

- 【表紙】
- 【提出書類】 有価証券届出書
- 【提出先】 関東財務局長 殿
- 【提出日】 平成26年3月11日提出
- 【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
- 【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真
- 【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
- 【事務連絡者氏名】 山部 努  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
- 【電話番号】 03-5555-3111
- 【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券に係る  
ファンドの名称】 DC ダイワ・ターゲットイヤー2020
- 【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券の金  
額】 継続申込期間（平成26年3月12日から平成27年3月11日まで）  
10兆円を上限とします。
- 【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2020

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5) 【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い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）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。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

平成26年3月12日から平成27年3月11日まで（継続申込期間）  
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

## (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

## (12) 【その他】

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。

受益権の取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた取得および換金の申込み（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。

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をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）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、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．取得申込者は、販売会社と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。）を締結するものとします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

## (参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

取得申込金額に利息は付きません。

## 第二部 【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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

|      |               |  |
|------|---------------|--|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信   | 追加型投信                                    |
|      | 投資対象地域        | 内外                                       |
|      | 投資対象資産(収益の源泉) | 資産複合                                     |
| 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 資産配分変更型(株式、債券、不動産投信))) |
|      | 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                                  |

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (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 資産配分変更型」...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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの

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

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） |
|-------------|--------|---------------|
| 単位型投信       | 国内     | 株式            |
| 追加型投信       | 海外     | 債券            |
|             | 内外     | 不動産投信         |
|             |        | その他資産<br>( )  |
|             |        | 資産複合          |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

### < 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### < ファンドの特色 >

# 1 内外の株式、債券、リートおよび短期金融資産に投資し、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2020年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。

- ◆2020年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

## 〈2013年12月時点の基本配分比率〉

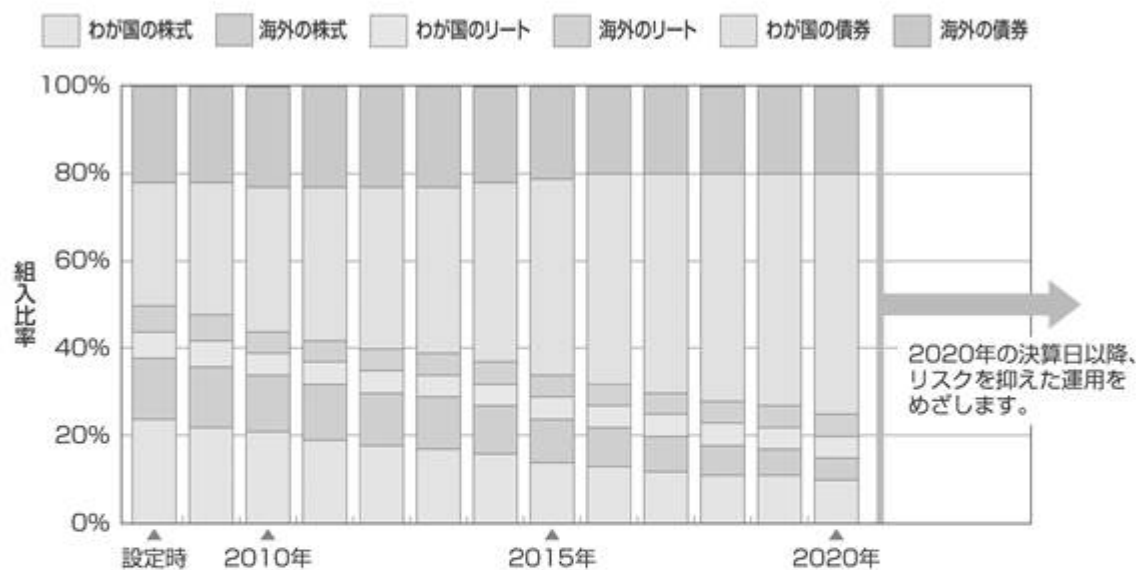
|                    | わが国の<br>株式 | 海外の<br>株式 | わが国の<br>リート | 海外の<br>リート | わが国の<br>債券 | 海外の<br>債券 |
|--------------------|------------|-----------|-------------|------------|------------|-----------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020 | 17%        | 12%       | 5%          | 5%         | 38%        | 23%       |

## 〈当初設定時の基本配分比率〉

|                    | わが国の<br>株式 | 海外の<br>株式 | わが国の<br>リート | 海外の<br>リート | わが国の<br>債券 | 海外の<br>債券 |
|--------------------|------------|-----------|-------------|------------|------------|-----------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020 | 24%        | 14%       | 6%          | 6%         | 28%        | 22%       |

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

## ファンドの基本配分比率のイメージ



(注1) 2013年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2012年以前は過去の基本配分比率を示しています。

(注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。

(注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。



## 2 わが国の株式への投資にあたっては、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

- 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、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。
  - (a) 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。
  - (b) 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。
  - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

### 運用プロセス



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。ベンチマークである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っています。

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

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

### 3 海外の株式への投資にあたっては、投資成果をMSC I 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います。

#### 運用プロセス



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。ベンチマークであるMSC I コクサイ指数（円ベース）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っています。

(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。

#### MSC I コクサイ指数とは

MSC I コクサイ指数は、MSC I 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、MSC I コクサイ指数（円ベース）は、MSC I コクサイ指数（米ドルベース）をもとに、MSC I 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、MSC I Inc. に帰属します。また、MSC I 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

わが国のリートへの投資にあたっては、東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

## 運用プロセス



- 組入銘柄はベンチマークである「東証REIT指数」（配当込み）の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。
- 組入銘柄それぞれの時価総額に応じた投資比率に基づきポートフォリオを構築することを基本とします。
- ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があれば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。

## 東証REIT指数とは

●「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

## 【算出方法の概要】

指数：算出時の時価総額<sup>(注1)</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>(注2)</sup> × 1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 平成15年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

- ①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利および東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ②(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ③本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、本商品の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 5

海外のリートへの投資にあたっては、ベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

## 運用プロセス



ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてベンチマークであるS&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の構成銘柄の全てに投資することをめざします。

ベンチマークへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

## S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

## 【特徴】

- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

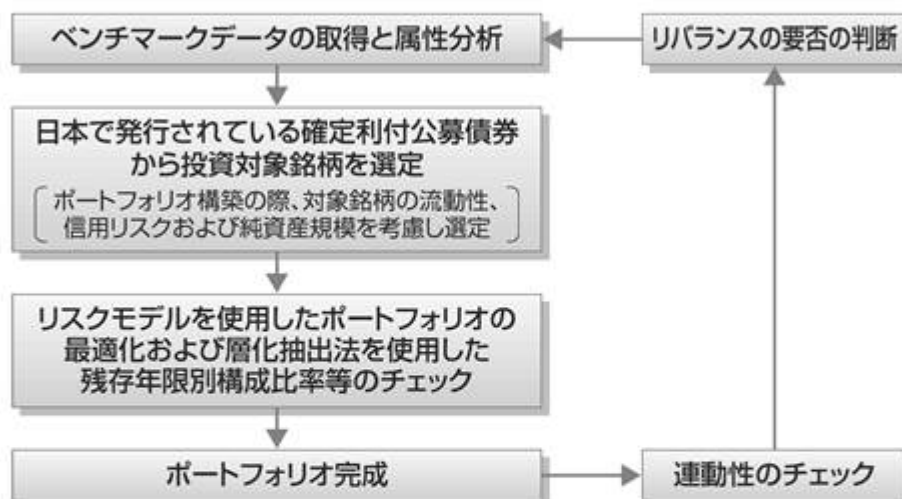
本商品は、スタンダード&プアーズおよびその関連会社（以下、S&P）によって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。S&Pは、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本）が市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付けまたは保証するものではありません。S&Pの大和証券投資信託委託株式会社に対する唯一の関係は、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に関する決定、作成および計算において、大和証券投資信託委託株式会社または本商品の所有者の要求等を考慮に入れずに行ないます。S&Pは本商品の販売に関する時期、価格の決定、または本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pは、本商品の管理、マーケティングまたは取引に関する義務または責任を何ら負うものではありません。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）の計算およびその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に含まれるいかなる誤り、欠落または障害に対する責任を負いません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそれらに含まれるデータの使用により、大和証券投資信託委託株式会社、本商品の所有者またはその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行ないません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害（利益の損失を含む）について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pが責任を負うことはありません。

## 6

わが国の債券への投資にあたっては、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て運用を行ないます。

## 運用プロセス



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である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、ベンチマーク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、ベンチマークに連動するポートフォリオの構築と、ポートフォリオのリスク特性の管理に用いています。

(注2) 層化抽出法とは…

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

- 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、債券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、ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の信託財産の純資産総額を超えることがあります。

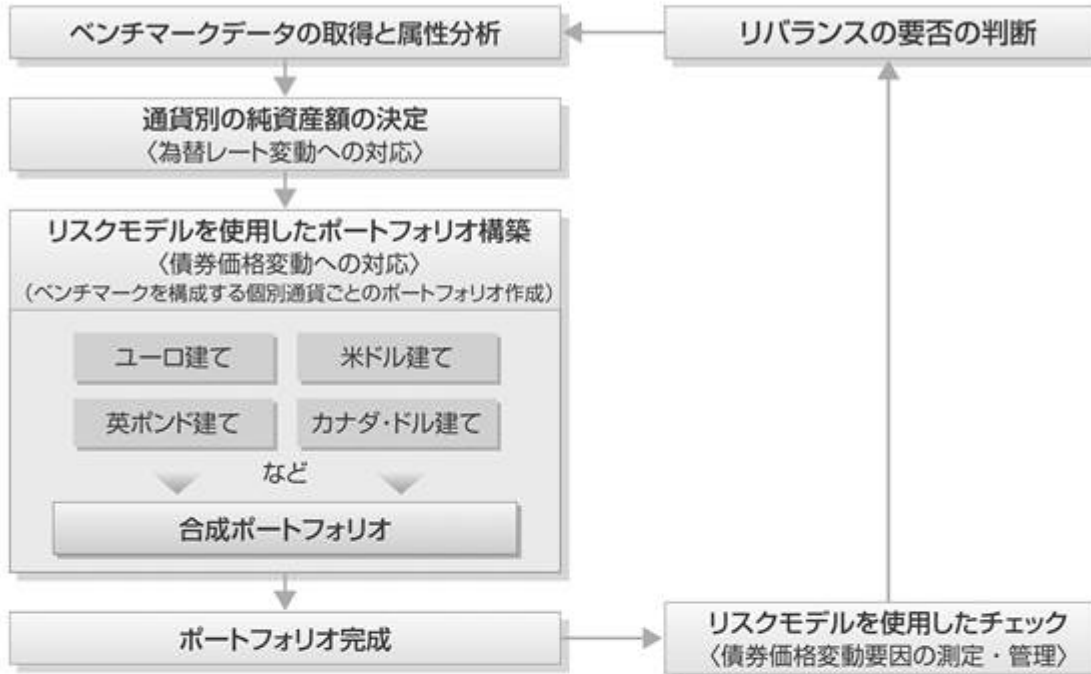
## NOMURA－BPI総合指数とは

NOMURA－BPI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－BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村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。

# 7 海外の債券への投資にあたっては、投資成果をシティ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います。

## 運用プロセス



ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の主な騰落要因は、為替レート変動と債券価格変動です。したがって、ファンドは、特に以下の3点に留意し運用します。

### ①為替レート変動への対応

為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

### ②債券価格変動への対応

ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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に、リスクモデル<sup>(注)</sup>を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

### ③債券価格変動要因の測定・管理

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、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度と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っています。

(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しています。その結果、ポートフォリオの効率的な複製を行なうこと、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を測定・管理することなどができます。

## シティ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。

## 8

2020年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。

- わが国の短期債券への投資にあたっては、ベンチマーク（NOMURA－BPI総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

#### NOMURA－BPI総合短期指数とは

NOMURA－BPI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－BPI総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、NOMURA－BPI総合短期(NOMURA－ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間1年以上3年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

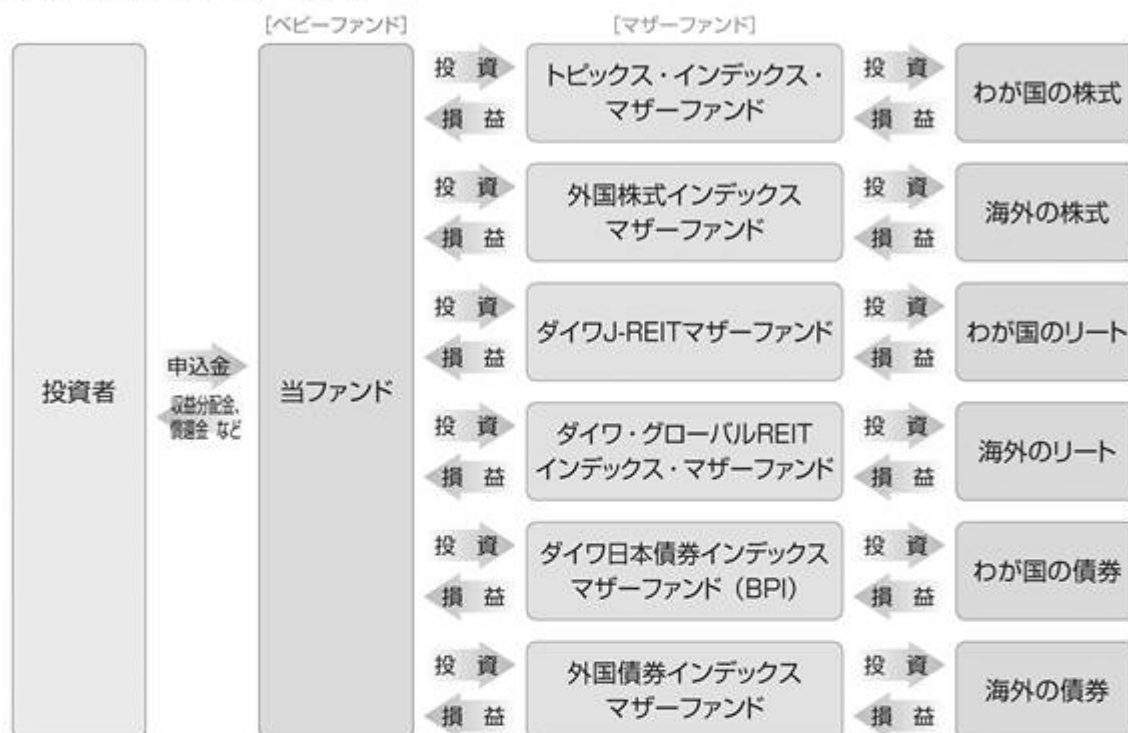
NOMURA－BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

## ファンドの仕組み

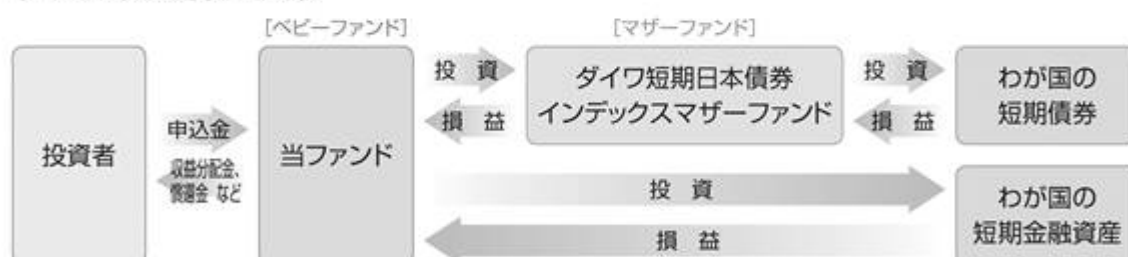
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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

〈2020年の決算日前日まで〉



〈2020年の決算日から〉



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

- 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～8.の運用が行なわれないことがあります。



9

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購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

10

毎年12月18日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。  
収益分配金は、自動的に再投資されます。

#### 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。
- ②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

#### (2) 【ファンドの沿革】

平成20年2月28日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

|       |  |  |
|-------|--|--|
| 受益者   | お申込者   |  |
|       | 収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）                          |  |
| お取扱窓口 | 販売会社   | 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。<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<br>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<br>など  |
| 運用指図  | 2  | 損益 信託金（ 3）   |
| 受託会社  | 三井住友信託銀行株式会社<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。<br>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<br>など |
|       | 損益 投資  |  |

投資対象

内外の株式・債券・リート( R E I T )および短期金融資産 など  
(ファミリーファンド方式で運用を行いません。)

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。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。

&lt; 委託会社の概況(平成25年12月末日現在) &gt;

- ・ 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。<br>(金融商品取引業者登録番号: 関東財務局長(金商)第352号) |

- ・ 大株主の状況

| 名 称            | 住 所               | 所有<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

下記の各マザーファンド(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。

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. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
5. 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
6. ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
7. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

#### 投資態度

- イ. 主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（REIT）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないません。
- ロ. マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2020年に近づくにしたがって株式等の組入れを漸減させ、債券の組入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないません。

#### 当初設定時の基本配分比率

|                                  |       |                |
|----------------------------------|-------|----------------|
| トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券        | ..... | 信託財産の純資産総額の24% |
| 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券           | ..... | 信託財産の純資産総額の14% |
| ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券            | ..... | 信託財産の純資産総額の6%  |
| ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券 | ..... | 信託財産の純資産総額の6%  |
| 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   | ..... | 信託財産の純資産総額の28% |
| 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券           | ..... | 信託財産の純資産総額の22% |

- ハ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ. 2020年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。
- ホ. 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】

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. 約束手形
  - ハ. 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、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 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。）

