742	55,388,400	
しまむら	8,200	11,260	92,332,000	

ＣＦＳコーポレーション	11,500	363	4,174,500	
高　島　屋	99,000	918	90,882,000	
松　屋	15,700	1,230	19,311,000	
エイチ・ツー・オーリテイリング	48,000	844	40,512,000	
ニッセンＨＤ	12,600	331	4,170,600	
パ　ル　コ	15,800	996	15,736,800	
丸井グループ	96,600	908	87,712,800	
クレディセゾン	64,400	2,324	149,665,600	
原信ナルスＨＬＤＧＳ	5,400	1,558	8,413,200	
ダイエー	49,700	300	14,910,000	
イズミヤ	31,000	446	13,826,000	
イオン	250,200	1,157	289,481,400	
ユニーグループ・ＨＤ	69,900	639	44,666,100	
イ　ズ　ミ	18,400	2,485	45,724,000	
東武ストア	17,000	263	4,471,000	
平　和　堂	15,800	1,511	23,873,800	
フ　ジ	6,000	1,688	10,128,000	
ヤオコー	3,900	3,590	14,001,000	
ゼビオ	9,800	1,911	18,727,800	
ケーズホールディングス	18,300	2,792	51,093,600	
Ｐａｌｔａｃ	9,600	1,237	11,875,200	
新生銀行	632,000	222	140,304,000	
あおぞら銀行	272,000	284	77,248,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	5,396,100	579	3,124,341,900	※
りそなホールディングス	735,200	446	327,899,200	
三井住友トラストＨＤ	1,415,000	420	594,300,000	
三井住友フィナンシャルＧ	538,600	4,060	2,186,716,000	
第四銀行	93,000	321	29,853,000	
北越銀行	80,000	184	14,720,000	
西日本シティ銀行	252,000	242	60,984,000	
千葉銀行	273,000	612	167,076,000	
横浜銀行	437,000	488	213,256,000	
常陽銀行	267,000	485	129,495,000	
群馬銀行	161,000	496	79,856,000	
武蔵野銀行	11,800	3,080	36,344,000	
千葉興業銀行	17,100	714	12,209,400	
筑波銀行	32,800	351	11,512,800	
東京都民銀行	14,900	1,101	16,404,900	
七十七銀行	114,000	444	50,616,000	
青森銀行	50,000	251	12,550,000	
秋田銀行	48,000	251	12,048,000	
山形銀行	45,000	389	17,505,000	
岩手銀行	4,900	3,790	18,571,000	
東邦銀行	52,000	294	15,288,000	
東北銀行	54,000	141	7,614,000	
みちのく銀行	45,000	182	8,190,000	
ふくおかフィナンシャルＧ	289,000	401	115,889,000	
静岡銀行	207,000	998	206,586,000	
十六銀行	90,000	351	31,590,000	
スルガ銀行	71,000	1,588	112,748,000	
八十二銀行	132,000	524	69,168,000	
山梨中央銀行	44,000	396	17,424,000	
大垣共立銀行	96,000	292	28,032,000	
福井銀行	61,000	193	11,773,000	
北國銀行	79,000	330	26,070,000	

清水銀行	2,900	2,587	7,502,300	
滋賀銀行	66,000	526	34,716,000	
南都銀行	66,000	363	23,958,000	
百五銀行	65,000	391	25,415,000	
京都銀行	127,000	801	101,727,000	
三重銀行	35,000	207	7,245,000	
ほくほくフィナンシャルG	491,000	187	91,817,000	
広島銀行	211,000	393	82,923,000	
山陰合同銀行	44,000	700	30,800,000	
中国銀行	52,000	1,332	69,264,000	
鳥取銀行	34,000	179	6,086,000	
伊予銀行	75,000	862	64,650,000	
百十四銀行	77,000	300	23,100,000	
四国銀行	52,000	238	12,376,000	
阿波銀行	55,000	513	28,215,000	
鹿児島銀行	50,000	602	30,100,000	
大分銀行	46,000	311	14,306,000	
宮崎銀行	51,000	283	14,433,000	
肥後銀行	59,000	557	32,863,000	
佐賀銀行	46,000	200	9,200,000	
十八銀行	45,000	220	9,900,000	
沖縄銀行	5,500	3,740	20,570,000	
琉球銀行	15,600	1,277	19,921,200	
八千代銀行	4,300	3,015	12,964,500	
セブン銀行	247,900	340	84,286,000	
みずほフィナンシャルG	9,198,400	192	1,766,092,800	
紀陽ホールディングス	290,000	135	39,150,000	
山口フィナンシャルG	70,000	879	61,530,000	
芙蓉総合リース	8,100	3,835	31,063,500	
興銀リース	12,500	3,065	38,312,500	
東京センチュリーリース	18,300	2,491	45,585,300	
ＳＢＩホールディングス	93,200	1,286	119,855,200	
日本証券金融	32,800	748	24,534,400	
大阪証券金融	22,900	292	6,686,800	
ポケットカード	11,400	693	7,900,200	
長野銀行	38,000	169	6,422,000	
名古屋銀行	71,000	353	25,063,000	
北洋銀行	110,100	323	35,562,300	
愛知銀行	2,800	4,480	12,544,000	
第三銀行	44,000	154	6,776,000	
中京銀行	21,000	175	3,675,000	
東日本銀行	37,000	201	7,437,000	
大光銀行	31,000	206	6,386,000	
愛媛銀行	38,000	228	8,664,000	
トマト銀行	37,000	167	6,179,000	
みなと銀行	61,000	157	9,577,000	
京葉銀行	59,000	493	29,087,000	
関西アーバン銀行	89,000	110	9,790,000	
栃木銀行	40,000	340	13,600,000	
北日本銀行	2,500	2,170	5,425,000	
東和銀行	83,000	93	7,719,000	
福島銀行	127,000	77	9,779,000	
リコーリース	6,600	2,657	17,536,200	
イオンフィナンシャルサービス	28,100	2,622	73,678,200	
ア　コ　ム	15,330	3,540	54,268,200	

ジャックス	47,000	503	23,641,000	
オ　リ　コ	156,500	286	44,759,000	
日立キャピタル	16,500	2,125	35,062,500	
オリックス	421,500	1,300	547,950,000	
三菱ＵＦＪリース	190,700	448	85,433,600	
ジャフコ	11,000	3,460	38,060,000	
トモニホールディングス	51,900	343	17,801,700	
大和証券Ｇ本社	708,000	790	559,320,000	
野村ホールディングス	1,459,800	719	1,049,596,200	
岡三証券グループ	63,000	840	52,920,000	
丸三証券	24,500	667	16,341,500	
東洋証券	34,000	327	11,118,000	
東海東京ＨＤ	83,800	675	56,565,000	
水戸証券	26,000	438	11,388,000	
いちよし証券	18,100	1,141	20,652,100	
松井証券	44,200	944	41,724,800	
ＮＫＳＪホールディングス	157,600	2,064	325,286,400	
日本取引所グループ	18,400	9,300	171,120,000	
マネックスＧ	883	36,550	32,273,650	
カブドットコム証券	30,800	564	17,371,200	
極東証券	10,800	1,742	18,813,600	
フィデアホール	42,800	212	9,073,600	
池田泉州ＨＤ	49,400	478	23,613,200	
ＭＳ＆ＡＤ	212,800	2,323	494,334,400	
ＳＯＮＹ　ＦＨ	67,100	1,376	92,329,600	
第一生命	3,820	133,900	511,498,000	
東京海上ＨＤ	274,600	2,825	775,745,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,200	2,350	9,870,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	245,100	1,147	281,129,700	
三井不動産	336,000	2,769	930,384,000	
三菱地所	499,000	2,385	1,190,115,000	
平和不動産	14,700	1,747	25,680,900	
東京建物	140,000	766	107,240,000	
ダイビル	19,800	1,139	22,552,200	
東急不動産	159,000	921	146,439,000	
京阪神ビルディング	12,200	652	7,954,400	
住友不動産	171,000	3,805	650,655,000	
大京	117,000	295	34,515,000	
テーオーシー	25,300	651	16,470,300	
東京楽天地	17,000	441	7,497,000	
レオパレス２１	67,600	435	29,406,000	
フジ住宅	10,400	675	7,020,000	
空港施設	12,200	595	7,259,000	
住友不動産販売	2,730	5,340	14,578,200	
ゴールドクレスト	6,200	2,145	13,299,000	
東栄住宅	5,500	1,707	9,388,500	
リロ・ホールディング	2,800	4,475	12,530,000	
東急リバブル	8,700	1,938	16,860,600	
飯田産業	7,900	1,508	11,913,200	
アーネストワン	12,300	1,822	22,410,600	
タカラレーベン	8,700	1,590	13,833,000	
サンヨーハウジ　名古屋	4,700	1,187	5,578,900	
イオンモール	32,600	2,358	76,870,800	
タクトホーム	46	171,000	7,866,000	
トーセイ	118	81,300	9,593,400	

エヌ・ティ・ティ都市開発	460	116,700	53,682,000	
東武鉄道	411,000	495	203,445,000	
相鉄ホールディングス	117,000	328	38,376,000	
東京急行	429,000	621	266,409,000	
京浜急行	185,000	827	152,995,000	
小田急電鉄	231,000	960	221,760,000	
京王電鉄	201,000	655	131,655,000	
京成電鉄	113,000	829	93,677,000	
富士急行	24,000	957	22,968,000	
新京成電鉄	16,000	378	6,048,000	
東日本旅客鉄道	133,000	7,360	978,880,000	
西日本旅客鉄道	62,400	4,060	253,344,000	
東海旅客鉄道	60,200	10,760	647,752,000	
西日本鉄道	92,000	365	33,580,000	
ハマキョウレックス	2,700	3,470	9,369,000	
近畿日本鉄道	653,000	410	267,730,000	
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	455,000	520	236,600,000	
南海電鉄	144,000	376	54,144,000	
京阪電鉄	149,000	397	59,153,000	
名古屋鉄道	256,000	262	67,072,000	
日本通運	286,000	436	124,696,000	
ヤマトホールディングス	133,900	1,841	246,509,900	
山　九	88,000	364	32,032,000	
日　新	36,000	253	9,108,000	
丸全昭和運輸	30,000	341	10,230,000	
センコー	33,000	476	15,708,000	
トナミホールディングス	22,000	201	4,422,000	
日本梱包運輸	22,900	1,403	32,128,700	
福山通運	40,000	500	20,000,000	
セイノーホールディングス	56,000	766	42,896,000	
神奈川中央交通	15,000	501	7,515,000	
日立物流	10,900	1,654	18,028,600	
日本郵船	585,000	260	152,100,000	
商船三井	360,000	360	129,600,000	
川崎汽船	336,000	195	65,520,000	
ＮＳユナイテッド海運	44,000	151	6,644,000	
飯野海運	33,500	518	17,353,000	
日本航空	81,600	5,190	423,504,000	
ＡＮＡホールディングス	1,417,000	203	287,651,000	
三菱倉庫	52,000	1,336	69,472,000	
三井倉庫	39,000	500	19,500,000	
住友倉庫	52,000	547	28,444,000	
渋沢倉庫	24,000	409	9,816,000	
ヤマタネ	51,000	174	8,874,000	
東陽倉庫	22,000	256	5,632,000	
日本トランスシティ	24,000	312	7,488,000	
安田倉庫	8,100	867	7,022,700	
東洋埠頭	33,000	168	5,544,000	
上　組	78,000	762	59,436,000	
郵船ロジスティクス	6,100	936	5,709,600	
近鉄エクスプレス	6,800	4,025	27,370,000	
東京放送ＨＤ	39,000	1,254	48,906,000	
日本テレビＨＬＤＳ	65,100	1,573	102,402,300	
テレビ朝日	18,900	1,853	35,021,700	
スカパーＪＳＡＴＨＤ	652	43,750	28,525,000	

テレビ東京ＨＤ	6,000	1,349	8,094,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	12,400	823	10,205,200	
ＮＥＣモバイリング	3,100	5,490	17,019,000	
日本電信電話	299,800	5,040	1,510,992,000	
ＫＤＤＩ	201,600	4,300	866,880,000	
光通信	7,200	5,290	38,088,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	5,834	145,200	847,096,800	
ＧＭＯインターネット	25,500	983	25,066,500	
学研ホールディングス	28,000	277	7,756,000	
ゼンリン	11,200	1,093	12,241,600	
角川グループＨＬＤＧＳ	6,600	2,986	19,707,600	
東京電力	616,100	513	316,059,300	
中部電力	219,600	1,240	272,304,000	
関西電力	294,600	1,132	333,487,200	
中国電力	98,600	1,375	135,575,000	
北陸電力	70,400	1,352	95,180,800	
東北電力	181,100	1,098	198,847,800	
四国電力	65,000	1,516	98,540,000	
九州電力	159,700	1,302	207,929,400	
北海道電力	68,200	1,238	84,431,600	
沖縄電力	4,700	3,795	17,836,500	
電源開発	44,800	3,060	137,088,000	
東京瓦斯	863,000	523	451,349,000	
大阪瓦斯	696,000	388	270,048,000	
東邦瓦斯	181,000	492	89,052,000	
北海道瓦斯	18,000	251	4,518,000	
西部瓦斯	78,000	221	17,238,000	
静岡瓦斯	19,000	706	13,414,000	
松　竹	48,000	905	43,440,000	
東　宝	50,800	1,751	88,950,800	
エイチ・アイ・エス	6,600	3,850	25,410,000	
東　映	34,000	581	19,754,000	
ＮＴＴデータ	437	328,500	143,554,500	
共立メンテナンス	4,900	3,260	15,974,000	
イチネンホールディングス	12,200	656	8,003,200	
スペース	6,200	880	5,456,000	
アインファーマシーズ	4,500	4,000	18,000,000	
東京テアトル	45,000	150	6,750,000	
よみうりランド	19,000	780	14,820,000	
東京都競馬	66,000	361	23,826,000	
常磐興産	40,000	168	6,720,000	
カナモト	10,000	2,395	23,950,000	
東京ドーム	62,000	575	35,650,000	
ＤＴＳ	8,500	1,403	11,925,500	
スクウェア・エニックス・ＨＤ	26,900	1,159	31,177,100	
シーイーシー	8,500	619	5,261,500	
カプコン	15,100	1,575	23,782,500	
日本空港ビルデング	25,300	1,389	35,141,700	
トランス・コスモス	10,900	1,393	15,183,700	
乃村工藝社	20,000	712	14,240,000	
ジャステック	7,000	665	4,655,000	
ＳＣＳＫ	17,700	2,035	36,019,500	
藤田観光	25,000	406	10,150,000	
日本管財	3,100	1,524	4,724,400	
トーカイ	4,200	2,544	10,684,800	

セコム	77,800	5,040	392,112,000	
アイネス	12,500	716	8,950,000	
メイテツク	12,300	2,249	27,662,700	
ＴＫＣ	6,300	1,600	10,080,000	
アサツー　ディ・ケイ	12,600	2,187	27,556,200	
富士ソフト	11,200	2,026	22,691,200	
応用地質	9,600	1,493	14,332,800	
船井総合研究所	11,400	723	8,242,200	
ＮＳＤ	16,400	998	16,367,200	
コナミ	33,000	2,306	76,098,000	
ベネッセホールディングス	22,100	3,615	79,891,500	
イオンディライト	6,600	1,739	11,477,400	
ニチイ学館	15,900	888	14,119,200	
ダイセキ	12,300	1,601	19,692,300	
元気寿司	4,700	1,168	5,489,600	
トラスコ中山	8,100	2,074	16,799,400	
ヤマダ電機	32,610	3,770	122,939,700	
オートバックスセブン	26,600	1,495	39,767,000	
アークランドサカモト	5,700	1,735	9,889,500	
ニトリホールディングス	13,450	7,870	105,851,500	
吉野家ホールディングス	181	109,000	19,729,000	
加藤産業	10,100	1,874	18,927,400	
イエローハット	7,500	1,833	13,747,500	
富士エレクトロニクス	4,200	1,200	5,040,000	
松屋フーズ	3,600	1,511	5,439,600	
ＪＢＣＣホールディングス	8,400	1,109	9,315,600	
サガミチェーン	11,000	774	8,514,000	
日　伝	2,800	2,211	6,190,800	
因幡電機産業	8,000	2,545	20,360,000	
住金物産	46,000	283	13,018,000	
プレナス	7,300	1,531	11,176,300	
ミニストップ	6,000	1,594	9,564,000	
アークス	11,600	1,750	20,300,000	
バ　ロ　ー	15,500	1,718	26,629,000	
ミスミグループ本社	26,400	2,657	70,144,800	
ベ　ル　ク	5,100	1,640	8,364,000	
大　庄	4,600	1,199	5,515,400	
タキヒヨー	10,000	411	4,110,000	
ファーストリテイリング	16,700	29,920	499,664,000	
ソフトバンク	345,800	5,110	1,767,038,000	
スズケン	27,200	3,055	83,096,000	
サンドラッグ	13,300	3,800	50,540,000	
ベルーナ	11,050	1,006	11,116,300	
合計			109,362,132,770	

（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24年6月5日現在 金 額（円）	平成25年6月5日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,247,195	75,156,418
国債証券	8,660,337,370	10,821,916,670
地方債証券	1,162,799,054	1,236,581,536
特殊債券	1,281,404,371	1,139,697,813
社債券	1,643,568,579	1,225,900,535
未収利息	48,957,641	50,976,218
前払費用	3,212,214	3,324,187
流動資産合計	12,858,526,424	14,553,553,377
資産合計	12,858,526,424	14,553,553,377
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,605,000	21,862,000
流動負債合計	12,605,000	21,862,000
負債合計	12,605,000	21,862,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	11,275,890,072	12,612,600,118
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,570,031,352	1,919,091,259
元本等合計	12,845,921,424	14,531,691,377
純資産合計	12,845,921,424	14,531,691,377
負債純資産合計	12,858,526,424	14,553,553,377

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24年6月6日 至 平成25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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成24年6月5日現在	平成25年6月5日現在
1. ※1 期首	平成23年6月7日	平成24年6月6日
期首元本額	10,699,066,048円	11,275,890,072円
期中追加設定元本額	3,058,176,610円	2,568,381,399円
期中一部解約元本額	2,481,352,586円	1,231,671,353円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,807,329,293円	3,272,617,083円

ダイワ・ライフ・バランス５０	936,743,102円	1,316,537,138円
ダイワ・ライフ・バランス７０	229,933,178円	373,697,781円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	217,433,745円	332,544,985円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	140,502,945円	229,350,488円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	32,423,432円	53,827,487円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	13,892,393円	21,173,282円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	4,597,593円	12,157,419円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	175,637円	510,336円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	3,705,066,112円	4,227,024,441円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	328,613,496円	382,598,828円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	922,091,459円	724,068,605円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	1,937,087,687円	1,666,492,245円
計	11,275,890,072円	12,612,600,118円
2.　期末日における受益権の総数	11,275,890,072口	12,612,600,118口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年6月6日 至 平成25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。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25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24年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成25年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	116,334,750	△41,018,990
地方債証券	2,566,410	△13,772,616
特殊債券	616,959	△7,914,270
社債券	△1,619,935	△6,275,155
合計	117,898,184	△68,981,031

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成24年6月5日まで、及び平成24年12月1日から平成25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24年6月5日現在	平成25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24年6月5日現在	平成25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）	1.1392円 (11,392円)	1.1522円 (11,522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	３１９　２年国債	17,000,000	16,998,980	
	３２０　２年国債	80,000,000	79,994,400	
	３２１　２年国債	40,000,000	39,994,400	
	３２２　２年国債	180,000,000	179,973,000	
	３２３　２年国債	5,000,000	4,999,200	
	３２５　２年国債	55,000,000	54,985,700	
	３２６　２年国債	27,000,000	26,992,710	
	３２７　２年国債	120,000,000	119,966,400	
	８５　５年国債	10,000,000	10,075,800	
	８６　５年国債	184,000,000	185,159,200	
	８７　５年国債	73,000,000	73,430,700	
	８８　５年国債	118,000,000	118,808,300	
	８９　５年国債	115,000,000	115,664,700	
	９０　５年国債	10,000,000	10,037,500	
	９１　５年国債	63,000,000	63,395,010	
	９２　５年国債	140,000,000	140,558,600	
	９３　５年国債	53,000,000	53,495,550	
	９４　５年国債	42,000,000	42,498,960	

