

【表紙】  
【提出書類】 有価証券報告書  
【提出先】 関東財務局長 殿  
【提出日】 平成21年8月28日提出  
【計算期間】 第4計算期間  
（自 平成20年6月6日 至 平成21年6月5日）  
【ファンド名】 ダイワ・ライフ・バランス70  
【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社  
【代表者の役職氏名】 取締役社長 石橋 俊朗  
【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号  
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男  
【連絡場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号  
【電話番号】 03-5695-2111  
【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

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

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

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

#### < 信託金の限度額 >

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

#### < ファンドの特色 >

# 1

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

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

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

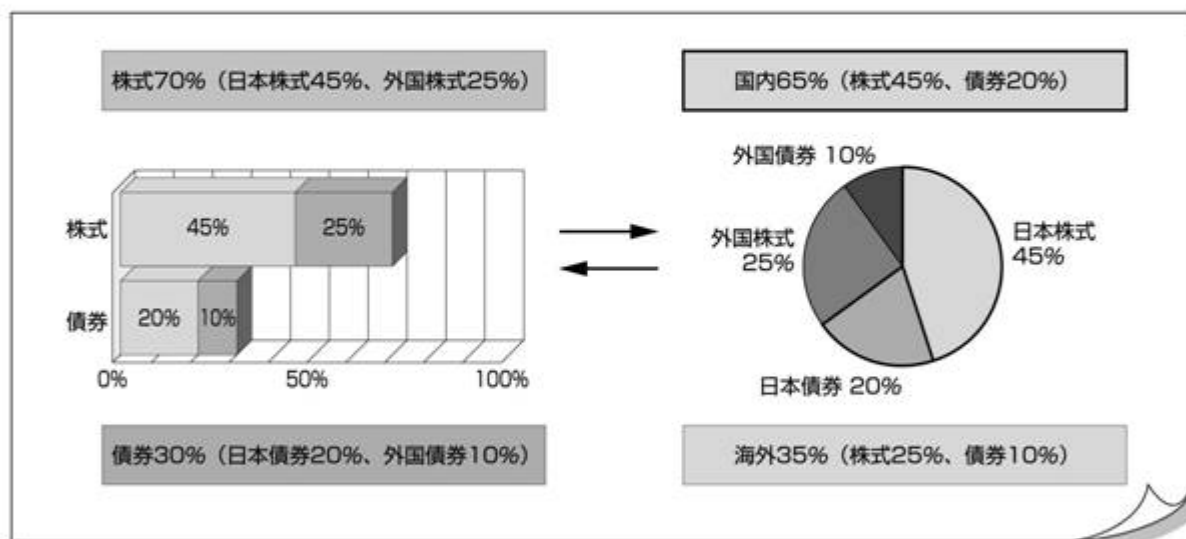
# 2

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

## 3

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

## 標準組入比率(基準ポートフォリオ)について



## 〈標準組入比率〉

- トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券：信託財産の純資産総額の45%
- 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20%
- 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25%
- 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%

# 4

## 運用の特色、関連説明

### (a) 合成ベンチマークについて

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

### (b) 各マザーファンドの運用プロセス

#### i. トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

#### ii. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

NOMURA-BPI総合指数に連動する投資成果をあげること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<sup>(注1)</sup>を用いて最適化を図ります。これに加えて、層化抽出法<sup>(注2)</sup>と呼ばれる手法を併用し、残存期間構成、セクター構成等をベンチマーク構成比に合わせることで、同指数との連動をめざします。また、NOMURA-BPI総合指数の構成銘柄変更等に対しても、リスクモデルによる最適化法と層化抽出法を使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

### iii. 外国株式インデックスマザーファンド

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

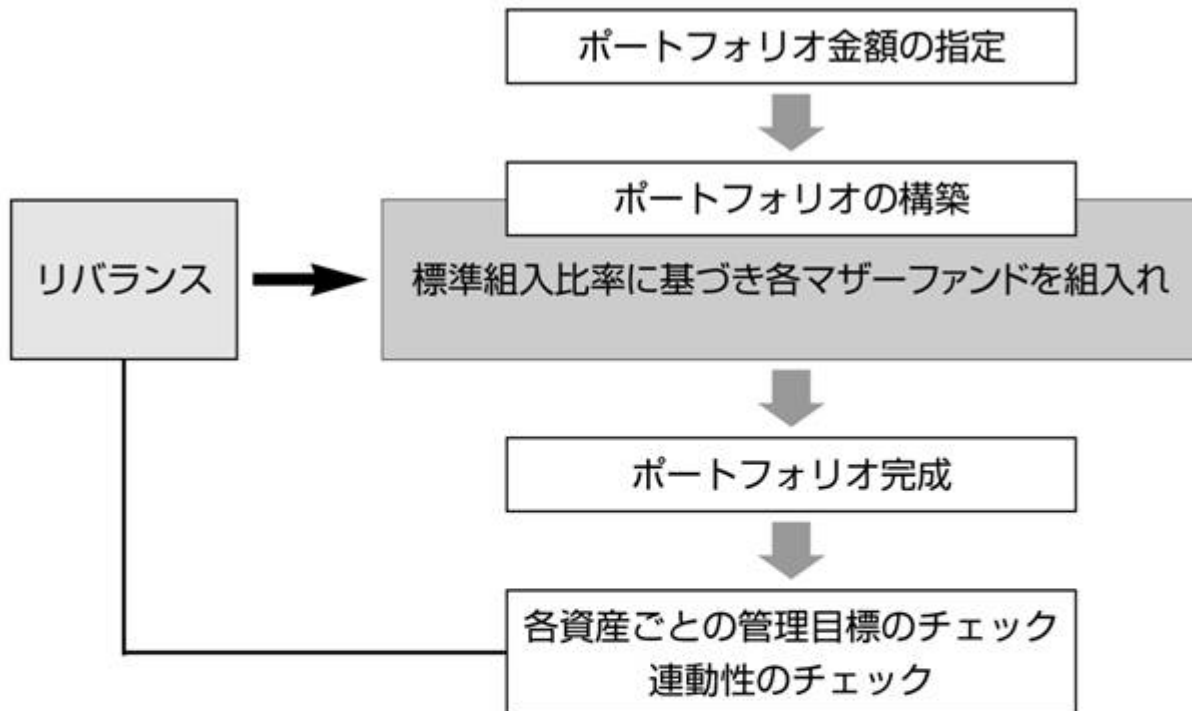
(注) ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

### iv. 外国債券インデックスマザーファンド

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

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

## (c) 運用プロセス



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

**5**

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

**6**

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

**7**

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

**8**

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

9

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

10

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます(前8.の前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合を除きます。)

## (2) 【ファンドの仕組み】

|       |  |  |
|-------|--|--|
| 受益者   | お申込者   |  |
|       | 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。<br>受益権の募集の取扱い<br>一部解約請求に関する事務<br>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。<br>受益権の募集・発行<br>信託財産の運用指図<br>信託財産の計算<br>運用報告書の作成 など  |
| 運用指図  | 2  | 損益 信託金（ 3 ）  |
| 受託会社  | 住友信託銀行株式会社<br>再信託受託会社：<br>日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社   | 信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br>信託財産の計算 など |
|       |  | 損益 投資  |
| 投資対象  | 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）、内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）、外国の株式（預託証券を含みます。）、外国の公社債 など（マザーファンド方式で運用を行ないます。） |  |

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

#### < 委託会社の概況（平成21年6月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

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

#### ・ 大株主の状況

| 名称             | 住所                | 所有<br>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<br>2,608,525 | %<br>100.00 |

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないません。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があります。

## &lt; 標準組入比率 &gt;

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45%

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20%

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25%

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】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券