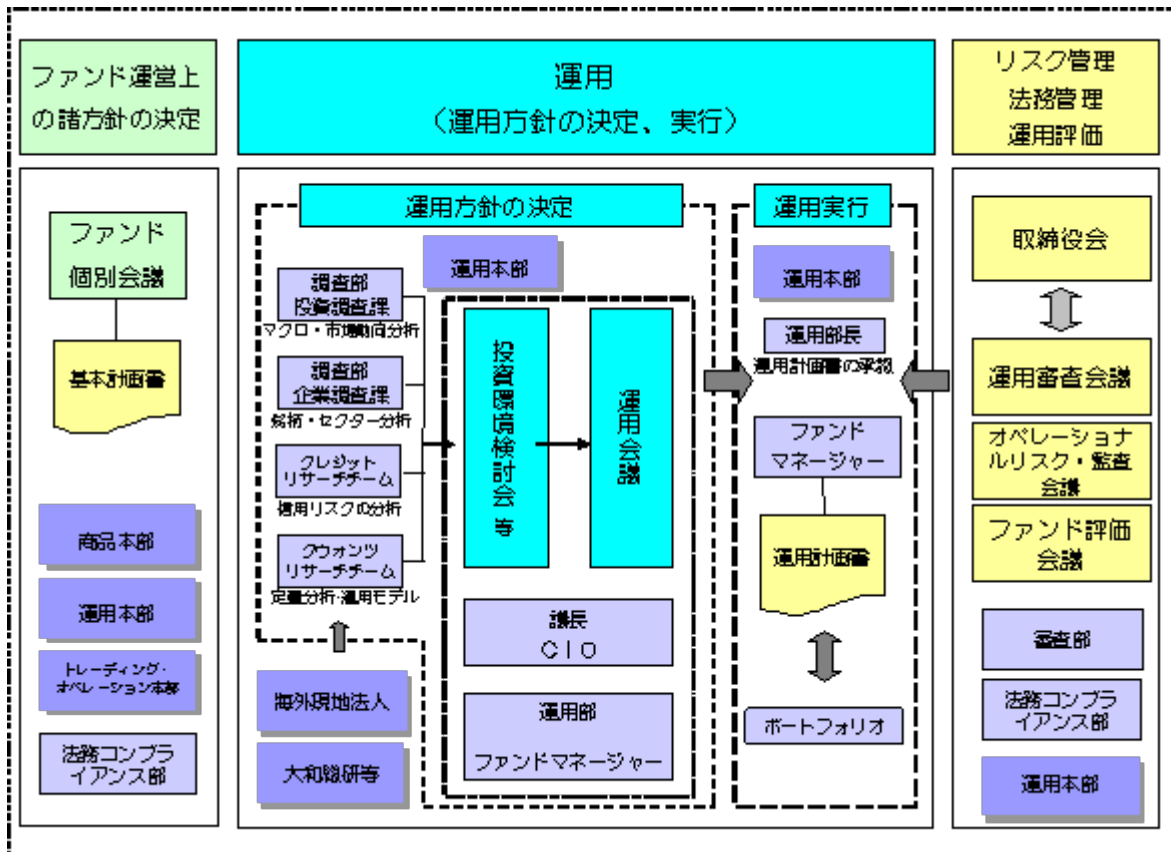
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

#### ロ．Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

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

#### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

#### ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

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

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成25年12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】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参考>各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。

##### 投資態度

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いません。

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」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

#### (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

(注) 東証株価指数(TOPIX)とは

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

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

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

## 2. 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

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.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12.ならびに前16.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13.の証券および前14.の証券を以下「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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(注)MSCIコクサイ指数とは

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

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

### 3. ダイワJ-REITマザーファンド

#### (1) 投資方針

##### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所( )上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下、「<参考>各マザーファンドの概要」において同じ。

##### 投資態度

- イ. 東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」(配当込み、以下同じ。)に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄(採用予定を含みます。)とし、組入比率を高位に保ちます。
- 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、「東証REIT指数」が改廃されたとき、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. 約束手形

ハ. 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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2. 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。)
- 3. 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。)

4. 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。）

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

（注）東証REIT指数とは

「東証REIT指数」は、東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、平成15年4月より算出・公表されています。

〔算出方法の概要〕

指数：算出時の時価総額<sup>（注1）</sup> ÷ 基準時の時価総額<sup>（注2）</sup> × 1,000

（注1）算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

（注2）平成15年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落（金銭の分配）についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下（株）東京証券取引所といたします。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利および東証REIT指数の商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有します。

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

（株）東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

（株）東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また（株）東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本件インデックス・ファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本件インデックス・ファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

本件インデックス・ファンドは、（株）東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

（株）東京証券取引所は、本件インデックス・ファンドの購入者または公衆に対し、本件インデックス・ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

（株）東京証券取引所は、当社または本件インデックス・ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は本件インデックス・ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 主要投資対象

海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

###### 投資態度

イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

ハ．保有外貨建資産の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。

二．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．約束手形

ハ．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．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3．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。）

4．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。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

6．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。）

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

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（注）S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

S & P先進国REIT指数は、S & Pの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

〔特徴〕

- ・世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用。
- ・1989年から過去データを算出。
- ・配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出。

本商品は、スタンダード&プアーズおよびその関連会社（以下、S&P）によって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。S&Pは、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本）が市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付けまたは保証するものではありません。S&Pの大和証券投資信託委託株式会社に対する唯一の関係は、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に関する決定、作成および計算において、大和証券投資信託委託株式会社または本商品の所有者の要求等を考慮に入れずに行いません。S&Pは本商品の販売に関する時期、価格の決定、または本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pは、本商品の管理、マーケティングまたは取引に関する義務または責任を何ら負うものではありません。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）の計算およびその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）に含まれるいかなる誤り、欠落または障害に対する責任を負いません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそれらに含まれるデータの使用により、大和証券投資信託委託株式会社、本商品の所有者またはその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそれに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行いません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害（利益の損失を含む）について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pが責任を負うことはありません。

## 5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

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

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）
  - ハ．約束手形
  - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ．為替手形

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

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

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ま

す。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。
- 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。

(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。

## 6. ダイワ短期日本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

わが国の公社債等（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 - B P I 総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．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、NOMURA - B P I 総合短期指数が改廃されたとき、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。

- 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。）
  - 有価証券
  - 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。）
  - 約束手形
- 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（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、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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ます。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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  
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、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。
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

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。

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。

#### (注) NOMURA - B P I 総合短期指数とは

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 総合には、債券の残存期間別に短期・中期・長期などのサブ・インデックスがあり、NOMURA - B P I 総合短期(NOMURA - ボンド・パフォーマンス・インデックス総合短期)は、残存期間1年以上3年未満の短期の公募利付債市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の銘柄採用基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

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。

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

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

## 3 【投資リスク】

## 〈基準価額の主な変動要因〉

|                 |       |       |      |
|-----------------|-------|-------|------|
| 株価変動リスク         | 株式市況  | 株 価   | 基準価額 |
|                 | 改 善   | ➡     | 上昇要因 |
|                 | 悪 化   | ➡     | 下落要因 |
| 公社債の<br>価格変動リスク | 金 利   | 公社債価格 | 基準価額 |
|                 | 低 下   | ➡     | 上昇要因 |
|                 | 上 昇   | ➡     | 下落要因 |
| リートの<br>価格変動リスク | リート市況 | リート価格 | 基準価額 |
|                 | 改 善   | ➡     | 上昇要因 |
|                 | 悪 化   | ➡     | 下落要因 |
| 外貨建資産の<br>為替リスク | 為替相場  | 円換算価値 | 基準価額 |
|                 | 円 安   | ➡     | 上昇要因 |
|                 | 円 高   | ➡     | 下落要因 |

○上図はイメージ図であり、必ずしも上図どおりにならない場合もあります。

## (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

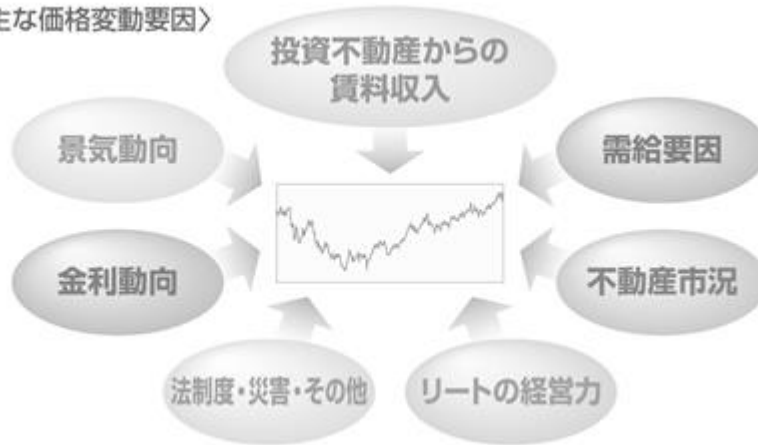


※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

## 〈リートの主な価格変動要因〉



イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、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



## 〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

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原則として行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

#### ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

#### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

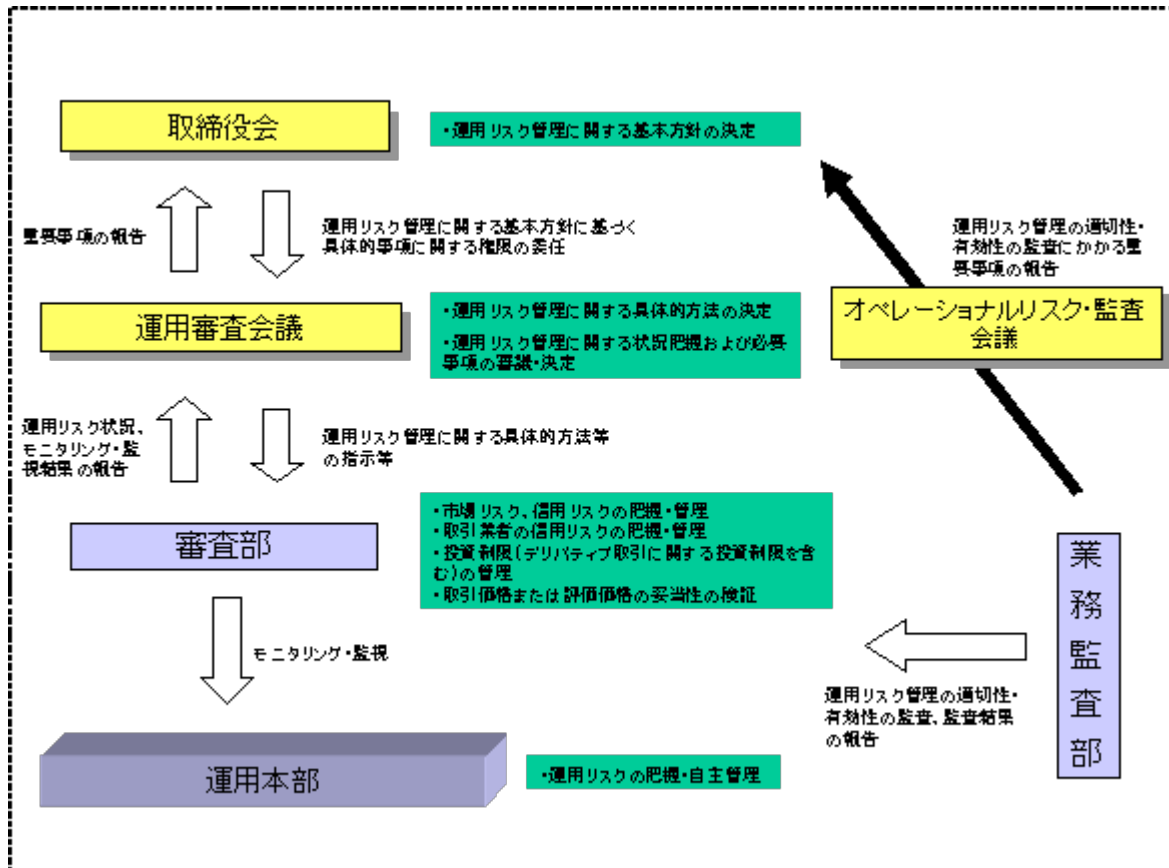
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受け付けを中止することがあります。

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け付けを中止することがあります。ご換金の申込み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ご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者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け付けたものとして取扱います。

#### (3) その他の留意点

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

## (4) リスク管理体制



## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

## ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

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

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次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。

|                   | 信託報酬率              |
|-------------------|--------------------|
| 第1計算期間から第13計算期間まで | 年率0.6825%（税抜0.65%） |
| 第14計算期間以降         | 年率0.2625%（税抜0.25%） |

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、それぞれ年率0.702%、年率0.27%となります。

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。

< 第1計算期間から第13計算期間まで >

| 委託会社           | 販売会社           | 受託会社            |
|----------------|----------------|-----------------|
| 年率0.3%<br>（税抜） | 年率0.3%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

< 第14計算期間以降 >

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.11%<br>（税抜） | 年率0.11%<br>（税抜） | 年率0.03%<br>（税抜） |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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（有価証券等への投資にかかる会計事務所等への支払金等を含むものとします。）、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに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、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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。

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

< 注1 > 個別元本について

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

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

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

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

< 注2 > 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 上記は、平成26年1月1日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成25年12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             | 81,626,621 | 99.86   |
| 内 日本                  | 81,626,621 | 99.86   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 116,377    | 0.14    |
| 純資産総額                 | 81,742,998 | 100.00  |

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

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

## (2) 【投資資産】（平成25年12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                         | 地域 | 数<br>種類<br>は | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)    | 評価単価<br>時価<br>(円)    | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------------|----|--------------|--------------------|----------------------|----------------------|-----------------|
| 1 | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)   | 日本 | 親投資信託受益証券    | 26,010,844         | 1.1734<br>30,523,347 | 1.1687<br>30,398,873 | 37.19           |
| 2 | 外国債券インデックスマザーファンド           | 日本 | 親投資信託受益証券    | 7,401,013          | 2.4740<br>18,310,107 | 2.5201<br>18,651,292 | 22.82           |
| 3 | トピックス・インデックス・マザーファンド        | 日本 | 親投資信託受益証券    | 18,990,094         | 0.7160<br>13,598,594 | 0.7462<br>14,170,408 | 17.34           |
| 4 | 外国株式インデックスマザーファンド           | 日本 | 親投資信託受益証券    | 6,104,403          | 1.5462<br>9,439,238  | 1.6458<br>10,046,626 | 12.29           |
| 5 | ダイワJ-REITマザーファンド            | 日本 | 親投資信託受益証券    | 2,260,534          | 1.7698<br>4,000,850  | 1.8742<br>4,236,692  | 5.18            |
| 6 | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券    | 2,720,556          | 1.4542<br>3,956,232  | 1.5154<br>4,122,730  | 5.04            |

(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 | 99.86% |
| 合計        | 99.86% |

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

|                          | 純資産総額<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)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(平成20年12月18日) | 6,547,046             | 6,547,046             | 0.7390                     | 0.7390                     |
| 第2計算期間末<br>(平成21年12月18日) | 27,850,148            | 27,850,148            | 0.8079                     | 0.8079                     |
| 第3計算期間末<br>(平成22年12月20日) | 36,256,038            | 36,256,038            | 0.8249                     | 0.8249                     |
| 第4計算期間末<br>(平成23年12月19日) | 40,591,212            | 40,591,212            | 0.7738                     | 0.7738                     |
| 第5計算期間末<br>(平成24年12月18日) | 54,675,911            | 54,675,911            | 0.8815                     | 0.8815                     |
| 平成24年12月末日               | 56,116,627            | -                     | 0.9044                     | -                          |
| 平成25年1月末日                | 60,675,612            | -                     | 0.9526                     | -                          |
| 2月末日                     | 61,846,014            | -                     | 0.9673                     | -                          |
| 3月末日                     | 64,907,679            | -                     | 1.0037                     | -                          |
| 4月末日                     | 70,310,011            | -                     | 1.0498                     | -                          |
| 5月末日                     | 63,599,222            | -                     | 1.0430                     | -                          |
| 6月末日                     | 64,108,720            | -                     | 1.0227                     | -                          |
| 7月末日                     | 65,656,922            | -                     | 1.0285                     | -                          |
| 8月末日                     | 65,351,329            | -                     | 1.0199                     | -                          |
| 9月末日                     | 69,322,578            | -                     | 1.0543                     | -                          |
| 10月末日                    | 74,282,959            | -                     | 1.0697                     | -                          |
| 11月末日                    | 77,875,168            | -                     | 1.0943                     | -                          |
| 第6計算期間末<br>(平成25年12月18日) | 79,552,652            | 79,552,652            | 1.0892                     | 1.0892                     |
| 12月末日                    | 81,742,998            | -                     | 1.1136                     | -                          |

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 26.1   |
| 第2計算期間 | 9.3    |

|        |      |
|--------|------|
| 第3計算期間 | 2.1  |
| 第4計算期間 | 6.2  |
| 第5計算期間 | 13.9 |
| 第6計算期間 | 23.6 |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)    | 解約数量(口)    |
|--------|------------|------------|
| 第1計算期間 | 10,442,373 | 2,582,699  |
| 第2計算期間 | 28,650,369 | 3,037,036  |
| 第3計算期間 | 11,533,326 | 2,056,679  |
| 第4計算期間 | 11,003,989 | 2,494,623  |
| 第5計算期間 | 16,094,256 | 6,525,749  |
| 第6計算期間 | 22,032,793 | 11,025,442 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式                    | 126,927,862,280 | 99.55   |
| 内 日本                  | 126,927,862,280 | 99.55   |
| 新株予約権証券               | 5,593,000       | 0.00    |
| 内 日本                  | 5,593,000       | 0.00    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 562,023,023     | 0.44    |
| 純資産総額                 | 127,495,478,303 | 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) | 625,200,000 | 0.49    |
| 内 日本         | 625,200,000 | 0.49    |