	９５　５年国債	117,000,000	118,508,130	
	９６　５年国債	60,000,000	60,607,200	
	９７　５年国債	95,000,000	95,760,950	
	９８　５年国債	100,000,000	100,483,000	
	９９　５年国債	55,000,000	55,431,200	
	１０１　５年国債	10,000,000	10,075,500	
	１０２　５年国債	47,000,000	47,189,880	
	１０３　５年国債	60,000,000	60,213,600	
	１０４　５年国債	60,000,000	59,988,600	
	１０５　５年国債	180,000,000	179,820,000	
	１０６　５年国債	120,000,000	119,770,800	
	１０７　５年国債	120,000,000	119,649,600	
	１０８　５年国債	60,000,000	59,556,000	
	１０９　５年国債	5,000,000	4,955,150	
	１１０　５年国債	30,000,000	30,014,100	
	１１１　５年国債	104,000,000	104,538,720	
	１　４０年国債	24,000,000	27,284,400	
	２　４０年国債	23,000,000	24,975,010	
	３　４０年国債	19,000,000	20,590,680	
	４　４０年国債	30,000,000	32,443,200	
	５　４０年国債	35,000,000	35,901,600	
	６　４０年国債	11,000,000	10,962,710	
	２６８　１０年国債	40,000,000	40,982,400	
	２６９　１０年国債	54,000,000	55,134,000	
	２７０　１０年国債	8,000,000	8,192,480	
	２７２　１０年国債	105,000,000	108,053,400	
	２７４　１０年国債	11,000,000	11,381,040	
	２７５　１０年国債	35,000,000	36,123,850	
	２７６　１０年国債	25,000,000	25,929,250	
	２７７　１０年国債	58,000,000	60,355,960	
	２７８　１０年国債	20,000,000	20,923,400	
	２７９　１０年国債	2,000,000	2,103,420	
	２８０　１０年国債	3,000,000	3,160,050	
	２８４　１０年国債	20,000,000	21,068,400	
	２８６　１０年国債	51,000,000	54,233,910	
	２８７　１０年国債	116,000,000	123,843,920	
	２８８　１０年国債	148,000,000	157,202,640	
	２８９　１０年国債	57,000,000	60,182,310	
	２９０　１０年国債	55,000,000	57,907,300	
	２９１　１０年国債	39,000,000	40,877,460	
	２９２　１０年国債	92,000,000	98,165,840	
	２９３　１０年国債	19,000,000	20,418,730	
	２９４　１０年国債	28,000,000	29,951,880	
	２９５　１０年国債	57,000,000	60,408,030	
	２９６　１０年国債	17,000,000	18,038,360	
	２９７　１０年国債	16,000,000	16,907,840	
	２９８　１０年国債	55,000,000	57,822,050	
	２９９　１０年国債	122,000,000	128,278,120	
	３００　１０年国債	45,000,000	47,838,600	
	３０１　１０年国債	35,000,000	37,224,950	
	３０２　１０年国債	40,000,000	42,307,200	
	３０３　１０年国債	44,000,000	46,541,440	
	３０４　１０年国債	49,000,000	51,530,850	
	３０５　１０年国債	84,000,000	88,281,480	
	３０６　１０年国債	60,000,000	63,417,600	
	３０７　１０年国債	100,000,000	105,042,000	
	３０８　１０年国債	69,000,000	72,406,530	

	３０９　１０年国債	120,000,000	124,260,000	
	３１０　１０年国債	130,000,000	133,443,700	
	３１１　１０年国債	52,000,000	52,652,600	
	３１２　１０年国債	95,000,000	98,753,450	
	３１３　１０年国債	98,000,000	102,528,580	
	３１４　１０年国債	85,000,000	87,638,400	
	３１５　１０年国債	67,000,000	69,521,880	
	３１６　１０年国債	90,000,000	92,702,700	
	３１７　１０年国債	59,000,000	60,705,690	
	３１８　１０年国債	15,000,000	15,316,500	
	３１９　１０年国債	105,000,000	107,948,400	
	３２０　１０年国債	78,000,000	79,531,920	
	３２１　１０年国債	86,000,000	87,627,120	
	３２２　１０年国債	68,000,000	68,698,360	
	３２３　１０年国債	59,000,000	59,546,930	
	３２４　１０年国債	114,000,000	114,047,880	
	３２５　１０年国債	167,000,000	166,854,710	
	３２６　１０年国債	63,000,000	62,303,220	
	３２７　１０年国債	21,000,000	20,962,830	
	３２８　１０年国債	194,000,000	189,790,200	
	２　３０年国債	9,000,000	10,232,370	
	３　３０年国債	4,000,000	4,477,840	
	４　３０年国債	8,000,000	9,662,880	
	５　３０年国債	8,000,000	8,779,520	
	６　３０年国債	9,000,000	10,126,800	
	７　３０年国債	12,000,000	13,298,760	
	８　３０年国債	5,000,000	5,118,000	
	９　３０年国債	11,000,000	10,523,700	
	１０　３０年国債	15,000,000	13,567,050	
	１１　３０年国債	12,000,000	12,063,000	
	１２　３０年国債	11,000,000	11,806,190	
	１３　３０年国債	13,000,000	13,729,430	
	１４　３０年国債	21,000,000	23,638,650	
	１５　３０年国債	20,000,000	22,868,800	
	１６　３０年国債	15,000,000	17,157,300	
	１７　３０年国債	17,000,000	19,147,610	
	１８　３０年国債	21,000,000	23,280,390	
	１９　３０年国債	15,000,000	16,629,300	
	２０　３０年国債	16,000,000	18,320,480	
	２１　３０年国債	16,000,000	17,737,600	
	２２　３０年国債	18,000,000	20,635,920	
	２３　３０年国債	26,000,000	29,813,160	
	２４　３０年国債	14,000,000	16,055,900	
	２５　３０年国債	19,000,000	21,075,750	
	２６　３０年国債	40,000,000	45,162,400	
	２７　３０年国債	30,000,000	34,481,100	
	２８　３０年国債	36,000,000	41,382,360	
	２９　３０年国債	41,000,000	46,320,980	
	３０　３０年国債	46,000,000	51,084,840	
	３１　３０年国債	43,000,000	46,820,980	
	３２　３０年国債	48,000,000	53,300,160	
	３３　３０年国債	57,000,000	59,521,680	
	３４　３０年国債	50,000,000	54,358,500	
	３５　３０年国債	57,000,000	59,415,090	
	３６　３０年国債	59,000,000	61,411,920	
	３７　３０年国債	59,000,000	60,073,800	
	３８　３０年国債	45,000,000	44,782,650	

	３０　利付国債２０年	16,000,000	17,308,320	
	３２　利付国債２０年	8,000,000	8,792,880	
	３３　利付国債２０年	5,000,000	5,595,200	
	３６　利付国債２０年	33,000,000	36,873,210	
	３７利付国債２０年	5,000,000	5,609,250	
	３８利付国債２０年	11,000,000	12,256,530	
	３９　２０年国債	32,000,000	35,504,320	
	４０　２０年国債	51,000,000	56,235,660	
	４１　２０年国債	40,000,000	42,523,200	
	４２　２０年国債	22,000,000	24,763,860	
	４３　２０年国債	14,000,000	16,102,240	
	４４　２０年国債	32,000,000	36,151,360	
	４５　２０年国債	20,000,000	22,478,400	
	４６　２０年国債	19,000,000	21,089,240	
	４７　２０年国債	23,000,000	25,579,220	
	４８　２０年国債	9,000,000	10,200,330	
	４９　２０年国債	4,000,000	4,425,040	
	５０　２０年国債	30,000,000	32,731,500	
	５１　２０年国債	25,000,000	27,483,750	
	５２　２０年国債	19,000,000	21,067,770	
	５３　２０年国債	13,000,000	14,425,320	
	５４　２０年国債	14,000,000	15,660,120	
	５５　２０年国債	41,000,000	45,205,780	
	５６　２０年国債	12,000,000	13,218,960	
	５７　２０年国債	24,000,000	26,291,040	
	５８　２０年国債	35,000,000	38,394,650	
	５９　２０年国債	28,000,000	30,259,600	
	６０　２０年国債	16,000,000	16,850,560	
	６１　２０年国債	40,000,000	40,652,000	
	６２　２０年国債	16,000,000	15,940,640	
	６３　２０年国債	30,000,000	32,756,400	
	６４　２０年国債	24,000,000	26,446,560	
	６５　２０年国債	22,000,000	24,257,200	
	６６　２０年国債	13,000,000	14,201,200	
	６７　２０年国債	10,000,000	11,031,700	
	６８　２０年国債	27,000,000	30,600,450	
	６９　２０年国債	22,000,000	24,704,240	
	７０　２０年国債	18,000,000	20,793,780	
	７１　２０年国債	24,000,000	27,227,520	
	７２　２０年国債	41,000,000	46,088,510	
	７３　２０年国債	10,000,000	11,132,200	
	７４　２０年国債	27,000,000	30,354,480	
	７５　２０年国債	14,000,000	15,731,100	
	７６　２０年国債	25,000,000	27,546,000	
	７７　２０年国債	9,000,000	10,017,360	
	７８　２０年国債	17,000,000	18,723,970	
	７９　２０年国債	12,000,000	13,353,600	
	８０　２０年国債	17,000,000	19,111,400	
	８１　２０年国債	18,000,000	20,024,460	
	８２　２０年国債	33,000,000	37,073,520	
	８３　２０年国債	28,000,000	31,448,480	
	８４　２０年国債	27,000,000	30,007,800	
	８５　２０年国債	41,000,000	46,007,330	
	８６　２０年国債	6,000,000	6,876,300	
	８７　２０年国債	16,000,000	18,145,280	
	８８　２０年国債	33,000,000	37,794,570	
	８９　２０年国債	21,000,000	23,796,360	

	９０　２０年国債	60,000,000	67,926,600	
	９１　２０年国債	13,000,000	14,877,460	
	９２　２０年国債	53,000,000	59,279,440	
	９３　２０年国債	10,000,000	11,044,100	
	９４　２０年国債	47,000,000	52,499,470	
	９５　２０年国債	33,000,000	37,654,320	
	９６　２０年国債	25,000,000	27,887,000	
	９７　２０年国債	25,000,000	28,169,250	
	９８　２０年国債	36,000,000	40,098,240	
	９９　２０年国債	55,000,000	61,164,400	
	１００　２０年国債	29,000,000	32,579,760	
	１０１　２０年国債	26,000,000	29,898,700	
	１０２　２０年国債	20,000,000	22,969,200	
	１０３　２０年国債	18,000,000	20,430,900	
	１０４　２０年国債	28,000,000	31,031,840	
	１０５　２０年国債	45,000,000	49,781,250	
	１０６　２０年国債	16,000,000	17,916,320	
	１０７　２０年国債	35,000,000	38,644,200	
	１０８　２０年国債	35,000,000	37,665,600	
	１０９　２０年国債	35,000,000	37,577,750	
	１１０　２０年国債	33,000,000	36,362,040	
	１１１　２０年国債	22,000,000	24,497,220	
	１１２　２０年国債	50,000,000	54,943,000	
	１１３　２０年国債	75,000,000	82,290,000	
	１１４　２０年国債	51,000,000	55,831,230	
	１１５　２０年国債	22,000,000	24,396,020	
	１１６　２０年国債	20,000,000	22,129,200	
	１１７　２０年国債	64,000,000	69,898,240	
	１１８　２０年国債	18,000,000	19,352,340	
	１１９　２０年国債	31,000,000	32,393,450	
	１２０　２０年国債	36,000,000	36,537,840	
	１２１　２０年国債	61,000,000	64,481,880	
	１２２　２０年国債	14,000,000	14,586,460	
	１２３　２０年国債	47,000,000	50,986,070	
	１２４　２０年国債	33,000,000	35,290,860	
	１２５　２０年国債	29,000,000	31,849,830	
	１２６　２０年国債	21,000,000	22,426,740	
	１２７　２０年国債	20,000,000	21,049,200	
	１２８　２０年国債	35,000,000	36,752,450	
	１２９　２０年国債	34,000,000	35,173,000	
	１３０　２０年国債	42,000,000	43,341,480	
	１３１　２０年国債	35,000,000	35,570,500	
	１３２　２０年国債	25,000,000	25,339,250	
	１３３　２０年国債	46,000,000	47,348,720	
	１３４　２０年国債	23,000,000	23,630,200	
	１３５　２０年国債	27,000,000	27,311,040	
	１３６　２０年国債	25,000,000	24,892,000	
	１３７　２０年国債	20,000,000	20,188,600	
	１３８　２０年国債	26,000,000	25,416,560	
	１３９　２０年国債	30,000,000	29,804,100	
	１４０　２０年国債	77,000,000	77,619,850	
	１４１　２０年国債	48,000,000	48,318,720	
	１４２　２０年国債	30,000,000	30,710,100	
	１４３　２０年国債	56,000,000	55,375,600	
	１４４　２０年国債	32,000,000	31,121,600	
国債証券　合計			10,821,916,670	

地方債証券	６２４　東京都公債	100,000,000	102,718,300	
	６５３　東京都公債	100,000,000	105,556,900	
	２０－６　北海道公債	100,000,000	106,607,300	
	２９３　大阪府公債	100,000,000	105,951,400	
	２１－２　埼玉県公債	100,000,000	106,484,300	
	２０　共同発行地方	100,000,000	101,955,000	
	２７　共同発行地方	34,000,000	34,784,686	
	３０　共同発行地方	50,000,000	51,285,550	
	７６　共同発行地方	100,000,000	105,502,700	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	98,708,100	
	２１－６　大阪市公債	100,000,000	106,416,300	
	１８－４　札幌市公債	100,000,000	105,203,500	
	１８－２　北九州市債	100,000,000	105,407,500	
地方債証券　合計			1,236,581,536	
特殊債券	３３３　政保道路債	21,000,000	21,422,499	
	３３４　政保道路債	2,000,000	2,039,894	
	２７　政保道路機構	50,000,000	52,912,250	
	５６　政保道路機構	100,000,000	105,192,600	
	１２２　政保道路機構	100,000,000	101,603,600	
	８４２　政保公営企業	5,000,000	5,100,970	
	２　政保地方公営機	100,000,000	106,541,700	
	２６　公営企業	100,000,000	105,635,200	
	１３　首都高速道路	100,000,000	102,187,000	
	２７　国際協力銀行	100,000,000	105,534,900	
	３０　国際協力銀行	100,000,000	107,080,600	
	１４　政保国民生活	19,000,000	19,328,700	
	２　成田国際空港	100,000,000	103,452,300	
	い７１５　利付商工債	100,000,000	100,829,200	
	い７２８　利付農林債	100,000,000	100,836,400	
特殊債券　合計			1,139,697,813	
社債券	１０　首都高速道路	100,000,000	99,818,300	
	３３　中日本高速道	100,000,000	101,592,500	
	５０　東芝	100,000,000	101,304,500	
	１　明治安田２０１１基	100,000,000	100,899,900	
	６　ドン・キホーテ	100,000,000	101,101,800	
	５８　伊藤忠商事	100,000,000	100,858,500	
	４　住友信託　劣後	100,000,000	102,582,200	
	１４０　オリックス	100,000,000	101,102,800	
	１５　三菱ＵＦＪリース	100,000,000	100,916,600	
	３１　三井不動産	100,000,000	101,829,600	
	３７８　東北電力	100,000,000	109,162,500	
	２６１　北海道電力	3,000,000	3,263,235	
	１０　電源開発	100,000,000	101,468,100	
社債券　合計			1,225,900,535	
合計			14,424,096,554	

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24年6月5日現在 金 額（円）	平成25年6月5日現在 金 額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		407,354,173	271,890,795
コール・ローン		148,072,034	168,237,453
株式		42,251,287,547	63,487,495,885
投資証券		923,164,743	1,369,676,527
派生商品評価勘定		103,620	45,615,938
未収入金		11,925,435	254,279,592
未収配当金		116,581,940	154,103,747
差入委託証拠金		302,898,864	323,686,800
流動資産合計		44,161,388,356	66,074,986,737
資産合計		44,161,388,356	66,074,986,737
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		49,303,708	—
未払金		215,947,471	65,333,895
未払解約金		18,500,000	149,331,000
その他未払費用		41,544	—
流動負債合計		283,792,723	214,664,895
負債合計		283,792,723	214,664,895
純資産の部			
元本等			
元本	※1	53,572,819,359	47,864,182,875
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△9,695,223,726	17,996,138,967
元本等合計		43,877,595,633	65,860,321,842
純資産合計		43,877,595,633	65,860,321,842
負債純資産合計		44,161,388,356	66,074,986,737

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成24年6月6日 至 平成25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、原則として期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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成24年6月5日現在	平成25年6月5日現在
1．※1 期首	平成23年6月7日	平成24年6月6日
期首元本額	50,681,256,369円	53,572,819,359円
期中追加設定元本額	8,391,607,266円	3,642,659,379円
期中一部解約元本額	5,500,044,276円	9,351,295,863円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	1,933,735,710円	1,767,921,192円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	97,361,825円	75,678,545円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,392,514,397円	1,172,613,781円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	187,349,099円	134,956,119円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	4,429,602,679円	3,793,019,120円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	17,171,129,893円	18,007,457,433円
ダイワ・ライフ・バランス３０	629,524,679円	517,224,694円
ダイワ・ライフ・バランス５０	579,094,011円	557,571,221円
ダイワ・ライフ・バランス７０	354,144,496円	378,967,048円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,554,480,215円	1,516,626,237円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	6,017,239円	5,580,411円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	5,519,967円	7,996,111円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,141,917円	1,702,131円
ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	114,546,775円	88,534,110円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	1,730,766,631円	1,263,434,093円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	39,443,846円	28,567,889円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	388,924,885円	285,218,661円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	5,860,266,833円	4,154,350,975円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	1,440,427,526円	1,041,692,049円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	11,845,270,700円	9,425,091,440円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	607,085,949円	482,501,977円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,050,766,038円	3,021,765,565円
ダイワライフスタイル２５	25,733,487円	20,914,663円
ダイワライフスタイル５０	72,670,714円	63,418,089円
ダイワライフスタイル７５	55,299,848円	51,379,321円
計	53,572,819,359円	47,864,182,875円
2.　期末日における受益権の総数	53,572,819,359口	47,864,182,875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9,695,223,726円であります。	―――――――

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　平成24年6月6日 至　平成25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おります。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	平成25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24年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	平成25年6月5日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,132,474,965	7,142,832,337
投資証券	76,510,379	83,248,687
合計	1,208,985,344	7,226,081,024

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成24年6月5日まで、及び平成24年12月1日から平成25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24年6月5日 現在				平成25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	697,000,227	―	647,727,859	△49,272,368	812,915,971	―	858,520,949	45,604,978
合計	697,000,227	―	647,727,859	△49,272,368	812,915,971	―	858,520,949	45,604,978

（注）　1．　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種 類	平成24年6月5日 現在				平成25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								
売 建	―	―	―	―	134,418,960	―	134,408,000	10,960
アメリカ・ドル	―	―	―	―	80,199,840	―	80,192,000	7,840
カナダ・ドル	―	―	―	―	38,715,120	―	38,712,000	3,120
香港・ドル	―	―	―	―	15,504,000	―	15,504,000	0
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	134,418,960	―	134,408,000	10,960