3．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

4．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

5．株券または新株引受権証書

6．国債証券

7．地方債証券

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

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

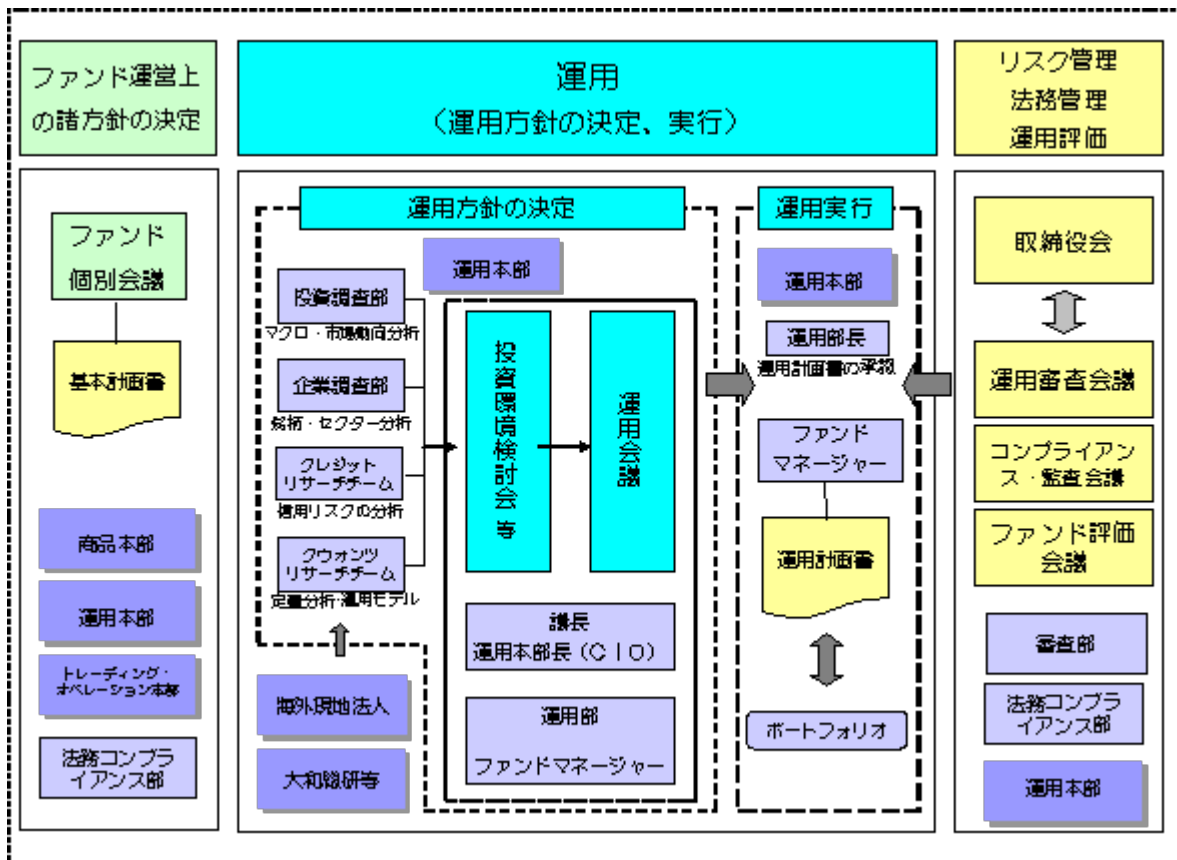
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

## (3) 【運用体制】

## 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

## イ．基本計画書の策定

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

## ロ．投資環境の検討

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

## ハ．基本的な運用方針の決定

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

## ニ．運用計画書の作成・承認

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

## 職務権限

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

イ．運用本部長（CIO）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．運用副本部長（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成21年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資信託証券（信託約款）

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

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

信用取引（信託約款）

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

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

先物取引等（信託約款）

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

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

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

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

内とします。

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

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

#### スワップ取引（信託約款）

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間

を超えないものとし、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、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、

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、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、

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、

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

同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

ロ．前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新

株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

#### 外貨建資産（信託約款）

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。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約取引（信託約款）

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

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 参 考 > マザーファンドの概要

## 1. トピックス・インデックス・マザーファンド

### (1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

基本的な投資態度

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

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

### (2) 投資対象

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号

イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことができます。

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

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

(注) 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

## 2. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

## 八．約束手形

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

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

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

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

#### 1．預金

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

### (3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 先物取引等

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

#### 金利先渡取引

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。

ん。

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

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

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

(注) NOMURA - B P I 総合指数とは

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

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

### 3. 外国株式インデックスマザーファンド

#### (1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

#### (2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注) M S C I コクサイ指数とは

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

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

#### 4. 外国債券インデックスマザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

###### 投資態度

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

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

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

##### (2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2

条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(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、すべて受益者に帰属します。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

##### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

##### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

##### 外国証券への投資に伴うリスク

##### イ．為替リスク

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

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

##### ロ．カントリー・リスク

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

##### その他

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

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

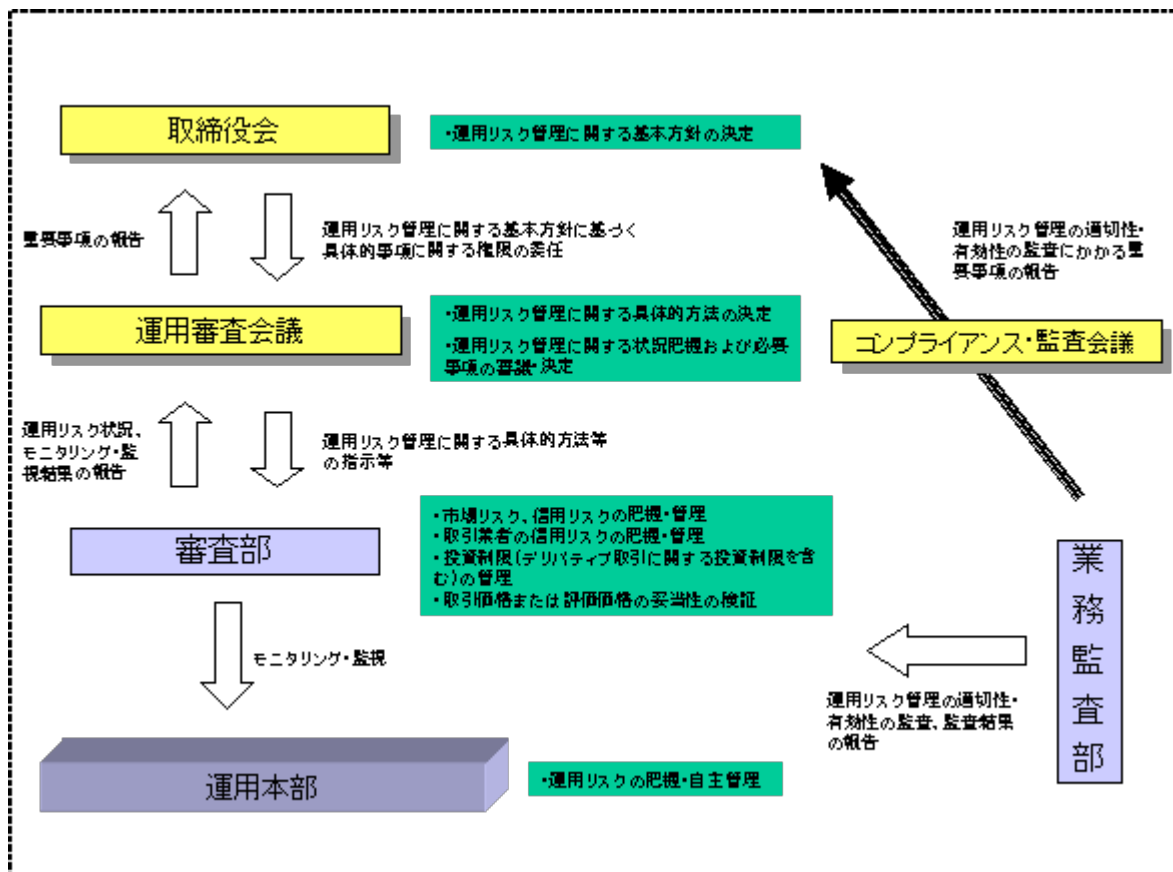
す。

## (2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

## (3) リスク管理体制



## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.231%（税抜0.22%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

| 委託会社                  | 販売会社                 | 受託会社                  |
|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| 年0.0945%<br>(税抜0.09%) | 年0.105%<br>(税抜0.10%) | 年0.0315%<br>(税抜0.03%) |

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

### < マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

## (5) 【課税上の取扱い】

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

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

#### イ．収益分配金に対する課税

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

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

#### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

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

#### ハ．損益通算について

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

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

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

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成21年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価（円）      | 投資比率（％） |
|-----------------------|------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 63,322,098 | 99.60   |
| 内 日本                  | 63,322,098 | 99.60   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 252,488    | 0.40    |
| 純資産総額                 | 63,574,586 | 100.00  |

## （参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

## 投資状況

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

## その他の資産の投資状況

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

## （参考）ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

## 投資状況

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

## （参考）外国株式インデックスマザーファンド

## 投資状況

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

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

## その他の資産の投資状況

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

(参考)外国債券インデックスマザーファンド  
投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券                  | 95,414,963,448 | 97.75   |
| 内 オーストラリア             | 599,480,050    | 0.61    |
| 内 カナダ                 | 2,351,003,643  | 2.41    |
| 内 スイス                 | 688,449,035    | 0.71    |
| 内 デンマーク               | 822,331,968    | 0.84    |
| 内 ユーロ                 | 50,201,837,892 | 51.43   |
| 内 英国                  | 8,008,831,446  | 8.21    |
| 内 マレーシア               | 516,295,559    | 0.53    |
| 内 ノルウェー               | 281,275,745    | 0.29    |
| 内 ポーランド               | 796,129,980    | 0.82    |
| 内 スウェーデン              | 656,162,182    | 0.67    |
| 内 シンガポール              | 405,212,591    | 0.42    |
| 内 米国                  | 30,087,953,357 | 30.83   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 2,191,578,948  | 2.25    |
| 純資産総額                 | 97,606,542,396 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価（円）         | 投資比率（％） |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 4,100,928,785 | 4.20    |
| 内 日本       | 4,100,928,785 | 4.20    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