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名    | 地域 | 種類 | 数業種は  | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)         | 評価単価<br>時価<br>(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|--------|----|----|-------|--------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|
| 1 | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 957,600            | 6,398.50<br>6,127,211,900 | 6,420.00<br>6,147,792,000 | 4.82            |



|    |               |    |    |                |           |                            |                            |      |
|----|---------------|----|----|----------------|-----------|----------------------------|----------------------------|------|
| 2  | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業            | 5,143,500 | 653.00<br>3,358,705,500    | 694.00<br>3,569,589,000    | 2.80 |
| 3  | ソフトバンク        | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 334,100   | 6,610.00<br>2,208,401,000  | 9,200.00<br>3,073,720,000  | 2.41 |
| 4  | 三井住友フィナンシャルG  | 日本 | 株式 | 銀行業            | 513,400   | 4,915.00<br>2,523,361,000  | 5,420.00<br>2,782,628,000  | 2.18 |
| 5  | 本田技研          | 日本 | 株式 | 輸送用機器          | 619,200   | 3,903.01<br>2,416,745,320  | 4,330.00<br>2,681,136,000  | 2.10 |
| 6  | みずほフィナンシャルG   | 日本 | 株式 | 銀行業            | 8,782,500 | 222.00<br>1,949,715,000    | 228.00<br>2,002,410,000    | 1.57 |
| 7  | 日本電信電話        | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 266,800   | 5,230.00<br>1,395,364,000  | 5,660.00<br>1,510,088,000  | 1.18 |
| 8  | 三菱地所          | 日本 | 株式 | 不動産業           | 476,000   | 2,969.00<br>1,413,244,000  | 3,145.00<br>1,497,020,000  | 1.17 |
| 9  | ファナック         | 日本 | 株式 | 電気機器           | 76,700    | 17,037.55<br>1,306,780,595 | 19,250.00<br>1,476,475,000 | 1.16 |
| 10 | 日本たばこ産業       | 日本 | 株式 | 食料品            | 425,100   | 3,580.00<br>1,521,858,000  | 3,420.00<br>1,453,842,000  | 1.14 |
| 11 | KDDI          | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 211,200   | 4,896.65<br>1,034,174,045  | 6,470.00<br>1,366,464,000  | 1.07 |
| 12 | キヤノン          | 日本 | 株式 | 電気機器           | 397,800   | 3,175.00<br>1,263,015,000  | 3,330.00<br>1,324,674,000  | 1.04 |
| 13 | 日立            | 日本 | 株式 | 電気機器           | 1,652,000 | 662.00<br>1,093,624,000    | 796.00<br>1,314,992,000    | 1.03 |
| 14 | 武田薬品          | 日本 | 株式 | 医薬品            | 269,700   | 4,705.00<br>1,268,938,500  | 4,825.00<br>1,301,302,500  | 1.02 |
| 15 | 三井不動産         | 日本 | 株式 | 不動産業           | 321,000   | 3,545.00<br>1,137,945,000  | 3,785.00<br>1,214,985,000  | 0.95 |
| 16 | セブン&アイ・HLDGS  | 日本 | 株式 | 小売業            | 283,600   | 3,620.00<br>1,026,632,000  | 4,180.00<br>1,185,448,000  | 0.93 |
| 17 | 野村ホールディングス    | 日本 | 株式 | 証券・商品<br>先物取引業 | 1,388,700 | 798.00<br>1,108,182,600    | 809.00<br>1,123,458,300    | 0.88 |
| 18 | 新日鐵住金         | 日本 | 株式 | 鉄鋼             | 3,041,000 | 349.00<br>1,061,309,000    | 352.00<br>1,070,432,000    | 0.84 |
| 19 | 三菱商事          | 日本 | 株式 | 卸売業            | 527,600   | 2,029.00<br>1,070,500,400  | 2,017.00<br>1,064,169,200  | 0.83 |
| 20 | 東日本旅客鉄道       | 日本 | 株式 | 陸運業            | 126,400   | 8,610.00<br>1,088,304,000  | 8,380.00<br>1,059,232,000  | 0.83 |
| 21 | アステラス製薬       | 日本 | 株式 | 医薬品            | 166,100   | 5,211.01<br>865,549,782    | 6,230.00<br>1,034,803,000  | 0.81 |
| 22 | NTTドコモ        | 日本 | 株式 | 情報・通信業         | 558,600   | 1,608.00<br>898,228,800    | 1,725.00<br>963,585,000    | 0.76 |
| 23 | パナソニック        | 日本 | 株式 | 電気機器           | 787,000   | 958.00<br>753,946,000      | 1,224.00<br>963,288,000    | 0.76 |
| 24 | デンソー          | 日本 | 株式 | 輸送用機器          | 169,600   | 4,770.00<br>808,992,000    | 5,550.00<br>941,280,000    | 0.74 |
| 25 | 東京海上HD        | 日本 | 株式 | 保険業            | 262,300   | 3,300.00<br>865,590,000    | 3,515.00<br>921,984,500    | 0.72 |
| 26 | 三井物産          | 日本 | 株式 | 卸売業            | 622,400   | 1,491.34<br>928,210,028    | 1,465.00<br>911,816,000    | 0.72 |

|    |        |    |    |       |         |                         |                         |      |
|----|--------|----|----|-------|---------|-------------------------|-------------------------|------|
| 27 | 三菱電機   | 日本 | 株式 | 電気機器  | 687,000 | 1,077.00<br>739,899,000 | 1,320.00<br>906,840,000 | 0.71 |
| 28 | ブリヂストン | 日本 | 株式 | ゴム製品  | 225,900 | 3,595.00<br>812,110,500 | 3,980.00<br>899,082,000 | 0.71 |
| 29 | 日産自動車  | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 964,400 | 1,016.00<br>979,830,400 | 884.00<br>852,529,600   | 0.67 |
| 30 | 住友不動産  | 日本 | 株式 | 不動産業  | 163,000 | 4,880.00<br>795,440,000 | 5,230.00<br>852,490,000 | 0.67 |

(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        | 99.55% |
| 新株予約権証券   | 0.00%  |
| 合計        | 99.56% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種         | 投資比率   |
|------------|--------|
| 水産・農林業     | 0.08%  |
| 鉱業         | 0.46%  |
| 建設業        | 2.56%  |
| 食料品        | 3.74%  |
| 繊維製品       | 0.71%  |
| パルプ・紙      | 0.30%  |
| 化学         | 5.25%  |
| 医薬品        | 4.29%  |
| 石油・石炭製品    | 0.59%  |
| ゴム製品       | 0.92%  |
| ガラス・土石製品   | 1.02%  |
| 鉄鋼         | 1.75%  |
| 非鉄金属       | 1.07%  |
| 金属製品       | 0.69%  |
| 機械         | 5.25%  |
| 電気機器       | 11.91% |
| 輸送用機器      | 11.87% |
| 精密機器       | 1.36%  |
| その他製品      | 1.44%  |
| 電気・ガス業     | 2.17%  |
| 陸運業        | 3.67%  |
| 海運業        | 0.39%  |
| 空運業        | 0.46%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.22%  |
| 情報・通信業     | 7.33%  |
| 卸売業        | 4.33%  |
| 小売業        | 4.20%  |
| 銀行業        | 9.96%  |
| 証券、商品先物取引業 | 1.85%  |
| 保険業        | 2.36%  |
| その他金融業     | 1.47%  |
| 不動産業       | 3.77%  |

|       |        |
|-------|--------|
| サービス業 | 2.10%  |
| 合計    | 99.55% |

(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<br>取引 | 日本 | TOPIX先物 2014年3月 | 買建        | 48 | 609,871,565 | 625,200,000 | 0.49%    |

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

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

#### 投資状況

| 投資資産の種類   | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------|----------------|---------|
| 株式        | 71,192,555,846 | 96.74   |
| 内 香港      | 922,829,549    | 1.25    |
| 内 シンガポール  | 469,027,384    | 0.64    |
| 内 イスラエル   | 149,436,063    | 0.20    |
| 内 ノルウェー   | 270,867,372    | 0.37    |
| 内 スウェーデン  | 1,078,384,198  | 1.47    |
| 内 デンマーク   | 394,221,524    | 0.54    |
| 内 イギリス    | 7,214,519,288  | 9.80    |
| 内 アイルランド  | 94,782,270     | 0.13    |
| 内 オランダ    | 896,663,160    | 1.22    |
| 内 ベルギー    | 391,014,215    | 0.53    |
| 内 フランス    | 3,234,154,920  | 4.39    |
| 内 ドイツ     | 3,195,547,894  | 4.34    |
| 内 スイス     | 2,990,258,198  | 4.06    |
| 内 ポルトガル   | 61,371,481     | 0.08    |
| 内 スペイン    | 1,117,192,950  | 1.52    |
| 内 イタリア    | 752,246,062    | 1.02    |
| 内 フィンランド  | 318,598,301    | 0.43    |
| 内 オーストリア  | 96,698,838     | 0.13    |
| 内 カナダ     | 3,273,649,008  | 4.45    |
| 内 アメリカ    | 41,920,709,980 | 56.96   |
| 内 オーストラリア | 2,314,518,592  | 3.15    |

|                       |            |                |        |
|-----------------------|------------|----------------|--------|
|                       | 内 ニュージーランド | 35,864,599     | 0.05   |
| 投資証券                  |            | 1,307,873,938  | 1.78   |
|                       | 内 香港       | 27,944,777     | 0.04   |
|                       | 内 シンガポール   | 21,343,928     | 0.03   |
|                       | 内 イギリス     | 99,338,140     | 0.13   |
|                       | 内 オランダ     | 9,507,627      | 0.01   |
|                       | 内 フランス     | 102,496,754    | 0.14   |
|                       | 内 アメリカ     | 891,028,561    | 1.21   |
|                       | 内 オーストラリア  | 156,214,151    | 0.21   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） |            | 1,090,825,224  | 1.48   |
| 純資産総額                 |            | 73,591,255,008 | 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) | 967,743,675 | 1.32    |
| 内 アメリカ       | 967,743,675 | 1.32    |
| 為替予約取引(売建)   | 21,754,500  | 0.03    |
| 内 日本         | 21,754,500  | 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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                 | 地域   | 種類 | 数業種は     | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------|------|----|----------|--------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1 | APPLE INC           | アメリカ | 株式 | 情報技術     | 21,200             | 58,604.21<br>1,242,409,407 | 59,027.88<br>1,251,391,164 | 1.70            |
| 2 | EXXON MOBIL CORP    | アメリカ | 株式 | エネルギー    | 103,255            | 9,851.85<br>1,017,253,515  | 10,698.13<br>1,104,636,332 | 1.50            |
| 3 | GOOGLE INC-CL A     | アメリカ | 株式 | 情報技術     | 6,400              | 111,670.19<br>714,689,217  | 117,868.17<br>754,356,326  | 1.03            |
| 4 | MICROSOFT CORP      | アメリカ | 株式 | 情報技術     | 185,100            | 4,018.52<br>743,828,182    | 3,929.99<br>727,441,723    | 0.99            |
| 5 | GENERAL ELECTRIC CO | アメリカ | 株式 | 資本財・サービス | 238,400            | 2,809.69<br>669,831,860    | 2,933.00<br>699,228,082    | 0.95            |
| 6 | JOHNSON & JOHNSON   | アメリカ | 株式 | ヘルスケア    | 66,200             | 9,976.21<br>660,425,592    | 9,732.76<br>644,309,142    | 0.88            |
| 7 | NESTLE SA-REG       | スイス  | 株式 | 生活必需品    | 77,500             | 7,824.84<br>606,425,100    | 7,724.37<br>598,638,675    | 0.81            |
| 8 | CHEVRON CORP        | アメリカ | 株式 | エネルギー    | 45,318             | 12,903.95<br>584,781,279   | 13,197.98<br>598,106,497   | 0.81            |

|    |                                  |      |    |                |           |                          |                          |      |
|----|----------------------------------|------|----|----------------|-----------|--------------------------|--------------------------|------|
| 9  | WELLS FARGO & CO                 | アメリカ | 株式 | 金融             | 117,572   | 4,639.26<br>545,447,994  | 4,795.24<br>563,786,545  | 0.77 |
| 10 | PROCTER & GAMBLE CO              | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 63,837    | 8,875.94<br>566,613,752  | 8,643.03<br>551,745,355  | 0.75 |
| 11 | JPMORGAN CHASE & CO              | アメリカ | 株式 | 金融             | 88,220    | 6,030.41<br>532,003,282  | 6,127.37<br>540,556,987  | 0.73 |
| 12 | HSBC HOLDINGS PLC                | イギリス | 株式 | 金融             | 447,900   | 1,184.86<br>530,703,022  | 1,150.98<br>515,526,737  | 0.70 |
| 13 | PFIZER INC                       | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 155,463   | 3,344.02<br>519,872,112  | 3,229.14<br>502,013,284  | 0.68 |
| 14 | ROCHE HOLDING AG-<br>GENUSSCHEIN | スイス  | 株式 | ヘルスケア          | 16,850    | 29,869.14<br>503,295,009 | 29,455.44<br>496,324,164 | 0.67 |
| 15 | VODAFONE GROUP PLC               | イギリス | 株式 | 電気通信<br>サービス   | 1,161,137 | 394.08<br>457,589,785    | 413.37<br>479,985,053    | 0.65 |
| 16 | INTL BUSINESS MACHINES<br>CORP   | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 24,400    | 18,936.47<br>462,049,995 | 19,505.58<br>475,936,181 | 0.65 |
| 17 | NOVARTIS AG-REG                  | スイス  | 株式 | ヘルスケア          | 55,200    | 8,469.03<br>467,490,456  | 8,457.21<br>466,837,992  | 0.63 |
| 18 | AT&T INC                         | アメリカ | 株式 | 電気通信<br>サービス   | 124,295   | 3,710.78<br>461,231,636  | 3,707.62<br>460,838,653  | 0.63 |
| 19 | BANK OF AMERICA CORP             | アメリカ | 株式 | 金融             | 250,601   | 1,667.26<br>417,819,479  | 1,651.46<br>413,857,853  | 0.56 |
| 20 | COCA-COLA CO                     | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 93,000    | 4,235.62<br>393,913,041  | 4,285.15<br>398,519,638  | 0.54 |
| 21 | CITIGROUP INC                    | アメリカ | 株式 | 金融             | 71,123    | 5,577.23<br>396,669,955  | 5,507.68<br>391,722,824  | 0.53 |
| 22 | BP PLC                           | イギリス | 株式 | エネルギー          | 450,300   | 837.52<br>377,136,697    | 849.16<br>382,379,054    | 0.52 |
| 23 | AMAZON.COM INC                   | アメリカ | 株式 | 一般消費<br>財・サービス | 8,600     | 41,483.61<br>356,759,061 | 41,953.65<br>360,801,400 | 0.49 |
| 24 | MERCK & CO. INC.                 | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 68,321    | 5,251.58<br>358,793,450  | 5,247.36<br>358,505,436  | 0.49 |
| 25 | VERIZON COMMUNICATIONS<br>INC    | アメリカ | 株式 | 電気通信<br>サービス   | 67,200    | 5,229.45<br>351,419,161  | 5,182.02<br>348,232,167  | 0.47 |
| 26 | PHILIP MORRIS<br>INTERNATIONAL   | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 37,700    | 9,015.06<br>339,867,785  | 9,141.52<br>344,635,628  | 0.47 |
| 27 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A          | イギリス | 株式 | エネルギー          | 90,600    | 3,558.60<br>322,409,595  | 3,757.56<br>340,434,936  | 0.46 |
| 28 | TOTAL SA                         | フランス | 株式 | エネルギー          | 51,000    | 6,468.50<br>329,893,742  | 6,454.72<br>329,190,975  | 0.45 |
| 29 | ORACLE CORP                      | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 81,883    | 3,719.21<br>304,540,326  | 4,002.71<br>327,754,083  | 0.45 |
| 30 | GLAXOSMITHKLINE PLC              | イギリス | 株式 | ヘルスケア          | 116,502   | 2,812.30<br>327,639,227  | 2,786.24<br>324,602,719  | 0.44 |

(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。

#### □ . 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        | 96.74% |
| 投資証券      | 1.78%  |
| 合計        | 98.52% |

(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。

#### 八．投資株式の業種別投資比率

| 業種         | 投資比率   |
|------------|--------|
| エネルギー      | 10.14% |
| 素材         | 5.62%  |
| 資本財・サービス   | 10.64% |
| 一般消費財・サービス | 11.26% |
| 生活必需品      | 10.14% |
| ヘルスケア      | 11.60% |
| 金融         | 18.68% |
| 情報技術       | 11.98% |
| 電気通信サービス   | 3.55%  |
| 公益事業       | 3.12%  |
| その他        | 0.00%  |
| 合計         | 96.74% |

(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 | アメリカ | S&P500 2014年3月  | 買建        | 20      | 931,926,884 | 967,743,675 | 1.32%    |
| 為替予約取引   | 日本   | ユーロ売/円買 2014年1月 | 売建        | 150,000 | 21,399,450  | 21,754,500  | 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、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考) ダイワJ - R E I T マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

##### 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 投資証券                  | 130,821,817,940 | 99.04   |
| 内 日本                  | 130,821,817,940 | 99.04   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,273,916,009   | 0.96    |
| 純資産総額                 | 132,095,733,949 | 100.00  |