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

（1口当たり情報）

	平成24年6月5日現在	平成25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）	0.8190円 (8,190円)	1.3760円 (13,760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	10,700	23.210	248,347.000	
	ABBOTT LABS	39,400	36.800	1,449,920.000	
	ALCOA	26,600	8.380	222,908.000	
	VERISK ANALYTICS INC-CL A	3,500	58.850	205,975.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,600	58.460	619,676.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,200	77.720	326,424.000	
	FIDELITY NATIONAL INFORMA	5,829	44.320	258,341.280	
	AFLAC INC	11,700	55.810	652,977.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,300	53.280	175,824.000	
	MONSTER BEVERAGE CORP	3,800	59.600	226,480.000	
	ADOBE SYSTEMS	11,800	44.390	523,802.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS IN	1,600	194.020	310,432.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	2,500	80.480	201,200.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,400	13.770	143,208.000	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,000	68.910	137,820.000	
	GARMIN LTD	3,200	34.760	111,232.000	
	AETNA INC	9,479	59.360	562,673.440	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	5,300	95.390	505,567.000	
	ALTERA CORPORATION	8,100	33.670	272,727.000	
	BEAM INC	3,600	65.390	235,404.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	18,400	77.740	1,430,416.000	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,951	23.460	116,150.460	
	WR BERKLEY CORP	3,600	40.490	145,764.000	
	AUTOZONE INC	800	407.800	326,240.000	
	DOLLAR TREE INC	6,000	48.550	291,300.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,700	55.880	150,876.000	
	CELANESE CORP-SERIES A	4,200	48.710	204,582.000	
	D.R.HORTON INC	7,166	22.920	164,244.720	
	CONTINENTAL RESOURCES	1,200	82.890	99,468.000	
	DENTSPLY INTERNATIONAL IN	3,800	41.910	159,258.000	
	AUTODESK INC	5,600	36.700	205,520.000	
	MOODY'S CORP	5,000	65.270	326,350.000	
	DEVON ENERGY CORPORATION	9,700	57.250	555,325.000	
	ALBEMARLE CORP	2,200	65.850	144,870.000	
	CONSOL ENERGY INC	6,100	34.280	209,108.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	2,800	49.060	137,368.000	
	CITIGROUP INC	74,523	51.230	3,817,813.290	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,800	68.970	813,846.000	
	AMERICAN ELEC POWER	12,300	46.050	566,415.000	
	ALLEGHANY CORP	300	379.100	113,730.000	
	DUN&BRADSTREET CORP	1,400	98.220	137,508.000	
	HESS CORP	7,900	68.250	539,175.000	
	COVIDIEN PLC	12,025	63.810	767,315.250	
	DAVITA INC	2,200	124.960	274,912.000	
	DANAHER CORP	14,300	61.790	883,597.000	
	AVNET INC	3,400	33.960	115,464.000	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE	1,900	164.760	313,044.000	
	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,000	61.540	123,080.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	16,700	33.000	551,100.000	
	PEABODY ENERGY CORP	7,400	19.540	144,596.000	
	BUNGE LIMITED	3,800	69.500	264,100.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	10,925	44.830	489,767.750	
	APPLE INC	23,300	449.310	10,468,923.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVIC	12,700	48.310	613,537.000	
	BOEING CO	17,800	99.610	1,773,058.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,815	46.190	176,214.850	

MEADWESTVACO CORP	4,800	35.030	168,144.000	
SPECTRA ENERGY CORP	16,596	30.330	503,356.680	
BECTON DICKINSON & CO	4,800	98.370	472,176.000	
SAIC INC	8,600	14.770	127,022.000	
NISOURCE INC	7,600	28.270	214,852.000	
JOY GLOBAL INC	2,700	54.050	145,935.000	
BMC SOFTWARE INC	3,200	45.290	144,928.000	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN	4,000	56.500	226,000.000	
BARD(C.R.) INC	2,000	104.150	208,300.000	
BANK OF NEW YORK MELLON	28,871	29.900	863,242.900	
VERIZON COMMUNICATIONS	70,500	48.840	3,443,220.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-B	24,900	113.420	2,824,158.000	
ANSYS INC	2,300	72.910	167,693.000	
H&R BLOCK INC	6,700	28.800	192,960.000	
BB&T CORPORATION	18,000	32.960	593,280.000	
HOSPIRA INC	4,520	34.450	155,714.000	
BROADCOM CORP-CL A	13,350	35.630	475,660.500	
BAKER HUGHES INC	11,123	45.420	505,206.660	
BRISTOL MYERS SQUIBB	40,700	46.830	1,905,981.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,600	94.410	151,056.000	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	4,938	25.990	128,338.620	
JPMORGAN CHASE & CO	95,220	54.040	5,145,688.800	
LEGG MASON INC	3,850	34.380	132,363.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,500	75.230	488,995.000	
CIGNA CORP	7,400	67.520	499,648.000	
LKQ CORP	7,300	24.000	175,200.000	
COMPUTER SCIENCES CORP	4,200	44.820	188,244.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS L	1,600	86.050	137,680.000	
FRONTIER COMMUNICATIONS	26,442	4.160	109,998.720	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,100	68.480	212,288.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,360	82.180	440,484.800	
DOLLAR GENERAL CORP	8,000	48.640	389,120.000	
CATERPILLAR INC DEL	16,500	85.920	1,417,680.000	
VIRGIN MEDIA INC	6,400	50.100	320,640.000	
CMS ENERGY CORP	7,100	26.630	189,073.000	
HERBALIFE LTD	2,800	44.590	124,852.000	
MOSAIC CO/THE	7,500	61.800	463,500.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,200	81.750	425,100.000	
CORNING INC	37,700	15.570	586,989.000	
CISCO SYSTEMS	132,500	24.360	3,227,700.000	
DU PONT	23,200	55.790	1,294,328.000	
MORGAN STANLEY	36,400	25.470	927,108.000	
DOW CHEMICAL	30,500	34.620	1,055,910.000	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,200	37.800	234,360.000	
DELL INC	37,700	13.420	505,934.000	
ENSCO PLC-CL A	5,800	60.590	351,422.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,300	52.440	120,612.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,300	66.490	285,907.000	
AGCO CORP	2,800	55.620	155,736.000	
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,100	55.660	784,806.000	
DENBURY RESOURCES INC	9,600	18.370	176,352.000	
DEERE & CO	9,000	87.150	784,350.000	
AIRGAS INC	1,700	103.520	175,984.000	
QUANTA SERVICES INC	5,200	27.140	141,128.000	
TIME WARNER INC	23,233	58.340	1,355,413.220	
VMWARE INC-CLASS A	2,100	68.620	144,102.000	
URBAN OUTFITTERS INC	3,700	42.310	156,547.000	

NASDAQ OMX GROUP	3,900	30.840	120,276.000	
KINDER MORGAN MANAGEMENT	2,803	82.280	230,630.840	
CONSOLIDATED EDISON INC	7,300	56.490	412,377.000	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	3,500	57.830	202,405.000	
HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN	2,300	71.750	165,025.000	
NYSE EURONEXT	6,100	39.230	239,303.000	
COLGATE PALMOLIVE CO	24,000	58.870	1,412,880.000	
AMETEK INC	6,025	42.970	258,894.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,500	60.300	211,050.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,900	67.680	534,672.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	10,700	110.660	1,184,062.000	
SCANA CORP	3,100	50.320	155,992.000	
GREEN MOUNTAIN COFFEE	3,200	73.700	235,840.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,400	163.730	229,222.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN	800	358.420	286,736.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,800	29.910	233,298.000	
CUMMINS INC	4,600	118.210	543,766.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	11,100	14.390	159,729.000	
LORILLARD INC	9,600	43.170	414,432.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,200	147.760	177,312.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP-C	3,200	75.460	241,472.000	
NIELSEN HOLDINGS NV	3,800	33.650	127,870.000	
KINDER MORGAN INC	16,500	37.930	625,845.000	
HCA HOLDINGS INC	6,600	39.020	257,532.000	
CABOT OIL & GAS CORP	5,300	70.420	373,226.000	
T-MOBILE US INC	3,650	20.820	75,993.000	
COCA COLA CO	100,000	41.420	4,142,000.000	
COCA-COLA ENTERPRISES	7,100	37.630	267,173.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,200	38.490	200,148.000	
EATON VANCE CORP	3,700	40.830	151,071.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	6,000	55.650	333,900.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	154.270	524,518.000	
CSX CORP	26,100	24.740	645,714.000	
FLUOR CORP	4,200	62.670	263,214.000	
LABORATORY CRP OF AMER HL	2,400	99.810	239,544.000	
EXPEDIA INC	2,675	56.130	150,147.750	
AUTOLIV INC	2,600	79.070	205,582.000	
AMAZON.COM INC	9,000	265.700	2,391,300.000	
FLOWSERVE CORP	1,300	166.840	216,892.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,900	65.400	189,660.000	
EXXON MOBIL CORP	111,455	90.790	10,118,999.450	
EQUINIX INC	1,200	198.030	237,636.000	
FLIR SYSTEMS INC	4,500	24.110	108,495.000	
AES CORP	15,700	12.280	192,796.000	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	2,400	85.710	205,704.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,300	128.220	166,686.000	
EOG RESOURCES INC	6,900	132.160	911,904.000	
EQUITABLE RESOURCES INC	3,700	79.170	292,929.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	4,400	44.650	196,460.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,900	53.260	314,234.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,890	45.420	403,783.800	
FORD MOTOR CO	88,523	15.780	1,396,892.940	
MACY'S INC	9,998	48.390	483,803.220	
DISCOVERY COMMUNICATION-A	3,640	78.690	286,431.600	
FOREST LABORATORIES INC	5,900	40.090	236,531.000	
LIBERTY GLOBAL INC	3,535	74.570	263,604.950	
LIBERTY MEDIA CORP	2,300	124.910	287,293.000	

DISCOVERY COMMUNICATION-C	2,540	69.450	176,403.000	
WARNER CHILCOTT PLC-CL A	5,200	18.540	96,408.000	
FOSSIL INC	1,500	104.850	157,275.000	
NEXTERA ENERGY INC	10,200	76.490	780,198.000	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	24,408	30.850	752,986.800	
US BANCORP	46,400	35.260	1,636,064.000	
FAMILY DOLLAR STORES	2,500	60.170	150,425.000	
F5 NETWORKS INC	2,100	77.320	162,372.000	
FASTENAL CO	7,400	50.920	376,808.000	
FISERV INC	3,400	86.310	293,454.000	
GENERAL ELECTRIC CO	257,200	23.660	6,085,352.000	
GENERAL MOTORS CO	18,300	34.960	639,768.000	
LINKEDIN CORP-A	2,200	162.460	357,412.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,600	77.210	586,796.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11,000	161.680	1,778,480.000	
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,000	35.490	106,470.000	
GOOGLE INC-CL A	6,600	859.100	5,670,060.000	
GENERAL MILLS INC	16,500	47.870	789,855.000	
FIRSTENERGY CORP	10,368	39.070	405,077.760	
GENUINE PARTS CO	3,900	76.810	299,559.000	
FIFTH THIRD BANCORP	21,800	17.920	390,656.000	
HARRIS CORP	2,900	50.080	145,232.000	
HALLIBURTON CO	23,700	41.990	995,163.000	
HOME DEPOT INC	37,300	76.630	2,858,299.000	
ASSURANT INC	2,600	48.980	127,348.000	
HERSHEY CO/THE	3,900	88.900	346,710.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	5,700	54.070	308,199.000	
HUMANA INC	4,100	80.180	328,738.000	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,000	67.340	336,700.000	
HELMERICH & PAYNE	2,700	62.810	169,587.000	
WINDSTREAM CORP	17,100	7.980	136,458.000	
HENRY SCHEIN INC	2,200	95.760	210,672.000	
HEWLETT-PACKARD CO	48,900	24.620	1,203,918.000	
DIRECTV	13,682	61.570	842,400.740	
HOLLYFRONTIER CORP	5,000	47.850	239,250.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	51.580	185,688.000	
HEINZ H J CO	8,000	72.460	579,680.000	
INT'L BUSINESS MACHINES	26,300	206.190	5,422,797.000	
INTERNATIONAL PAPER	10,700	45.510	486,957.000	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	7,629	57.060	435,310.740	
LEGGETT & PLATT INC	4,200	31.380	131,796.000	
LIBERTY GLOBAL INC-C	2,835	69.660	197,486.100	
JUNIPER NETWORKS INC	13,100	17.390	227,809.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	2,800	102.640	287,392.000	
JOHNSON & JOHNSON	69,000	84.100	5,802,900.000	
ABBVIE INC	38,900	43.630	1,697,207.000	
HOLOGIC INC	7,100	20.740	147,254.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,800	97.580	956,284.000	
KROGER CO	12,200	33.950	414,190.000	
KLA-TENCOR CORPORATION	4,200	56.980	239,316.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,000	105.070	735,490.000	
L BRANDS INC	6,500	51.940	337,610.000	
LOWE'S COS INC	27,600	40.990	1,131,324.000	
ELI LILLY & CO	25,400	52.500	1,333,500.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN	4,300	21.180	91,074.000	
LAM RESEARCH CORP	4,300	47.980	206,314.000	
RANGE RESOURCES CORP	4,100	74.390	304,999.000	

LSI CORP	17,000	7.400	125,800.000	
LOEWS CORP	8,000	45.250	362,000.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,149	34.800	248,785.200	
MCDONALD'S CORP	24,900	98.370	2,449,413.000	
3M CO	16,200	110.020	1,782,324.000	
FACEBOOK INC-A	38,400	23.520	903,168.000	
MANPOWER INC	2,300	55.920	128,616.000	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,300	54.620	344,106.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,300	106.980	139,074.000	
CONCHO RESOURCES INC	2,500	86.270	215,675.000	
PHILLIPS 66	14,600	65.180	951,628.000	
MURPHY OIL CORP	4,600	63.020	289,892.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,800	15.010	162,108.000	
MATTEL INC	9,000	44.810	403,290.000	
KBR INC	4,200	35.010	147,042.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SH	3,100	69.470	215,357.000	
MYLAN INC	10,400	29.870	310,648.000	
METLIFE INC	22,300	43.960	980,308.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	14,500	10.810	156,745.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,328	57.410	363,290.480	
MONSANTO CO	13,506	102.110	1,379,097.660	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,600	87.490	314,964.000	
MERCK & CO INC	75,121	49.440	3,713,982.240	
MASCO CORP	9,700	20.020	194,194.000	
M & T BANK CORP	2,900	104.290	302,441.000	
MARSH & MCLENNAN COS	14,000	39.930	559,020.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -A	6,582	40.410	265,978.620	
NETAPP INC	9,400	37.290	350,526.000	
NIKE INC -CL B	17,700	62.780	1,111,206.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,900	77.000	608,300.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,300	37.090	196,577.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,600	82.420	461,552.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,400	48.760	360,824.000	
NEWMONT MINIG CORP	12,600	34.450	434,070.000	
KRAFT FOODS GROUP INC	14,403	54.400	783,523.200	
ADT CORP/THE	5,762	40.400	232,784.800	
MCKESSON CORP	6,000	112.310	673,860.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,300	29.210	213,233.000	
XYLEM INC	5,700	27.860	158,802.000	
PHILIP MORRIS INTERNATION	40,500	91.890	3,721,545.000	
NUCOR CORP	8,100	45.160	365,796.000	
NABORS INDUSTRIES LTD	8,300	16.350	135,705.000	
WESTERN UNION CO	14,846	16.360	242,880.560	
NEWELL RUBBERMAID INC	7,100	26.900	190,990.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM	20,100	94.260	1,894,626.000	
OMNICARE INC	3,200	45.950	147,040.000	
PAYCHEX INC	8,200	37.100	304,220.000	
J.C.PENNY CO INC(HLDG CO)	4,400	17.960	79,024.000	
PATTERSON COS INC	2,900	38.990	113,071.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	109.530	317,637.000	
ALTRIA GROUP INC	50,100	36.210	1,814,121.000	
OWENS-ILLINOIS INC	4,600	27.520	126,592.000	
PG & E CORPORATION	11,200	44.650	500,080.000	
ONYX PHARMACEUTICALS INC	1,600	89.600	143,360.000	
PFIZER INC	178,163	27.660	4,927,988.580	
XCEL ENERGY INC	12,700	28.860	366,522.000	
STRYKER CORP	7,900	66.700	526,930.000	

PARKER HANNIFIN CORP	3,800	98.440	374,072.000	
PALL CORP	2,800	67.610	189,308.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES	3,100	140.000	434,000.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,700	95.410	162,197.000	
PROCTER & GAMBLE CO	67,337	77.370	5,209,863.690	
EXELON CORP	21,722	31.590	686,197.980	
ALEXION PHARMACEUTICALS	4,900	92.560	453,544.000	
CONOCOPHILLIPS	29,100	61.680	1,794,888.000	
PEPSICO INC	37,900	81.630	3,093,777.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,300	69.070	780,491.000	
AMERICAN WATER WORKS CO	4,400	39.810	175,164.000	
ACCENTURE LTD-CL A	15,900	81.250	1,291,875.000	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,700	44.130	119,151.000	
PENTAIR LTD-REGISTERED	5,205	57.770	300,692.850	
QUALCOMM INC	42,100	63.710	2,682,191.000	
PARTNERRE LTD	1,500	88.990	133,485.000	
INVESCO LTD	11,450	33.300	381,285.000	
ADVANCE AUTO PARTS	1,850	81.990	151,681.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,500	37.640	282,300.000	
MDU RESOURCES GROUP INC	5,200	25.430	132,236.000	
ENERGEN CORP	2,000	54.290	108,580.000	
RAYTHEON CO	8,400	66.350	557,340.000	
SCRIPPS NETWORKS INTER-A	2,200	67.100	147,620.000	
RED HAT INC	4,800	46.180	221,664.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,800	232.880	419,184.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,100	34.150	242,465.000	
PRICELINE.COM INC	1,200	798.690	958,428.000	
ROSS STORES INC	5,400	64.650	349,110.000	
QEP RESOURCES INC	4,400	29.370	129,228.000	
RESMED INC	3,600	47.530	171,108.000	
QUEST DIAGNOSTICS	4,000	62.400	249,600.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,700	34.010	125,837.000	
REYNOLDS AMERICAN INC	8,400	48.890	410,676.000	
RALPH LAUREN CORP	1,500	176.320	264,480.000	
ROWAN COS PLC	3,700	33.330	123,321.000	
ROCKWELL COLLINS INC.	3,500	64.920	227,220.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	35,435	8.980	318,206.300	
CHEVRON CORP	48,118	122.960	5,916,589.280	
EDISON INTERNATIONAL	7,900	46.270	365,533.000	
SYMANTEC CORP	16,700	21.900	365,730.000	
STANLEY BLACK & DECKER IN	4,022	78.640	316,290.080	
SYNOPSYS INC	3,900	36.560	142,584.000	
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	114.950	160,930.000	
CBRE GROUP INC	7,800	23.050	179,790.000	
COBALT INT'L ENERGY	6,000	25.870	155,220.000	
SLM CORP	11,500	23.840	274,160.000	
SANDISK CORP	6,100	58.140	354,654.000	
SOUTHERN CO	22,000	43.950	966,900.000	
SYSCO CORP	14,600	34.180	499,028.000	
TRAVELERS COS INC	9,623	83.820	806,599.860	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,000	37.870	340,830.000	
SPX CORP	1,400	77.710	108,794.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,100	30.230	123,943.000	
STERICYCLE INC	2,200	108.020	237,644.000	
SCHLUMBERGER LTD	32,667	72.850	2,379,790.950	
RACKSPACE HOSTING INC	2,700	35.690	96,363.000	
AT&T INC	136,095	35.670	4,854,508.650	

SOUTHWEST AIRLINES CO	6,000	13.920	83,520.000	
SIGMA-ALDRICH	3,000	83.920	251,760.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,300	182.600	419,980.000	
SEMPRA ENERGY	6,000	80.120	480,720.000	
TIFFANY & CO	3,200	78.840	252,288.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	8,500	44.740	380,290.000	
TEXAS INSTRUMENT INC	27,300	36.640	1,000,272.000	
SALESFORCE.COM INC	13,400	37.800	506,520.000	
SUPERIOR ENERGY SERVICES	4,200	26.280	110,376.000	
TRW INC	3,000	63.350	190,050.000	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	1,800	99.880	179,784.000	
TIME WARNER CABLE	7,253	95.230	690,703.190	
TYCO INTERNATIONAL LTD	11,725	33.700	395,132.500	
TESORO CORP	3,000	59.440	178,320.000	
UNION PACIFIC CORP	11,700	155.720	1,821,924.000	
MARATHON OIL CORP	17,600	34.940	614,944.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	8,200	80.630	661,166.000	
UNITED TECHNOLOGIES	21,600	94.280	2,036,448.000	
UNITED PARCEL SERVICE-B	18,400	85.960	1,581,664.000	
SPRINT NEXTEL CORP	73,222	7.260	531,591.720	
UNUM GROUP	7,000	28.180	197,260.000	
AMEREN CORPORATION	6,500	34.020	221,130.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	25,326	62.360	1,579,329.360	
VERISIGN INC	4,000	45.860	183,440.000	
VALERO ENERGY CORP	14,092	38.960	549,024.320	
ULTA SALON COSME	1,600	87.110	139,376.000	
WEYERHAEUSER CO	13,994	29.230	409,044.620	
WELLPOINT INC	7,700	77.440	596,288.000	
THE WALT DISNEY CO.	42,000	64.350	2,702,700.000	
WELLS FARGO & CO	124,572	40.440	5,037,691.680	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,200	56.620	124,564.000	
WASTE MANAGEMENT INC	11,400	41.770	476,178.000	
WILLIAMS COMPANY	15,900	34.460	547,914.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,800	108.620	195,516.000	
WHITING PETROLEUM CORP	2,900	46.620	135,198.000	
WHIRLPOOL CORP	1,900	122.630	232,997.000	
WAL-MART STORES	41,100	75.940	3,121,134.000	
ZIMMER HOLDINGS INC	4,300	77.600	333,680.000	
WEATHERFORD INTERNATIONAL	18,900	13.400	253,260.000	
WYNN RESORTS LTD	2,100	136.840	287,364.000	
XEROX CORP	29,044	8.990	261,105.560	
TJX COMPANIES INC	18,200	50.510	919,282.000	
WATERS CORP	2,200	96.590	212,498.000	
ACTAVIS INC	3,300	119.910	395,703.000	
WHOLE FOODS MARKET INC	9,000	51.240	461,160.000	
WALGREEN CO	22,200	48.030	1,066,266.000	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	4,100	39.240	160,884.000	
WESTERN DIGITAL CORP	5,600	63.420	355,152.000	
WISCONSIN ENERGY CORP	5,800	40.820	236,756.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	13,000	32.840	426,920.000	
VISA INC-CLASS A SHS	13,200	180.200	2,378,640.000	
PPL CORPORATION	14,700	29.700	436,590.000	
PEPCO HOLDINGS INC	6,400	20.740	132,736.000	
PULTE GROUP INC	8,200	20.560	168,592.000	
ULTRA PETROLEUM CORP	4,100	22.860	93,726.000	
PPG INDUSTRIES INC	3,700	153.560	568,172.000	
NORTHERN TRUST CORP	5,500	57.810	317,955.000	