## (2) 【投資資産】(平成21年6月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

(単位：円)

|   | 銘柄名<br>地域                           | 種類<br>業種           | 株数、口数<br>または額面金額 | 簿価単価<br>簿価            | 評価単価<br>時価           | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|-------------------------------------|--------------------|------------------|-----------------------|----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | トピックス・インデックス・<br>マザーファンド<br>日本      | 親投資信託受<br>益証券<br>- | 58,816,340       | 0.47741<br>28,079,741 | 0.4846<br>28,502,398 | -<br>-                   | 44.83%   |
| 2 | 外国株式インデックスマザー<br>ファンド<br>日本         | 親投資信託受<br>益証券<br>- | 20,790,728       | 0.76096<br>15,820,935 | 0.7672<br>15,950,646 | -<br>-                   | 25.09%   |
| 3 | ダイワ日本債券インデックス<br>マザーファンド(BPI)<br>日本 | 親投資信託受<br>益証券<br>- | 11,766,744       | 1.06225<br>12,499,312 | 1.0653<br>12,535,112 | -<br>-                   | 19.72%   |
| 4 | 外国債券インデックスマザー<br>ファンド<br>日本         | 親投資信託受<br>益証券<br>- | 3,259,207        | 1.92344<br>6,268,891  | 1.9434<br>6,333,942  | -<br>-                   | 9.96%    |

（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 | 99.60% |
| 合計        | 99.60% |

（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

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 96.82% |
| 合計        | 96.82% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

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

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

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

|    | 銘柄名<br>地域       | 種類<br>業種  | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価            | 評価単価<br>時価            | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|----|-----------------|-----------|----------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|----------|
| 1  | 273 2年国債<br>日本  | 国債証券<br>- | 180,000,000          | 100.60<br>181,093,600 | 100.74<br>181,348,200 | 0.800000<br>10/10/15     | 1.57%    |
| 2  | 288 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 166,000,000          | 103.58<br>171,949,230 | 104.36<br>173,242,580 | 1.700000<br>17/09/20     | 1.50%    |
| 3  | 289 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 149,000,000          | 101.57<br>151,349,830 | 102.62<br>152,903,800 | 1.500000<br>17/12/20     | 1.33%    |
| 4  | 296 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 144,000,000          | 100.84<br>145,221,390 | 101.98<br>146,852,640 | 1.500000<br>18/09/20     | 1.27%    |
| 5  | 298 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 138,000,000          | 99.99<br>137,994,250  | 99.95<br>137,940,660  | 1.300000<br>18/12/20     | 1.20%    |
| 6  | 390 東北電力<br>日本  | 社債券<br>-  | 130,000,000          | 103.50<br>134,556,240 | 103.96<br>135,160,610 | 2.250000<br>11/09/22     | 1.17%    |
| 7  | 272 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 130,000,000          | 102.94<br>133,833,300 | 103.27<br>134,260,100 | 1.400000<br>15/09/20     | 1.17%    |
| 8  | 299 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 130,000,000          | 99.34<br>129,145,600  | 99.65<br>129,552,800  | 1.300000<br>19/03/20     | 1.12%    |
| 9  | 5 政保中部空港<br>日本  | 特殊債券<br>- | 121,000,000          | 100.33<br>121,407,145 | 100.75<br>121,913,792 | 0.800000<br>13/03/28     | 1.06%    |
| 10 | 286 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 115,000,000          | 104.63<br>120,326,210 | 105.31<br>121,115,700 | 1.800000<br>17/06/20     | 1.05%    |
| 11 | 282 10年国債<br>日本 | 国債証券<br>- | 113,000,000          | 104.62<br>118,222,170 | 104.99<br>118,643,220 | 1.700000<br>16/09/20     | 1.03%    |
| 12 | 378 東北電力<br>日本  | 社債券<br>-  | 100,000,000          | 116.95<br>116,951,000 | 118.31<br>118,316,300 | 3.850000<br>16/04/25     | 1.03%    |
| 13 | 69 5年国債<br>日本   | 国債証券<br>- | 110,000,000          | 100.69<br>110,766,150 | 101.34<br>111,479,500 | 0.900000<br>12/12/20     | 0.97%    |

|    |              |    |            |             |                       |                       |                      |       |
|----|--------------|----|------------|-------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-------|
| 14 | 279 10年国債    | 日本 | 国債証券<br>-  | 102,000,000 | 107.49<br>109,640,590 | 107.06<br>109,205,280 | 2.000000<br>16/03/20 | 0.95% |
| 15 | 144 神奈川県公債   | 日本 | 地方債証券<br>- | 100,000,000 | 104.66<br>104,661,000 | 104.80<br>104,802,600 | 1.830000<br>16/12/20 | 0.91% |
| 16 | 26 公営企業      | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 103.07<br>103,070,000 | 104.30<br>104,301,300 | 1.780000<br>17/03/24 | 0.91% |
| 17 | 60 5年国債      | 日本 | 国債証券<br>-  | 102,000,000 | 101.77<br>103,805,980 | 101.92<br>103,963,500 | 1.200000<br>11/09/20 | 0.90% |
| 18 | 18 共同発行地方    | 日本 | 地方債証券<br>- | 100,000,000 | 102.47<br>102,478,400 | 103.66<br>103,669,700 | 1.600000<br>14/09/25 | 0.90% |
| 19 | 2 成田国際空港     | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 102.06<br>102,061,600 | 103.38<br>103,384,200 | 1.660000<br>15/12/18 | 0.90% |
| 20 | 13 首都高速道路    | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 101.03<br>101,032,000 | 102.63<br>102,638,300 | 1.480000<br>15/03/20 | 0.89% |
| 21 | 4 国際協力銀行     | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 101.45<br>101,456,400 | 102.62<br>102,628,600 | 1.520000<br>12/03/20 | 0.89% |
| 22 | 12 - こ 名古屋市債 | 日本 | 地方債証券<br>- | 100,000,000 | 101.51<br>101,513,700 | 102.45<br>102,459,700 | 1.400000<br>12/05/21 | 0.89% |
| 23 | 25 三菱化学      | 日本 | 社債券<br>-   | 100,000,000 | 101.92<br>101,924,000 | 102.38<br>102,380,700 | 1.800000<br>13/02/05 | 0.89% |
| 24 | 1 公営企業       | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 101.28<br>101,283,500 | 102.35<br>102,358,400 | 1.420000<br>11/12/26 | 0.89% |
| 25 | 21 東京瓦斯      | 日本 | 社債券<br>-   | 100,000,000 | 101.13<br>101,131,400 | 102.17<br>102,170,800 | 1.390000<br>11/11/15 | 0.89% |
| 26 | 576 東京都公債    | 日本 | 地方債証券<br>- | 100,000,000 | 101.56<br>101,563,210 | 102.04<br>102,048,900 | 1.400000<br>11/08/25 | 0.89% |
| 27 | 482 東京電力     | 日本 | 社債券<br>-   | 100,000,000 | 101.14<br>101,141,600 | 101.95<br>101,952,500 | 1.450000<br>11/05/25 | 0.89% |
| 28 | 793 政保公営企業   | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 102.00<br>102,000,700 | 101.89<br>101,899,600 | 1.800000<br>10/09/22 | 0.88% |
| 29 | 41 三菱電機      | 日本 | 社債券<br>-   | 100,000,000 | 100.39<br>100,393,200 | 101.82<br>101,828,800 | 1.400000<br>12/12/07 | 0.88% |
| 30 | い688 利付商工債   | 日本 | 特殊債券<br>-  | 100,000,000 | 100.05<br>100,050,100 | 101.82<br>101,823,300 | 1.350000<br>12/09/27 | 0.88% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （参考）外国株式インデックスマザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

（単位：円）

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 主要銘柄の明細

(単位：円)

|   | 銘柄名<br>地域                | 種類<br>業種 | 株数、口数<br>または額面金<br>額 | 簿価単価<br>簿価           | 評価単価<br>時価           | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|---|--------------------------|----------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------|----------|
| 1 | U.S. TREASURY NOTE<br>米国 | 国債証券     | 666,981,470          | 98.78<br>658,857,644 | 93.89<br>626,228,902 | 2.750000<br>19/02/15     | 0.64%    |

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 97.75% |
| 合計        | 97.75% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