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

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

#### (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

##### 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|    | 銘柄名                | 地域 | 数<br>種類<br>は | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)            | 評価単価<br>時価<br>(円)             | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------------------|----|--------------|--------------------|------------------------------|-------------------------------|-----------------|
| 1  | 日本ビルファンド           | 日本 | 投資証券         | 24,106             | 592,874.93<br>14,291,843,160 | 612,000.00<br>14,752,872,000  | 11.17           |
| 2  | ジャパンリアルエステイト       | 日本 | 投資証券         | 20,697             | 569,077.78<br>11,778,202,946 | 564,000.00<br>11,673,108,000  | 8.84            |
| 3  | 日本リテールファンド         | 日本 | 投資証券         | 40,203             | 197,757.54<br>7,950,446,593  | 214,200.00<br>8,611,482,600   | 6.52            |
| 4  | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 日本 | 投資証券         | 41,457             | 140,692.44<br>5,832,686,588  | 151,300.00<br>6,272,444,100   | 4.75            |
| 5  | 日本プロロジスリート         | 日本 | 投資証券         | 5,419              | 924,614.79<br>5,010,487,567  | 1,006,000.00<br>5,451,514,000 | 4.13            |
| 6  | アドバンス・レジデンス        | 日本 | 投資証券         | 21,598             | 206,118.61<br>4,451,749,882  | 227,000.00<br>4,902,746,000   | 3.71            |
| 7  | 日本プライムリアルティ        | 日本 | 投資証券         | 14,369             | 313,127.00<br>4,499,321,877  | 337,000.00<br>4,842,353,000   | 3.67            |
| 8  | フロンティア不動産投資        | 日本 | 投資証券         | 8,639              | 472,069.65<br>4,078,209,741  | 520,000.00<br>4,492,280,000   | 3.40            |
| 9  | オリックス不動産投資         | 日本 | 投資証券         | 29,392             | 118,808.02<br>3,492,005,544  | 131,700.00<br>3,870,926,400   | 2.93            |
| 10 | 森トラスト総合リート         | 日本 | 投資証券         | 4,598              | 916,982.24<br>4,216,284,381  | 838,000.00<br>3,853,124,000   | 2.92            |
| 11 | GLP投資法人            | 日本 | 投資証券         | 36,536             | 95,093.78<br>3,474,346,622   | 102,800.00<br>3,755,900,800   | 2.84            |
| 12 | API投資法人            | 日本 | 投資証券         | 4,326              | 783,496.83<br>3,389,407,316  | 829,000.00<br>3,586,254,000   | 2.71            |
| 13 | 森ヒルズリート            | 日本 | 投資証券         | 4,824              | 631,885.61<br>3,048,216,218  | 698,000.00<br>3,367,152,000   | 2.55            |
| 14 | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 日本 | 投資証券         | 2,891              | 939,214.51<br>2,715,269,177  | 1,115,000.00<br>3,223,465,000 | 2.44            |
| 15 | 野村不動産オフィスF         | 日本 | 投資証券         | 6,489              | 447,257.05<br>2,902,251,024  | 489,000.00<br>3,173,121,000   | 2.40            |
| 16 | NMF投資法人            | 日本 | 投資証券         | 29,004             | 98,269.52<br>2,850,209,436   | 108,400.00<br>3,144,033,600   | 2.38            |
| 17 | ケネディクス不動産投資法人      | 日本 | 投資証券         | 5,792              | 438,796.16<br>2,541,507,383  | 499,500.00<br>2,893,104,000   | 2.19            |
| 18 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 日本 | 投資証券         | 4,018              | 673,657.38<br>2,706,755,391  | 708,000.00<br>2,844,744,000   | 2.15            |
| 19 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人  | 日本 | 投資証券         | 6,512              | 389,615.12<br>2,537,173,664  | 419,500.00<br>2,731,784,000   | 2.07            |
| 20 | ジャパンエクセレント投資法人     | 日本 | 投資証券         | 19,590             | 117,784.84<br>2,307,405,023  | 123,300.00<br>2,415,447,000   | 1.83            |
| 21 | 産業ファンド             | 日本 | 投資証券         | 2,725              | 867,310.76<br>2,363,421,825  | 877,000.00<br>2,389,825,000   | 1.81            |
| 22 | ジャパン・ホテル・リート投資法人   | 日本 | 投資証券         | 45,656             | 42,774.28<br>1,952,902,666   | 50,400.00<br>2,301,062,400    | 1.74            |
| 23 | 東急リアル・エステート        | 日本 | 投資証券         | 3,405              | 571,392.38<br>1,945,591,078  | 649,000.00<br>2,209,845,000   | 1.67            |

|    |              |    |      |        |                             |                             |      |
|----|--------------|----|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 24 | イオンリート投資     | 日本 | 投資証券 | 16,400 | 141,069.61<br>2,313,541,606 | 129,200.00<br>2,118,880,000 | 1.60 |
| 25 | 福岡リート投資法人    | 日本 | 投資証券 | 2,404  | 762,753.05<br>1,833,658,355 | 852,000.00<br>2,048,208,000 | 1.55 |
| 26 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 3,499  | 419,000.00<br>1,466,081,000 | 491,500.00<br>1,719,758,500 | 1.30 |
| 27 | 大和ハウスリート     | 日本 | 投資証券 | 2,134  | 704,788.41<br>1,504,018,481 | 790,000.00<br>1,685,860,000 | 1.28 |
| 28 | 日本賃貸住宅投資法人   | 日本 | 投資証券 | 25,464 | 69,561.81<br>1,771,322,082  | 64,500.00<br>1,642,428,000  | 1.24 |
| 29 | プレミア投資法人     | 日本 | 投資証券 | 3,809  | 422,010.18<br>1,607,436,795 | 407,000.00<br>1,550,263,000 | 1.17 |
| 30 | 野村不レジデンシャル   | 日本 | 投資証券 | 2,801  | 511,919.97<br>1,433,887,861 | 545,000.00<br>1,526,545,000 | 1.16 |

(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   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 99.04% |
| 合計        | 99.04% |

(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) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

##### 投資状況

| 投資資産の種類  | 時価(円)       | 投資比率(%) |
|----------|-------------|---------|
| 投資証券     | 833,705,414 | 98.37   |
| 内 香港     | 15,594,118  | 1.84    |
| 内 シンガポール | 33,566,599  | 3.96    |
| 内 イスラエル  | 228,910     | 0.03    |
| 内 イギリス   | 56,834,149  | 6.71    |
| 内 アイルランド | 663,749     | 0.08    |
| 内 オランダ   | 10,051,202  | 1.19    |
| 内 ベルギー   | 5,112,215   | 0.60    |
| 内 フランス   | 44,884,961  | 5.30    |
| 内 ドイツ    | 1,524,605   | 0.18    |



|                       |             |        |
|-----------------------|-------------|--------|
| 内 イタリア                | 950,599     | 0.11   |
| 内 カナダ                 | 24,350,166  | 2.87   |
| 内 アメリカ                | 556,958,615 | 65.71  |
| 内 オーストラリア             | 80,264,593  | 9.47   |
| 内 ニュージーランド            | 2,720,933   | 0.32   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 13,838,630  | 1.63   |
| 純資産総額                 | 847,544,044 | 100.00 |

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

|    | 銘柄名                       | 地域      | 数<br>種類<br>は | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------------------------|---------|--------------|--------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1  | SIMON PROPERTY GROUP INC  | アメリカ    | 投資証券         | 3,247              | 15,792.69<br>51,278,869 | 16,147.85<br>52,432,088 | 6.19            |
| 2  | UNIBAIL-RODAMCO SE        | フランス    | 投資証券         | 1,000              | 27,914.87<br>27,914,873 | 26,493.38<br>26,493,383 | 3.13            |
| 3  | PUBLIC STORAGE            | アメリカ    | 投資証券         | 1,500              | 16,093.05<br>24,139,580 | 15,926.53<br>23,889,805 | 2.82            |
| 4  | PROLOGIS INC              | アメリカ    | 投資証券         | 5,146              | 3,997.44<br>20,570,840  | 3,919.45<br>20,169,511  | 2.38            |
| 5  | WESTFIELD GROUP           | オーストラリア | 投資証券         | 20,300             | 969.69<br>19,684,829    | 951.98<br>19,325,202    | 2.28            |
| 6  | EQUITY RESIDENTIAL        | アメリカ    | 投資証券         | 3,500              | 5,431.80<br>19,011,302  | 5,463.41<br>19,121,962  | 2.26            |
| 7  | VENTAS INC                | アメリカ    | 投資証券         | 3,079              | 5,989.31<br>18,441,097  | 6,032.52<br>18,574,140  | 2.19            |
| 8  | HCP INC                   | アメリカ    | 投資証券         | 4,700              | 3,875.19<br>18,213,394  | 3,846.73<br>18,079,655  | 2.13            |
| 9  | BOSTON PROPERTIES INC     | アメリカ    | 投資証券         | 1,600              | 10,485.25<br>16,776,402 | 10,581.15<br>16,929,850 | 2.00            |
| 10 | HEALTH CARE REIT INC      | アメリカ    | 投資証券         | 3,000              | 5,900.78<br>17,702,358  | 5,606.74<br>16,820,244  | 1.98            |
| 11 | VORNADO REALTY TRUST      | アメリカ    | 投資証券         | 1,764              | 9,266.94<br>16,346,887  | 9,474.56<br>16,713,126  | 1.97            |
| 12 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ    | 投資証券         | 1,300              | 12,495.03<br>16,243,550 | 12,531.92<br>16,291,502 | 1.92            |
| 13 | HOST HOTELS & RESORTS INC | アメリカ    | 投資証券         | 7,800              | 1,940.22<br>15,133,793  | 2,039.29<br>15,906,513  | 1.88            |
| 14 | LAND SECURITIES GROUP PLC | イギリス    | 投資証券         | 8,150              | 1,655.93<br>13,495,852  | 1,659.40<br>13,524,175  | 1.60            |
| 15 | LINK REIT                 | 香港      | 投資証券         | 24,000             | 516.42<br>12,394,080    | 503.50<br>12,084,228    | 1.43            |
| 16 | GENERAL GROWTH PROPERTIES | アメリカ    | 投資証券         | 5,577              | 2,186.84<br>12,196,021  | 2,124.66<br>11,849,242  | 1.40            |

|    |                             |         |      |        |                        |                        |      |
|----|-----------------------------|---------|------|--------|------------------------|------------------------|------|
| 17 | BRITISH LAND CO PLC         | イギリス    | 投資証券 | 10,450 | 1,061.67<br>11,094,489 | 1,086.86<br>11,357,779 | 1.34 |
| 18 | SL GREEN REALTY CORP        | アメリカ    | 投資証券 | 1,000  | 9,534.63<br>9,534,633  | 9,701.14<br>9,701,150  | 1.14 |
| 19 | MACERICH CO                 | アメリカ    | 投資証券 | 1,500  | 6,000.90<br>9,001,360  | 6,235.92<br>9,353,889  | 1.10 |
| 20 | KIMCO REALTY CORP           | アメリカ    | 投資証券 | 4,200  | 2,173.14<br>9,127,196  | 2,121.50<br>8,910,303  | 1.05 |
| 21 | WESTFIELD RETAIL TRUST      | オーストラリア | 投資証券 | 31,300 | 284.38<br>8,901,157    | 273.19<br>8,550,947    | 1.01 |
| 22 | REALTY INCOME CORP          | アメリカ    | 投資証券 | 2,117  | 4,014.09<br>8,498,004  | 3,990.06<br>8,446,968  | 1.00 |
| 23 | STOCKLAND                   | オーストラリア | 投資証券 | 24,100 | 358.97<br>8,651,273    | 337.52<br>8,134,444    | 0.96 |
| 24 | FEDERAL REALTY INVS TRUST   | アメリカ    | 投資証券 | 700    | 10,909.97<br>7,636,981 | 10,717.10<br>7,501,976 | 0.89 |
| 25 | GOODMAN GROUP               | オーストラリア | 投資証券 | 15,840 | 451.28<br>7,148,301    | 442.89<br>7,015,378    | 0.83 |
| 26 | DIGITAL REALTY TRUST INC    | アメリカ    | 投資証券 | 1,300  | 4,978.62<br>6,472,211  | 5,174.64<br>6,727,044  | 0.79 |
| 27 | COLE REAL ESTATE INVESTMENT | アメリカ    | 投資証券 | 4,400  | 1,508.13<br>6,635,776  | 1,475.46<br>6,492,024  | 0.77 |
| 28 | HAMMERSON PLC               | イギリス    | 投資証券 | 7,450  | 887.04<br>6,608,484    | 868.80<br>6,472,560    | 0.76 |
| 29 | UDR INC                     | アメリカ    | 投資証券 | 2,600  | 2,452.42<br>6,376,306  | 2,460.85<br>6,398,227  | 0.75 |
| 30 | ESSEX PROPERTY TRUST INC    | アメリカ    | 投資証券 | 400    | 15,999.25<br>6,399,702 | 15,277.33<br>6,110,934 | 0.72 |

(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。

#### □．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   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 98.37% |
| 合計        | 98.37% |

(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。

#### 八．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) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド ( B P I )

(1) 投資状況 (平成25年12月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               |      | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券                  |      | 10,926,495,440 | 73.32   |
|                       | 内 日本 | 10,926,495,440 | 73.32   |
| 地方債証券                 |      | 1,232,733,124  | 8.27    |
|                       | 内 日本 | 1,232,733,124  | 8.27    |
| 特殊債券                  |      | 1,299,750,650  | 8.72    |
|                       | 内 日本 | 1,299,750,650  | 8.72    |
| 社債券                   |      | 1,335,796,683  | 8.96    |
|                       | 内 日本 | 1,335,796,683  | 8.96    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |      | 106,921,370    | 0.72    |
| 純資産総額                 |      | 14,901,697,267 | 100.00  |

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|    | 銘柄名       | 地域 | 数<br>種類<br>は | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-----------|----|--------------|--------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1  | 105 5年国債  | 日本 | 国債証券         | 190,000,000        | 100.26<br>190,501,600 | 100.17<br>190,324,900 | 0.200000<br>2017/06/20   | 1.28            |
| 2  | 325 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 160,000,000        | 102.25<br>163,610,650 | 101.31<br>162,108,800 | 0.800000<br>2022/09/20   | 1.09            |
| 3  | 288 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 148,000,000        | 105.92<br>156,773,440 | 105.66<br>156,385,680 | 1.700000<br>2017/09/20   | 1.05            |
| 4  | 92 5年国債   | 日本 | 国債証券         | 140,000,000        | 100.39<br>140,551,600 | 100.34<br>140,487,200 | 0.300000<br>2015/09/20   | 0.94            |
| 5  | 115 5年国債  | 日本 | 国債証券         | 140,000,000        | 100.09<br>140,133,000 | 99.88<br>139,836,200  | 0.200000<br>2018/09/20   | 0.94            |
| 6  | 287 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 116,000,000        | 106.29<br>123,304,520 | 106.02<br>122,986,680 | 1.900000<br>2017/06/20   | 0.83            |
| 7  | 330 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 120,000,000        | 101.75<br>122,107,080 | 100.77<br>120,925,200 | 0.800000<br>2023/09/20   | 0.81            |
| 8  | 107 5年国債  | 日本 | 国債証券         | 120,000,000        | 100.20<br>120,240,000 | 100.07<br>120,093,600 | 0.200000<br>2017/12/20   | 0.81            |
| 9  | 327 2年国債  | 日本 | 国債証券         | 120,000,000        | 100.02<br>120,032,400 | 100.02<br>120,030,000 | 0.100000<br>2015/04/15   | 0.81            |
| 10 | 88 5年国債   | 日本 | 国債証券         | 118,000,000        | 100.54<br>118,638,380 | 100.49<br>118,585,280 | 0.500000<br>2015/03/20   | 0.80            |
| 11 | 95 5年国債   | 日本 | 国債証券         | 117,000,000        | 101.16<br>118,363,050 | 101.09<br>118,282,320 | 0.600000<br>2016/03/20   | 0.79            |
| 12 | 324 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 115,000,000        | 102.37<br>117,728,950 | 101.44<br>116,661,750 | 0.800000<br>2022/06/20   | 0.78            |
| 13 | 312 10年国債 | 日本 | 国債証券         | 110,000,000        | 105.70<br>116,270,800 | 105.01<br>115,520,900 | 1.200000<br>2020/12/20   | 0.78            |

|    |              |    |       |             |                       |                       |                        |      |
|----|--------------|----|-------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 14 | 89 5年国債      | 日本 | 国債証券  | 115,000,000 | 100.49<br>115,565,800 | 100.44<br>115,515,200 | 0.400000<br>2015/06/20 | 0.78 |
| 15 | 309 10年国債    | 日本 | 国債証券  | 110,000,000 | 105.13<br>115,646,300 | 104.53<br>114,985,200 | 1.100000<br>2020/06/20 | 0.77 |
| 16 | 319 10年国債    | 日本 | 国債証券  | 105,000,000 | 104.96<br>110,212,200 | 104.03<br>109,232,550 | 1.100000<br>2021/12/20 | 0.73 |
| 17 | 378 東北電力     | 日本 | 社債券   | 100,000,000 | 107.97<br>107,970,400 | 107.94<br>107,945,200 | 3.850000<br>2016/04/25 | 0.72 |
| 18 | 272 10年国債    | 日本 | 国債証券  | 105,000,000 | 102.36<br>107,483,250 | 102.21<br>107,326,800 | 1.400000<br>2015/09/20 | 0.72 |
| 19 | 15 NTTドコモ    | 日本 | 社債券   | 100,000,000 | 107.60<br>107,602,400 | 107.30<br>107,309,800 | 1.960000<br>2018/06/20 | 0.72 |
| 20 | 5 日本政策投資CO   | 日本 | 特殊債券  | 100,000,000 | 107.66<br>107,664,200 | 107.17<br>107,174,300 | 1.745000<br>2019/03/20 | 0.72 |
| 21 | 21 - 6 大阪市公債 | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 107.39<br>107,398,600 | 106.81<br>106,816,200 | 1.570000<br>2019/11/25 | 0.72 |
| 22 | 30 国際協力銀行    | 日本 | 特殊債券  | 100,000,000 | 106.94<br>106,944,400 | 106.68<br>106,683,500 | 1.870000<br>2018/03/20 | 0.72 |
| 23 | 21 - 2 埼玉県公債 | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 107.16<br>107,162,900 | 106.62<br>106,620,400 | 1.570000<br>2019/05/27 | 0.72 |
| 24 | 2 政保地方公営機    | 日本 | 特殊債券  | 100,000,000 | 106.82<br>106,824,300 | 106.45<br>106,451,400 | 1.600000<br>2018/11/16 | 0.71 |
| 25 | 20 - 6 北海道公債 | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 106.70<br>106,706,800 | 106.40<br>106,408,700 | 1.720000<br>2018/08/29 | 0.71 |
| 26 | 76 共同発行地方    | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 106.35<br>106,352,700 | 105.80<br>105,808,800 | 1.400000<br>2019/07/25 | 0.71 |
| 27 | 307 10年国債    | 日本 | 国債証券  | 100,000,000 | 106.33<br>106,338,000 | 105.76<br>105,762,000 | 1.300000<br>2020/03/20 | 0.71 |
| 28 | 653 東京都公債    | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 105.42<br>105,429,000 | 105.19<br>105,198,400 | 1.540000<br>2017/12/20 | 0.71 |
| 29 | 16 政保政策投資B   | 日本 | 特殊債券  | 100,000,000 | 105.30<br>105,304,000 | 105.16<br>105,164,100 | 1.800000<br>2017/02/28 | 0.71 |
| 30 | 293 大阪府公債    | 日本 | 地方債証券 | 100,000,000 | 105.19<br>105,190,800 | 105.04<br>105,044,100 | 2.100000<br>2016/08/30 | 0.70 |