PRECISION CASTPARTS CORP	3,700	213.900	791,430.000	
NVIDIA CORP	15,550	14.470	225,008.500	
PNC FINANCIAL SERVICES	13,193	71.090	937,890.370	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	13,050	23.000	300,150.000	
TERADATA CORP	4,200	55.180	231,756.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,100	25.200	178,920.000	
NETFLIX.COM INC	1,300	225.310	292,903.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC	8,700	88.270	767,949.000	
NRG ENERGY INC	8,500	25.190	214,115.000	
TORCHMARK CORP	2,450	63.270	155,011.500	
TEXTRON INC	7,500	26.460	198,450.000	
NEWS CORP-CL A	37,750	32.470	1,225,742.500	
NEWS CORP-CLASS B	10,900	32.620	355,558.000	
OGE ENERGY CORP	2,200	67.200	147,840.000	
OMNICOM GROUP	6,700	61.930	414,931.000	
ORACLE CORPORATION	92,883	34.160	3,172,883.280	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,600	568.220	1,477,372.000	
ONEOK INC	4,900	44.140	216,286.000	
OCEANEERING INTL INC	2,700	71.410	192,807.000	
CENTURYLINK INC	15,695	34.760	545,558.200	
ROPER INDUSTRIES INC	2,500	123.960	309,900.000	
YUM! BRANDS INC	11,300	68.860	778,118.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR	1,300	176.660	229,658.000	
MOLSON COORS BREWING CO-B	3,800	50.380	191,444.000	
NOBLE ENERGY INC	9,000	57.750	519,750.000	
BANK OF AMERICA CORP	265,701	13.360	3,549,765.360	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL	2,800	59.820	167,496.000	
NORDSTROM INC	4,100	59.390	243,499.000	
AMERICAN EXPRESS CO	24,800	76.060	1,886,288.000	
ANALOG DEVICES INC	7,900	46.130	364,427.000	
TD AMERITRADE HOLDING COR	6,500	23.040	149,760.000	
AMERICAN INTL GROUP	34,872	44.100	1,537,855.200	
ANADARKO PETROLEUM CORP	12,400	87.520	1,085,248.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES L	4,300	34.370	147,791.000	
HUDSON CITY BANCORP INC	14,800	8.510	125,948.000	
AVERY DENNISON CORP	3,000	43.100	129,300.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-	7,600	64.820	492,632.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,600	57.150	1,005,840.000	
AON CORP	7,300	63.080	460,484.000	
AMGEN	18,500	97.290	1,799,865.000	
CORE LABORATORIES N.V.	1,200	134.350	161,220.000	
ALLERGAN INC	7,400	98.470	728,678.000	
COACH INC	7,300	58.570	427,561.000	
EATON CORP PLC	11,886	65.590	779,602.740	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,200	69.850	502,920.000	
CELGENE CORP	10,400	117.770	1,224,808.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-	4,200	52.110	218,862.000	
APPLIED MATERIALS INC	29,800	15.540	463,092.000	
CIT GROUP INC	5,100	45.790	233,529.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,100	70.870	148,827.000	
CME GROUP INC	8,000	69.170	553,360.000	
NATIONAL OILWELL VARCO IN	10,944	69.900	764,985.600	
ECOLAB INC	6,600	84.520	557,832.000	
EQUIFAX INC	3,000	60.920	182,760.000	
GAP INC	8,000	40.930	327,440.000	
GILEAD SCIENCES INC	37,700	52.320	1,972,464.000	
ST JUDE MEDICAL INC	7,000	42.520	297,640.000	

DR PEPPER SNAPPLE GROUP	5,448	46.910	255,565.680	
HORMEL FOODS CORP	3,600	39.800	143,280.000	
SAFEWAY INC	6,300	22.970	144,711.000	
STATE STREET CORP	11,343	66.150	750,339.450	
STAPLES INC	17,300	15.110	261,403.000	
SUNTRUST BANKS INC	13,848	32.020	443,412.960	
SCHWAB(CHARLES) CORP	27,600	19.580	540,408.000	
IHS INC-CLASS A	1,400	105.800	148,120.000	
BAXTER INTL INC	13,500	69.780	942,030.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,900	43.530	213,297.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,600	42.160	151,776.000	
CHUBB CORP	6,400	86.160	551,424.000	
CARDINAL HEALTH INC	8,800	46.490	409,112.000	
CAREFUSION CORP	5,550	37.700	209,235.000	
FEDEX CORP	7,600	98.380	747,688.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL COR	14,754	61.260	903,830.040	
FMC CORP	3,400	62.180	211,412.000	
FLEXTRONICS INTL LTD	22,600	7.610	171,986.000	
CERNER CORP	3,700	99.040	366,448.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,000	80.220	160,440.000	
CITRIX SYSTEMS INC	4,700	62.410	293,327.000	
INTEL CORP	121,500	25.360	3,081,240.000	
CAMERON INTERNATIONAL COR	6,300	60.020	378,126.000	
INTERPUBLIC GROUP CDS INC	10,600	14.190	150,414.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	10,600	29.730	315,138.000	
IRON MOUNTAIN INC	3,647	34.500	125,821.500	
CREE INC	2,700	62.360	168,372.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,600	70.040	742,424.000	
SIRIUS XM RADIO INC	83,900	3.410	286,099.000	
ILLUMINA INC	3,100	69.890	216,659.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,400	21.720	291,048.000	
SEALED AIR CORP	5,500	24.560	135,080.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,000	498.590	498,590.000	
CALPINE CORP	7,300	19.680	143,664.000	
CABLEVISION SYSTEMS-NY A	6,100	15.110	92,171.000	
CARMAX INC	5,700	46.120	262,884.000	
COMERICA INC	4,700	38.610	181,467.000	
DUKE ENERGY CORP	17,428	67.150	1,170,290.200	
TARGET CORP	15,200	71.510	1,086,952.000	
DOVER CORP	4,600	79.210	364,366.000	
WW GRAINGER INC	1,500	256.730	385,095.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP	3,500	56.900	199,150.000	
JOHNSON CONTROLS INC	17,600	37.160	654,016.000	
CINTAS CORP	2,800	45.400	127,120.000	
CA INC	8,005	27.610	221,018.050	
CONAGRA INC	10,300	33.530	345,359.000	
CLOROX COMPANY	3,200	84.220	269,504.000	
ENTERGY CORP	4,700	68.240	320,728.000	
MICROSOFT CORP	190,500	34.990	6,665,595.000	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,300	73.980	318,114.000	
CVS CAREMARK CORP	30,674	57.490	1,763,448.260	
MEDTRONIC INC	25,000	51.420	1,285,500.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	25,300	11.710	296,263.000	
BLACKROCK INC-CLASS A	3,400	276.280	939,352.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	10,700	23.110	247,277.000	
HASBRO INC	2,900	44.660	129,514.000	
KELLOGG CO	6,500	63.050	409,825.000	

	KEYCORP	23,200	10.670	247,544.000	
	KANSAS CITY SOUTHERN	2,800	108.850	304,780.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL IN	42,611	29.570	1,260,007.270	
	KOHLS CORP	5,400	51.850	279,990.000	
	SEARS HOLDING CORP	1,225	48.040	58,849.000	
	NEW YORK COMMUNITY BANCOR	11,100	13.070	145,077.000	
	APACHE CORP	9,810	84.350	827,473.500	
	ACE LTD	8,500	88.790	754,715.000	
	ARROW ELECTRONICS INC	3,200	39.790	127,328.000	
	ALLSTATE	12,300	46.680	574,164.000	
	EBAY INC	29,000	52.590	1,525,110.000	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,800	71.110	270,218.000	
	XILINX INC	6,600	40.690	268,554.000	
	EXPRESS SCRIPTS HOLDING	20,710	62.350	1,291,268.500	
	DISH NETWORK CORP	5,300	38.820	205,746.000	
	YAHOO! INC	24,300	26.260	638,118.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-A	6,100	67.470	411,567.000	
	TOLL BROTHERS INC	4,500	32.920	148,140.000	
	TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,000	27.230	163,380.000	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,800	37.600	218,080.000	
	LENNAR CORP	3,900	38.040	148,356.000	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,400	25.510	239,794.000	
	NOBLE CORP	6,500	39.200	254,800.000	
	PROGRESSIVE CORP	14,600	25.020	365,292.000	
	PRAXAIR INC	7,400	116.660	863,284.000	
	PACCAR INC	8,337	53.830	448,780.710	
	PETSMART INC	2,800	67.190	188,132.000	
	PVH CORP	2,100	112.540	236,334.000	
	EMC CORP/MASS	51,300	24.420	1,252,746.000	
	BIOGEN IDEC INC	5,730	219.740	1,259,110.200	
	INTL GAME TECHNOLOGY	8,100	17.510	141,831.000	
	STARBUCKS CORP	18,800	63.330	1,190,604.000	
	PERRIGO CO	2,200	114.620	252,164.000	
	NORTHEAST UTILITIES	8,180	41.540	339,797.200	
	INTUIT INC	7,200	57.780	416,016.000	
	BORG-WARNER AUTOMOTIVE	3,100	80.380	249,178.000	
	BEST BUY COMPANY INC	7,100	27.400	194,540.000	
	BALL CORP	3,700	43.360	160,432.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,247	9.150	331,660.050	
	BED BATH & BEYOND INC	5,800	66.980	388,484.000	
	XL GROUP PLC	7,500	31.370	235,275.000	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,100	22.720	206,752.000	
	VULCAN MATERIALS CO	3,200	52.090	166,688.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS IN	5,400	78.360	423,144.000	
	VF CORP	2,200	186.640	410,608.000	
	CBS CORP-CL B	15,071	49.110	740,136.810	
	VIACOM INC-CLASS B	11,371	67.040	762,311.840	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,500	107.000	160,500.000	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,000	18.980	113,880.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN	2,800	66.840	187,152.000	
	CARNIVAL CORP	9,700	32.360	313,892.000	
	COMCAST CORP -CL A	51,770	40.920	2,118,428.400	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	12,600	39.230	494,298.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 372,093,275.180 (37,302,350,837)	

イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	481,500	4.695	2,260,642.500	
	UNILEVER PLC	32,660	27.560	900,109.600	
	BARCLAYS PLC	302,600	3.203	969,227.800	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	48,400	11.900	575,960.000	
	TUI TRAVEL PLC	16,100	3.549	57,138.900	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	43,400	4.663	202,374.200	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,300	51.300	117,990.000	
	REXAM PLC	21,780	5.265	114,671.700	
	PRUDENTIAL PLC	64,600	11.120	718,352.000	
	INMARSAT PLC	12,800	6.210	79,488.000	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GR	57,491	3.354	192,824.810	
	JOHNSON MATTHEY PLC	5,509	26.030	143,399.270	
	BAE SYSTEMS PLC	82,600	4.064	335,686.400	
	AVIVA PLC	77,400	3.350	259,290.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	125,002	16.920	2,115,033.840	
	MELROSE PLC	30,600	2.615	80,019.000	
	INVENSYS PLC	23,500	4.018	94,423.000	
	REED ELSEVIER PLC	31,446	7.410	233,014.860	
	BG GROUP PLC	86,200	12.050	1,038,710.000	
	DIAGEO PLC	64,000	19.560	1,251,840.000	
	RIO TINTO PLC-REG	31,700	28.820	913,594.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	61,100	15.425	942,467.500	
	TESCO PLC	207,800	3.644	757,223.200	
	FRESNILLO PLC	5,000	11.650	58,250.000	
	SMITH & NEPHEW PLC	24,300	7.555	183,586.500	
	GLENCORE INTERNATIONAL PL	254,525	3.264	830,769.600	
	SMITHS GROUP PLC	10,733	13.490	144,788.170	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	10,000	11.520	115,200.000	
	PEARSON PLC	21,763	12.130	263,985.190	
	SAINSBURY (J) PLC	31,125	3.719	115,753.870	
	NEXT PLC	4,100	46.870	192,167.000	
	WHITBREAD PLC	4,511	28.870	130,232.570	
	IMI PLC	8,300	12.800	106,240.000	
	BUNZL PLC	8,455	12.790	108,139.450	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	24,800	4.639	115,047.200	
	GKN PLC	41,100	3.134	128,807.400	
	VODAFONE GROUP PLC	1,247,637	1.920	2,395,463.040	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	24.730	96,447.000	
	KINGFISHER PLC	61,211	3.513	215,034.240	
	WPP PLC	32,400	11.200	362,880.000	
	UNITED UTILITIES GROUP PL	18,327	7.540	138,185.580	
	SEVERN TRENT PLC	6,433	20.320	130,718.560	
	RECKITT BENCKISER PLC	16,400	46.940	769,816.000	
	SCHRODERS PLC	3,200	23.640	75,648.000	
	TATE&LYLE PLC	12,800	8.320	106,496.000	
	AMEC PLC	7,900	10.240	80,896.000	
	SSE PLC	24,300	15.350	373,005.000	
	WEIR GROUP PLC (THE)	5,500	23.230	127,765.000	
	ASTRAZENECA PLC	31,100	33.430	1,039,673.000	
	WOLSELEY PLC	7,233	31.450	227,477.850	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	155,800	1.805	281,219.000	
	3I GROUP PLC	27,591	3.438	94,857.850	
	BRITISH SKY BROADCASTING	27,500	7.860	216,150.000	
	SAGE GROUP PLC (THE)	32,100	3.541	113,666.100	
	NATIONAL GRID PLC	92,828	7.905	733,805.340	

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,098,865	0.625	686,790.620	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	96,300	1.147	110,456.100	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP	25,100	24.060	603,906.000	
	CENTRICA PLC	134,660	3.714	500,127.240	
	ARM HOLDINGS PLC	36,500	9.240	337,260.000	
	BRIT AMERICAN TOBACCO PLC	49,260	36.340	1,790,108.400	
	ICAP PLC	16,900	3.661	61,870.900	
	SABMILLER PLC	24,400	33.600	819,840.000	
	BHP BILLITON PLC	53,777	18.945	1,018,805.260	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS	9,100	18.670	169,897.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	470,700	7.319	3,445,053.300	
	SHIRE PLC	14,600	21.450	313,170.000	
	OLD MUTUAL PLC	126,425	2.056	259,929.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	35,183	15.185	534,253.850	
	MORRISON SUPERMARKETS	59,900	2.722	163,047.800	
	CARNIVAL PLC	4,561	21.570	98,380.770	
	COMPASS GROUP PLC	47,700	8.660	413,082.000	
	BT GROUP PLC	202,000	2.964	598,728.000	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	4,500	17.470	78,615.000	
	WILLIAM HILL PLC	20,400	4.320	88,128.000	
	BURBERRY GROUP PLC	11,289	14.350	161,997.150	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	7,346	18.960	139,280.160	
	AGGREKO PLC	6,871	16.870	115,913.770	
	CAPITA PLC	16,690	9.650	161,058.500	
	SERCO GROUP PLC	15,300	6.100	93,330.000	
	INTERTEK GROUP PLC	4,100	32.030	131,323.000	
	ITV PLC	92,900	1.295	120,305.500	
	TULLOW OIL PLC	24,000	10.550	253,200.000	
	VEDANTA RESOURCES PLC	3,500	12.840	44,940.000	
	PETROFAC LTD	7,000	13.370	93,590.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	4,349	14.040	61,059.960	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S	95,800	21.725	2,081,255.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	66,981	22.500	1,507,072.500	
	MEGGITT PLC	19,800	5.330	105,534.000	
	G4S PLC	38,000	2.495	94,810.000	
	COBHAM PLC	31,500	2.729	85,963.500	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,700	13.200	75,240.000	
	INVESTEC PLC	16,400	4.650	76,260.000	
	ANTOFAGASTA PLC	10,800	9.560	103,248.000	
	STANDARD LIFE PLC	61,500	3.919	241,018.500	
	EXPERIAN PLC	26,254	12.120	318,198.480	
	RESOLUTION LTD	37,876	2.867	108,590.490	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 42,690,289.640 (6,543,994,499)	
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	4.651	262,316.400	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	14,000	41.780	584,920.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND L	21,800	141.400	3,082,520.000	
	BANK HAPOALIM BM	36,300	17.590	638,517.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	37,600	12.890	484,664.000	
	NICE SYSTEMS LTD	2,100	135.600	284,760.000	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	800	182.000	145,600.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 5,483,297.400 (149,694,018)	

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	82,100	34.260	2,812,746.000	
	LEND LEASE	13,800	9.790	135,102.000	
	ASCIANO LTD	28,600	4.900	140,140.000	
	ALUMINA LTD	69,900	1.050	73,395.000	
	WOODSIDE PETROLEUM	16,900	36.110	610,259.000	
	FORTESCUE METALS GROUP	39,700	3.460	137,362.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	11,800	9.910	116,938.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	59,900	29.610	1,773,639.000	
	WESTPAC BANKING	78,798	28.950	2,281,202.100	
	SANTOS LIMITED	24,400	12.900	314,760.000	
	AUSTRALIA & NZLAND BK	70,000	27.910	1,953,700.000	
	RIO TINTO LTD	11,500	55.130	633,995.000	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	28,100	13.320	374,292.000	
	AMCOR	31,100	9.750	303,225.000	
	METCASH LTD	23,500	3.880	91,180.000	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP	20,500	2.850	58,425.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	46,800	4.280	200,304.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	14,600	5.900	86,140.000	
	NEWCREST MINING	20,000	15.150	303,000.000	
	INCITEC PIVOT LTD	45,600	2.860	130,416.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	41,000	67.150	2,753,150.000	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,800	22.410	107,568.000	
	ORICA LIMITED	9,300	22.000	204,600.000	
	QBE INSURANCE	30,500	15.610	476,105.000	
	LEIGHTON HOLDINGS	4,600	17.670	81,282.000	
	WOOLWORTHS	32,100	32.550	1,044,855.000	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	15,900	12.780	203,202.000	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20,500	3.280	67,240.000	
	CROWN LTD	10,600	12.590	133,454.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	38,700	1.565	60,565.500	
	TELSTRA CORPORATION	113,000	4.670	527,710.000	
	AMP LIMITED	79,400	5.150	408,910.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES	11,400	9.690	110,466.000	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	7,800	42.130	328,614.000	
	CSL LIMITED	12,700	59.260	752,602.000	
	WESFARMERS LIMITED	26,200	38.910	1,019,442.000	
	COCHLEAR LIMITED	1,700	56.010	95,217.000	
	SUNCORP GROUP LTD	33,100	12.530	414,743.000	
	BORAL LIMITED	22,700	4.410	100,107.000	
	ASX LTD	5,000	36.800	184,000.000	
	COMPUTERSHARE LIMITED	13,900	10.530	146,367.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LT	14,000	2.600	36,400.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	53,400	5.620	300,108.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	9,500	14.200	134,900.000	
	TRANSURBAN GROUP	33,400	6.960	232,464.000	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,000	11.400	136,800.000	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	18,800	4.830	90,804.000	
	SYDNEY AIRPORT	6,700	3.550	23,785.000	
	WORLEYPARSONS LTD	6,100	20.390	124,379.000	
	TATTS GROUP LTD	36,900	3.180	117,342.000	
	AGL ENERGY LTD	14,000	14.470	202,580.000	
	BRAMBLES LTD	42,700	9.040	386,008.000	
	APA GROUP	21,700	6.350	137,795.000	
	ALS LTD	9,500	9.940	94,430.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル	