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

|                            |    |           |            |            |       |
|----------------------------|----|-----------|------------|------------|-------|
| ポ ーランド ス ーチ買/円売<br>2009年8月 | 買建 | 227,000   | 6,836,105  | 6,796,380  | 0.01% |
| スウェーデ ンクローナ買/円売<br>2009年7月 | 買建 | 1,747,000 | 21,777,804 | 21,907,379 | 0.02% |
| スウェーデ ンクローナ買/円売<br>2009年8月 | 買建 | 457,000   | 5,731,237  | 5,730,780  | 0.01% |
| シンガ ポ ールト ル買/円売<br>2009年7月 | 買建 | 235,273   | 15,426,584 | 15,577,394 | 0.02% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

|                        | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)<br>(円) |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 設定時<br>(平成17年6月6日)     | 1,000,000             | -                     | 1.0000                         | -                              |
| 第1計算期間末<br>(平成18年6月5日) | 1,228,911             | 1,228,911             | 1.2289                         | 1.2289                         |
| 第2計算期間末<br>(平成19年6月5日) | 1,432,583             | 1,432,583             | 1.4326                         | 1.4326                         |
| 第3計算期間末<br>(平成20年6月5日) | 1,253,030             | 1,253,030             | 1.2530                         | 1.2530                         |
| 平成20年6月末日              | 3,388,557             | -                     | 1.1982                         | -                              |
| 7月末日                   | 3,378,441             | -                     | 1.1946                         | -                              |
| 8月末日                   | 3,323,140             | -                     | 1.1750                         | -                              |
| 9月末日                   | 3,715,656             | -                     | 1.0445                         | -                              |
| 10月末日                  | 4,354,026             | -                     | 0.8759                         | -                              |
| 11月末日                  | 21,948,349            | -                     | 0.8428                         | -                              |
| 12月末日                  | 19,140,930            | -                     | 0.8505                         | -                              |
| 平成21年1月末日              | 5,009,507             | -                     | 0.7997                         | -                              |
| 2月末日                   | 5,109,971             | -                     | 0.7876                         | -                              |
| 3月末日                   | 13,505,805            | -                     | 0.8114                         | -                              |
| 4月末日                   | 15,111,602            | -                     | 0.8670                         | -                              |
| 5月末日                   | 17,499,599            | -                     | 0.9087                         | -                              |
| 第4計算期間末<br>(平成21年6月5日) | 17,846,547            | 17,846,547            | 0.9267                         | 0.9267                         |
| 6月末日                   | 63,574,586            | -                     | 0.9293                         | -                              |

#### 【分配の推移】

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

|        |        |
|--------|--------|
| 第4計算期間 | 0.0000 |
|--------|--------|

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 22.9   |
| 第2計算期間 | 16.6   |
| 第3計算期間 | 12.5   |
| 第4計算期間 | 26.0   |

## 第二部 【ファンドの詳細情報】

### 第1 【ファンドの沿革】

平成17年6月6日 信託契約締結、当初設定、運用開始

### 第2 【手続等】

#### 1 【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時（半休日においては午前11時）までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎ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いません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行いません。

#### 2 【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時（半休日においては午前11時）までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎ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。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回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け付けたものとして、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。

委託会社は、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。委託会社は、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。

### 第3 【管理及び運営】

#### 1 【資産管理等の概要】

##### (1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00、半休日は9:00～12:00）

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年6月6日から翌年6月5日までとします。

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

## (5) 【その他】

## 信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
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、この4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

## 信託約款の変更

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

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

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

#### 反対者の買取請求権

前 1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1.の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 3.または前 4.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 2 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

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

#### 換金請求権

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

#### 第4 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

##### 1 【財務諸表】

#### ダイワ・ライフ・バランス70

## ダイワ・ライフ・バランス70

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>平成20年6月5日現在 | 第4期<br>平成21年6月5日現在 |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| <b>資産の部</b>     |                    |                    |
| 流動資産            |                    |                    |
| コール・ローン         | 5,262              | 85,335             |
| 親投資信託受益証券       | 1,249,260          | 17,775,879         |
| 流動資産合計          | 1,254,522          | 17,861,214         |
| 資産合計            | 1,254,522          | 17,861,214         |
| <b>負債の部</b>     |                    |                    |
| 流動負債            |                    |                    |
| 未払受託者報酬         | 183                | 2,567              |
| 未払委託者報酬         | 1,126              | 11,674             |
| その他未払費用         | 183                | 426                |
| 流動負債合計          | 1,492              | 14,667             |
| 負債合計            | 1,492              | 14,667             |
| <b>純資産の部</b>    |                    |                    |
| 元本等             |                    |                    |
| 元本              | 1,000,000          | 19,257,602         |
| 剰余金             |                    |                    |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 253,030            | 1,411,055          |
| （分配準備積立金）       | 432,583            | 1,838,490          |
| 元本等合計           | 1,253,030          | 17,846,547         |
| 純資産合計           | 1,253,030          | 17,846,547         |
| 負債純資産合計         | 1,254,522          | 17,861,214         |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期<br>自 平成19年6月6日<br>至 平成20年6月5日 | 第4期<br>自 平成20年6月6日<br>至 平成21年6月5日 |
|-------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益                    |                                   |                                   |
| 有価証券売買等損益               | 176,382                           | 539,619                           |
| 営業収益合計                  | 176,382                           | 539,619                           |
| 営業費用                    |                                   |                                   |
| 受託者報酬                   | 405                               | 3,696                             |
| 委託者報酬                   | 2,400                             | 16,892                            |
| その他費用                   | 366                               | 672                               |
| 営業費用合計                  | 3,171                             | 21,260                            |
| 営業利益又は営業損失（ ）           | 179,553                           | 518,359                           |
| 経常利益又は経常損失（ ）           | 179,553                           | 518,359                           |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）         | 179,553                           | 518,359                           |
| 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）   | -                                 | 1,263,959                         |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         | 432,583                           | 253,030                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | -                                 | 2,011,685                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | -                                 | 2,011,685                         |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | -                                 | 5,458,088                         |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | -                                 | 5,458,088                         |
| 分配金                     | 1                                 | -                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         | 253,030                           | 1,411,055                         |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 区分                  | 第3期<br>平成20年6月5日現在 | 第4期<br>平成21年6月5日現在                            |
|---------------------|--------------------|---|
| 1. 1 期首元本額          | 1,000,000円         | 1,000,000円                                    |
| 期中追加設定元本額           | - 円                | 39,662,604円                                   |
| 期中一部解約元本額           | - 円                | 21,405,002円                                   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,000,000口         | 19,257,602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1,411,055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3期<br>自平成19年6月6日<br>至平成20年6月5日  | 第4期<br>自平成20年6月6日<br>至平成21年6月5日  |
|------------|--|--|
| 1 分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(432,583円)より分配対象額は432,583円(1万口当たり4,325.83円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,742,457円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,234,685円)及び分配準備積立金(96,033円)より分配対象額は10,073,175円(1万口当たり5,230.75円)ですが、分配を行っておりません。 |

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第3期<br>平成20年6月5日現在 |                              | 第4期<br>平成21年6月5日現在 |                              |
|----|--------------------|------------------------------|--------------------|------------------------------|
|    | 貸借対照表計上額<br>(円)    | 当計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) | 貸借対照表計上額<br>(円)    | 当計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |
|    |                    |                              |                    |                              |

|           |           |         |            |           |
|-----------|-----------|---------|------------|-----------|
| 親投資信託受益証券 | 1,249,260 | 177,264 | 17,775,879 | 1,805,030 |
| 合計        | 1,249,260 | 177,264 | 17,775,879 | 1,805,030 |

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

|   |                                   |
|---|-----------------------------------|
| 第3期<br>自 平成19年6月6日<br>至 平成20年6月5日                                 | 第4期<br>自 平成20年6月6日<br>至 平成21年6月5日 |
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 | 同左                                |

## (1口当たり情報)

|                           |                      |                     |
|---------------------------|----------------------|---------------------|
|                           | 第3期<br>平成20年6月5日現在   | 第4期<br>平成21年6月5日現在  |
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.2530円<br>(12,530円) | 0.9267円<br>(9,267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<br>(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      | 16,756,838 | 8,004,741  |    |
|              | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 3,245,304  | 3,429,312  |    |
|              | 外国株式インデックスマザーファンド         | 5,851,212  | 4,587,935  |    |
|              | 外国債券インデックスマザーファンド         | 907,060    | 1,753,891  |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                           | 26,760,414 | 17,775,879 |    |
| 合計           |                           | 26,760,414 | 17,775,879 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考）