(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      | 73.32% |
| 地方債証券     | 8.27%  |
| 特殊債券      | 8.72%  |
| 社債券       | 8.96%  |
| 合計        | 99.28% |

(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) 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | 148,402,652,001 | 97.97   |
| 内 ユーロ                 | 65,047,855,476  | 42.94   |
| 内 シンガポール              | 536,257,087     | 0.35    |
| 内 マレーシア               | 772,509,927     | 0.51    |
| 内 ノルウェー               | 493,073,245     | 0.33    |
| 内 スウェーデン              | 832,070,756     | 0.55    |
| 内 デンマーク               | 1,180,381,150   | 0.78    |
| 内 イギリス                | 11,712,024,043  | 7.73    |
| 内 スイス                 | 613,515,538     | 0.41    |
| 内 ポーランド               | 1,293,137,139   | 0.85    |
| 内 カナダ                 | 3,517,947,134   | 2.32    |
| 内 アメリカ                | 57,917,417,959  | 38.23   |
| 内 メキシコ                | 1,536,877,867   | 1.01    |
| 内 南アフリカ               | 730,643,497     | 0.48    |
| 内 オーストラリア             | 2,218,941,183   | 1.46    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,081,055,177   | 2.03    |
| 純資産総額                 | 151,483,707,178 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 1,012,185,839 | 0.67    |
| 内 日本       | 1,012,185,839 | 0.67    |

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

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

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

## (2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                    | 地域  | 数<br>種類<br>は | 株数、口<br>また<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|------------------------|-----|--------------|--------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券         | 4,358,000          | 117.90<br>745,278,794 | 115.71<br>731,479,442 | 4.250000<br>2023/10/25   | 0.48            |

|    |                         |      |      |           |                       |                       |                        |      |
|----|-------------------------|------|------|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 2  | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 7,656,000 | 92.07<br>742,945,928  | 90.15<br>727,437,966  | 1.750000<br>2023/05/15 | 0.48 |
| 3  | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 4,619,000 | 108.73<br>728,515,922 | 106.86<br>715,993,885 | 3.000000<br>2022/04/25 | 0.47 |
| 4  | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 4,723,000 | 100.04<br>685,365,730 | 99.88<br>684,269,616  | 0.250000<br>2015/11/25 | 0.45 |
| 5  | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 6,410,000 | 99.03<br>669,003,821  | 98.10<br>662,721,207  | 0.625000<br>2017/08/31 | 0.44 |
| 6  | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 6,152,000 | 101.75<br>659,725,018 | 101.59<br>658,687,643 | 1.250000<br>2015/08/31 | 0.43 |
| 7  | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,630,000 | 110.91<br>658,103,449 | 108.85<br>645,910,195 | 3.625000<br>2020/02/15 | 0.43 |
| 8  | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,843,000 | 103.04<br>634,550,848 | 102.87<br>633,497,840 | 2.500000<br>2015/03/31 | 0.42 |
| 9  | ITALIAN GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 4,052,000 | 107.85<br>633,903,903 | 106.88<br>628,185,168 | 4.250000<br>2019/02/01 | 0.41 |
| 10 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,660,000 | 98.72<br>588,884,035  | 97.92<br>584,106,011  | 0.500000<br>2017/07/31 | 0.39 |
| 11 | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,590,000 | 113.29<br>589,970,901 | 111.51<br>580,670,672 | 3.500000<br>2020/04/25 | 0.38 |
| 12 | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,752,000 | 105.37<br>573,452,622 | 104.98<br>571,351,903 | 3.000000<br>2015/10/25 | 0.38 |
| 13 | ITALIAN GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 3,598,000 | 107.48<br>560,927,264 | 106.45<br>555,551,798 | 4.250000<br>2019/09/01 | 0.37 |
| 14 | GERMAN GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,859,000 | 99.86<br>559,014,680  | 97.86<br>547,797,331  | 1.500000<br>2022/09/04 | 0.36 |
| 15 | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,522,000 | 107.09<br>547,086,506 | 106.66<br>544,910,216 | 3.250000<br>2016/04/25 | 0.36 |
| 16 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,361,000 | 98.10<br>554,311,719  | 96.04<br>542,655,856  | 2.500000<br>2023/08/15 | 0.36 |
| 17 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,098,000 | 100.02<br>537,423,285 | 99.98<br>537,213,746  | 0.250000<br>2015/07/31 | 0.35 |
| 18 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 5,083,000 | 100.23<br>536,950,901 | 100.19<br>536,763,407 | 0.375000<br>2015/06/30 | 0.35 |
| 19 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 4,921,000 | 102.71<br>532,699,650 | 102.54<br>531,807,616 | 2.375000<br>2015/02/28 | 0.35 |
| 20 | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,230,000 | 114.99<br>538,741,373 | 112.98<br>529,324,292 | 3.750000<br>2021/04/25 | 0.35 |
| 21 | FRENCH GOVERNMENT BOND  | ユーロ  | 国債証券 | 3,288,000 | 110.80<br>528,475,158 | 110.05<br>524,879,148 | 3.750000<br>2017/04/25 | 0.35 |
| 22 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 4,635,000 | 108.31<br>529,085,327 | 107.43<br>524,811,104 | 3.250000<br>2017/03/31 | 0.35 |
| 23 | ITALIAN GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 3,118,000 | 116.94<br>528,879,743 | 115.71<br>523,316,872 | 6.000000<br>2031/05/01 | 0.35 |
| 24 | ITALIAN GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 2,963,000 | 122.08<br>524,692,163 | 120.28<br>516,943,172 | 6.500000<br>2027/11/01 | 0.34 |
| 25 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 4,788,000 | 100.00<br>504,642,642 | 99.95<br>504,370,154  | 0.250000<br>2015/08/15 | 0.33 |
| 26 | U.S. TREASURY NOTE      | アメリカ | 国債証券 | 4,658,000 | 102.60<br>503,675,101 | 102.44<br>502,909,286 | 1.875000<br>2015/06/30 | 0.33 |

|    |                        |      |      |           |                       |                       |                        |      |
|----|------------------------|------|------|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 27 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 2,507,000 | 139.60<br>507,649,201 | 137.26<br>499,140,017 | 5.750000<br>2032/10/25 | 0.33 |
| 28 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 2,623,000 | 133.04<br>506,187,384 | 130.67<br>497,181,750 | 5.500000<br>2029/04/25 | 0.33 |
| 29 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ  | 国債証券 | 3,146,000 | 109.36<br>499,066,914 | 107.44<br>490,278,051 | 3.500000<br>2026/04/25 | 0.32 |
| 30 | U.S. TREASURY NOTE     | アメリカ | 国債証券 | 4,527,000 | 104.10<br>496,704,590 | 102.03<br>486,828,609 | 2.625000<br>2020/08/15 | 0.32 |

(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      | 97.97% |
| 合計        | 97.97% |

(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 | デンマーク・クローネ買/<br>円売 2014年1月  | 買建        | 603,000   | 11,251,980  | 11,722,320  | 0.01%    |
|        |    | メキシコ・ペソ買/円売<br>2014年1月      | 買建        | 1,942,000 | 15,108,760  | 15,613,680  | 0.01%    |
|        |    | 米ドル買/円売 2014年1月             | 買建        | 3,303,000 | 338,227,180 | 348,070,119 | 0.23%    |
|        |    | ノルウェー・クローネ買/<br>円売 2014年1月  | 買建        | 284,000   | 4,737,120   | 4,876,280   | 0.00%    |
|        |    | ポーランド・ズロチ買/円<br>売 2014年1月   | 買建        | 361,000   | 11,941,880  | 12,624,170  | 0.01%    |
|        |    | シンガポール・ドル買/円<br>売 2014年1月   | 買建        | 63,000    | 5,139,540   | 5,232,150   | 0.00%    |
|        |    | スイス・フラン買/円売<br>2014年1月      | 買建        | 48,000    | 5,425,440   | 5,673,600   | 0.00%    |
|        |    | 英ポンド買/円売 2014年1<br>月        | 買建        | 822,000   | 138,139,650 | 142,806,060 | 0.09%    |
|        |    | スウェーデン・クローネ<br>買/円売 2014年1月 | 買建        | 509,000   | 7,950,580   | 8,235,620   | 0.01%    |
|        |    | カナダ・ドル買/円売<br>2014年1月       | 買建        | 631,000   | 61,152,606  | 62,084,090  | 0.04%    |
|        |    | ユーロ買/円売 2014年1月             | 買建        | 2,528,000 | 351,670,080 | 366,635,840 | 0.24%    |
|        |    | 南アフリカ・ランド買/円<br>売 2014年1月   | 買建        | 719,000   | 7,190,000   | 7,182,810   | 0.00%    |
|        |    | 豪ドル買/円売 2014年1月             | 買建        | 230,000   | 21,431,400  | 21,429,100  | 0.01%    |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)



## (参考情報)

2013年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,136円 |
| 純資産総額 | 81百万円   |

| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 1.8%  |
| 3カ月間     | 5.6%  |
| 6カ月間     | 8.9%  |
| 1年間      | 23.1% |
| 3年間      | 35.2% |
| 5年間      | 48.7% |
| 設定来      | 11.4% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |               |               |               |               |               | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |
|-----|-----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--|--|
|     | 第1期<br>08年12月   | 第2期<br>09年12月 | 第3期<br>10年12月 | 第4期<br>11年12月 | 第5期<br>12年12月 | 第6期<br>13年12月 |               |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円            | 0円            | 0円            | 0円            | 0円            |               |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率    | 通貨別構成       | 比率     | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位銘柄                   | 国・地域名 | 比率   |
|-------------|-------|-------|-------------|--------|--------------|--------------------------|-------|------|
| 国内債券        | 291   | 36.9% | 日本円         | 59.9%  | 直接利回り(%)     | トヨタ自動車                   | 日本    | 0.8% |
| 外国債券        | 683   | 22.4% | 米ドル         | 19.5%  | 最終利回り(%)     | 三菱UFJフィナンシャルG            | 日本    | 0.5% |
| 国内株式・先物     | 1,302 | 17.3% | ユーロ         | 12.1%  | 修正デュレーション    | ソフトバンク                   | 日本    | 0.4% |
| 外国株式・先物     | 1,176 | 12.1% | 英ポンド        | 3.4%   | 残存年数         | 三井住友フィナンシャルG             | 日本    | 0.4% |
| 外国リート       | 276   | 5.2%  | カナダ・ドル      | 1.3%   | 債券格付別構成      | 本田技研                     | 日本    | 0.4% |
| 国内リート       | 43    | 5.1%  | 豪ドル         | 1.2%   | AAA          | 日本ビルファンド                 | 日本    | 0.6% |
|             |       |       | スイス・フラン     | 0.6%   | AA           | ジャパンリアルエステイト             | 日本    | 0.5% |
|             |       |       | シンガポール・ドル   | 0.4%   | A            | 日本リテールファンド               | 日本    | 0.3% |
|             |       |       | スウェーデン・クローネ | 0.3%   | BBB          | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ  | 0.3% |
| コール・ローン、その他 |       | 1.3%  | その他         | 1.4%   | BB以下・無格付     | ユナイテッド・アーバン投資法人          | 日本    | 0.2% |
| 合計          | 3,771 | -     | 合計          | 100.0% | 合計           | 合計                       |       | 4.4% |

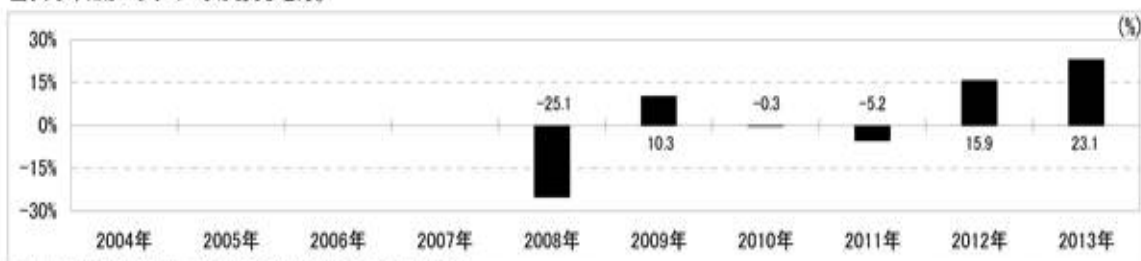
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.6%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2008年は設定日(2月28日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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、受益権の取得申込みの受け付けを中止することが出来ます。

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出来ます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

### 2 【換金（解約）手続等】

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

#### < 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、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出来るほか、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出来ます。

- ・ お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
    電話番号（コールセンター） 0120-106212  
    （営業日の9:00～17:00）
- ・ 委託会社のホームページ  
    アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・ わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：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。

- ・ 海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・ 公社債等：原則として、次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
  3. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・ お電話によるお問い合わせ先(委託会社)

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

- ・ 委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) 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12月19日から翌年12月18日までとします。ただし、第1計算期間は、平成20年2月28日から平成20年12月18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、あるいは、第14計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、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、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 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。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、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。
8. 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。

#### 信託約款の変更等

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または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとし、
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款

にかかる知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 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7. 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5. 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. の規定にしたがい重大な信託約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な信託約款の変更等に反対した受益者は、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。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、前 2. または前 2. に規定する書面に付記します。

#### 運用報告書

委託会社は、毎計算期末に、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っている受益者に対して交付します。

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

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

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

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（平成24年12月19日から平成25年12月18日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

#### DCダイワ・ターゲットイヤー2020



DCダイワ・ターゲットイヤー2020  
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第5期<br>平成24年12月18日現在    | 第6期<br>平成25年12月18日現在    |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 252,371                 | 379,898                 |
| 親投資信託受益証券       | 54,598,659              | 79,435,769              |
| 流動資産合計          | 54,851,030              | 79,815,667              |
| 資産合計            | 54,851,030              | 79,815,667              |
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払解約金           | 9,636                   | 21,688                  |
| 未払受託者報酬         | 12,554                  | 18,323                  |
| 未払委託者報酬         | 151,134                 | 220,319                 |
| その他未払費用         | 1,795                   | 2,685                   |
| 流動負債合計          | 175,119                 | 263,015                 |
| 負債合計            | 175,119                 | 263,015                 |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | <sup>1</sup> 62,027,527 | <sup>1</sup> 73,034,878 |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | <sup>2</sup> 7,351,616  | <sup>2</sup> 6,517,774  |
| （分配準備積立金）       | 4,889,877               | 16,029,492              |
| 元本等合計           | 54,675,911              | 79,552,652              |
| 純資産合計           | 54,675,911              | 79,552,652              |
| 負債純資産合計         | 54,851,030              | 79,815,667              |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第5期 |                              | 第6期 |                              |
|-------------------------|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
|                         | 自   | 平成23年12月20日<br>至 平成24年12月18日 | 自   | 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日 |
| 営業収益                    |     |                              |     |                              |
| 受取利息                    |     | -                            |     | 1                            |
| 有価証券売買等損益               |     | 6,403,265                    |     | 14,102,110                   |
| 営業収益合計                  |     | 6,403,265                    |     | 14,102,111                   |
| 営業費用                    |     |                              |     |                              |
| 受託者報酬                   |     | 24,183                       |     | 34,750                       |
| 委託者報酬                   |     | 291,229                      |     | 417,891                      |
| その他費用                   |     | 3,485                        |     | 5,068                        |
| 営業費用合計                  |     | 318,897                      |     | 457,709                      |
| 営業利益                    |     | 6,084,368                    |     | 13,644,402                   |
| 経常利益                    |     | 6,084,368                    |     | 13,644,402                   |
| 当期純利益                   |     | 6,084,368                    |     | 13,644,402                   |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |     | 237,247                      |     | 1,735,080                    |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         |     | 11,867,808                   |     | 7,351,616                    |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |     | 1,444,697                    |     | 1,960,068                    |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |     | 1,444,697                    |     | 1,148,601                    |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |     | -                            |     | 811,467                      |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |     | 2,775,626                    |     | -                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |     | 2,775,626                    |     | -                            |
| 分配金                     |     | 1 -                          |     | 1 -                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         |     | 7,351,616                    |     | 6,517,774                    |