				23,768,214.600 (2,295,534,166)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,500	40.360	302,700.000	
	SILVER WHEATON CORP	9,300	24.680	229,524.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,400	62.300	211,820.000	
	BCE INC	6,530	46.170	301,490.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,700	44.040	162,948.000	
	SUNCOR ENERGY INC	38,680	31.780	1,229,250.400	
	METRO INC-A	2,500	68.630	171,575.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,300	76.570	329,251.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	30,400	58.710	1,784,784.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	10,200	78.060	796,212.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	23,400	84.020	1,966,068.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	7,200	29.030	209,016.000	
	MEG ENERGY CORP	3,800	29.010	110,238.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	36,900	61.190	2,257,911.000	
	TOURMALINE OIL CORP	3,800	41.640	158,232.000	
	VERMILION ENERGY INC	2,800	52.070	145,796.000	
	TRANSCANADA CORP	18,200	47.400	862,680.000	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,400	38.840	132,056.000	
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,600	16.070	73,922.000	
	PENGROWTH ENERGY CORP	14,700	5.400	79,380.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,500	32.890	246,675.000	
	BOMBARDIER INC 'B'	36,600	4.880	178,608.000	
	BARRICK GOLD CORP	25,900	21.580	558,922.000	
	CAE INC	9,200	10.950	100,740.000	
	THOMSON REUTERS CORP	9,804	34.980	342,943.920	
	POTASH CORP OF SASKATCHEW	21,800	43.430	946,774.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	3,500	49.340	172,690.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,800	76.010	136,818.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS-B	9,200	46.450	427,340.000	
	AGNICO-EAGLE MINES	4,400	33.470	147,268.000	
	ATHABASCA OIL CORP	9,000	7.280	65,520.000	
	KINROSS GOLD CORP	29,500	6.660	196,470.000	
	BANK OF MONTREAL	16,500	61.280	1,011,120.000	
	POWER CORP OF CANADA	9,200	29.020	266,984.000	
	CAMECO CORP	10,300	22.350	230,205.000	
	TELUS CORP	6,400	35.810	229,184.000	
	POWER FINANCIAL CORP	6,300	31.440	198,072.000	
	NEW GOLD INC	14,000	7.090	99,260.000	
	TECK RESOURECES LIMITED-B	15,100	27.820	420,082.000	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,000	83.690	167,380.000	
	TALISMAN ENERGY INC	27,000	12.120	327,240.000	
	TURQUOISE HILL RESOURCES	11,100	6.930	76,923.000	
	AGRIUM INC	3,800	95.200	361,760.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCE	28,200	30.390	856,998.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	5,800	69.700	404,260.000	
	TRANSALTA CORP	6,700	14.600	97,820.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	1,400	82.790	115,906.000	
	RESEARCH IN MOTION	11,900	13.970	166,243.000	
	SUN LIFE FINANCIAL SVSC	15,200	30.220	459,344.000	
	ENBRIDGE INC	19,800	44.690	884,862.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-A	14,200	36.150	513,330.000	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERT	8,750	18.040	157,850.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	47,200	16.290	768,888.000	

	VALEANT PHARMACEUTICALS I	7,200	88.180	634,896.000	
	GOLDCORP INC	20,559	30.420	625,404.780	
	ENCANA CORP	18,900	19.300	364,770.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY	4,400	131.760	579,744.000	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR	2,800	39.370	110,236.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,400	41.590	141,406.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	10,800	105.630	1,140,804.000	
	CGI GROUP INC - CL A	5,300	31.650	167,745.000	
	HUSKY ENERGY INC	8,800	29.170	256,696.000	
	ONEX CORPORATION	2,300	49.000	112,700.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9,800	23.370	229,026.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	5,200	22.670	117,884.000	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	5,100	45.540	232,254.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	3,800	40.580	154,204.000	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	17,200	8.300	142,760.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	48.720	151,032.000	
	OPEN TEXT CORP	2,000	72.940	145,880.000	
	CI FINANCIAL CORP	5,600	30.690	171,864.000	
	SAPUTO INC	3,300	50.520	166,716.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LT	12,400	18.670	231,508.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD	3,500	57.700	201,950.000	
	YAMANA GOLD INC	20,000	12.210	244,200.000	
	FORTIS INC	4,900	33.070	162,043.000	
	CRESCENT POINT ENERGY COR	9,400	36.740	345,356.000	
	CENOVUS ENERGY INC	19,200	31.310	601,152.000	
	TIM HORTONS INC	3,900	55.120	214,968.000	
	DOLLARAMA INC	1,600	74.150	118,640.000	
	CATAMARAN CORP	5,400	49.960	269,784.000	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	12,400	20.000	248,000.000	
	ENERPLUS CORP	6,000	15.770	94,620.000	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	13,600	10.900	148,240.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,400	28.630	211,862.000	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY C	8,100	22.310	180,711.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 31,768,389.200 (3,074,862,390)	
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	34,000	20.920	711,280.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	44,000	16.620	731,280.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,470	10.630	175,076.100	
	KEPPEL CORP	41,500	10.570	438,655.000	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	6.800	131,920.000	
	CITY DEVELOPMENT	17,000	10.850	184,450.000	
	CAPITALAND LIMITED	67,000	3.490	233,830.000	
	SEMBCORP MARINE LTD	25,000	4.360	109,000.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	49,000	4.320	211,680.000	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT	3,000	46.050	138,150.000	
	O.C.B.C.	68,000	10.480	712,640.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	175,000	1.435	251,125.000	
	SINGAPORE TELECOM LTD	203,450	3.820	777,179.000	
	NOBLE GROUP LTD	115,181	1.025	118,060.520	
	SINGAP. TECH ENGINEERING	48,000	4.080	195,840.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	36,000	4.900	176,400.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	219,400	0.575	126,155.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,000	7.390	199,530.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	50,000	1.715	85,750.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56,000	3.250	182,000.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	45,000	1.945	87,525.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIE	56,000	2.730	152,880.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 6,130,405.620 (489,635,497)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ADECCO SA-REG	3,850	52.800	203,280.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUS	18,000	232.100	4,177,800.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	800	66.000	52,800.000	
	SIKA AG-BR	60	2,337.000	140,220.000	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	40,500.000	121,500.000	
	ABB LTD	57,150	21.000	1,200,150.000	
	ARYZTA AG	2,700	55.850	150,795.000	
	TRANSOCEAN LTD	9,350	48.560	454,036.000	
	SWISS RE LTD	9,400	69.600	654,240.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	82,150	63.950	5,253,492.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CE	1,250	137.600	172,000.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	34,470	28.230	973,088.100	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,250	37.600	235,000.000	
	SULZER AG-REG	800	159.000	127,200.000	
	SGS SA	150	2,182.000	327,300.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	850	555.000	471,750.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,782	251.800	952,307.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,600	93.800	150,080.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	58,550	68.250	3,996,037.500	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	13,350	84.150	1,123,402.500	
	UBS AG-REGISTERED	92,600	17.080	1,581,608.000	
	SWISSCOM AG-REG	670	404.900	271,283.000	
	GEBERIT AG-REG	1,050	236.700	248,535.000	
	GIVAUDAN REG	220	1,216.000	267,520.000	
	ACTELION LTD-REG	2,750	56.300	154,825.000	
	SYNGENTA AG	2,462	375.800	925,219.600	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,450	106.000	153,700.000	
	LONZA GROUP AG-REG	1,550	72.800	112,840.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,500	95.600	143,400.000	
	HOLCIM LTD-REG	6,200	73.700	456,940.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	950	161.100	153,045.000	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	1,650	104.800	172,920.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 25,578,314.800 (2,702,093,175)	
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	79,130	78.500	6,211,705.000	
	VOLVO AB-B SHS	36,700	98.350	3,609,445.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SD	1,700	524.000	890,800.000	
	S.K.F. AB-B SHS	9,900	161.200	1,595,880.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,400	181.200	1,159,680.000	
	NORDEA AB	67,700	81.250	5,500,625.000	
	ELEKTA AB-B SHS	8,800	100.100	880,880.000	
	SCANIA AB-B SHS	8,150	146.900	1,197,235.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,350	233.600	1,249,760.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,950	81.100	725,845.000	
	GETINGE AB-B SHS	5,100	200.200	1,021,020.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BA	36,550	68.650	2,509,157.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	12,850	285.700	3,671,245.000	

	SWEDBANK AB	21,350	154.700	3,302,845.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B	24,000	228.000	5,472,000.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	15,250	169.300	2,581,825.000	
	SKANSKA AB-B	9,600	117.400	1,127,040.000	
	SANDVIK AB	26,250	92.700	2,433,375.000	
	INVESTOR AB-B SHS	11,500	192.900	2,218,350.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,850	174.100	3,107,685.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,200	59.800	550,160.000	
	TELIASONERA AB	56,350	44.180	2,489,543.000	
	ALFA LAVAL AB	8,400	142.600	1,197,840.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,200	154.700	1,577,940.000	
	ASSA ABLOY AB-B	8,550	266.800	2,281,140.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,400	139.400	892,160.000	
	BOLIDEN AB	7,900	95.200	752,080.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	12,550	38.090	478,029.500	
	RATOS AB-B SHS	5,900	56.600	333,940.000	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,250	174.400	915,600.000	
	HEXAGON AB-B SHS	6,100	197.100	1,202,310.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 63,137,140.000 (962,841,385)	
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	10,650	937.000	9,979,050.000	
	DANSKE BANK A/S	17,100	114.300	1,954,530.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	19	40,280.000	765,320.000	
	TDC A/S	11,500	44.500	511,750.000	
	CARLSBERG AS-B	2,750	543.500	1,494,625.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,500	197.600	1,284,400.000	
	COLOPLAST-B	3,250	325.800	1,058,850.000	
	DSV A/S	5,600	139.000	778,400.000	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	825	453.200	373,890.000	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	32	42,240.000	1,351,680.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 19,552,495.000 (343,537,337)	
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	2.270	148,887.030	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	26,000	2.980	77,480.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	8.420	169,242.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 395,609.030 (31,783,230)	
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	26.660	658,502.000	
	DNB ASA	25,200	93.250	2,349,900.000	
	ORKLA ASA	23,350	49.500	1,155,825.000	
	TELENOR ASA	18,700	120.500	2,253,350.000	
	STATOIL ASA	28,973	132.700	3,844,717.100	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	255.900	1,269,264.000	
	SEADRILL LTD	9,850	239.900	2,363,015.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	4,250	86.900	369,325.000	
	SUBSEA 7 SA	8,000	131.000	1,048,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 15,311,898.100	

				(263,670,885)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG	20,950	82.000	1,717,900.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	23,700	36.725	870,382.500	
	COMMERZBANK AG	10,485	7.820	81,992.700	
	VOLKSWAGEN AG	850	161.450	137,232.500	
	VOLKSWAGEN AG PFD	3,750	165.250	619,687.500	
	M.A.N.	1,300	84.490	109,837.000	
	SIEMENS AG	20,500	81.140	1,663,370.000	
	E.ON SE	45,800	12.855	588,759.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE	8,650	73.300	634,045.000	
	GEA GROUP AG	5,050	28.000	141,400.000	
	CONTINENTAL AG	2,850	100.350	285,997.500	
	BASF SE	23,450	75.100	1,761,095.000	
	LINDE	4,800	145.350	697,680.000	
	K+S AG	4,400	31.390	138,116.000	
	ALLIANZ SE-REG	11,550	119.100	1,375,605.000	
	THYSSENKRUPP AG	9,950	15.350	152,732.500	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,750	74.880	355,680.000	
	R.W.E. AG	12,500	26.235	327,937.500	
	LUFTHANSA	6,750	17.095	115,391.250	
	FRAPORT AG	1,100	43.820	48,202.000	
	BRENNTAG AG	1,400	119.900	167,860.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	3,300	92.040	303,732.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SH	4,100	22.380	91,758.000	
	HOCHTIEF AG	1,150	54.080	62,192.000	
	SAP AG	23,592	58.420	1,378,244.640	
	MUNCHENER RUECK AG-REG	4,650	141.500	657,975.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,650	58.880	214,912.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	4,050	63.920	258,876.000	
	BEIERSDORF AG	2,550	68.670	175,108.500	
	CELESIO AG	2,800	16.010	44,828.000	
	MERCK KGAA	1,650	122.700	202,455.000	
	ADIDAS AG	5,570	83.590	465,596.300	
	HENKEL KGAA	3,300	62.780	207,174.000	
	METRO AG	3,850	26.060	100,331.000	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	73,100	8.711	636,774.100	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,500	52.090	286,495.000	
	DAIMLER AG	23,100	48.590	1,122,429.000	
	QIAGEN N.V.	6,800	14.210	96,628.000	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	27,700	6.582	182,321.400	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUN	1,850	56.300	104,155.000	
	DEUTSCHE POST AG	24,100	19.270	464,407.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG	4,950	50.260	248,787.000	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-	2,400	30.850	74,040.000	
	RWE AG-NON VTG PFD	1,150	24.965	28,709.750	
	SUEDZUCKER AG	2,250	26.075	58,668.750	
	LANXESS	2,250	57.700	129,825.000	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING	2,250	74.310	167,197.500	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	24,926	21.810	543,636.060	
	ARCELORMITTAL	26,650	9.830	261,969.500	
	UNILEVER NV-CVA	41,600	31.435	1,307,696.000	
	HEINEKEN NV	6,100	53.870	328,607.000	
	REED ELSEVIER NV	17,777	12.660	225,056.820	
	AEGON NV	45,544	5.297	241,246.560	
	AHOLD (KONINKLIJKE) NV	25,960	12.185	316,322.600	

AKZO NOBEL	6,100	48.425	295,392.500	
KONINKLIJKE DSM NV	4,000	51.450	205,800.000	
WOLTERS KLUWER	7,700	16.740	128,898.000	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	2,100	30.680	64,428.000	
ING GROEP N.V.	97,650	7.164	699,564.600	
KONINKLIJKE KPN NV	28,500	1.393	39,700.500	
ASML HOLDING NV	8,180	61.890	506,260.200	
TNT EXPRESS NV	10,195	5.865	59,793.670	
VOPAK	2,000	46.505	93,010.000	
RANDSTAD HOLDING NV	3,250	32.555	105,803.750	
FUGRO NV-CVA	1,900	45.095	85,680.500	
HEINEKEN HOLDING NV	2,550	46.190	117,784.500	
DE MASTER BLENDERS1753 NV	13,100	12.140	159,034.000	
ZIGGO NV	2,750	27.650	76,037.500	
GEMALTO	2,050	67.270	137,903.500	
TOTAL SA	54,000	38.700	2,089,800.000	
MICHELIN (CGDE) - B	4,850	67.400	326,890.000	
AIR LIQUIDE	8,126	97.930	795,779.180	
KERING	2,000	166.950	333,900.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	13,650	60.390	824,323.500	
BOUYGUES	4,750	20.060	95,285.000	
LAFARGE SA	4,850	54.960	266,556.000	
BNP PARIBAS	25,550	45.235	1,155,754.250	
NATIXIS	28,050	3.627	101,737.350	
THALES SA	3,050	37.140	113,277.000	
GROUPE DANONE	14,750	56.690	836,177.500	
CARREFOUR	15,600	22.385	349,206.000	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	8,075	10.015	80,871.120	
VIVENDI SA	30,341	15.175	460,424.670	
L'OREAL	6,150	129.300	795,195.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,500	33.205	348,652.500	
LEGRAND SA	6,067	37.240	225,935.080	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	79.610	123,395.500	
PERNOD-RICARD	5,417	92.100	498,905.700	
EURAZEO	1,130	42.225	47,714.250	
SOCIETE GENERALE-A	18,200	31.030	564,746.000	
LVMH	6,500	134.550	874,575.000	
ACCOR SA	4,450	27.010	120,194.500	
CAP GEMINI SA	4,100	36.910	151,331.000	
PUBLICIS GROUPE	4,600	54.240	249,504.000	
VALLOUREC	2,650	41.440	109,816.000	
BUREAU VERITAS SA	1,400	86.680	121,352.000	
SODEXO	2,450	65.160	159,642.000	
ESSILOR INTERNATIONAL	5,200	84.340	438,568.000	
AXA	46,000	15.795	726,570.000	
CHRISTIAN DIOR	1,400	140.250	196,350.000	
LAGARDERE S.C.A.	3,800	20.075	76,285.000	
TECHNIP S.A.	2,650	85.550	226,707.500	
EDENRED	4,300	24.950	107,285.000	
RENAULT	4,950	59.520	294,624.000	
STMICROELECTRONICS NV	19,150	7.470	143,050.500	
ATOS	1,600	56.060	89,696.000	
DASSAULT SYSTEMS SA	1,600	97.940	156,704.000	
WENDEL	1,100	85.750	94,325.000	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ	4,650	18.640	86,676.000	
FRANCE TELECOM SA	46,950	7.761	364,378.950	
ALSTOM	5,750	28.725	165,168.750	

CNP ASSURANCES	5,150	11.695	60,229.250	
SANOFI	30,525	81.660	2,492,671.500	
VINCI	11,750	39.800	467,650.000	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN	11,750	43.325	509,068.750	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,000	9.563	105,193.000	
CREDIT AGRICOLE SA	25,700	7.223	185,631.100	
GDF SUEZ	34,173	15.615	533,611.390	
IMERYS SA	1,100	48.735	53,608.500	
ELECTRICITE DE FRANCE	6,850	17.920	122,752.000	
SES	7,800	22.900	178,620.000	
SAFRAN SA	5,850	40.025	234,146.250	
ILIAD SA	600	161.000	96,600.000	
ARKEMA	1,700	80.110	136,187.000	
ADP	950	70.310	66,794.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,050	23.600	95,580.000	
SCOR SE	4,550	22.860	104,013.000	
GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR	18,050	6.110	110,285.500	
UCB SA	2,800	41.840	117,152.000	
KBC GROUPE	5,100	30.695	156,544.500	
COLRUYT SA	2,500	38.390	95,975.000	
DELHAIZE GROUP	2,950	49.480	145,966.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	2,300	60.350	138,805.000	
SOLVAY SA	1,550	114.650	177,707.500	
UMICORE	2,950	37.300	110,035.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	20,550	70.640	1,451,652.000	
AGEAS	5,890	28.900	170,221.000	
BELGACOM SA	4,900	16.940	83,006.000	
FIAT SPA	26,650	6.220	165,763.000	
PRYSMIAN SPA	5,700	16.400	93,480.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	29,693	14.510	430,845.430	
SAIPEM	6,900	20.770	143,313.000	
FIAT INDUSTRIAL	22,050	8.880	195,804.000	
MEDIOBANCA SPA	17,115	5.145	88,056.670	
TENARIS SA	12,150	16.260	197,559.000	
UNICREDIT SPA	102,969	4.278	440,501.380	
TELECOM ITALIA SPA	240,082	0.576	138,287.230	
TELECOM ITALIA-RNC	170,950	0.466	79,662.700	
INTESA SANPAOLO	260,297	1.449	377,170.350	
ATLANTIA SPA	8,407	13.260	111,476.820	
ENI SPA	64,300	17.650	1,134,895.000	
FINMECCANICA SPA	11,225	4.176	46,875.600	
MONTE DEI PASCHI SIENA	131,900	0.249	32,843.100	
ENEL SPA	166,700	2.854	475,761.800	
SNAM SPA	42,650	3.648	155,587.200	
LUXOTTICA GROUP SPA	3,750	39.500	148,125.000	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE	26,800	3.506	93,960.800	
TERNA SPA	33,000	3.428	113,124.000	
PIRELLI & C.	7,645	8.915	68,155.170	
ENEL GREEN POWER SPA	55,400	1.711	94,789.400	
TELEFONICA S.A.	106,077	10.540	1,118,051.580	
BANCO POPULAR ESPANOL	132,615	0.651	86,332.360	
BANCO BILBAO VIZCAYA	140,262	7.278	1,020,826.830	
IBERDROLA SA	112,684	4.191	472,258.640	
BANCO DE SABADELL SA	75,246	1.448	108,956.200	
REPSOL SA	21,100	17.675	372,942.500	
GRIFOLS SA	3,800	29.220	111,036.000	
BANCO SANTANDER SA	267,150	5.582	1,491,231.300	