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

なお、同ファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                     | 平成20年6月5日現在      | 平成21年6月5日現在      |
|---|------------------|------------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 109,545,207,316円 | 137,304,656,548円 |
| 同期中における追加設定元本額                          | 37,340,297,389円  | 63,231,398,384円  |
| 同期中における一部解約元本額                          | 9,580,848,157円   | 14,713,392,395円  |
| 同期末における元本の内訳                            |                  |                  |
| ファンド名                                   |                  |                  |
| 適格機関投資家専用投信1号                           | 1,805,465,578円   | 1,869,501,381円   |
| トピックス・インデックスファンド                        | 11,155,443,911円  | 12,621,747,086円  |
| トピックス インデックス オープン                       | 4,555,850,857円   | - 円              |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA                  | 32,766,519,580円  | 39,922,760,343円  |
| 適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2        | 1,197,783,125円   | 1,134,072,648円   |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）            | 317,171,805円     | 443,542,905円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）            | 6,066,170,668円   | 6,961,598,127円   |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）            | 292,306,999円     | 399,500,970円     |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）            | 7,448,345,318円   | 9,330,703,812円   |

|  |  |  |
|--|--|--|
| DCダイワ日本株式インデックス                                      | 40,496,337,177円  | 47,641,531,873円  |
| ダイワ・ライフ・バランス30                                       | 1,378,829,978円   | 1,742,109,348円   |
| ダイワ・ライフ・バランス50                                       | 520,941円   | 14,810,425円  |
| ダイワ・ライフ・バランス70                                       | 819,673円   | 16,756,838円  |
| 年金ダイワ日本株式インデックス                                      | 227,002,583円   | 643,139,852円   |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020                               | 478,800円   | 8,853,720円   |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030                               | 791,884円   | 3,306,293円   |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040                               | 692,459円   | 897,635円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>15VA                              | 395,330,707円   | 541,117,017円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>20VA                              | 2,612,669,796円   | 3,806,303,937円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>20VA(国内株式型)                       | 1,497,591,082円   | 2,159,221,882円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>25VA                              | 95,810,817円  | 116,834,393円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>30VA                              | 524,249,505円   | 801,539,690円   |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>30VA(国内株式型)                       | 265,626,198円   | 380,371,813円   |
| ダイワ世界バランスファンド40<br>VA                                | 4,529,551,887円   | 4,185,224,653円   |
| ダイワ世界バランスファンド60<br>VA                                | 475,424,484円   | 568,728,238円   |
| ダイワ・バランスファンド35VA                                     | 7,646,028,863円   | 30,187,918,286円  |
| ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド50VA                            | 501,911,694円   | 2,369,393,830円   |
| ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド75VA                            | 1,215,687,234円   | 5,566,214,893円   |
| ダイワライフスタイル25   | 82,172,768円  | 138,900,305円   |
| ダイワライフスタイル50   | 263,711,162円   | 398,813,568円   |
| ダイワライフスタイル75   | 260,283,263円   | 328,907,878円   |
| DC・ダイワ・トピックス・イン<br>デックス(確定拠出年金専用ファ<br>ンド)            | 9,228,075,752円   | 11,518,338,898円  |
| 計  | 137,304,656,548円   | 185,822,662,537円   |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>計算期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 137,304,656,548口   | 185,822,662,537口   |
| 3. 2 元本の欠損   | 貸借対照表上の純資産額が元<br>本総額を下回っており、その差<br>額は37,455,195,607円であり<br>ます。 | 貸借対照表上の純資産額が元<br>本総額を下回っており、その差<br>額は97,058,715,425円であり<br>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<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。               | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。               |
|  | 株式 76,550,000円   | 株式 60,910,000円   |

(有価証券関係に関する注記)  
売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の状況に関する事項

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

取引の時価等に関する事項

株式関連

| 種類           | 平成20年6月5日現在   |           |               |             | 平成21年6月5日現在   |           |               |             |
|--------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|              | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
| 市場取引         |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 株価指数<br>先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買建           | 2,655,755,000 | -         | 2,848,000,000 | 192,245,000 | 1,651,943,000 | -         | 1,929,900,000 | 277,957,000 |

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

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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

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

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

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

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

|             |         |         |             |
|-------------|---------|---------|-------------|
| アステラス製薬     | 173,400 | 3,220   | 558,348,000 |
| 大日本住友製薬     | 55,000  | 754     | 41,470,000  |
| 塩野義製薬       | 113,000 | 1,837   | 207,581,000 |
| 田辺三菱製薬      | 76,000  | 1,010   | 76,760,000  |
| わかもと製薬      | 16,000  | 400     | 6,400,000   |
| あすか製薬       | 10,000  | 822     | 8,220,000   |
| 日本新薬        | 20,000  | 1,100   | 22,000,000  |
| 中外製薬        | 102,300 | 1,735   | 177,490,500 |
| 科研製薬        | 34,000  | 837     | 28,458,000  |
| エーザイ        | 95,600  | 3,150   | 301,140,000 |
| ロート製薬       | 35,000  | 974     | 34,090,000  |
| 小野薬品        | 38,400  | 4,140   | 158,976,000 |
| 久光製薬        | 23,900  | 2,990   | 71,461,000  |
| 持田製薬        | 32,000  | 884     | 28,288,000  |
| 大正製薬        | 72,000  | 1,769   | 127,368,000 |
| 参天製薬        | 23,600  | 2,950   | 69,620,000  |
| エスエス製薬      | 21,000  | 499     | 10,479,000  |
| 扶桑薬品        | 30,000  | 295     | 8,850,000   |
| 日本ケミファ      | 17,000  | 273     | 4,641,000   |
| ツムラ         | 22,700  | 2,985   | 67,759,500  |
| テルモ         | 53,000  | 3,950   | 209,350,000 |
| みらかホールディングス | 14,600  | 2,050   | 29,930,000  |
| キッセイ薬品工業    | 16,000  | 2,170   | 34,720,000  |
| 生化学工業       | 15,600  | 1,000   | 15,600,000  |
| 栄研化学        | 8,000   | 751     | 6,008,000   |
| 鳥居薬品        | 5,600   | 1,487   | 8,327,200   |
| 東和薬品        | 3,200   | 4,160   | 13,312,000  |
| 沢井製薬        | 5,100   | 4,960   | 25,296,000  |
| ゼリア新薬工業     | 12,000  | 1,065   | 12,780,000  |
| 第一三共        | 227,900 | 1,712   | 390,164,800 |
| キョーリン       | 19,000  | 1,353   | 25,707,000  |
| 大日本塗料       | 49,000  | 109     | 5,341,000   |
| 日本ペイント      | 85,000  | 463     | 39,355,000  |
| 関西ペイント      | 86,000  | 612     | 52,632,000  |
| 中国塗料        | 23,000  | 652     | 14,996,000  |
| 日本特殊塗料      | 12,000  | 329     | 3,948,000   |
| 藤倉化成        | 12,600  | 518     | 6,526,800   |
| 太陽インキ製造     | 6,200   | 2,145   | 13,299,000  |
| D I C       | 256,000 | 157     | 40,192,000  |
| サカタインクス     | 20,000  | 323     | 6,460,000   |
| 東洋インキ       | 77,000  | 299     | 23,023,000  |
| オリエンタルランド   | 21,600  | 6,310   | 136,296,000 |
| ダスキン        | 23,800  | 1,598   | 38,032,400  |
| パーク24       | 44,900  | 857     | 38,479,300  |
| フジ・メディア・HD  | 753     | 130,100 | 97,965,300  |
| 秀英予備校       | 9,700   | 362     | 3,511,400   |
| ラウンドワン      | 13,200  | 895     | 11,814,000  |
| リゾートトラスト    | 14,600  | 937     | 13,680,200  |
| オービック       | 2,280   | 16,080  | 36,662,400  |
| ヤフー         | 5,395   | 27,280  | 147,175,600 |
| ビー・エム・エル    | 4,900   | 1,955   | 9,579,500   |
| ワタベウェディング   | 4,200   | 1,549   | 6,505,800   |
| トレンドマイクロ    | 35,500  | 3,390   | 120,345,000 |
| もしもしホットライン  | 6,150   | 1,854   | 11,402,100  |
| 東急コミュニティー   | 3,200   | 1,883   | 6,025,600   |