## (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6期  |               |
|-----------------|--|---------------|
|                 | 自 平成24年12月19日  | 至 平成25年12月18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。 |               |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第5期   | 第6期           |
|---------------------|---|---------------|
|                     | 平成24年12月18日現在                                 | 平成25年12月18日現在 |
| 1. 1 期首元本額          | 52,459,020円                                   | 62,027,527円   |
| 期中追加設定元本額           | 16,094,256円                                   | 22,032,793円   |
| 期中一部解約元本額           | 6,525,749円                                    | 11,025,442円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 62,027,527口                                   | 73,034,878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7,351,616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5期   | 第6期   |
|------------|---|---|
|            | 自 平成23年12月20日<br>至 平成24年12月18日  | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18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(3,620,645円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,270,204円)及び分配準備積立金(1,269,232円)より分配可能額は6,160,081円(1万口当たり993.12円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1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(11,909,321円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,133,066円)及び分配準備積立金(4,120,170円)より分配可能額は19,162,558円(1万口当たり2,623.75円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 第6期           |               |
|-----|---------------|---------------|
|     | 自 平成24年12月19日 | 至 平成25年12月18日 |
|     |               |               |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第6期<br>平成25年12月18日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第5期<br>平成24年12月18日現在     | 第6期<br>平成25年12月18日現在     |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 5,951,740                | 11,654,416               |
| 合計        | 5,951,740                | 11,654,416               |

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第5期<br>平成24年12月18日現在 | 第6期<br>平成25年12月18日現在 |
|----------------------|----------------------|
| 該当事項はありません。          | 該当事項はありません。          |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 第6期<br>自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18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われていないため、該当事項はありません。 |

## （1口当たり情報）

|                           | 第5期<br>平成24年12月18日現在 | 第6期<br>平成25年12月18日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.8815円<br>(8,815円)  | 1.0892円<br>(10,892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        | 18,876,528 | 13,515,594 |    |
|              | 外国株式インデックスマザーファンド           | 6,111,206  | 9,449,757  |    |
|              | 外国債券インデックスマザーファンド           | 7,425,218  | 18,369,989 |    |
|              | ダイワJ-REITマザーファンド            | 2,225,277  | 3,937,850  |    |
|              | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 2,720,556  | 3,956,232  |    |
|              | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)   | 25,740,390 | 30,206,347 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                             |            | 79,435,769 |    |
| 合計           |                             |            | 79,435,769 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在 |                 | 平成25年12月18日現在 |                 |
|-----------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
|                 | 金額（円）         |                 | 金額（円）         |                 |
| 資産の部            |               |                 |               |                 |
| 流動資産            |               |                 |               |                 |
| コール・ローン         |               | 1,334,166,652   |               | 813,122,476     |
| 株式              | 3             | 91,258,540,710  |               | 122,192,491,830 |
| 新株予約権証券         |               | -               |               | 4,926,600       |
| 派生商品評価勘定        |               | 39,999,965      |               | 1,537,912       |
| 未収入金            |               | 3,015,491       |               | -               |
| 未収配当金           |               | 10,518,638      |               | 9,620,800       |
| 前払金             |               | -               |               | 10,362,000      |
| 流動資産合計          |               | 92,646,241,456  |               | 123,032,061,618 |
| 資産合計            |               | 92,646,241,456  |               | 123,032,061,618 |
| 負債の部            |               |                 |               |                 |
| 流動負債            |               |                 |               |                 |
| 派生商品評価勘定        |               | -               |               | 2,311,636       |
| 前受金             |               | 25,730,000      |               | -               |
| 未払金             |               | -               |               | 74,472          |
| 未払解約金           |               | 108,997,000     |               | 157,055,000     |
| 流動負債合計          |               | 134,727,000     |               | 159,441,108     |
| 負債合計            |               | 134,727,000     |               | 159,441,108     |
| 純資産の部           |               |                 |               |                 |
| 元本等             |               |                 |               |                 |
| 元本              | 1             | 201,568,942,984 |               | 171,609,857,377 |
| 剰余金             |               |                 |               |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2             | 109,057,428,528 |               | 48,737,236,867  |
| 元本等合計           |               | 92,511,514,456  |               | 122,872,620,510 |
| 純資産合計           |               | 92,511,514,456  |               | 122,872,620,510 |
| 負債純資産合計         |               | 92,646,241,456  |               | 123,032,061,618 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                     | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | (1) 株式<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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br><br>(2) 新株予約権証券<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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引  |

|                |   |
|----------------|---|
|                | 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<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。 |
| 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。                                      |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                      | 平成24年12月18日現在    | 平成25年12月18日現在    |
|--|------------------|------------------|
| 1. 1 期首                                  | 平成23年12月20日      | 平成24年12月19日      |
| 期首元本額                                    | 204,724,819,772円 | 201,568,942,984円 |
| 期中追加設定元本額                                | 17,296,801,557円  | 11,801,971,044円  |
| 期中一部解約元本額                                | 20,452,678,345円  | 41,761,056,651円  |
| 期末元本額の内訳                                 |                  |                  |
| ファンド名                                    |                  |                  |
| 適格機関投資家専用投信1号                            | 1,998,530,202円   | 1,686,119,625円   |
| トピックス・インデックスファン<br>ド                     | 9,782,893,736円   | 7,801,545,233円   |
| ダイワ・トピックス・インデッ<br>クスファンドVA               | 27,491,495,477円  | 23,541,978,090円  |
| 適格機関投資家専用・ダイワ・<br>トピックスインデックスファン<br>ドVA2 | 803,040,978円     | 477,790,435円     |
| ダイワ国内重視バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私募)         | 410,275,341円     | 287,060,542円     |
| ダイワ国内重視バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私募)         | 6,684,255,711円   | 5,175,338,703円   |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私募)         | 405,076,477円     | 244,600,824円     |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私募)         | 8,847,959,697円   | 7,135,925,294円   |
| D-I's TOPIXインデッ<br>クス                    | - 円              | 1,412,946円       |
| DCダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 63,668,373,750円  | 62,724,250,286円  |
| ダイワ・ライフ・バランス30                           | 2,769,238,424円   | 2,045,924,864円   |
| ダイワ・ライフ・バランス50                           | 1,990,370,525円   | 1,870,921,154円   |
| ダイワ・ライフ・バランス70                           | 1,461,664,009円   | 1,563,316,437円   |
| 年金ダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 2,259,459,772円   | 2,485,672,271円   |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020                   | 22,049,573円      | 18,876,528円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030                   | 31,319,190円      | 32,799,580円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040                   | 3,323,105円       | 5,988,897円       |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド15VA                  | 494,018,413円     | 319,467,877円     |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド20VA                  | 3,578,278,361円   | 2,367,033,356円   |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド20VA(国内株式型)           | 1,997,617,946円   | 1,314,872,463円   |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド25VA                  | 115,543,742円     | 78,438,955円      |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド30VA                  | 796,922,624円     | 547,366,846円     |

|                                   |   |   |
|-----------------------------------|---|---|
| ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)        | 369,541,369円  | 241,641,491円  |
| ダイワ世界バランスファンド40VA                 | 3,936,183,109円  | 2,677,705,786円  |
| ダイワ世界バランスファンド60VA                 | 582,261,871円  | 406,782,366円  |
| ダイワ・バランスファンド35VA                  | 32,198,179,949円   | 23,110,940,440円   |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA             | 2,365,876,405円  | 1,097,967,765円  |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA             | 5,152,596,941円  | 2,455,360,976円  |
| ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)       | 2,842,626,590円  | 1,900,887,857円  |
| ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)      | 542,310,526円  | 347,684,741円  |
| ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)      | 614,885,899円  | 429,784,645円  |
| ダイワ・インデックスセレクトTOPIX               | -円  | 1,408,882円  |
| ダイワライフスタイル25                      | 230,063,000円  | 178,321,453円  |
| ダイワライフスタイル50                      | 654,994,154円  | 560,453,041円  |
| ダイワライフスタイル75                      | 495,626,689円  | 445,868,405円  |
| DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) | 15,972,089,429円   | 16,028,348,323円   |
| 計                                 | 201,568,942,984円  | 171,609,857,377円  |
| 2. 期末日における受益権の総数                  | 201,568,942,984口  | 171,609,857,377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109,057,428,528円でありませす。        | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は48,737,236,867円でありませす。           |
| 4. 3 差入委託証拠金代用有価証券                | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。<br>株式 618,000,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。<br>株式 1,009,400,000円 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。 |



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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成25年12月18日現在   |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類     | 平成24年12月18日現在          | 平成25年12月18日現在          |
|---------|------------------------|------------------------|
|         | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式      | 5,830,993,362          | 3,419,546,418          |
| 新株予約権証券 | -                      | 4,926,600              |
| 合計      | 5,830,993,362          | 3,424,473,018          |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年9月20日から平成24年12月18日まで、及び平成25年9月20日から平成25年12月18日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

| 種 類          | 平成24年12月18日 現在 |           |               |             | 平成25年12月18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          | 1,130,987,000  | -         | 1,171,170,000 | 40,183,000  | 664,671,000    | -         | 664,090,000 | 581,000     |
| 合計           | 1,130,987,000  | -         | 1,171,170,000 | 40,183,000  | 664,671,000    | -         | 664,090,000 | 581,000     |

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## (1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在       | 平成25年12月18日現在       |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.4590円<br>(4,590円) | 0.7160円<br>(7,160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  | 263    | 10,783,000  |    |
| 日本水産           | 115,700 | 228    | 26,379,600  |    |
| マルハニチロホールディングス | 167,000 | 188    | 31,396,000  |    |
| サカタのタネ         | 13,400  | 1,320  | 17,688,000  |    |
| ホクト            | 9,400   | 1,911  | 17,963,400  |    |
| ショーボンドHD       | 6,900   | 4,530  | 31,257,000  |    |
| ミライト・ホールディングス  | 23,100  | 890    | 20,559,000  |    |
| 住石ホールディングス     | 29,800  | 135    | 4,023,000   |    |
| 日鉄鉱業           | 21,000  | 485    | 10,185,000  |    |
| 三井松島           | 62,000  | 154    | 9,548,000   |    |
| 国際石油開発帝石       | 375,400 | 1,262  | 473,754,800 |    |
| 日本海洋掘削         | 2,000   | 6,130  | 12,260,000  |    |
| 関東天然瓦斯         | 10,000  | 725    | 7,250,000   |    |
| 石油資源開発         | 10,900  | 3,885  | 42,346,500  |    |
| 安藤・間           | 51,100  | 326    | 16,658,600  |    |
| 東急建設           | 28,800  | 454    | 13,075,200  |    |
| コムシスホールディングス   | 38,700  | 1,571  | 60,797,700  |    |
| ミサワホーム         | 8,800   | 1,572  | 13,833,600  |    |
| 高松コンストラクションGP  | 6,600   | 1,749  | 11,543,400  |    |
| 東建コーポレーション     | 3,150   | 4,950  | 15,592,500  |    |
| 大成建設           | 392,000 | 445    | 174,440,000 |    |
| 大林組            | 234,000 | 539    | 126,126,000 |    |
| 清水建設           | 240,000 | 501    | 120,240,000 |    |
| 飛鳥建設           | 51,200  | 153    | 7,833,600   |    |
| 長谷工コーポレーション    | 103,200 | 747    | 77,090,400  |    |
| 松井建設           | 13,000  | 405    | 5,265,000   |    |
| 鹿島建設           | 343,000 | 367    | 125,881,000 |    |
| 不動テトラ          | 58,400  | 168    | 9,811,200   |    |
| 大末建設           | 35,000  | 116    | 4,060,000   |    |
| 鉄建建設           | 49,000  | 281    | 13,769,000  |    |
| 日鉄住金テックスエンジ    | 17,000  | 416    | 7,072,000   |    |
| 西松建設           | 103,000 | 302    | 31,106,000  |    |
| 三井住友建設         | 213,300 | 114    | 24,316,200  |    |
| 大豊建設           | 23,000  | 315    | 7,245,000   |    |
| 前田建設           | 49,000  | 639    | 31,311,000  |    |
| 佐田建設           | 32,000  | 127    | 4,064,000   |    |
| 奥村組            | 71,000  | 458    | 32,518,000  |    |
| 東鉄工業           | 9,900   | 1,781  | 17,631,900  |    |

|               |         |       |             |
|---------------|---------|-------|-------------|
| 浅沼組           | 29,000  | 145   | 4,205,000   |
| 戸田建設          | 92,000  | 342   | 31,464,000  |
| 熊谷組           | 63,000  | 258   | 16,254,000  |
| 三井ホーム         | 17,000  | 490   | 8,330,000   |
| 矢作建設          | 12,400  | 849   | 10,527,600  |
| 大東建託          | 29,100  | 9,390 | 273,249,000 |
| NIPPPO        | 18,000  | 1,575 | 28,350,000  |
| 東亜道路          | 17,000  | 489   | 8,313,000   |
| 前田道路          | 24,000  | 1,636 | 39,264,000  |
| 日本道路          | 23,000  | 547   | 12,581,000  |
| 東亜建設          | 71,000  | 221   | 15,691,000  |
| 若築建設          | 47,000  | 121   | 5,687,000   |
| 東洋建設          | 26,900  | 334   | 8,984,600   |
| 五洋建設          | 94,500  | 332   | 31,374,000  |
| 大林道路          | 11,000  | 523   | 5,753,000   |
| 世紀東急          | 45,000  | 127   | 5,715,000   |
| 福田組           | 14,000  | 465   | 6,510,000   |
| 住友林業          | 54,100  | 1,214 | 65,677,400  |
| 日本基礎技術        | 11,300  | 346   | 3,909,800   |
| 日成ビルド工業       | 25,000  | 238   | 5,950,000   |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 44,000  | 136   | 5,984,000   |
| 巴コーポレーション     | 11,700  | 465   | 5,440,500   |
| パナホーム         | 31,000  | 742   | 23,002,000  |
| 大和ハウス         | 213,000 | 1,969 | 419,397,000 |
| ライト工業         | 17,200  | 717   | 12,332,400  |
| 積水ハウス         | 203,000 | 1,422 | 288,666,000 |
| 日特建設          | 11,800  | 387   | 4,566,600   |
| 中電工           | 11,600  | 1,835 | 21,286,000  |
| 関電工           | 36,000  | 556   | 20,016,000  |
| きんでん          | 51,000  | 1,047 | 53,397,000  |
| トーエネック        | 15,000  | 643   | 9,645,000   |
| 住友電設          | 6,400   | 1,540 | 9,856,000   |
| 日本電設工業        | 13,000  | 1,334 | 17,342,000  |
| 協和エクシオ        | 31,000  | 1,332 | 41,292,000  |
| 日本工営          | 27,000  | 397   | 10,719,000  |
| 九電工           | 17,000  | 673   | 11,441,000  |
| 三機工業          | 19,000  | 631   | 11,989,000  |
| 日揮            | 77,000  | 3,855 | 296,835,000 |
| 中外炉工業         | 30,000  | 267   | 8,010,000   |
| 太平電業          | 14,000  | 646   | 9,044,000   |
| 高砂熱学          | 23,400  | 845   | 19,773,000  |
| NECネットエスアイ    | 8,000   | 2,400 | 19,200,000  |
| 明星工業          | 16,000  | 405   | 6,480,000   |
| 大気社           | 10,600  | 2,222 | 23,553,200  |
| ダイダン          | 16,000  | 549   | 8,784,000   |
| 日比谷総合設備       | 10,900  | 1,192 | 12,992,800  |
| 東芝プラントシステム    | 13,000  | 1,498 | 19,474,000  |
| 日本製粉          | 51,000  | 510   | 26,010,000  |
| 日清製粉G本社       | 77,700  | 1,077 | 83,682,900  |
| 昭和産業          | 45,000  | 308   | 13,860,000  |
| 日本甜菜糖         | 60,000  | 181   | 10,860,000  |
| 三井製糖          | 36,000  | 390   | 14,040,000  |
| ネクスト          | 2,200   | 3,070 | 6,754,000   |
| 日本M&Aセンター     | 3,800   | 6,450 | 24,510,000  |
| アコーディア・ゴルフ    | 30,200  | 1,248 | 37,689,600  |