	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	9,300	13.990	130,107.000	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A	7,950	23.330	185,473.500	
	GAS NATURAL SDG SA	9,100	16.040	145,964.000	
	MAPFRE SA	21,450	2.826	60,617.700	
	CAIXABANK	24,750	2.745	67,938.750	
	ZARDOYA OTIS SA	3,700	10.400	38,480.000	
	INTL CONSOLIDATED AIRLINE	31,300	3.246	101,599.800	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SE	3,876	21.780	84,419.280	
	ACCIONA SA	750	47.800	35,850.000	
	INDITEX	5,750	97.920	563,040.000	
	ENAGAS	5,650	19.300	109,045.000	
	RED ELECTRICA DE ESPANA	3,050	42.020	128,161.000	
	FERROVIAL SA	9,800	12.535	122,843.000	
	DISTRIBUIDORA INTERNACION	18,700	6.045	113,041.500	
	BANKIA SA	222	0.694	154.060	
	UPM-KYMMENE OYJ	13,550	8.080	109,484.000	
	NOKIA OYJ	95,950	2.706	259,640.700	
	WARTSILA OYJ	4,300	34.850	149,855.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,750	5.420	96,205.000	
	METSO OYJ	3,750	28.890	108,337.500	
	ELISA OYJ-A SHARES	4,550	14.520	66,066.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	11,150	31.550	351,782.500	
	FORTUM OYJ	11,300	14.260	161,138.000	
	KESKO OYJ-B SHS	1,950	22.750	44,362.500	
	KONE OYJ-B	4,000	68.100	272,400.000	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,000	32.130	96,390.000	
	NESTE OIL OYJ	4,300	11.120	47,816.000	
	POHJOLA BANK PLC	4,800	12.610	60,528.000	
	VERBUND AG	2,100	15.995	33,589.500	
	IMMOFINANZ AG	31,200	3.165	98,748.000	
	OMV AG	3,850	36.195	139,350.750	
	ERSTE GROUP BANK AG	5,550	25.200	139,860.000	
	TELEKOM AUSTRIA AG	8,800	5.089	44,783.200	
	VOESTALPINE AG	2,850	25.360	72,276.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATI	1,900	26.500	50,350.000	
	ANDRITZ AG	1,600	41.300	66,080.000	
	VIENNA INSURANCE GROUP	1,000	38.035	38,035.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	16.335	98,010.000	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA	20,300	3.365	68,309.500	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	48,950	2.475	121,151.250	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B	7,450	12.745	94,950.250	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGAN	5,300	6.500	34,450.000	
	ELAN CORPORATION PLC	14,200	9.490	134,758.000	
	KERRY GROUP PLC-A	3,900	44.000	171,600.000	
	CRH PLC	18,500	16.290	301,365.000	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	52,300	0.774	40,480.200	
	OPAP SA	6,100	6.740	41,114.000	
ユーロ 小計				ユーロ 64,448,855.690 (8,442,155,608)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	68.900	2,583,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT	53,000	41.600	2,204,800.000	
	MTR CORP	37,500	30.500	1,143,750.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	42,000	101.500	4,263,000.000	
	HOPEWELL HOLDINGS	21,000	27.850	584,850.000	

	SINO LAND	88,000	11.560	1,017,280.000	
	CHEUNG KONG	37,000	108.800	4,025,600.000	
	WHARF HOLDINGS	39,000	71.000	2,769,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,500	96.400	1,687,000.000	
	CLP HOLDINGS LIMITED	47,500	65.500	3,111,250.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	41,000	14.960	613,360.000	
	HUTCHISON WHAMPOA	56,300	83.200	4,684,160.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMNT	26,000	54.750	1,423,500.000	
	HK & CHINA GAS	136,284	22.250	3,032,319.000	
	HANG SENG BANK	19,900	124.100	2,469,590.000	
	WHEELOCK & CO	25,000	42.850	1,071,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	95,000	12.240	1,162,800.000	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,500	49.850	324,025.000	
	HONG KONG EX & CL	28,900	129.400	3,739,660.000	
	LI & FUNG LTD	164,000	11.100	1,820,400.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	27.500	1,567,500.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	91.350	593,775.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	21,000	22.500	472,500.000	
	NWS HOLDINGS LTD	46,500	13.380	622,170.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	22,500	31.600	711,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	37,040	30.000	1,111,200.000	
	SJM HOLDINGS LTD	57,000	21.050	1,199,850.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	30,000	24.400	732,000.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR	15,000	53.450	801,750.000	
	AIA GROUP LTD	301,000	34.350	10,339,350.000	
	SANDS CHINA LTD	62,000	41.600	2,579,200.000	
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	14.400	604,800.000	
	BANK OF CHINA HONG KONG	94,500	25.500	2,409,750.000	
	WYNN MACAU LTD	46,000	22.800	1,048,800.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 68,524,989.000 (885,342,858)	
合計				63,487,495,885 [63,487,495,885]	

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,947	400,939.350	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,687	1,273,428.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,800	414,048.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	10,500	210,735.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,227	338,329.080	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,000	457,120.000	
		AMERICAN TOWER CORP	9,900	758,637.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	18,093	313,189.830	
		KIMCO REALTY CORP	10,200	222,666.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO-REIT	4,000	190,040.000	
		RAYONIER INC	3,300	180,246.000	
		VENTAS INC	7,200	505,728.000	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY	9,300	240,405.000	
		PROLOGIS INC	11,662	459,716.040	
		DUKE REALTY CORP	8,000	129,680.000	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,700	181,815.000	
		HEALTH CARE REIT INC	6,500	439,400.000	
		HCP INC	11,200	526,512.000	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	3,300	132,495.000	
	MACERICH CO/THE	3,400	213,146.000	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN	24,800	337,528.000	
	REALTY INCOME CORP	4,600	199,732.000	
	PUBLIC STORAGE	3,700	560,698.000	
	REGENCY CENTERS CORP	2,700	137,133.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,200	189,486.000	
	UDR INC	6,500	159,185.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,100	182,280.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 9,354,317.720 (937,770,351)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES PLC	19,800	187,308.000	
	SEGRO PLC	25,350	70,853.250	
	HAMMERSON PLC	20,400	103,020.000	
	BRITISH LAND CO PLC	23,500	142,997.500	
	INTU PROPERTIES PLC	18,800	64,220.800	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 568,399.550 (87,129,967)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	81,396	250,699.680	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	65,500	131,000.000	
	DEXUS PROPERTY GROUP	143,700	155,914.500	
	GPT GROUP	35,960	137,007.600	
	MIRVAC GROUP	93,400	150,374.000	
	STOCKLAND	56,000	202,720.000	
	WESTFIELD GROUP	55,096	629,196.320	
	GOODMAN GROUP	47,100	231,732.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,888,644.100 (182,405,247)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	48,000	117,120.000	
	CAPITAMALL TRUST	79,000	173,010.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 290,130.000 (23,172,683)	
ユーロ			ユーロ	
	CORIO NV	2,024	68,836.240	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,450	468,685.000	
	ICADE	800	55,424.000	
	GECINA SA	650	61,249.500	
	KLEPIERRE	3,200	106,400.000	
	FONCIERE DES REGIONS	950	61,797.500	
ユーロ 小計			ユーロ 822,392.240 (107,725,159)	
香港・ドル			香港・ドル	
	LINK REIT	60,000	2,436,000.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,436,000.000 (31,473,120)	

投資証券 合計		1,369,676,527 [1,369,676,527]	
合計		1,369,676,527 [1,369,676,527]	

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 565銘柄 投資証券 27銘柄	97.5%	2.5%	59.1%
イギリス・ポンド	株式 97銘柄 投資証券 5銘柄	98.7%	1.3%	10.2%
イスラエル・シュケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄 投資証券 8銘柄	92.6%	7.4%	3.8%
カナダ・ドル	株式 86銘柄	100%	-%	4.7%
シンガポール・ドル	株式 22銘柄 投資証券 2銘柄	95.5%	4.5%	0.8%
スイス・フラン	株式 32銘柄	100%	-%	4.2%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	100%	-%	1.5%
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 3銘柄	100%	-%	-%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100%	-%	0.4%
ユーロ	株式 215銘柄 投資証券 6銘柄	98.7%	1.3%	13.2%
香港・ドル	株式 34銘柄 投資証券 1銘柄	96.6%	3.4%	1.4%

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24年6月5日現在 金 額（円）	平成25年6月5日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,829,355,222	2,706,885,650
コール・ローン	903,090,345	1,412,748,557
国債証券	108,656,179,461	139,636,998,751
派生商品評価勘定	1,814,063	1,524,792
未収利息	1,110,585,291	1,382,595,723
前払費用	38,529,165	26,105,411
流動資産合計	112,539,553,547	145,166,858,884
資産合計	112,539,553,547	145,166,858,884
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,174,925	2,919,446
未払金	1,793,454,315	2,594,813,366
未払解約金	28,010,000	88,702,000
流動負債合計	1,825,639,240	2,686,434,812
負債合計	1,825,639,240	2,686,434,812
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	62,609,509,885	60,436,532,420
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	48,104,404,422	82,043,891,652
元本等合計	110,713,914,307	142,480,424,072
純資産合計	110,713,914,307	142,480,424,072
負債純資産合計	112,539,553,547	145,166,858,884

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24年6月6日 至 平成25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、原則として期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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成24年6月5日現在	平成25年6月5日現在
1. ※1 期首	平成23年6月7日	平成24年6月6日
期首元本額	60,637,063,976円	62,609,509,885円
期中追加設定元本額	7,079,923,542円	4,698,218,588円
期中一部解約元本額	5,107,477,633円	6,871,196,053円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	3,058,339,660円	2,796,875,253円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	98,485,796円	85,934,817円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	695,829,639円	640,908,730円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	213,133,558円	184,364,893円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	2,202,869,768円	2,048,834,549円
ダイワ・スマートアロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	－円	10,447,215円
先進国債券ファンド（為替ヘッジあり）（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	－円	4,140,048円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	30,146,074,810円	31,895,337,545円
ダイワ・ライフ・バランス３０	469,921,235円	443,850,428円
ダイワ・ライフ・バランス５０	143,614,036円	161,108,965円
ダイワ・ライフ・バランス７０	70,218,674円	89,819,629円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	139,479,045円	170,772,861円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	91,081,729円	115,056,064円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	20,485,475円	28,433,505円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	5,522,897円	6,174,991円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	2,202,787円	4,432,277円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	110,328円	243,174円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	3,331,696,893円	2,864,325,703円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	349,428,019円	307,738,015円

ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	11,935,483,748円	10,409,895,338円
ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ	2,353,443,946円	1,423,098,061円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	1,865,565,833円	1,199,524,773円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	717,840,202円	599,415,603円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	4,628,615,912円	4,874,216,082円
ダイワライフスタイル２５	25,039,861円	24,507,985円
ダイワライフスタイル５０	35,950,157円	37,100,647円
ダイワライフスタイル７５	9,075,877円	9,975,269円
計	62,609,509,885円	60,436,532,420円
2. 期末日における受益権の総数	62,609,509,885口	60,436,532,420口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成24年6月6日 至 平成25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こと、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25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24年6月5日現在	平成25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	4,630,890,939	△1,514,394,530
合計	4,630,890,939	△1,514,394,530

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成23年12月1日から平成24年6月5日まで、及び平成24年12月1日から平成25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24年6月5日 現在				平成25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	992,891,776	－	990,530,914	△2,360,862	1,389,045,062	－	1,387,650,408	△1,394,654
アメリカ・ドル	422,858,801	－	422,134,422	△724,379	564,819,833	－	562,346,388	△2,473,445
イギリス・ポンド	99,243,813	－	96,511,270	△2,732,543	103,150,442	－	103,283,760	133,318
オーストラリア・ドル	14,107,482	－	14,004,240	△103,242	21,927,927	－	21,875,990	△51,937
カナダ・ドル	29,688,588	－	29,168,190	△520,398	37,488,697	－	37,136,675	△352,022
シンガポール・ドル	－	－	－	－	5,591,180	－	5,590,200	△980
スイス・フラン	3,912,931	－	3,920,640	7,709	5,283,225	－	5,282,000	△1,225
スウェーデン・クローナ	5,531,612	－	5,557,520	25,908	7,705,557	－	7,665,720	△39,837
デンマーク・クローネ	8,816,775	－	8,830,794	14,019	11,856,165	－	11,894,890	38,725
ノルウェー・クローネ	－	－	－	－	4,524,088	－	4,540,800	16,712
ポーランド・ズロチ	6,731,684	－	6,756,893	25,209	10,712,520	－	10,821,330	108,810
メキシコ・ペソ	9,009,543	－	8,915,180	△94,363	15,438,589	－	15,499,960	61,371
ユーロ	392,990,547	－	394,731,765	1,741,218	592,610,077	－	593,515,675	905,598
南アフリカ・ランド	－	－	－	－	7,936,762	－	8,197,020	260,258
合計	992,891,776	－	990,530,914	△2,360,862	1,389,045,062	－	1,387,650,408	△1,394,654

（注） 1． 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	平成24年6月5日現在	平成25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）	1.7683円 (17,683円)	2.3575円 (23,575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 20140815	2,599,000.000	2,725,285.410	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20141115	1,894,000.000	2,004,003.520	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20150215	2,654,000.000	2,822,237.060	
		4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515	3,708,000.000	3,982,466.160	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	3,926,000.000	4,261,673.000	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,828,000.000	2,010,854.840	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215	1,826,000.000	2,025,344.420	
		5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515	1,940,000.000	2,202,656.600	
		4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815	1,999,000.000	2,272,283.290	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	2,336,000.000	2,654,280.000	
		4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215	2,039,000.000	2,330,984.800	
		4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515	1,795,000.000	2,056,387.900	
		4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815	2,401,000.000	2,791,522.650	
		4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115	1,686,000.000	1,932,965.280	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215	3,839,000.000	4,288,278.170	
		3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515	2,960,000.000	3,369,516.000	
		4% U.S. TREASURY NOTE 20180815	3,173,000.000	3,645,205.860	

		3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115	3,805,000.000	4,332,030.550	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	3,161,000.000	3,429,906.270	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,195,000.000	2,325,668.350	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,463,000.000	2,596,248.300	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,001,000.000	2,124,101.520	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20190515	3,096,000.000	3,428,324.640	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	1,775,000.000	1,811,529.500	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160531	621,000.000	671,791.590	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140630	2,833,000.000	2,907,366.250	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160630	2,121,000.000	2,297,552.040	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20140731	3,238,000.000	3,329,441.120	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20160731	1,833,000.000	1,988,859.990	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20190815	3,116,000.000	3,545,665.240	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140831	3,958,000.000	4,064,826.420	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,488,000.000	2,683,133.840	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20140930	3,971,000.000	4,084,848.570	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,499,000.000	2,696,371.020	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20141031	4,082,000.000	4,205,562.140	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,319,000.000	2,515,743.960	
		3.375% U.S. TREASURY NOTE 20191115	4,020,000.000	4,520,892.000	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,594,000.000	3,695,494.560	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20161130	4,149,000.000	4,449,138.660	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20141231	4,437,000.000	4,603,387.500	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,011,000.000	4,378,568.040	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	2,315,000.000	2,391,047.750	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,884,000.000	3,138,368.800	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20200215	5,630,000.000	6,426,082.000	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20150228	4,921,000.000	5,100,714.920	
		3% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,687,000.000	2,914,320.200	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150331	5,843,000.000	6,078,531.330	
		3.25% U.S. TREASURY NOTE 20170331	4,635,000.000	5,074,212.600	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20150430	2,218,000.000	2,310,867.660	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20170430	1,653,000.000	1,804,480.920	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	5,259,000.000	5,959,078.080	

		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20150531	2,576,000.000	2,668,555.680	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,835,000.000	3,056,470.200	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20150630	4,658,000.000	4,807,708.120	
		2.5% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,468,000.000	3,706,147.560	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20150731	2,386,000.000	2,458,677.560	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20170731	1,773,000.000	1,885,886.910	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20200815	4,527,000.000	4,851,993.330	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150831	2,519,000.000	2,569,858.610	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,903,000.000	3,026,812.950	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20150930	2,568,000.000	2,620,644.000	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20170930	2,831,000.000	2,950,977.780	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20151031	1,265,000.000	1,291,425.850	
		1.875% U.S. TREASURY NOTE 20171031	382,000.000	398,082.200	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20201115	4,509,000.000	4,824,269.280	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20151130	3,151,000.000	3,228,892.720	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20171130	883,000.000	935,220.620	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	2,515,000.000	2,625,609.700	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	924,000.000	999,139.680	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20160131	635,000.000	661,460.450	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180131	255,000.000	274,382.550	
		3.625% U.S. TREASURY NOTE 20210215	4,076,000.000	4,649,493.200	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20160229	2,590,000.000	2,708,855.100	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	1,234,000.000	1,335,990.100	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20160331	2,649,000.000	2,781,847.350	
		2.875% U.S. TREASURY NOTE 20180331	1,300,000.000	1,415,063.000	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20160430	2,295,000.000	2,395,039.050	
		2.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	260,000.000	280,046.000	
		3.125% U.S. TREASURY NOTE 20210515	4,417,000.000	4,869,742.500	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	3,832,000.000	3,973,745.680	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180531	1,322,000.000	1,407,506.960	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20140615	4,416,000.000	4,442,716.800	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160630	3,406,000.000	3,506,953.840	
		2.375% U.S. TREASURY NOTE 20180630	3,782,000.000	4,028,397.300	

		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20140715	4,093,000.000	4,113,587.790	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20160731	2,053,000.000	2,114,015.160	
		2.25% U.S. TREASURY NOTE 20180731	1,341,000.000	1,420,092.180	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20140815	2,097,000.000	2,104,926.660	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20210815	1,418,000.000	1,450,784.160	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20160831	2,108,000.000	2,136,647.720	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20180831	2,730,000.000	2,786,074.200	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140915	3,109,000.000	3,111,767.010	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20160930	2,793,000.000	2,829,979.320	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20180930	2,835,000.000	2,872,195.200	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20141015	2,784,000.000	2,795,414.400	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20161031	2,718,000.000	2,752,926.300	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20181031	1,920,000.000	1,981,939.200	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20141115	4,179,000.000	4,188,778.860	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20211115	1,353,000.000	1,366,624.710	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161130	3,027,000.000	3,051,094.920	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181130	2,165,000.000	2,190,027.400	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141215	4,827,000.000	4,828,689.450	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20161231	4,265,000.000	4,294,982.950	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20181231	1,861,000.000	1,879,740.270	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150115	4,162,000.000	4,162,790.780	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170131	2,970,000.000	2,988,889.200	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190131	1,426,000.000	1,429,778.900	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150215	3,983,000.000	3,982,840.680	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20220215	3,224,000.000	3,243,118.320	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170228	2,408,000.000	2,421,436.640	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20190228	1,843,000.000	1,857,320.110	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150315	3,557,000.000	3,563,224.750	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20170331	3,856,000.000	3,892,593.440	
		1.5% U.S. TREASURY NOTE 20190331	300,000.000	304,170.000	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150415	3,410,000.000	3,415,592.400	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20170430	2,375,000.000	2,384,832.500	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20190430	559,000.000	558,234.170	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150515	2,261,000.000	2,259,213.810	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20220515	5,111,000.000	5,014,146.550	

		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140531	3,589,000.000	3,592,481.330	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170531	2,125,000.000	2,110,868.750	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20190531	2,385,000.000	2,360,768.400	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20150615	3,379,000.000	3,383,325.120	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140630	4,207,000.000	4,210,912.510	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20170630	3,906,000.000	3,895,453.800	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20190630	1,368,000.000	1,342,240.560	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150715	3,665,000.000	3,659,099.350	
		0.125% U.S. TREASURY NOTE 20140731	4,077,000.000	4,074,594.570	
		0.5% U.S. TREASURY NOTE 20170731	3,817,000.000	3,763,752.850	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20190731	2,784,000.000	2,706,994.560	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815	4,788,000.000	4,778,807.040	
		1.625% U.S. TREASURY NOTE 20220815	5,191,000.000	5,013,727.350	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140831	2,946,000.000	2,948,180.040	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170831	2,211,000.000	2,188,713.120	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20190831	1,331,000.000	1,302,183.850	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150915	3,987,000.000	3,976,554.060	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20140930	5,184,000.000	5,188,613.760	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170930	1,183,000.000	1,169,596.610	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20190930	2,215,000.000	2,163,589.850	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20151015	3,548,000.000	3,538,278.480	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141031	5,156,000.000	5,159,815.440	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20171031	1,178,000.000	1,169,895.360	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20191031	147,000.000	145,747.560	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20151115	1,473,000.000	1,472,705.400	
		1.625% U.S. TREASURY NOTE 20221115	4,067,000.000	3,910,176.480	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20141130	3,256,000.000	3,257,628.000	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20171130	149,000.000	146,991.480	
		1% U.S. TREASURY NOTE 20191130	150,000.000	146,143.500	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20151215	2,822,000.000	2,811,502.160	
		0.125% U.S. TREASURY NOTE 20141231	3,265,000.000	3,259,873.950	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20171231	148,000.000	146,641.360	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20191231	894,000.000	876,325.620	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20160115	2,425,000.000	2,422,235.500	