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

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

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

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

|               |           |         |             |
|---------------|-----------|---------|-------------|
| セガサミーホールディングス | 84,000    | 1,074   | 90,216,000  |
| 日本ピストンリング     | 44,000    | 101     | 4,444,000   |
| リケン           | 39,000    | 274     | 10,686,000  |
| 帝国ピストン        | 12,700    | 455     | 5,778,500   |
| ホシザキ電機        | 15,000    | 1,057   | 15,855,000  |
| 大豊工業          | 8,300     | 713     | 5,917,900   |
| 日本精工          | 153,000   | 484     | 74,052,000  |
| N T N         | 131,000   | 359     | 47,029,000  |
| ジェイテクト        | 73,900    | 867     | 64,071,300  |
| 不二越           | 77,000    | 193     | 14,861,000  |
| ミネベア          | 111,000   | 404     | 44,844,000  |
| 日本トムソン        | 25,000    | 487     | 12,175,000  |
| T H K         | 45,800    | 1,556   | 71,264,800  |
| ユーシン精機        | 3,900     | 1,439   | 5,612,100   |
| イーグル工業        | 12,000    | 405     | 4,860,000   |
| キッツ           | 35,000    | 313     | 10,955,000  |
| 日立            | 1,238,000 | 317     | 392,446,000 |
| 東芝            | 1,425,000 | 356     | 507,300,000 |
| 三菱電機          | 690,000   | 573     | 395,370,000 |
| 富士電機HLDGS     | 173,000   | 152     | 26,296,000  |
| 東洋電機製造        | 16,000    | 593     | 9,488,000   |
| 安川電機          | 81,000    | 594     | 48,114,000  |
| シンフォニアテクノロジー  | 49,000    | 238     | 11,662,000  |
| 明電舎           | 70,000    | 480     | 33,600,000  |
| オリジン電気        | 15,000    | 293     | 4,395,000   |
| デンヨー          | 8,800     | 822     | 7,233,600   |
| 日立工機          | 25,500    | 935     | 23,842,500  |
| 三桜工業          | 12,900    | 461     | 5,946,900   |
| マキタ           | 44,800    | 2,340   | 104,832,000 |
| 東芝テック         | 54,000    | 401     | 21,654,000  |
| 芝浦メカトロニクス     | 15,000    | 454     | 6,810,000   |
| マブチモーター       | 11,100    | 4,760   | 52,836,000  |
| 日本電産          | 36,500    | 6,000   | 219,000,000 |
| 高岳製作所         | 38,000    | 326     | 12,388,000  |
| ダイヘン          | 38,000    | 359     | 13,642,000  |
| JVCケンウッドHD    | 224,300   | 70      | 15,701,000  |
| 日新電機          | 18,000    | 473     | 8,514,000   |
| 大崎電気          | 12,000    | 951     | 11,412,000  |
| オムロン          | 87,400    | 1,503   | 131,362,200 |
| 日東工業          | 11,600    | 931     | 10,799,600  |
| I D E C       | 11,600    | 660     | 7,656,000   |
| エルピーダメモリ      | 36,000    | 1,111   | 39,996,000  |
| ジーエス・ユアサコーポ   | 119,000   | 854     | 101,626,000 |
| サクサホールディングス   | 28,000    | 130     | 3,640,000   |
| メルコホールディングス   | 4,400     | 1,276   | 5,614,400   |
| 日本電気          | 746,000   | 379     | 282,734,000 |
| 富士通           | 761,000   | 495     | 376,695,000 |
| 沖電気           | 210,000   | 104     | 21,840,000  |
| 岩崎通信機         | 37,000    | 100     | 3,700,000   |
| 電気興業          | 21,000    | 501     | 10,521,000  |
| サンケン電気        | 44,000    | 408     | 17,952,000  |
| アイホン          | 6,400     | 1,579   | 10,105,600  |
| NECエレクトロニクス   | 14,300    | 960     | 13,728,000  |
| セイコーエプソン      | 54,000    | 1,461   | 78,894,000  |
| ワコム           | 147       | 176,200 | 25,901,400  |

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

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

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

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

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

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

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

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

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

|              |           |         |             |
|--------------|-----------|---------|-------------|
| 日本エスリード      | 6,700     | 475     | 3,182,500   |
| 東急リバブル       | 10,600    | 715     | 7,579,000   |
| 飯田産業         | 7,000     | 709     | 4,963,000   |
| 日神不動産        | 11,000    | 332     | 3,652,000   |
| アーネストワン      | 15,400    | 251     | 3,865,400   |
| タカラレーベン      | 10,900    | 184     | 2,005,600   |
| イオンモール       | 33,300    | 1,709   | 56,909,700  |
| リサ・パートナーズ    | 111       | 73,400  | 8,147,400   |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 457       | 82,300  | 37,611,100  |
| サンフロンティア不動産  | 99        | 22,950  | 2,272,050   |
| 東武鉄道         | 317,000   | 519     | 164,523,000 |
| 相模鉄道         | 103,000   | 398     | 40,994,000  |
| 東京急行         | 409,000   | 441     | 180,369,000 |
| 京浜急行         | 188,000   | 719     | 135,172,000 |
| 小田急電鉄        | 236,000   | 784     | 185,024,000 |
| 京王電鉄         | 190,000   | 549     | 104,310,000 |
| 京成電鉄         | 123,000   | 500     | 61,500,000  |
| 富士急行         | 25,000    | 405     | 10,125,000  |
| 東日本旅客鉄道      | 137,700   | 5,450   | 750,465,000 |
| 西日本旅客鉄道      | 691       | 311,000 | 214,901,000 |
| 東海旅客鉄道       | 615       | 615,000 | 378,225,000 |
| 西日本鉄道        | 95,000    | 357     | 33,915,000  |
| ハマキョウレックス    | 3,000     | 2,005   | 6,015,000   |
| 近畿鉄道         | 663,000   | 418     | 277,134,000 |
| 阪急阪神HLDGS    | 495,000   | 456     | 225,720,000 |
| 南海電鉄         | 153,000   | 429     | 65,637,000  |
| 京阪電鉄         | 163,000   | 405     | 66,015,000  |
| 名古屋鉄道        | 255,000   | 300     | 76,500,000  |
| 日本通運         | 316,000   | 417     | 131,772,000 |
| ヤマトホールディングス  | 147,000   | 1,214   | 178,458,000 |
| 山九           | 90,000    | 356     | 32,040,000  |
| 日新           | 38,000    | 205     | 7,790,000   |
| 丸全昭和運輸       | 29,000    | 264     | 7,656,000   |
| センコー         | 33,000    | 315     | 10,395,000  |
| トナミホールディングス  | 28,000    | 235     | 6,580,000   |
| 日本梱包運輸       | 21,000    | 950     | 19,950,000  |
| 福山通運         | 59,000    | 405     | 23,895,000  |
| セイノーホールディングス | 57,000    | 715     | 40,755,000  |
| 神奈川中央交通      | 15,000    | 508     | 7,620,000   |
| 日立物流         | 15,500    | 1,107   | 17,158,500  |
| 日本郵船         | 397,000   | 449     | 178,253,000 |
| 商船三井         | 389,000   | 672     | 261,408,000 |
| 川崎汽船         | 179,000   | 430     | 76,970,000  |
| 新和海運         | 33,000    | 303     | 9,999,000   |
| 乾汽船          | 10,700    | 735     | 7,864,500   |
| 明治海運         | 9,600     | 514     | 4,934,400   |
| 飯野海運         | 36,700    | 576     | 21,139,200  |
| 太平洋海運        | 26,000    | 117     | 3,042,000   |
| 第一中央汽船       | 51,000    | 297     | 15,147,000  |
| 全日本空輸        | 762,000   | 346     | 263,652,000 |
| 日本航空         | 1,071,000 | 186     | 199,206,000 |
| パスコ          | 21,000    | 189     | 3,969,000   |
| 三菱倉庫         | 53,000    | 968     | 51,304,000  |
| 三井倉庫         | 34,000    | 351     | 11,934,000  |
| 住友倉庫         | 60,000    | 387     | 23,220,000  |

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

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

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

[次へ](#)

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

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 区分 | 平成20年6月5日現在 | 平成21年6月5日現在 |
|----|-------------|-------------|
|    |             |             |

|    |   |                 |                 |
|----|---|-----------------|-----------------|
| 1. | 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額              | 3,910,125,090円  | 12,166,198,651円 |
|    | 同期中における追加設定元本額                                    | 9,945,106,658円  | 5,210,271,958円  |
|    | 同期中における一部解約元本額                                    | 1,689,033,097円  | 6,595,286,457円  |
|    | 同期末における元本の内訳<br>ファンド名                             |                 |                 |
|    | ダイワ・ライフ・バランス30                                    | 2,330,360,339円  | 2,010,472,049円  |
|    | ダイワ・ライフ・バランス50                                    | 448,173円        | 8,680,542円      |
|    | ダイワ・ライフ・バランス70                                    | 221,306円        | 3,245,304円      |
|    | DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/安定コース)                    | 54,996,560円     | 80,138,302円     |
|    | DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/6分散コース)                   | 68,337,146円     | 68,229,072円     |
|    | DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/成長コース)                    | 13,400,679円     | 12,856,247円     |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020                            | 386,644円        | 5,070,449円      |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030                            | 204,727円        | 590,303円        |
|    | DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040                            | 48,297円         | 42,013円         |
|    | ダイワ世界バランスファンド40<br>VA                             | 7,989,747,203円  | 4,637,722,661円  |
|    | ダイワ世界バランスファンド60<br>VA                             | 503,116,659円    | 378,123,406円    |
|    | ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド50VA                         | 352,103,040円    | 1,059,674,847円  |
|    | ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド75VA                         | 852,827,878円    | 2,516,338,957円  |
|    | 計   | 12,166,198,651円 | 10,781,184,152円 |
| 2. | 本報告書における開示対象ファンドの<br>計算期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 12,166,198,651口 | 10,781,184,152口 |

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

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

## (1口当たり情報)

|  | 平成20年6月5日現在          | 平成21年6月5日現在          |
|--|----------------------|----------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0217円<br>(10,217円) | 1.0567円<br>(10,567円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