|                   |         |         |             |
|-------------------|---------|---------|-------------|
| タケエイ              | 5,700   | 1,246   | 7,102,200   |
| パソナグループ           | 8,200   | 729     | 5,977,800   |
| G C A サヴィアン       | 5,100   | 931     | 4,748,100   |
| エス・エム・エス          | 4,500   | 1,995   | 8,977,500   |
| テンプホールディングス       | 15,900  | 2,710   | 43,089,000  |
| クックパッド            | 4,500   | 3,145   | 14,152,500  |
| 森永製菓              | 91,000  | 210     | 19,110,000  |
| 中村屋               | 34,000  | 390     | 13,260,000  |
| 江崎グリコ             | 28,000  | 1,195   | 33,460,000  |
| 不二家               | 61,000  | 204     | 12,444,000  |
| 山崎製パン             | 56,000  | 1,075   | 60,200,000  |
| モロゾフ              | 38,000  | 310     | 11,780,000  |
| 亀田製菓              | 4,900   | 2,747   | 13,460,300  |
| カルビー              | 27,900  | 2,549   | 71,117,100  |
| 森永乳業              | 70,000  | 303     | 21,210,000  |
| ヤクルト              | 44,900  | 5,100   | 228,990,000 |
| 明治ホールディングス        | 22,900  | 6,800   | 155,720,000 |
| 雪印メグミルク           | 17,600  | 1,284   | 22,598,400  |
| プリマハム             | 47,000  | 197     | 9,259,000   |
| 日本ハム              | 54,000  | 1,729   | 93,366,000  |
| 伊藤ハム              | 45,000  | 457     | 20,565,000  |
| 丸大食品              | 50,000  | 301     | 15,050,000  |
| スタジオアリス           | 5,900   | 1,423   | 8,395,700   |
| シミックホールディングス      | 3,900   | 1,193   | 4,652,700   |
| システナ              | 11,400  | 709     | 8,082,600   |
| N E C フィールドینگ    | 9,000   | 1,149   | 10,341,000  |
| 新日鉄住金 S O L       | 6,500   | 2,287   | 14,865,500  |
| 総合警備保障            | 26,600  | 1,992   | 52,987,200  |
| 日本駐車場開発           | 1,026   | 7,580   | 7,777,080   |
| カカクコム             | 43,800  | 1,826   | 79,978,800  |
| 新日本科学             | 5,500   | 1,315   | 7,232,500   |
| ツクイ               | 9,300   | 944     | 8,779,200   |
| エムスリー             | 239     | 246,800 | 58,985,200  |
| ディー・エヌ・エー         | 38,600  | 2,109   | 81,407,400  |
| 博報堂 D Y H L D G S | 99,700  | 815     | 81,255,500  |
| ぐるなび              | 5,400   | 3,005   | 16,227,000  |
| 一休                | 57      | 148,100 | 8,441,700   |
| ジャパンベストレスキュー S    | 56      | 57,400  | 3,214,400   |
| P G M ホールディングス    | 11,800  | 1,003   | 11,835,400  |
| バリューコマース          | 4,900   | 1,298   | 6,360,200   |
| サッポロホールディングス      | 130,000 | 450     | 58,500,000  |
| アサヒグループホールディン     | 154,600 | 2,893   | 447,257,800 |
| キリン H D           | 330,000 | 1,497   | 494,010,000 |
| 宝ホールディングス         | 62,000  | 961     | 59,582,000  |
| オエノンホールディングス      | 30,000  | 250     | 7,500,000   |
| コカ・コーラウエスト        | 23,400  | 2,196   | 51,386,400  |
| コカ・コーライーストジャパン    | 15,900  | 2,074   | 32,976,600  |
| サントリー食品インター       | 38,200  | 3,400   | 129,880,000 |
| ダイドードリンコ          | 3,900   | 4,280   | 16,692,000  |
| 伊藤園               | 20,800  | 2,166   | 45,052,800  |
| キーコーヒー            | 9,300   | 1,577   | 14,666,100  |
| 日清オイリオグループ        | 42,000  | 329     | 13,818,000  |
| 不二製油              | 18,900  | 1,594   | 30,126,600  |
| J - オイルミルズ        | 42,000  | 270     | 11,340,000  |
| ローソン              | 27,400  | 7,580   | 207,692,000 |

|                |         |        |               |
|----------------|---------|--------|---------------|
| サンエー           | 5,500   | 2,789  | 15,339,500    |
| カワチ薬品          | 5,700   | 1,884  | 10,738,800    |
| エービーシー・マート     | 9,500   | 4,630  | 43,985,000    |
| アスクル           | 5,900   | 3,120  | 18,408,000    |
| ゲオホールディングス     | 14,200  | 913    | 12,964,600    |
| アダストリアホールディング  | 5,400   | 3,865  | 20,871,000    |
| くらコーポレーション     | 5,300   | 1,519  | 8,050,700     |
| キャンドウ          | 4,300   | 1,445  | 6,213,500     |
| パル             | 4,300   | 2,450  | 10,535,000    |
| エディオン          | 32,800  | 612    | 20,073,600    |
| あらた            | 21,000  | 318    | 6,678,000     |
| J Pホールディングス    | 14,700  | 397    | 5,835,900     |
| あみやき亭          | 1,600   | 3,710  | 5,936,000     |
| ひらまつ           | 9,200   | 606    | 5,575,200     |
| 双日             | 475,200 | 183    | 86,961,600    |
| アルフレッサホールディングス | 20,100  | 5,110  | 102,711,000   |
| ハニーズ           | 7,100   | 1,002  | 7,114,200     |
| キッコーマン         | 64,000  | 1,961  | 125,504,000   |
| 味の素            | 183,000 | 1,485  | 271,755,000   |
| キューピー          | 38,100  | 1,427  | 54,368,700    |
| ハウス食品G本社       | 26,500  | 1,564  | 41,446,000    |
| カゴメ            | 29,000  | 1,692  | 49,068,000    |
| アリアケジャパン       | 7,600   | 2,534  | 19,258,400    |
| ニチレイ           | 88,000  | 523    | 46,024,000    |
| 横浜冷凍           | 21,800  | 774    | 16,873,200    |
| 東洋水産           | 37,000  | 3,045  | 112,665,000   |
| 日清食品HD         | 29,300  | 4,240  | 124,232,000   |
| 永谷園            | 13,000  | 895    | 11,635,000    |
| フジッコ           | 11,000  | 1,171  | 12,881,000    |
| ロックフィールド       | 5,800   | 1,852  | 10,741,600    |
| 日本たばこ産業        | 427,400 | 3,490  | 1,491,626,000 |
| わらべや日洋         | 5,900   | 1,828  | 10,785,200    |
| 片倉工業           | 9,200   | 1,150  | 10,580,000    |
| グンゼ            | 66,000  | 254    | 16,764,000    |
| ヒューリック         | 114,700 | 1,505  | 172,623,500   |
| アルペン           | 5,900   | 1,857  | 10,956,300    |
| クオール           | 7,900   | 587    | 4,637,300     |
| アルコニック         | 3,700   | 2,278  | 8,428,600     |
| ジェイアイエヌ        | 3,600   | 4,515  | 16,254,000    |
| ビックカメラ         | 272     | 52,200 | 14,198,400    |
| DCMホールディングス    | 34,600  | 690    | 23,874,000    |
| MonotaRO       | 10,700  | 1,959  | 20,961,300    |
| あいホールディングス     | 13,000  | 1,245  | 16,185,000    |
| J. フロントリテイリング  | 163,000 | 770    | 125,510,000   |
| ドトール・日レスHD     | 12,500  | 1,678  | 20,975,000    |
| マツモトキヨシHLDGS   | 14,100  | 3,280  | 46,248,000    |
| スタートトゥデイ       | 21,200  | 2,537  | 53,784,400    |
| 物語コーポレーション     | 1,300   | 3,135  | 4,075,500     |
| ココカラファイン       | 7,500   | 2,650  | 19,875,000    |
| 三越伊勢丹HD        | 136,000 | 1,444  | 196,384,000   |
| 東洋紡            | 315,000 | 193    | 60,795,000    |
| ユニチカ           | 237,000 | 63     | 14,931,000    |
| 富士紡ホールディングス    | 43,000  | 207    | 8,901,000     |
| 日清紡ホールディングス    | 48,000  | 946    | 45,408,000    |
| 倉敷紡績           | 86,000  | 181    | 15,566,000    |

|                |         |        |               |
|----------------|---------|--------|---------------|
| ダイワボウHD        | 68,000  | 207    | 14,076,000    |
| シキボウ           | 53,000  | 134    | 7,102,000     |
| 日東紡績           | 56,000  | 547    | 30,632,000    |
| トヨタ紡織          | 24,600  | 1,292  | 31,783,200    |
| ウエルシアHD        | 2,600   | 5,560  | 14,456,000    |
| クリエイトSDH       | 3,200   | 3,680  | 11,776,000    |
| バイタルKSKHD      | 15,000  | 714    | 10,710,000    |
| UKCホールディングス    | 5,000   | 1,655  | 8,275,000     |
| TOKAIホールディングス  | 40,400  | 339    | 13,695,600    |
| 日本毛織           | 25,000  | 729    | 18,225,000    |
| ダイドーリミテッド      | 9,900   | 639    | 6,326,100     |
| 野村不動産HLDS      | 44,600  | 2,271  | 101,286,600   |
| 常和ホールディングス     | 2,800   | 2,784  | 7,795,200     |
| フージャースHD       | 11,300  | 701    | 7,921,300     |
| オープンハウス        | 2,800   | 2,391  | 6,694,800     |
| 東急不動産HD        | 152,000 | 889    | 135,128,000   |
| 飯田GHD          | 30,000  | 2,131  | 63,930,000    |
| 帝国繊維           | 9,000   | 1,076  | 9,684,000     |
| 日本コークス工業       | 71,100  | 130    | 9,243,000     |
| あさひ            | 4,800   | 1,498  | 7,190,400     |
| コスモス薬品         | 3,400   | 11,330 | 38,522,000    |
| シップヘルスケアHD     | 9,900   | 4,040  | 39,996,000    |
| セブン&アイ・HLDS    | 284,500 | 3,895  | 1,108,127,500 |
| ツルハホールディングス    | 6,600   | 9,600  | 63,360,000    |
| サンマルクホールディングス  | 2,600   | 4,880  | 12,688,000    |
| トリドール          | 7,400   | 931    | 6,889,400     |
| クスリのアオキ        | 1,200   | 6,020  | 7,224,000     |
| 帝人             | 302,000 | 229    | 69,158,000    |
| 東レ             | 523,000 | 723    | 378,129,000   |
| クラレ            | 115,100 | 1,181  | 135,933,100   |
| 旭化成            | 451,000 | 813    | 366,663,000   |
| 宮地エンジニアリングG    | 27,000  | 255    | 6,885,000     |
| トーカロ           | 5,300   | 1,605  | 8,506,500     |
| SUMCO          | 45,300  | 908    | 41,132,400    |
| 住江織物           | 26,000  | 280    | 7,280,000     |
| アツギ            | 91,000  | 120    | 10,920,000    |
| セーレン           | 23,600  | 772    | 18,219,200    |
| 小松精練           | 16,000  | 549    | 8,784,000     |
| ワコールホールディングス   | 43,000  | 1,055  | 45,365,000    |
| ホギメディカル        | 4,800   | 5,280  | 25,344,000    |
| TSIホールディングス    | 35,100  | 634    | 22,253,400    |
| ITホールディングス     | 25,200  | 1,582  | 39,866,400    |
| グリー            | 35,200  | 998    | 35,129,600    |
| コーエーテクモHD      | 14,300  | 1,214  | 17,360,200    |
| 三菱総合研究所        | 3,800   | 2,087  | 7,930,600     |
| KLab           | 5,200   | 757    | 3,936,400     |
| ポルトゥウィン・ピットクル  | 2,300   | 3,225  | 7,417,500     |
| ネクソン           | 56,000  | 971    | 54,376,000    |
| ブロードリーフ        | 7,400   | 1,906  | 14,104,400    |
| 特種東海製紙         | 52,000  | 208    | 10,816,000    |
| ドワンゴ           | 6,400   | 2,639  | 16,889,600    |
| マクロミル          | 13,200  | 781    | 10,309,200    |
| ティーガイア         | 8,200   | 1,132  | 9,282,400     |
| GMOペイメントゲートウェイ | 2,800   | 3,985  | 11,158,000    |
| ザッパラス          | 6,300   | 764    | 4,813,200     |

|                 |         |       |             |
|-----------------|---------|-------|-------------|
| インターネットイニシアティブ  | 10,300  | 2,902 | 29,890,600  |
| ビットアイル          | 6,900   | 807   | 5,568,300   |
| 朝日ネット           | 11,900  | 487   | 5,795,300   |
| 王子ホールディングス      | 321,000 | 501   | 160,821,000 |
| 日本製紙            | 37,800  | 1,955 | 73,899,000  |
| 三菱製紙            | 131,000 | 88    | 11,528,000  |
| 北越紀州製紙          | 53,500  | 480   | 25,680,000  |
| 大王製紙            | 25,000  | 907   | 22,675,000  |
| レンゴー            | 57,000  | 599   | 34,143,000  |
| トーモク            | 31,000  | 335   | 10,385,000  |
| ザ・パック           | 5,700   | 1,918 | 10,932,600  |
| 昭和電工            | 494,000 | 149   | 73,606,000  |
| 住友化学            | 535,000 | 421   | 225,235,000 |
| 住友精化            | 17,000  | 820   | 13,940,000  |
| 日産化学            | 50,500  | 1,607 | 81,153,500  |
| ラサ工業            | 31,000  | 173   | 5,363,000   |
| クレハ             | 55,000  | 490   | 26,950,000  |
| 石原産業            | 139,000 | 114   | 15,846,000  |
| 日本曹達            | 49,000  | 650   | 31,850,000  |
| 東ソー             | 197,000 | 463   | 91,211,000  |
| トクヤマ            | 116,000 | 382   | 44,312,000  |
| セントラル硝子         | 72,000  | 341   | 24,552,000  |
| 東亜合成            | 87,000  | 437   | 38,019,000  |
| ダイソー            | 39,000  | 340   | 13,260,000  |
| 関東電化            | 23,000  | 250   | 5,750,000   |
| 電気化学            | 148,000 | 428   | 63,344,000  |
| イビデン            | 41,900  | 1,917 | 80,322,300  |
| 信越化学            | 129,300 | 5,950 | 769,335,000 |
| 日本カ-バイド         | 23,000  | 306   | 7,038,000   |
| 堺化学             | 33,000  | 311   | 10,263,000  |
| エア・ウォーター        | 60,000  | 1,393 | 83,580,000  |
| 大陽日酸            | 92,000  | 664   | 61,088,000  |
| 日本化学工業          | 36,000  | 137   | 4,932,000   |
| 日本パ-カラijing     | 18,000  | 2,087 | 37,566,000  |
| 高压ガス            | 13,000  | 583   | 7,579,000   |
| 四国化成            | 13,000  | 770   | 10,010,000  |
| 戸田工業            | 17,000  | 284   | 4,828,000   |
| ステラケミファ         | 4,500   | 1,576 | 7,092,000   |
| 保土谷化学           | 34,000  | 208   | 7,072,000   |
| 日本触媒            | 60,000  | 1,131 | 67,860,000  |
| 大日精化            | 34,000  | 448   | 15,232,000  |
| カネカ             | 89,000  | 665   | 59,185,000  |
| 協和発酵キリン         | 87,000  | 1,147 | 99,789,000  |
| 三菱瓦斯化学          | 113,000 | 859   | 97,067,000  |
| 三井化学            | 333,000 | 261   | 86,913,000  |
| J S R           | 65,500  | 1,855 | 121,502,500 |
| 東京応化工業          | 14,600  | 2,084 | 30,426,400  |
| 三菱ケミカルH L D G S | 453,000 | 480   | 217,440,000 |
| 日本合成化学          | 16,000  | 905   | 14,480,000  |
| ダイセル            | 93,000  | 790   | 73,470,000  |
| 住友ベ-クライト        | 58,000  | 361   | 20,938,000  |
| 積水化学            | 148,000 | 1,248 | 184,704,000 |
| 日本ゼオン           | 57,000  | 1,032 | 58,824,000  |
| アイカ工業           | 20,700  | 1,982 | 41,027,400  |
| 宇部興産            | 369,000 | 209   | 77,121,000  |

|               |         |         |               |
|---------------|---------|---------|---------------|
| 積水樹脂          | 12,000  | 1,453   | 17,436,000    |
| タキロン          | 24,000  | 414     | 9,936,000     |
| 旭有機材          | 39,000  | 217     | 8,463,000     |
| 日立化成          | 30,900  | 1,650   | 50,985,000    |
| リケンテクノス       | 14,000  | 483     | 6,762,000     |
| 大倉工業          | 22,000  | 365     | 8,030,000     |
| 積水化成品         | 29,000  | 273     | 7,917,000     |
| 群栄化学          | 21,000  | 476     | 9,996,000     |
| 日本化薬          | 52,000  | 1,472   | 76,544,000    |
| イーピーエス        | 91      | 117,400 | 10,683,400    |
| パナソニック インフォシス | 2,200   | 2,939   | 6,465,800     |
| アミューズ         | 3,400   | 1,999   | 6,796,600     |
| 野村総合研究所       | 38,500  | 3,270   | 125,895,000   |
| ケネディクス        | 85,900  | 485     | 41,661,500    |
| 電通            | 68,000  | 4,210   | 286,280,000   |
| インテージホールディングス | 6,400   | 1,242   | 7,948,800     |
| テイクアンドギヴニーズ   | 3,500   | 2,213   | 7,745,500     |
| 日本精化          | 8,400   | 635     | 5,334,000     |
| A D E K A     | 31,700  | 1,080   | 34,236,000    |
| 日油            | 61,000  | 746     | 45,506,000    |
| ミヨシ油脂         | 40,000  | 157     | 6,280,000     |
| 花 王           | 187,700 | 3,220   | 604,394,000   |
| 第一工業製薬        | 23,000  | 241     | 5,543,000     |
| 三洋化成          | 25,000  | 698     | 17,450,000    |
| 武田薬品          | 270,300 | 5,050   | 1,365,015,000 |
| アステラス製薬       | 166,500 | 5,960   | 992,340,000   |
| 大日本住友製薬       | 52,200  | 1,477   | 77,099,400    |
| 塩野義製薬         | 113,200 | 2,235   | 253,002,000   |
| 田辺三菱製薬        | 58,100  | 1,425   | 82,792,500    |
| あすか製薬         | 13,000  | 790     | 10,270,000    |
| 日本新薬          | 17,000  | 1,944   | 33,048,000    |
| 中外製薬          | 72,000  | 2,265   | 163,080,000   |
| 科研製薬          | 27,000  | 1,507   | 40,689,000    |
| エーザイ          | 88,900  | 3,965   | 352,488,500   |
| ロート製薬         | 31,000  | 1,635   | 50,685,000    |
| 小野薬品          | 32,800  | 8,010   | 262,728,000   |
| 久光製薬          | 22,200  | 5,080   | 112,776,000   |
| 持田製薬          | 5,600   | 5,890   | 32,984,000    |
| 参天製薬          | 26,400  | 4,790   | 126,456,000   |
| 扶桑薬品          | 33,000  | 337     | 11,121,000    |
| 日本ケミファ        | 17,000  | 462     | 7,854,000     |
| ツムラ           | 21,300  | 2,705   | 57,616,500    |
| 日医工           | 11,900  | 1,523   | 18,123,700    |
| テ ル モ         | 53,000  | 5,160   | 273,480,000   |
| みらかホールディングス   | 19,000  | 4,955   | 94,145,000    |
| キッセイ薬品工業      | 14,000  | 2,290   | 32,060,000    |
| 生化学工業         | 16,800  | 1,233   | 20,714,400    |
| 栄研化学          | 6,600   | 1,904   | 12,566,400    |
| 鳥居薬品          | 6,000   | 2,988   | 17,928,000    |
| 東和薬品          | 4,000   | 4,535   | 18,140,000    |
| 沢井製薬          | 10,300  | 7,130   | 73,439,000    |
| ゼリア新薬工業       | 12,000  | 2,091   | 25,092,000    |
| 第一三共          | 227,800 | 1,863   | 424,391,400   |
| キョーリン製薬HD     | 19,800  | 2,168   | 42,926,400    |
| 大幸薬品          | 3,900   | 2,384   | 9,297,600     |