		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150131	143,000.000	143,015.730	
		0.875% U.S. TREASURY NOTE 20180131	1,569,000.000	1,561,813.980	
		1.375% U.S. TREASURY NOTE 20200131	71,000.000	70,608.790	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20160215	143,000.000	142,759.760	
		2% U.S. TREASURY NOTE 20230215	3,850,000.000	3,815,388.500	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150228	4,589,000.000	4,587,715.080	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20180228	3,447,000.000	3,408,600.420	
		1.25% U.S. TREASURY NOTE 20200229	2,583,000.000	2,544,539.130	
		0.375% U.S. TREASURY NOTE 20160315	3,155,000.000	3,147,964.350	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20150331	2,321,000.000	2,319,909.130	
		0.75% U.S. TREASURY NOTE 20180331	2,315,000.000	2,286,131.950	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20200331	1,160,000.000	1,131,533.600	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20160415	2,037,000.000	2,024,329.860	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20230515	3,223,000.000	3,112,193.260	
		0.125% U.S. TREASURY NOTE 20150430	1,704,000.000	1,698,870.960	
		0.25% U.S. TREASURY NOTE 20160515	713,000.000	708,237.160	
		0.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	1,441,000.000	1,413,303.980	
		1.125% U.S. TREASURY NOTE 20200430	1,451,000.000	1,413,012.820	
		11.25% U.S. TREASURY BOND 20150215	939,000.000	1,113,334.740	
		9.875% U.S. TREASURY BOND 20151115	461,000.000	567,371.140	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20160515	1,850,000.000	2,217,021.500	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20161115	1,552,000.000	1,916,052.640	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20170515	1,527,000.000	2,003,225.490	
		8.875% U.S. TREASURY BOND 20190215	904,000.000	1,289,185.360	
		8.125% U.S. TREASURY BOND 20190815	1,582,000.000	2,228,389.380	
		8.75% U.S. TREASURY BOND 20200815	1,380,000.000	2,063,955.600	
		8% U.S. TREASURY BOND 20211115	3,025,000.000	4,504,406.500	
		7.25% U.S. TREASURY BOND 20220815	768,000.000	1,115,397.120	
		7.125% U.S. TREASURY BOND 20230215	1,602,000.000	2,328,330.780	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20230815	1,666,000.000	2,303,694.820	
		7.5% U.S. TREASURY BOND 20241115	791,000.000	1,209,486.460	
		6% U.S. TREASURY BOND 20260215	855,000.000	1,185,637.050	
		6.5% U.S. TREASURY BOND 20261115	630,000.000	914,923.800	
		6.125% U.S. TREASURY BOND 20271115	709,000.000	1,004,780.620	

		5.5% U.S. TREASURY BOND 20280815	813,000.000	1,093,737.030	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20281115	938,000.000	1,232,879.060	
		5.25% U.S. TREASURY BOND 20290215	215,000.000	282,959.350	
		6.25% U.S. TREASURY BOND 20300515	1,347,000.000	1,971,981.060	
		5.375% U.S. TREASURY BOND 20310215	1,324,000.000	1,784,500.440	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	1,606,000.000	1,981,900.360	
		4.75% U.S. TREASURY BOND 20370215	599,000.000	765,174.580	
		5% U.S. TREASURY BOND 20370515	547,000.000	722,723.750	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20380215	108,000.000	130,932.720	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20380515	1,019,000.000	1,258,933.740	
		3.5% U.S. TREASURY BOND 20390215	2,086,000.000	2,198,122.500	
		4.25% U.S. TREASURY BOND 20390515	694,000.000	826,290.280	
		4.5% U.S. TREASURY BOND 20390815	1,977,000.000	2,445,746.700	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20391115	1,625,000.000	1,973,091.250	
		4.625% U.S. TREASURY BOND 20400215	1,517,000.000	1,913,194.890	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20400515	2,169,000.000	2,633,968.530	
		3.875% U.S. TREASURY BOND 20400815	3,819,000.000	4,278,463.890	
		4.25% U.S. TREASURY BOND 20401115	3,269,000.000	3,893,150.170	
		4.75% U.S. TREASURY BOND 20410215	3,086,000.000	3,970,324.160	
		4.375% U.S. TREASURY BOND 20410515	3,356,000.000	4,077,540.000	
		3.75% U.S. TREASURY BOND 20410815	1,367,000.000	1,496,646.280	
		3.125% U.S. TREASURY BOND 20411115	4,039,000.000	3,930,754.800	
		3.125% U.S. TREASURY BOND 20420215	3,921,000.000	3,812,231.460	
		3% U.S. TREASURY BOND 20420515	4,432,000.000	4,196,882.400	
		2.75% U.S. TREASURY BOND 20420815	1,731,000.000	1,553,157.060	
		2.75% U.S. TREASURY BOND 20421115	3,984,000.000	3,571,257.600	
		3.125% U.S. TREASURY BOND 20430215	2,026,000.000	1,963,943.620	
		2.875% U.S. TREASURY BOND 20430515	1,305,000.000	1,200,286.800	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 565,596,497.740 (56,701,048,898)	
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	1,153,832.400	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20151207	641,000.000	763,046.400	
		8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	1,213,000.000	1,785,050.800	

		6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	909,000.000	1,293,961.500	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20320607	1,815,000.000	2,152,771.500	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20140907	2,382,000.000	2,520,870.600	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20250307	1,662,000.000	2,118,551.400	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150907	1,963,000.000	2,155,374.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20360307	2,157,000.000	2,544,181.500	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20381207	1,466,000.000	1,860,500.600	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200307	1,724,000.000	2,092,418.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20551207	1,708,000.000	2,031,324.400	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160907	2,475,000.000	2,747,992.500	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20461207	2,061,000.000	2,423,323.800	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20271207	1,465,000.000	1,745,547.500	
		5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180307	1,604,000.000	1,905,070.800	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20421207	1,793,000.000	2,198,218.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20301207	1,806,000.000	2,274,837.600	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20491207	1,915,000.000	2,257,210.500	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190307	1,820,000.000	2,154,698.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20390907	1,178,000.000	1,384,621.200	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220307	1,391,000.000	1,627,330.900	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND 20340907	1,300,000.000	1,586,910.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20190907	1,428,000.000	1,637,773.200	
		4% UNITED KINGDOM GILT BOND 20600122	1,144,000.000	1,303,244.800	
		2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20150122	2,529,000.000	2,626,366.500	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20200907	2,316,000.000	2,665,021.200	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	2,133,000.000	2,504,781.900	
		2% UNITED KINGDOM GILT BOND 20160122	2,338,000.000	2,428,480.600	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210907	2,117,000.000	2,434,338.300	
		1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170122	1,976,000.000	2,049,704.800	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20520722	665,000.000	710,818.500	
		1% UNITED KINGDOM GILT BOND 20170907	1,739,000.000	1,747,173.300	
		1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND 20220907	2,049,000.000	1,999,619.100	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20440122	91,000.000	88,643.100	
		1.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20180722	492,000.000	495,739.200	

イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 67,469,349.200 (10,342,376,539)	
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	1,476,880.900	
	6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170215	1,411,000.000	1,573,617.750	
	5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20190315	2,567,000.000	2,869,726.310	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,755,000.000	2,055,262.950	
	6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20140615	1,215,000.000	1,260,805.500	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	1,928,000.000	2,085,074.160	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,475,000.000	1,746,237.750	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20160615	1,221,000.000	1,295,017.020	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20141021	1,129,000.000	1,158,839.470	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20180121	1,441,000.000	1,605,346.050	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,422,000.000	1,665,858.780	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20151021	721,000.000	756,062.230	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	997,000.000	1,054,128.100	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	462,000.000	510,847.260	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	452,000.000	420,219.880	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	479,000.000	440,028.560	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	646,000.000	622,918.420	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 22,596,871.090 (2,182,405,811)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	647,086.540	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,290,000.000	1,852,736.700	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,375,000.000	2,053,755.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	2,112,000.000	2,193,079.680	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	1,036,000.000	1,105,702.080	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,563,000.000	2,216,443.410	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	571,000.000	617,473.690	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170601	1,747,000.000	1,921,595.180	
	4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180601	2,018,000.000	2,282,398.360	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20190601	2,199,000.000	2,459,911.350	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,608,000.000	1,638,246.480	

		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,224,000.000	1,553,121.360	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141201	1,657,000.000	1,679,684.330	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,476,000.000	1,640,736.360	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150601	827,000.000	850,205.620	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20151201	973,000.000	1,017,368.800	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,257,000.000	1,382,574.300	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160601	629,000.000	643,378.940	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160901	761,000.000	796,257.130	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20140801	268,000.000	271,628.720	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,949,000.000	2,070,754.030	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,092,000.000	1,298,726.520	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170301	1,327,000.000	1,333,316.520	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150201	1,535,000.000	1,533,403.600	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150801	430,000.000	433,882.900	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20170901	216,000.000	216,380.160	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20141101	594,000.000	593,429.760	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	205,000.000	194,296.950	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160201	294,000.000	294,617.400	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180301	1,265,000.000	1,251,692.200	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20150501	296,000.000	295,659.600	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20160801	45,000.000	44,634.600	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20180901	458,000.000	451,235.340	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 38,835,413.610 (3,758,879,683)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20160901	518,000.000	570,628.800	
		3.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20140701	343,000.000	355,179.930	
		4% SINGAPORE GOVERNMENT 20180901	572,000.000	658,023.080	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	777,696.480	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	442,000.000	500,087.640	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	486,666.180	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20150701	642,000.000	675,512.400	
		2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	434,000.000	465,877.300	

	1.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20141001	179,000.000	181,516.740	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	376,000.000	407,850.960	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20170401	323,000.000	342,916.180	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	279,000.000	292,032.090	
	1.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20160401	548,000.000	558,592.840	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	197,000.000	205,161.710	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	227,000.000	220,140.060	
	0.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20150201	177,000.000	176,739.810	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20180401	108,000.000	105,825.960	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,980,448.160 (557,528,394)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20230211	1,342,000.000	1,750,316.920	
	4% SWISS GOVERNMENT BOND 20280408	200,000.000	279,722.000	
	2.5% SWISS GOVERNMENT BOND 20160312	1,717,000.000	1,838,666.620	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20180108	373,000.000	421,665.310	
	3% SWISS GOVERNMENT BOND 20190512	105,000.000	121,632.000	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	485,000.000	545,106.050	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 4,957,108.900 (523,668,985)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20150812	6,885,000.000	7,408,397.700	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	4,340,000.000	5,340,109.600	
	3% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20160712	4,705,000.000	4,982,124.500	
	3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20170812	5,175,000.000	5,707,352.250	
	4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20190312	8,325,000.000	9,601,888.500	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,940,000.000	5,593,759.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	6,260,000.000	7,104,912.200	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,120,000.000	3,941,150.800	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 49,679,695.150 (757,615,352)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	4,579,000.000	7,176,941.440	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20151115	8,732,000.000	9,567,215.800	

	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20171115	9,139,000.000	10,577,478.600	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,472,000.000	17,982,877.920	
	4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115	8,601,000.000	10,323,608.280	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,017,000.000	2,302,990.430	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20141115	5,534,000.000	5,696,810.280	
	2.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20161115	1,602,000.000	1,726,283.160	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	1,153,000.000	1,139,452.250	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 66,493,658.160 (1,168,293,574)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20150515	6,164,000.000	6,604,972.560	
	4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20170519	6,325,000.000	6,969,454.250	
	4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20190522	5,810,000.000	6,689,053.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	4,213,000.000	4,722,983.650	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	2,194,000.000	2,136,473.320	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 27,122,936.780 (467,056,972)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	6.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20151024	2,679,000.000	2,896,963.440	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20220923	2,309,000.000	2,733,094.030	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20171025	4,466,000.000	4,891,118.540	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	2,458,000.000	2,788,502.680	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290425	1,935,000.000	2,401,818.750	
	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20150425	3,068,000.000	3,227,934.840	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20201025	2,012,000.000	2,277,282.200	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20160425	2,218,000.000	2,358,399.400	
	5.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20211025	936,000.000	1,099,612.800	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20161025	2,281,000.000	2,427,668.300	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20140725	1,705,000.000	1,656,578.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20170425	1,135,000.000	1,213,553.350	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20231025	2,012,000.000	2,101,171.840	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20180425	1,720,000.000	1,778,703.600	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20150725	732,000.000	692,325.600	

	2.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20180725	229,000.000	224,305.500	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 34,769,032.870 (1,074,363,116)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160915	2,614,000.000	2,696,628.540	
	4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150930	1,107,000.000	1,150,803.990	
	4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180207	1,210,000.000	1,260,021.400	
	5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT 20190730	938,000.000	1,056,900.880	
	3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170215	1,015,000.000	1,033,330.900	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	573,000.000	564,588.360	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	867,710.880	
	4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT 20191129	1,093,000.000	1,152,142.230	
	3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150227	1,056,000.000	1,070,382.720	
	3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT 20150812	653,000.000	664,505.860	
	4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT 20170915	1,427,000.000	1,465,215.060	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,885,000.000	1,970,296.250	
	3.434% MALAYSIAN GOVERNMENT 20140815	192,000.000	193,140.480	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	946,000.000	1,015,578.300	
	3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180928	738,000.000	745,903.980	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	572,000.000	567,990.280	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	757,096.700	
	3.197% MALAYSIAN GOVERNMENT 20151015	1,827,000.000	1,834,983.990	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	432,000.000	452,507.040	
	3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT 20171031	399,000.000	400,005.480	
	3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331	444,000.000	446,486.400	
	3.172% MALAYSIAN GOVERNMENT 20160715	445,000.000	444,933.250	
	3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT 20180301	533,000.000	532,717.510	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	401,000.000	401,308.770	
マレーシア・リンギット 小計			マレーシア・リンギット 22,745,179.250 (736,943,807)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20231207	2,516,000.000	3,067,255.600	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20241205	10,175,000.000	14,364,759.750	
	9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20141218	10,588,000.000	11,447,533.840	

	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20151217	4,320,000.000	4,702,449.600	
	7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20270603	8,568,000.000	10,181,440.080	
	7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20161215	10,474,000.000	11,464,735.660	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20171214	7,015,000.000	7,948,345.750	
	10% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20361120	6,874,000.000	9,955,201.760	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20290531	7,549,000.000	9,672,533.700	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20181213	6,960,000.000	8,273,700.000	
	8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20381118	9,694,000.000	12,369,737.880	
	7% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20140619	3,526,000.000	3,647,611.740	
	8% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20200611	18,429,000.000	21,826,386.150	
	6% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20150618	7,782,000.000	8,073,591.540	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20210610	14,694,000.000	16,105,358.700	
	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	11,839,000.000	12,495,117.380	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20310529	8,456,000.000	10,070,504.080	
	6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20220609	10,778,000.000	11,853,105.500	
	7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20421113	1,878,000.000	2,241,223.980	
	5% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20170615	2,474,000.000	2,526,052.960	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 192,286,645.650 (1,519,064,501)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160620	289,000.000	339,303.340	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	1,223,000.000	1,781,372.880	
	6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,067,000.000	1,668,884.030	
	5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	958,000.000	1,395,365.320	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	887,000.000	1,196,296.900	
	6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,492,784.700	
	5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,705,000.000	2,522,854.400	
	4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,154,000.000	3,034,275.180	
	4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20140704	2,717,000.000	2,839,509.530	
	3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150104	2,087,000.000	2,207,649.470	
	4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,911,000.000	2,482,389.000	
	3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150704	2,000,000.000	2,130,160.000	
	3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160104	2,510,000.000	2,726,060.800	

		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160704	2,619,000.000	2,921,730.210	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170104	2,185,000.000	2,454,410.500	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,301,000.000	1,780,951.910	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170704	2,099,000.000	2,427,703.400	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180104	1,798,000.000	2,085,769.900	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180704	2,211,000.000	2,618,774.730	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,848,000.000	2,732,637.600	
		3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190104	2,682,000.000	3,134,936.160	
		3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20190704	2,481,000.000	2,885,725.530	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104	2,075,000.000	2,394,425.500	
		3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	2,247,000.000	2,564,860.620	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	1,630,979.220	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	2,072,000.000	2,255,620.640	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,547,000.000	2,815,402.860	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	2,065,000.000	2,396,329.250	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,563,000.000	1,690,884.660	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,956,000.000	2,069,487.120	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	3,331,000.000	3,431,929.300	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	498,000.000	510,016.740	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,093,000.000	1,099,098.940	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,640,000.000	1,638,638.800	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	579,000.000	576,394.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20140613	1,428,000.000	1,427,314.560	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20140912	1,155,000.000	1,154,052.900	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20141212	784,000.000	783,051.360	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150313	650,000.000	651,612.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20150612	383,000.000	382,115.270	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20141010	1,406,000.000	1,451,835.600	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150227	2,401,000.000	2,500,545.460	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20150410	2,471,000.000	2,568,653.920	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20151009	2,786,000.000	2,891,979.440	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160226	1,926,000.000	2,021,876.280	
		2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	1,642,000.000	1,761,094.260	

		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20161014	997,000.000	1,030,369.590	
		0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170224	785,000.000	797,819.050	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20170407	2,302,000.000	2,315,512.740	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20171013	149,000.000	149,524.480	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180223	890,000.000	889,457.100	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20180413	443,000.000	436,740.410	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	653,000.000	946,360.250	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,285,000.000	2,028,937.900	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,141,000.000	2,974,919.500	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,623,000.000	3,571,791.560	
		5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20161025	2,925,000.000	3,363,077.250	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,507,000.000	3,586,614.480	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,953,000.000	2,506,109.130	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20141025	1,778,000.000	1,873,567.500	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20190425	1,591,000.000	1,876,409.490	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,800,000.000	2,089,260.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150425	2,232,000.000	2,370,450.960	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151025	3,752,000.000	3,994,904.480	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,742,601.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160425	3,522,000.000	3,810,029.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,558,000.000	2,972,037.880	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170425	3,288,000.000	3,675,819.600	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,358,000.000	5,208,463.700	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20171025	1,872,000.000	2,151,489.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180425	2,261,000.000	2,600,602.200	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20181025	1,897,000.000	2,219,755.580	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,365,000.000	2,975,690.300	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191025	2,610,000.000	3,015,019.800	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425	3,590,000.000	4,098,559.400	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	905,000.000	1,052,505.950	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,495,709.360	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,335,704.020	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	2,872,000.000	3,212,647.920	

		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	4,619,000.000	5,048,567.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	113,000.000	114,615.900	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	38,000.000	38,871.340	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20180525	1,045,000.000	1,048,573.900	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20151125	442,000.000	441,062.960	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	205,000.000	206,701.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	336,000.000	325,674.720	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140712	3,622,000.000	3,737,831.560	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150115	2,178,000.000	2,260,023.480	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20150712	2,614,000.000	2,712,338.680	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160225	2,429,000.000	2,551,907.400	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20160725	2,673,000.000	2,839,875.390	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170225	2,315,000.000	2,411,350.300	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20140925	1,467,000.000	1,479,469.500	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20170725	1,868,000.000	1,888,230.440	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	700,000.000	1,057,210.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,739,667.510	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20140715	1,767,000.000	1,838,616.510	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150715	1,536,000.000	1,634,027.520	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,235,000.000	1,558,693.500	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160715	1,398,000.000	1,552,283.280	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,132,000.000	1,331,401.800	
		4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170715	1,405,000.000	1,624,980.850	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180715	2,093,000.000	2,420,345.200	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190715	772,000.000	904,845.760	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150115	1,506,000.000	1,569,116.460	
		3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,318,404.240	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,739,000.000	2,161,524.830	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,418,000.000	1,607,118.660	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20170115	2,154,000.000	2,303,746.080	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150415	1,280,000.000	1,293,619.200	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,159,000.000	1,213,438.230	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	600,000.000	600,882.000	

		1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	433,000.000	442,521.670	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160415	112,000.000	110,793.760	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	665,000.000	657,146.350	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,342,000.000	1,897,453.800	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,613,000.000	2,086,044.510	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,963,000.000	3,609,526.600	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101	2,654,000.000	2,884,314.120	
		6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501	3,118,000.000	3,662,714.600	
		5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201	1,880,000.000	2,151,848.000	
		5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801	2,528,000.000	2,778,448.960	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201	4,052,000.000	4,297,956.400	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140801	2,708,000.000	2,813,124.560	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201	1,921,000.000	2,047,209.700	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201	2,223,000.000	2,332,949.580	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801	1,866,000.000	1,950,063.300	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801	2,172,000.000	2,264,614.080	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201	2,589,000.000	2,386,617.870	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801	3,128,000.000	3,179,643.280	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801	3,963,000.000	4,152,669.180	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201	2,280,000.000	2,404,488.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201	2,480,000.000	2,660,643.200	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801	1,699,000.000	1,762,372.700	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801	1,001,000.000	1,064,663.600	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801	2,928,000.000	3,145,169.760	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301	2,347,000.000	2,515,279.900	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	3,598,000.000	3,812,296.880	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140601	1,707,000.000	1,753,874.220	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301	2,403,000.000	2,592,019.980	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901	1,647,000.000	1,698,221.700	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301	2,560,000.000	2,698,777.600	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415	2,891,000.000	2,975,966.490	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200901	2,000,000.000	2,073,000.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150615	833,000.000	857,107.020	