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

|     |       |             |             |
|-----|-------|-------------|-------------|
| 236 | 10年国債 | 10,000,000  | 10,274,000  |
| 237 | 10年国債 | 45,000,000  | 46,307,700  |
| 238 | 10年国債 | 9,000,000   | 9,236,880   |
| 239 | 10年国債 | 9,000,000   | 9,247,050   |
| 240 | 10年国債 | 37,000,000  | 37,905,020  |
| 241 | 10年国債 | 18,000,000  | 18,449,640  |
| 242 | 10年国債 | 17,000,000  | 17,369,920  |
| 243 | 10年国債 | 17,000,000  | 17,315,010  |
| 244 | 10年国債 | 6,000,000   | 6,088,140   |
| 245 | 10年国債 | 11,000,000  | 11,121,660  |
| 246 | 10年国債 | 15,000,000  | 15,114,000  |
| 247 | 10年国債 | 26,000,000  | 26,177,320  |
| 248 | 10年国債 | 20,000,000  | 20,062,600  |
| 249 | 10年国債 | 33,000,000  | 32,981,520  |
| 250 | 10年国債 | 44,000,000  | 43,706,520  |
| 251 | 10年国債 | 13,000,000  | 13,119,730  |
| 252 | 10年国債 | 55,000,000  | 55,722,150  |
| 253 | 10年国債 | 56,000,000  | 58,093,840  |
| 254 | 10年国債 | 31,000,000  | 31,894,970  |
| 255 | 10年国債 | 4,000,000   | 4,132,920   |
| 256 | 10年国債 | 14,000,000  | 14,401,660  |
| 257 | 10年国債 | 15,000,000  | 15,364,650  |
| 258 | 10年国債 | 55,000,000  | 56,316,700  |
| 260 | 10年国債 | 40,000,000  | 41,516,400  |
| 261 | 10年国債 | 32,000,000  | 33,530,240  |
| 262 | 10年国債 | 45,000,000  | 47,380,500  |
| 263 | 10年国債 | 6,000,000   | 6,230,520   |
| 264 | 10年国債 | 6,000,000   | 6,198,600   |
| 265 | 10年国債 | 38,000,000  | 39,262,740  |
| 266 | 10年国債 | 39,000,000  | 40,090,050  |
| 267 | 10年国債 | 45,000,000  | 46,020,600  |
| 268 | 10年国債 | 25,000,000  | 25,816,250  |
| 269 | 10年国債 | 67,000,000  | 68,433,130  |
| 270 | 10年国債 | 88,000,000  | 89,781,120  |
| 271 | 10年国債 | 47,000,000  | 47,669,750  |
| 272 | 10年国債 | 130,000,000 | 133,229,200 |
| 273 | 2年国債  | 180,000,000 | 181,427,400 |
| 273 | 10年国債 | 49,000,000  | 50,521,940  |
| 274 | 2年国債  | 25,000,000  | 25,135,500  |
| 274 | 10年国債 | 11,000,000  | 11,326,590  |
| 275 | 2年国債  | 69,000,000  | 69,380,190  |
| 275 | 10年国債 | 30,000,000  | 30,707,100  |
| 276 | 2年国債  | 90,000,000  | 90,351,000  |
| 276 | 10年国債 | 16,000,000  | 16,578,080  |
| 277 | 2年国債  | 20,000,000  | 20,041,800  |
| 277 | 10年国債 | 45,000,000  | 46,579,950  |
| 278 | 2年国債  | 70,000,000  | 70,128,800  |
| 278 | 10年国債 | 36,000,000  | 37,731,600  |
| 279 | 2年国債  | 50,000,000  | 50,078,000  |
| 279 | 10年国債 | 96,000,000  | 101,864,640 |
| 280 | 2年国債  | 35,000,000  | 35,050,050  |
| 280 | 10年国債 | 50,000,000  | 52,660,500  |
| 281 | 10年国債 | 27,000,000  | 28,622,430  |
| 282 | 10年国債 | 113,000,000 | 117,174,220 |
| 283 | 10年国債 | 69,000,000  | 72,060,840  |
| 284 | 10年国債 | 71,000,000  | 73,526,890  |
| 285 | 10年国債 | 69,000,000  | 71,326,680  |

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                    | 自 平成19年6月6日<br>至 平成20年6月5日  | 自 平成20年6月6日<br>至 平成21年6月5日                      |
|-----------------------|---|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | <p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>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。</p> | <p>(1)株式</p> <p>同左</p> <p>(2)投資証券</p> <p>同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引</p> <p>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。</p> <p>(2)為替予約取引</p>  | <p>(1)先物取引</p> <p>同左</p> <p>(2)為替予約取引</p>       |

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

|  |  |    |
|--|--|----|
|  | <p>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。</p> | 同左 |
|--|--|----|

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                     | 平成20年6月5日現在     | 平成21年6月5日現在     |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 14,978,362,016円 | 30,808,672,404円 |
| 同期中における追加設定元本額                          | 18,466,040,170円 | 25,956,993,314円 |
| 同期中における一部解約元本額                          | 2,635,729,782円  | 6,204,442,087円  |
| 同期末における元本の内訳                            |                 |                 |
| ファンド名                                   |                 |                 |
| ダイワ外国株式インデックスV A                        | 1,736,819,706円  | 1,825,634,080円  |
| ダイワ国内重視バランスファンド30 V A（一般投資家私募）          | 85,837,312円     | 139,917,994円    |
| ダイワ国内重視バランスファンド50 V A（一般投資家私募）          | 1,370,194,511円  | 1,888,495,135円  |
| ダイワ国際分散バランスファンド30 V A（一般投資家私募）          | 161,687,932円    | 249,225,404円    |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ国際分散バランスファンド<br>50VA(一般投資家私募)                     | 4,042,184,146円  | 5,982,787,046円  |
| DCダイワ外国株式インデックス                                      | 6,512,051,735円  | 9,437,925,872円  |
| ダイワ・ライフ・バランス30                                       | 365,399,452円    | 535,445,531円    |
| ダイワ・ライフ・バランス50                                       | 187,331円        | 6,181,105円      |
| ダイワ・ライフ・バランス70                                       | 241,964円        | 5,851,212円      |
| 大和DC海外株式インデックス<br>ファンド                               | 997,210,601円    | 1,147,659,082円  |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020                               | 154,044円        | 3,481,202円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030                               | 252,781円        | 1,174,974円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040                               | 248,600円        | 381,816円        |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>15VA                              | 107,799,388円    | 168,413,914円    |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>20VA                              | 1,397,027,007円  | 2,379,276,845円  |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>25VA                              | 34,382,327円     | 48,857,957円     |
| ダイワ世界分散バランスファンド<br>30VA                              | 285,275,163円    | 501,358,081円    |
| ダイワ世界バランスファンド40<br>VA                                | 7,510,263,039円  | 7,764,580,427円  |
| ダイワ世界バランスファンド60<br>VA                                | 1,313,945,969円  | 1,758,523,713円  |
| ダイワ・バランスファンド35V<br>A                                 | 3,208,903,578円  | 14,519,374,128円 |
| ダイワ投信倶楽部外国株式イン<br>デックス                               | 1,596,306,299円  | 2,059,911,632円  |
| ダイワライフスタイル25   | 11,056,624円     | 23,274,084円     |
| ダイワライフスタイル50   | 35,889,823円     | 62,081,104円     |
| ダイワライフスタイル75   | 35,353,072円     | 51,411,293円     |
| 計  | 30,808,672,404円 | 50,561,223,631円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>計算期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 30,808,672,404口 | 50,561,223,631口 |

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

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

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

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

## 取引の時価等に関する事項

## 1. 株式関連

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

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

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

|  | 平成20年6月5日現在          | 平成21年6月5日現在         |
|--|----------------------|---------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.2775円<br>(12,775円) | 0.7841円<br>(7,841円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

## (2) 株式以外の有価証券

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分                                     | 平成20年6月5日現在     | 平成21年6月5日現在     |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 20,578,948,601円 | 36,568,278,437円 |
| 同期中における追加設定元本額                          | 17,425,816,965円 | 18,326,125,160円 |
| 同期中における一部解約元本額                          | 1,436,487,129円  | 5,694,938,284円  |
| 同期末における元本の内訳<br>ファンド名                   |                 |                 |
| ダイワ外国債券インデックスV A                        | 3,383,774,479円  | 3,611,906,985円  |
| ダイワ国内重視バランスファンド<br>30 V A（一般投資家私募）      | 99,133,471円     | 101,447,195円    |
| ダイワ国内重視バランスファンド<br>50 V A（一般投資家私募）      | 833,503,704円    | 745,935,929円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド<br>30 V A（一般投資家私募）      | 231,147,053円    | 227,332,124円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド<br>50 V A（一般投資家私募）      | 2,423,701,183円  | 2,081,324,444円  |
| DCダイワ外国債券インデックス<br>ダイワ・ライフ・バランス30       | 15,411,033,407円 | 19,274,497,140円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50                          | 317,639,891円    | 307,421,429円    |
|   | 54,974円         | 1,212,583円      |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ・ライフ・バランス70                                       | 55,842円         | 907,060円        |
| DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/安定コース)                       | 26,554,524円     | 44,341,875円     |
| DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/6分散コース)                      | 32,969,960円     | 38,389,959円     |
| DCダイワ・ワールドアセット<br>(六つの羽/成長コース)                       | 6,457,230円      | 7,264,561円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020                               | 146,958円        | 2,054,345円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030                               | 77,229円         | 263,804円        |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040                               | 23,435円         | 23,419円         |
| ダイワ世界バランスファンド40<br>VA                                | 5,377,021,764円  | 3,583,489,811円  |
| ダイワ世界バランスファンド60<br>VA                                | 403,071,319円    | 347,818,359円    |
| ダイワ・バランスファンド35<br>VA                                 | 3,922,232,673円  | 11,137,980,114円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド50VA                            | 688,635,445円    | 2,352,432,612円  |
| ダイワ・ワールド・バランスファ<br>ンド75VA                            | 625,069,347円    | 2,064,944,904円  |
| ダイワ投信倶楽部外国債券イン<br>デックス                               | 2,743,979,856円  | 3,221,864,643円  |
| ダイワライフスタイル25   | 13,320,537円     | 16,087,038円     |
| ダイワライフスタイル50   | 21,586,627円     | 23,776,154円     |
| ダイワライフスタイル75   | 7,087,529円      | 6,748,826円      |
| 計  | 36,568,278,437円 | 49,199,465,313円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの<br>計算期間末日における当該親投資信託<br>の受益権の総数 | 36,568,278,437口 | 49,199,465,313口 |

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の状況に関する事項

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

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

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

|  | 平成20年6月5日現在          | 平成21年6月5日現在          |
|--|----------------------|----------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期末における当該親投資信託の1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 2.1127円<br>(21,127円) | 1.9336円<br>(19,336円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成21年6月30日

|                 |             |  |
|-----------------|-------------|--|
| 資産総額            | 63,577,473円 |  |
| 負債総額            | 2,887円      |  |
| 純資産総額( - )      | 63,574,586円 |  |
| 発行済数量           | 68,408,923口 |  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 0.9293円     |  |

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド  
純資産額計算書

平成21年6月30日

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

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

平成21年6月30日

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド  
純資産額計算書

平成21年6月30日

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

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド  
純資産額計算書

平成21年6月30日

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

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

## 第5 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量（口）    | 解約数量（口）    |
|--------|------------|------------|
| 第1計算期間 | 0          | 0          |
| 第2計算期間 | 0          | 0          |
| 第3計算期間 | 0          | 0          |
| 第4計算期間 | 39,662,604 | 21,405,002 |

（注）当初設定数量は1,000,000口です。

## 第三部 【特別情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

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

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

けて、必要事項を審議・決定します。

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、あずさ監査法人により受けております。

3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

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

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

（単位：千円）

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

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

## 重要な会計方針



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

## 会計方針の変更

|   |   |
|---|---|
| <p>前事業年度<br/>(自 平成19年4月1日<br/>至 平成20年3月31日)</p> | <p>当事業年度<br/>(自 平成20年4月1日<br/>至 平成21年3月31日)</p> |
|---|---|

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

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

| 前事業年度<br>(平成20年3月31日現在)  | 当事業年度<br>(平成21年3月31日現在) |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
|--|-------------------------|-----------|------|-------------|------|-----------|--------|----------|--|----|-----------|------|-------------|------|-----------|--------|----------|
| <p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>建物</td> <td style="text-align: right;">735,161千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,604,537千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td style="text-align: right;">662,012千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">26,457千円</td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 4,620,908千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券(投資有価証券)に対するものであります。</p> <p>4 保証債務<br/>子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。</p> | 建物                      | 735,161千円 | 器具備品 | 1,604,537千円 | 投資建物 | 662,012千円 | 投資器具備品 | 26,457千円 | <p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>建物</td> <td style="text-align: right;">776,838千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,691,069千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td style="text-align: right;">675,647千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td style="text-align: right;">26,929千円</td> </tr> </table> <p>2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 1,848,998千円</p> <p>3 同左</p> <p>4 保証債務<br/>子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。</p> | 建物 | 776,838千円 | 器具備品 | 1,691,069千円 | 投資建物 | 675,647千円 | 投資器具備品 | 26,929千円 |
| 建物   | 735,161千円               |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 器具備品   | 1,604,537千円             |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資建物   | 662,012千円               |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資器具備品   | 26,457千円                |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 建物   | 776,838千円               |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 器具備品   | 1,691,069千円             |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資建物   | 675,647千円               |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |
| 投資器具備品   | 26,929千円                |           |      |             |      |           |        |          |  |    |           |      |             |      |           |        |          |

## (損益計算書関係)

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

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

|       | 前事業年度末<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成19年6月22日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 7,799                  | 2,990               | 平成19年<br>3月31日 | 平成19年<br>6月25日 |

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

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

剰余金の配当の総額 8,555百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 3,280円

基準日 平成20年3月31日

効力発生日 平成20年6月23日

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

|       | 前事業年度末<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成20年6月20日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 8,555                  | 3,280               | 平成20年<br>3月31日 | 平成20年<br>6月23日 |

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

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

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

## (リース取引関係)

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

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

## (有価証券関係)

## 1. その他有価証券で時価のあるもの

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

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

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

## 2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

## 3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

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

## 4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

前事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）

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

当事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

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

(デリバティブ取引関係)

## 1. 取引の状況に関する事項

| 前事業年度<br>(自平成19年4月1日<br>至平成20年3月31日) | 当事業年度<br>(自平成20年4月1日<br>至平成21年3月31日) |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
|                                      |                                      |

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

## 2. 取引の時価等に関する事項

### 通貨関連

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

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

### (退職給付関係)

| 前事業年度<br>(平成20年3月31日現在)                                   |           | 当事業年度<br>(平成21年3月31日現在)  |             |
|---|-----------|--------------------------|-------------|
| 1. 採用している退職給付制度の概要<br>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。 |           | 1. 採用している退職給付制度の概要<br>同左 |             |
| 2. 退職給付債務に関する事項   |           | 2. 退職給付債務に関する事項          |             |
| 退職給付債務  | 988,898千円 | 退職給付債務                   | 1,150,011千円 |
| 退職給付引当金   | 988,898千円 | 退職給付引当金                  | 1,150,011千円 |

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

## (税効果会計関係)

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

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

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## 1. 親会社及び法人主要株主等

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 兄弟会社等

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

## (追加情報)

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

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 財務諸表提出会社の子会社

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

#### (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

### (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

| 種類          | 会社等の名称          | 所在地     | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容   | 議決権等の所有（被所有）割合（％） | 関連当事者との関係       | 取引の内容        | 取引金額（千円）   | 科目     | 期末残高（千円）  |
|-------------|-----------------|---------|---------------|---------|-------------------|-----------------|--------------|------------|--------|-----------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株)         | 東京都千代田区 | 100,000       | 金融商品取引業 | -                 | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 25,915,828 | 未払手数料  | 2,154,948 |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券エスエムピーシー(株) | 東京都千代田区 | 255,700       | 金融商品取引業 | -                 | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 980,553    | 未払手数料  | 58,506    |
|             |                 |         |               |         |                   |                 | 為替予約         | 17,314,889 | -      | -         |
| 同一の親会社をもつ会社 | 株大和総研           | 東京都江東区  | 1,000         | 情報サービス業 | -                 | ソフトウェアの開発       | ソフトウェアの購入    | 544,950    | その他未払金 | 197,190   |

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

#### 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

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

(4) 株大和総研との取引金額には、株大和総研ホールディングス（旧・株大和総研）分社化前の取引金額が含まれております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## (重要な後発事象)

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

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成20年7月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

平成21年4月2日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 株主名簿管理人の廃止

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

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 住友信託銀行株式会社

資本金の額 287,537百万円（平成21年3月末日現在）

事業の内容

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

## (2) 販売会社

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

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

## 3 【資本関係】

該当ありません。

## &lt; 再信託受託会社の概要 &gt;

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成21年3月末日現在）

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

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

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

## 第3 【参考情報】

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成21年7月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

|                |       |         |
|----------------|-------|---------|
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山元 太志 印 |
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 久野 佳樹 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス70の平成20年6月6日から平成21年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス70の平成21年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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

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

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

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

以上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成20年7月25日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

### あずさ監査法人

|                |       |         |
|----------------|-------|---------|
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山元 太志 印 |
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 久野 佳樹 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ライフ・バランス70の平成19年6月6日から平成20年6月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ライフ・バランス70の平成20年6月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社  
員&nbsp;公認会計士 堀内 巧 印  
業務執行社員

指定社  
員&nbsp;公認会計士 小澤 陽一 印  
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

---

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