		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,361,000.000	2,435,843.700	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210301	2,144,000.000	2,179,761.920	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151101	1,035,000.000	1,064,549.250	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,687,000.000	2,893,092.900	
		3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160415	2,034,000.000	2,136,513.600	
		4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20140701	443,000.000	458,863.830	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160915	986,000.000	1,062,395.280	
		5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,089,000.000	1,184,679.540	
		6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20141115	2,210,000.000	2,365,208.300	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170501	2,315,000.000	2,495,685.750	
		5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,088,000.000	1,215,024.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150301	1,330,000.000	1,357,477.800	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170601	2,626,000.000	2,828,989.800	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150715	1,412,000.000	1,493,401.800	
		5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221101	108,000.000	120,501.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20171101	1,261,000.000	1,298,893.050	
		2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20151201	549,000.000	560,814.480	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280901	529,000.000	549,102.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230501	824,000.000	853,911.200	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160515	22,000.000	22,114.840	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180601	22,000.000	22,544.500	
		4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20440901	760,000.000	749,223.200	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20280328	1,211,000.000	1,617,096.740	
		8% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	383,000.000	436,623.830	
		5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170928	810,000.000	969,618.600	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20140928	1,258,000.000	1,325,692.980	
		5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350328	1,605,000.000	2,090,737.200	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150928	1,106,000.000	1,193,816.400	
		3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160928	1,205,000.000	1,312,112.450	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220328	1,822,000.000	2,119,149.980	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170328	1,045,000.000	1,173,911.200	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180328	1,507,000.000	1,722,681.840	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190328	1,543,000.000	1,783,491.980	

		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20150328	1,555,000.000	1,646,573.950	
		3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20200928	1,218,000.000	1,397,374.860	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20160328	516,000.000	549,457.440	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20410328	1,297,000.000	1,542,055.180	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20210928	1,656,000.000	1,961,946.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20170628	1,202,000.000	1,330,529.860	
		4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20260328	801,000.000	966,734.910	
		4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	1,067,000.000	1,261,065.960	
		4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320328	864,000.000	988,804.800	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20190928	431,000.000	473,341.440	
		2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20230622	503,000.000	502,436.640	
		1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20180622	272,000.000	274,216.800	
		4.6% IRISH TREASURY 20160418	659,000.000	714,408.720	
		4.5% IRISH TREASURY 20181018	664,000.000	721,542.240	
		4.4% IRISH TREASURY 20190618	800,000.000	855,568.000	
		5.9% IRISH TREASURY 20191018	702,000.000	806,373.360	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,262,000.000	1,411,433.420	
		5% IRISH TREASURY 20201018	770,000.000	844,320.400	
		4.5% IRISH TREASURY 20150218	538,000.000	571,608.860	
		5.5% IRISH TREASURY 20171018	579,000.000	652,486.680	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	507,336.480	
		4.5% IRISH TREASURY 20200418	1,239,000.000	1,321,789.980	
		6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20270715	816,000.000	1,211,229.600	
		4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20180115	1,775,000.000	2,090,062.500	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20140715	476,000.000	498,709.960	
		3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20200715	870,000.000	1,023,111.300	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20150715	996,000.000	1,066,337.520	
		3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20210915	1,212,000.000	1,396,527.000	
		4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20160915	909,000.000	1,015,834.770	
		4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20370315	933,000.000	1,190,890.530	
		4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170915	711,000.000	820,316.250	
		4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190315	1,302,000.000	1,546,242.180	
		3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20141020	1,349,000.000	1,411,499.170	
		4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	929,000.000	1,212,038.430	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20170220	1,137,000.000	1,249,563.000	
		3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20220420	554,000.000	643,853.260	
		3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20221122	686,000.000	783,960.800	

		3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20620126	546,000.000	701,347.920	
		1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20190618	338,000.000	355,677.400	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20440620	290,000.000	319,504.600	
		1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20231020	210,000.000	206,677.800	
		4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND 20150704	111,000.000	120,356.190	
		3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170915	391,000.000	444,496.620	
		4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20190704	550,000.000	658,938.500	
		3.125% FINNISH GOVERNMENT BOND 20140915	658,000.000	683,642.260	
		4% FINNISH GOVERNMENT BOND 20250704	667,000.000	808,510.720	
		3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND 20200415	738,000.000	844,478.640	
		1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20160415	839,000.000	874,506.480	
		3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	459,000.000	530,397.450	
		1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND 20170415	252,000.000	264,952.800	
		2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND 20280704	270,000.000	286,707.600	
		1.625% FINNISH GOVERNMENT BOND 20220915	725,000.000	722,317.500	
		1.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20230415	378,000.000	368,572.680	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,108,000.000	2,373,397.200	
		4.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20140730	2,167,000.000	2,252,098.090	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,398,000.000	1,538,918.400	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170730	1,654,000.000	1,814,189.900	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150131	2,565,000.000	2,683,579.950	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,963,000.000	1,733,525.300	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160131	1,881,000.000	1,917,547.830	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20170131	1,016,000.000	1,048,664.400	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,139,000.000	1,114,853.200	
		4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	1,493,000.000	1,558,468.050	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,777,000.000	1,816,698.180	
		4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20190730	2,382,000.000	2,514,772.680	
		4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031	1,775,000.000	1,839,077.500	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20141031	2,091,000.000	2,144,634.150	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	893,000.000	846,760.460	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430	2,491,000.000	2,515,038.150	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	1,135,000.000	1,136,339.300	

		3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150430	1,805,000.000	1,840,937.550	
		4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,779,254.450	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160430	1,609,000.000	1,643,336.060	
		5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,768,009.000	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,074,000.000	1,193,321.400	
		4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	1,446,000.000	1,517,938.500	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,283,000.000	1,434,098.910	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150730	1,293,000.000	1,347,538.740	
		3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20151031	979,000.000	1,011,502.800	
		4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180131	1,041,000.000	1,099,098.210	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20150331	109,000.000	110,694.950	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,758,000.000	1,892,627.640	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20160730	980,000.000	998,943.400	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,089,000.000	1,081,431.450	
	ユーロ 小計			ユーロ 450,764,251.250 (59,045,609,271)	
	南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20141221	1,374,000.000	1,441,380.960	
		13.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20150915	6,184,000.000	7,209,678.240	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20170915	8,080,000.000	8,712,744.800	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20181221	7,256,000.000	7,815,147.360	
		7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115	8,732,000.000	9,047,312.520	
		10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	11,696,000.000	14,752,632.640	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	6,158,000.000	4,851,826.620	
		6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	8,963,000.000	9,001,899.420	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	4,942,000.000	3,931,015.060	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	6,336,000.000	5,733,446.400	
		7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,839,000.000	2,993,668.720	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	2,911,000.000	2,996,903.610	
	南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 78,487,656.350 (802,143,848)	
国債証券 合計				139,636,998,751 [139,636,998,751]	
合計				139,636,998,751 [139,636,998,751]	

（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	215銘柄	100%	40.6%
イギリス・ポンド	国債証券	36銘柄	100%	7.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	17銘柄	100%	1.6%
カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	100%	2.7%
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	100%	0.4%
スイス・フラン	国債証券	6銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券	5銘柄	100%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.8%
マレーシア・リンギット	国債証券	24銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	20銘柄	100%	1.1%
ユーロ	国債証券	262銘柄	100%	42.3%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	0.6%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２ 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年6月28日

Ⅰ 資産総額	3,825,149,841円
Ⅱ 負債総額	2,505,975円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,822,643,866円
Ⅳ 発行済数量	3,017,658,991口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2668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25年6月28日

Ⅰ 資産総額	116,491,961,346円
Ⅱ 負債総額	387,016,581円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	116,104,944,765円
Ⅳ 発行済数量	180,140,532,338口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6445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25年6月28日

Ⅰ 資産総額	14,401,975,308円
Ⅱ 負債総額	386,991,000円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,014,984,308円
Ⅳ 発行済数量	12,161,337,659口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1524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25年6月28日

Ⅰ 資産総額	62,527,843,724円
Ⅱ 負債総額	184,790,359円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	62,343,053,365円
Ⅳ 発行済数量	47,245,327,127口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3196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25年6月28日

Ⅰ 資産総額	138,486,704,827円
Ⅱ 負債総額	921,579,129円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	137,565,125,698円
Ⅳ 発行済数量	60,389,517,240口
Ⅴ １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2780円

第４ 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座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25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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

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

ロ．投資環境検討会

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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25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	6	99,073
追加型株式投資信託	442	8,821,883
株式投資信託　合計	448	8,920,956
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,757,060
公社債投資信託 合計	17	2,757,060
総合計	465	11,678,016

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24年４月１日から平成25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24年３月31日現在）		当事業年度 （平成25年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,745,233		14,380,327
有価証券		19,655,070		9,427,636
前払金		314		207
前払費用		90,562		142,919
未収入金		11,931		521,825
未収委託者報酬		6,516,540		7,183,011
未収収益		55,102		106,914
貯蔵品		11,888		9,551
繰延税金資産		630,508		491,727
その他		190,450		8,445
流動資産計		30,907,602		32,272,567
固定資産				
有形固定資産	※1	1,003,450	※1	254,258
建物（純額）		513,162		26,257
器具備品（純額）		484,571		222,274
リース資産（純額）		—		5,726
建設仮勘定		5,715		—
無形固定資産		2,870,849		3,194,512
ソフトウェア		2,173,517		3,132,238
ソフトウェア仮勘定		684,878		50,423
電話加入権		11,850		11,850
商標権		132		—
その他		471		—
投資その他の資産		16,375,520		15,113,434
投資有価証券		10,034,136		8,342,934
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		136,315
従業員に対する長期貸付金		112,674		92,527

差入保証金		542,920		1,000,820
長期前払費用		8,478		7,376
投資不動産（純額）	※1	409,876	※1	402,340
貸倒引当金		△9,950		△9,950
固定資産計		20,249,820		18,562,205
資産合計		51,157,423		50,834,773

（単位：千円）

		前事業年度 （平成24年３月31日現在）		当事業年度 （平成25年３月31日現在）
負債の部				
流動負債				
リース債務		―		1,227
預り金		55,551		56,491
未払金		7,194,946		6,795,899
未払収益分配金		17,954		10,333
未払償還金		88,334		113,002
未払手数料		3,386,380		3,764,501
その他未払金	※2	3,702,277	※2	2,908,061
未払費用		3,313,011		3,383,551
未払法人税等		963,539		588,040
未払消費税等		229,365		189,139
賞与引当金		307,000		841,300
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		12,789,375		11,855,648
固定負債				
リース債務		―		4,494
退職給付引当金		1,670,344		1,935,442
役員退職慰労引当金		68,068		67,410
繰延税金負債		1,782,558		1,740,407
固定負債計		3,520,970		3,747,753
負債合計		16,310,345		15,603,402
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174,272		15,174,272
資本剰余金				
資本準備金		11,495,727		11,495,727
資本剰余金合計		11,495,727		11,495,727
利益剰余金				
利益準備金		374,297		374,297
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		7,715,116		7,722,723
利益剰余金合計		8,089,414		8,097,020
株主資本合計		34,759,414		34,767,020
評価・換算差額等				

その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	―
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773

(2) 【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	72,931,048	73,498,726
その他営業収益	401,212	526,465
営業収益計	73,332,260	74,025,191
営業費用		
支払手数料	41,050,089	41,213,272
広告宣伝費	709,853	604,864
公告費	699	949
受益証券発行費	74	―
調査費	7,993,144	8,116,701
調査費	878,635	824,915
委託調査費	7,114,509	7,291,786
委託計算費	733,156	807,090
営業雑経費	1,651,996	1,280,599
通信費	205,421	206,564
印刷費	472,511	404,023
協会費	52,117	53,643
諸会費	11,971	11,281
その他営業雑経費	909,973	605,086
営業費用計	52,139,015	52,023,478
一般管理費		
給料	4,452,711	5,264,128
役員報酬	209,630	249,180
給料・手当	3,646,155	3,782,533
賞与	289,926	391,114
賞与引当金繰入額	307,000	841,300
福利厚生費	728,342	809,254
交際費	71,356	55,806
寄付金	591	636
旅費交通費	215,939	196,147
租税公課	171,533	206,178
不動産賃借料	727,939	887,968
退職給付費用	422,030	469,713
役員退職慰労引当金繰入額	27,988	38,970
固定資産減価償却費	1,107,222	1,181,438
諸経費	1,077,041	1,094,627
一般管理費計	9,002,696	10,204,869
営業利益	12,190,548	11,796,843

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）		当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）	
営業外収益				
受取配当金	※1	74,753	※1	257,704
有価証券利息		13,537		11,102
受取利息		2,771		10,598
時効成立分配金・償還金		42,189		21,305
投資有価証券売却益		117,695		279,443
有価証券償還益		68,106		101,052
その他		54,685		44,912
営業外収益計		373,739		726,118
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		2,182		19,392
投資有価証券売却損		95,389		36,469
有価証券償還損		67,873		33,338
投資不動産管理費用		16,454		16,271
その他		49,191		23,111
営業外費用計		231,091		128,584
経常利益		12,333,196		12,394,377
特別利益				
投資有価証券売却益		―		39,827
固定資産売却益		―		31
その他		―		16,466
特別利益計		―		56,325
特別損失				
固定資産除却損	※2	4,871	※2	129,816
減損損失	※3	76,217	※3	―
有価証券評価損		211,376		―
本社移転関連費用		346,425		1,099,913
その他		19,547		14,428
特別損失計		658,438		1,244,158
税引前当期純利益		11,674,757		11,206,544
法人税、住民税及び事業税		5,254,642		4,286,691
法人税等調整額		△602,832		△109,902
法人税等合計		4,651,809		4,176,789
当期純利益		7,022,948		7,029,755

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25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		
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,874,176	7,715,116
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計		
当期首残高	10,248,473	8,089,414
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	8,089,414	8,097,020

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
株主資本合計		
当期首残高	36,918,473	34,759,414
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	△104,040	33,879
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	137,920	430,470
当期変動額合計	137,920	430,470
当期末残高	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	85,902	53,783
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△32,119	△53,783
当期変動額合計	△32,119	△53,783
当期末残高	53,783	―
評価・換算差額等合計		
当期首残高	△18,137	87,663
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	105,800	376,686
当期末残高	87,663	464,350
純資産合計		
当期首残高	36,900,336	34,847,077
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	△2,053,258	384,293
当期末残高	34,847,077	35,231,371

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．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とおりであります。

建物　　６～47年

器具備品　　３～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年４月１日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

（３）長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

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

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（3）退職給付引当金

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

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

（4）役員退職慰労引当金

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

（5）本社移転関連費用引当金

前事業年度において、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、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

（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）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「時効成立後支払分配金・償還金」及び「投資不動産管理費用」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた67,829千円は、「時効成立後支払分配金・償還金」2,182千円、「投資不動産管理費用」16,454千円、「その他」49,191千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１ 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成24年３月31日現在）	当事業年度 （平成25年３月31日現在）
建物	986,089千円	15,528千円
器具備品	2,234,738千円	250,072千円
リース資産	－	409千円
投資建物	712,587千円	724,130千円
投資器具備品	22,398千円	23,691千円

※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24年３月31日現在）	当事業年度 （平成25年３月31日現在）
未払金	3,577,654千円	2,883,398千円

３ 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

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

（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23年４月１日 至　平成24年３月31日）	当事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）
受取配当金	－	185,280千円

※２　固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成23年４月１日 至　平成24年３月31日）	当事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）
建物	－	546千円
器具備品	4,812千円	128,892千円
無形固定資産（その他）	－	377千円
投資不動産	59千円	－
計	4,871千円	129,816千円

※３　減損損失に関する注記

前事業年度（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。

当事業年度（自　平成24年４月１日　至　平成25年３月31日）

該当事項はありません。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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とおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　7,022百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　2,692円
④ 基準日　平成24年３月31日
⑤ 効力発生日　平成24年６月26日

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年６月25日定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年３月31日	平成24年６月26日

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

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

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

（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関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は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おりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「５．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し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おりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。

（iii）デリバティブ取引

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

②信用リスクの管理

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

（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			
その他有価証券	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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額

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

（*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。

<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、（２）未収委託者報酬並びに（３）未収入金

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

（４）有価証券及び投資有価証券

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

負 債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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

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24年３月31日現在）	当事業年度 （平成25年３月31日現在）
（１）その他有価証券		
非上場株式	1,163,689	1,059,169
（２）子会社株式及び関連会社株式		
子会社株式	5,141,069	5,141,069
（３）差入保証金	542,920	1,000,820

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 その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	-

当事業年度（平成25年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

（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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

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

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	93,459	55,101	38,357
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	△100,323
小計	10,393,629	10,493,953	△100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
（１）株式	141,128	39,827	-
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469

合計	28,255,753	319,271	36,469

4．減損処理を行った有価証券

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

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

（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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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24年３月31日現在）	当事業年度 （平成25年３月31日現在）
退職給付債務	1,670,344千円	1,935,442千円
退職給付引当金	1,670,344千円	1,935,442千円

３．退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自　平成23年４月１日 至　平成24年３月31日）	当事業年度 （自　平成24年４月１日 至　平成25年３月31日）
勤務費用	261,341千円	301,777千円
その他	160,689千円	167,935千円
退職給付費用	442,030千円	469,713千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（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24年３月31日現在）	当事業年度 （平成25年３月31日現在）
繰延税金資産		
減損損失	838,826	837,121
退職給付引当金	599,247	693,199
賞与引当金	116,690	280,855
連結法人間取引（譲渡損）	258,256	264,269
繰延資産	12	157,330
未払事業税	212,753	154,219
投資有価証券評価損	191,138	128,953
出資金評価損	114,425	114,425
未払社会保険料	14,071	43,411
器具備品	33,365	33,316
役員退職慰労引当金	25,804	24,920
本社移転関連費用引当金	131,676	－
資産除去債務	110,989	－
有価証券評価損	80,344	－
その他有価証券評価差額金	27,099	－
その他	27,474	29,627
繰延税金資産小計	2,782,177	2,761,651
評価性引当額	△ 1,379,241	△ 1,323,069
繰延税金資産合計	1,402,935	1,438,582
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△ 2,428,233	△ 2,428,233
建物（資産除去債務）	△ 76,837	－
繰延ヘッジ損益	△ 29,783	－
その他有価証券評価差額金	△ 18,241	△ 257,138
その他	△ 1,888	△ 1,888
繰延税金負債合計	△ 2,554,985	△ 2,687,261
繰延税金負債の純額	△ 1,152,049	△ 1,248,679

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の

原因となった主要な項目別の内訳

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

（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

旧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

前事業年度において、移転までの使用見込期間を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23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
期首残高	―	292,000
見積りの変更に伴う増加額	292,000	―
資産除去債務の履行による減少額	―	△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

前事業年度において、本社移転計画に基づく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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

該当事項はありません。

[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。

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（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㈱	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・マーケッツ㈱	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	㈱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・マーケッツ株式会社は、平成24年４月１日をもって合併いたしました。

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ（株）	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

２.親会社に関する注記

㈱大和証券グループ本社（東京証券取引所、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23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
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	１株当たり純資産額　13,506.24円 １株当たり当期純利益　2,694.91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23年４月１日 至 平成24年３月31日）	当事業年度 （自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）
当期純利益（千円）	7,022,948	7,029,755
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。

4 【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

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

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

第２ 【その他の関係法人の概況】

１ 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

① 名称 三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 （平成25年3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
日本生命保険相互会社	1,250,000	（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	

（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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３ 【資本関係】

該当ありません。

＜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25年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３ 【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24年8月29日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第7期）・同添付書類
平成25年2月26日	半期報告書（第8期中）、有価証券届出書の訂正届出書・同添付書類

独立監査人の監査報告書

平成25年7月12日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス５０の平成24年6月6日から平成25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５０の平成25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25年５月29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24年４月１日から平成25年３月31日までの第54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25年３月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注)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。