|                |         |         |             |
|----------------|---------|---------|-------------|
| ダイト            | 3,300   | 1,413   | 4,662,900   |
| 大塚ホールディングス     | 141,800 | 2,899   | 411,078,200 |
| 大正製薬HD         | 17,100  | 7,100   | 121,410,000 |
| 大日本塗料          | 47,000  | 170     | 7,990,000   |
| 日本ペイント         | 62,000  | 1,707   | 105,834,000 |
| 関西ペイント         | 87,000  | 1,485   | 129,195,000 |
| 中国塗料           | 23,000  | 529     | 12,167,000  |
| 藤倉化成           | 13,000  | 538     | 6,994,000   |
| 太陽ホールディングス     | 6,600   | 3,195   | 21,087,000  |
| D I C          | 253,000 | 304     | 76,912,000  |
| サカタインクス        | 16,000  | 942     | 15,072,000  |
| 東洋インキSCホールディン  | 66,000  | 493     | 32,538,000  |
| T & K T O K A  | 3,500   | 2,168   | 7,588,000   |
| サニックス          | 11,100  | 918     | 10,189,800  |
| オリエンタルランド      | 19,300  | 14,470  | 279,271,000 |
| ダスキン           | 20,300  | 1,912   | 38,813,600  |
| パーク24          | 35,800  | 1,950   | 69,810,000  |
| 明光ネットワークジャパン   | 9,200   | 1,069   | 9,834,800   |
| ファルコSDホールディングス | 5,000   | 1,225   | 6,125,000   |
| フジ・メディア・HD     | 65,900  | 2,218   | 146,166,200 |
| ラウンドワン         | 22,800  | 789     | 17,989,200  |
| リゾートトラスト       | 12,300  | 3,645   | 44,833,500  |
| オービック          | 23,700  | 2,993   | 70,934,100  |
| ヤフー            | 493,200 | 570     | 281,124,000 |
| ビー・エム・エル       | 5,300   | 3,385   | 17,940,500  |
| トレンドマイクロ       | 30,500  | 3,650   | 111,325,000 |
| もしもしホットライン     | 14,400  | 1,076   | 15,494,400  |
| リソー教育          | 11,700  | 467     | 5,463,900   |
| 日本オラクル         | 13,600  | 3,935   | 53,516,000  |
| フューチャーアーキテクト   | 12,600  | 551     | 6,942,600   |
| シーエーシー         | 6,000   | 927     | 5,562,000   |
| ユー・エス・エス       | 87,100  | 1,379   | 120,110,900 |
| オービックビジネスC     | 3,700   | 3,230   | 11,951,000  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 8,200   | 4,070   | 33,374,000  |
| 大塚商会           | 6,100   | 12,510  | 76,311,000  |
| 総合メディカル        | 2,300   | 3,875   | 8,912,500   |
| セントラルスポーツ      | 4,200   | 1,469   | 6,169,800   |
| 電通国際情報S        | 6,500   | 1,098   | 7,137,000   |
| WOWOW          | 2,600   | 3,330   | 8,658,000   |
| 富士フイルムHLDGS    | 165,300 | 2,830   | 467,799,000 |
| コニカミノルタ        | 183,500 | 990     | 181,665,000 |
| 資生堂            | 128,600 | 1,623   | 208,717,800 |
| ライオン           | 85,000  | 592     | 50,320,000  |
| 高砂香料           | 29,000  | 609     | 17,661,000  |
| マンダム           | 7,600   | 3,165   | 24,054,000  |
| ミルボン           | 5,160   | 3,750   | 19,350,000  |
| ファンケル          | 18,200  | 1,075   | 19,565,000  |
| コーセー           | 11,700  | 3,290   | 38,493,000  |
| ドクターシーラボ       | 52      | 306,500 | 15,938,000  |
| ポーラ・オルビスHD     | 7,200   | 3,745   | 26,964,000  |
| ノエビアホールディングス   | 5,000   | 1,898   | 9,490,000   |
| エステー           | 4,900   | 989     | 4,846,100   |
| コニシ            | 6,200   | 1,974   | 12,238,800  |
| 長谷川香料          | 9,900   | 1,447   | 14,325,300  |
| 小林製薬           | 11,600  | 5,610   | 65,076,000  |

|              |           |         |               |
|--------------|-----------|---------|---------------|
| 荒川化学工業       | 7,600     | 915     | 6,954,000     |
| 日本高純度化学      | 29        | 208,000 | 6,032,000     |
| 新田ゼラチン       | 5,500     | 916     | 5,038,000     |
| アース製薬        | 5,700     | 3,800   | 21,660,000    |
| イハラケミカル      | 14,000    | 761     | 10,654,000    |
| 大成ラミック       | 2,700     | 2,515   | 6,790,500     |
| クミアイ化学       | 16,000    | 750     | 12,000,000    |
| 日本農薬         | 17,000    | 1,420   | 24,140,000    |
| 昭和シエル石油      | 65,600    | 1,095   | 71,832,000    |
| コスモ石油        | 198,000   | 195     | 38,610,000    |
| ニチレキ         | 10,000    | 923     | 9,230,000     |
| 東燃ゼネラル石油     | 104,000   | 965     | 100,360,000   |
| ユシロ化学        | 6,600     | 958     | 6,322,800     |
| 富士石油         | 22,300    | 323     | 7,202,900     |
| 出光興産         | 8,100     | 9,240   | 74,844,000    |
| JXホールディングス   | 803,500   | 521     | 418,623,500   |
| 横浜ゴム         | 82,000    | 1,014   | 83,148,000    |
| 東洋ゴム         | 61,000    | 591     | 36,051,000    |
| ブリヂストン       | 226,400   | 3,800   | 860,320,000   |
| 住友ゴム         | 56,400    | 1,437   | 81,046,800    |
| オカモト         | 39,000    | 327     | 12,753,000    |
| アキレス         | 66,000    | 146     | 9,636,000     |
| ニッタ          | 7,700     | 2,194   | 16,893,800    |
| 東海ゴム工業       | 14,100    | 985     | 13,888,500    |
| 三ツ星ベルト       | 21,000    | 590     | 12,390,000    |
| バンドー化学       | 31,000    | 402     | 12,462,000    |
| 鬼怒川ゴム        | 17,000    | 512     | 8,704,000     |
| 旭硝子          | 356,000   | 647     | 230,332,000   |
| 日本板硝子        | 356,000   | 126     | 44,856,000    |
| 石塚硝子         | 13,000    | 400     | 5,200,000     |
| 有沢製作所        | 13,500    | 577     | 7,789,500     |
| 日本電気硝子       | 151,000   | 530     | 80,030,000    |
| 住友大阪セメント     | 140,000   | 393     | 55,020,000    |
| 太平洋セメント      | 426,000   | 396     | 168,696,000   |
| デイ・シイ        | 8,400     | 627     | 5,266,800     |
| 日本ヒュ-ム       | 9,000     | 908     | 8,172,000     |
| 日本コンクリ-ト     | 14,000    | 475     | 6,650,000     |
| ジャパンパイル      | 6,500     | 997     | 6,480,500     |
| 東海カーボン       | 72,000    | 355     | 25,560,000    |
| 日本カーボン       | 44,000    | 195     | 8,580,000     |
| 東洋炭素         | 4,500     | 2,006   | 9,027,000     |
| ノリタケ         | 47,000    | 255     | 11,985,000    |
| TOTO         | 107,000   | 1,572   | 168,204,000   |
| 日本碍子         | 92,000    | 1,876   | 172,592,000   |
| 日本特殊陶業       | 62,000    | 2,408   | 149,296,000   |
| MARUWA       | 2,400     | 3,195   | 7,668,000     |
| 品川リフラクトリーズ   | 22,000    | 219     | 4,818,000     |
| 黒崎播磨         | 20,000    | 245     | 4,900,000     |
| フジインコーポレーテッド | 7,400     | 1,256   | 9,294,400     |
| ニチアス         | 38,000    | 712     | 27,056,000    |
| 新日鐵住金        | 3,053,000 | 334     | 1,019,702,000 |
| 神戸製鋼所        | 1,004,000 | 173     | 173,692,000   |
| 中山製鋼所        | 44,000    | 89      | 3,916,000     |
| 合同製鐵         | 44,000    | 179     | 7,876,000     |
| JFEホールディングス  | 184,600   | 2,385   | 440,271,000   |

|              |         |       |             |
|--------------|---------|-------|-------------|
| 日新製鋼HD       | 30,100  | 1,273 | 38,317,300  |
| 東京製鐵         | 40,500  | 504   | 20,412,000  |
| 共英製鋼         | 7,000   | 1,917 | 13,419,000  |
| 大和工業         | 14,700  | 3,245 | 47,701,500  |
| 東京鐵鋼         | 19,000  | 376   | 7,144,000   |
| 大阪製鐵         | 3,800   | 1,823 | 6,927,400   |
| 淀川製鋼所        | 54,000  | 433   | 23,382,000  |
| 東洋鋼鈹         | 19,000  | 469   | 8,911,000   |
| 丸一鋼管         | 23,700  | 2,522 | 59,771,400  |
| 大同特殊鋼        | 121,000 | 524   | 63,404,000  |
| 日本高周波        | 38,000  | 103   | 3,914,000   |
| 日本冶金工        | 58,000  | 335   | 19,430,000  |
| 山陽特殊製鋼       | 40,000  | 464   | 18,560,000  |
| 愛知製鋼         | 40,000  | 426   | 17,040,000  |
| 日立金属         | 64,000  | 1,421 | 90,944,000  |
| 大平洋金属        | 53,000  | 365   | 19,345,000  |
| 日本電工         | 35,000  | 292   | 10,220,000  |
| 栗本鉄工所        | 42,000  | 239   | 10,038,000  |
| 日本製鋼所        | 105,000 | 543   | 57,015,000  |
| 三菱製鋼         | 47,000  | 252   | 11,844,000  |
| 日本軽金属HD      | 174,200 | 133   | 23,168,600  |
| 三井金属         | 190,000 | 307   | 58,330,000  |
| 東邦亜鉛         | 48,000  | 337   | 16,176,000  |
| 三菱マテリアル      | 453,000 | 371   | 168,063,000 |
| 住友鋳山         | 187,000 | 1,298 | 242,726,000 |
| DOWAホールディングス | 81,000  | 1,000 | 81,000,000  |
| 古河機金         | 129,000 | 200   | 25,800,000  |
| 大阪チタニウム      | 8,300   | 1,721 | 14,284,300  |
| 東邦チタニウム      | 13,500  | 713   | 9,625,500   |
| UACJ         | 93,000  | 344   | 31,992,000  |
| 古河電工         | 234,000 | 248   | 58,032,000  |
| 住友電工         | 272,100 | 1,701 | 462,842,100 |
| フジクラ         | 119,000 | 478   | 56,882,000  |
| 昭和電線HLDGS    | 100,000 | 99    | 9,900,000   |
| タツタ電線        | 12,100  | 565   | 6,836,500   |
| リョービ         | 46,000  | 409   | 18,814,000  |
| アサヒHD        | 11,600  | 1,728 | 20,044,800  |
| 東洋製罐グループHD   | 51,500  | 2,077 | 106,965,500 |
| ホッカンホールディングス | 21,000  | 332   | 6,972,000   |
| コロナ          | 3,400   | 1,130 | 3,842,000   |
| 横河ブリッジHLDGS  | 14,000  | 1,376 | 19,264,000  |
| 駒井ハルテック      | 16,000  | 302   | 4,832,000   |
| 三和ホールディングス   | 63,000  | 664   | 41,832,000  |
| 文化シャツタ-      | 20,000  | 623   | 12,460,000  |
| 三協立山         | 9,900   | 2,076 | 20,552,400  |
| LIXILグループ    | 100,500 | 2,816 | 283,008,000 |
| ノーリツ         | 14,700  | 2,208 | 32,457,600  |
| 長府製作所        | 6,900   | 2,398 | 16,546,200  |
| リンナイ         | 11,200  | 7,750 | 86,800,000  |
| ユニプレス        | 11,600  | 1,911 | 22,167,600  |
| ダイニチ工業       | 4,600   | 798   | 3,670,800   |
| 岡部           | 15,500  | 1,133 | 17,561,500  |
| 東プレ          | 14,700  | 1,559 | 22,917,300  |
| 高周波熱錬        | 12,000  | 832   | 9,984,000   |
| 東京製綱         | 55,000  | 161   | 8,855,000   |

|               |         |        |             |
|---------------|---------|--------|-------------|
| パイオラックス       | 3,900   | 3,820  | 14,898,000  |
| 日本発条          | 57,900  | 1,147  | 66,411,300  |
| 三浦工業          | 11,100  | 2,649  | 29,403,900  |
| タクマ           | 23,000  | 901    | 20,723,000  |
| リブセンス         | 1,900   | 4,525  | 8,597,500   |
| ツガミ           | 24,000  | 606    | 14,544,000  |
| オークマ          | 49,000  | 1,113  | 54,537,000  |
| 東芝機械          | 41,000  | 561    | 23,001,000  |
| アマダ           | 112,000 | 910    | 101,920,000 |
| アイダエンジニア      | 18,200  | 1,061  | 19,310,200  |
| 富士機械製造        | 23,400  | 864    | 20,217,600  |
| 牧野フライス        | 37,000  | 853    | 31,561,000  |
| オーエスジー        | 30,200  | 1,778  | 53,695,600  |
| 旭ダイヤモンド       | 20,300  | 1,037  | 21,051,100  |
| D M G 森精機     | 38,400  | 1,729  | 66,393,600  |
| ディスコ          | 8,000   | 6,820  | 54,560,000  |
| 日東工器          | 3,600   | 1,850  | 6,660,000   |
| 豊田自動織機        | 62,200  | 4,490  | 279,278,000 |
| 豊和工業          | 6,100   | 840    | 5,124,000   |
| 大阪機工          | 37,000  | 138    | 5,106,000   |
| 島精機製作所        | 9,900   | 1,889  | 18,701,100  |
| 日阪製作所         | 11,000  | 940    | 10,340,000  |
| やまびこ          | 3,300   | 2,946  | 9,721,800   |
| ナプテスコ         | 32,600  | 2,359  | 76,903,400  |
| 三井海洋開発        | 6,000   | 2,968  | 17,808,000  |
| S M C         | 20,500  | 24,850 | 509,425,000 |
| 新川            | 7,900   | 632    | 4,992,800   |
| ホソカワミクロン      | 15,000  | 652    | 9,780,000   |
| ユニオンツール       | 3,900   | 2,336  | 9,110,400   |
| オイレス工業        | 7,400   | 2,042  | 15,110,800  |
| 日精エーエスピー      | 2,400   | 2,326  | 5,582,400   |
| サト - ホールディングス | 8,000   | 2,375  | 19,000,000  |
| 日精樹脂工業        | 7,400   | 594    | 4,395,600   |
| 小松製作所         | 336,700 | 2,089  | 703,366,300 |
| 住友重機械         | 199,000 | 467    | 92,933,000  |
| 日立建機          | 37,200  | 2,178  | 81,021,600  |
| 日工            | 12,000  | 599    | 7,188,000   |
| 巴工業           | 3,300   | 1,608  | 5,306,400   |
| 井関農機          | 75,000  | 303    | 22,725,000  |
| T O W A       | 7,900   | 463    | 3,657,700   |
| 丸山製作所         | 22,000  | 266    | 5,852,000   |
| 北川鉄工所         | 38,000  | 188    | 7,144,000   |
| クボタ           | 377,000 | 1,670  | 629,590,000 |
| 東洋エンジニア       | 42,000  | 387    | 16,254,000  |
| 三菱化工機         | 31,000  | 171    | 5,301,000   |
| 月島機械          | 13,000  | 1,057  | 13,741,000  |
| 帝国電機製作所       | 2,900   | 2,300  | 6,670,000   |
| 新東工業          | 19,700  | 769    | 15,149,300  |
| 渋谷工業          | 4,900   | 1,620  | 7,938,000   |
| アイチ コーポレーション  | 13,400  | 459    | 6,150,600   |
| 小森コーポレーション    | 18,000  | 1,680  | 30,240,000  |
| 鶴見製作所         | 7,000   | 1,031  | 7,217,000   |
| 住友精密          | 16,000  | 428    | 6,848,000   |
| 酒井重工業         | 16,000  | 371    | 5,936,000   |
| 荏原製作所         | 162,000 | 639    | 103,518,000 |

|               |           |       |               |
|---------------|-----------|-------|---------------|
| 石井鉄工所         | 15,000    | 300   | 4,500,000     |
| 西島製作所         | 9,400     | 970   | 9,118,000     |
| 千代田化工建        | 61,000    | 1,440 | 87,840,000    |
| ダイキン工業        | 94,300    | 6,340 | 597,862,000   |
| ト・ヨ・カネツ       | 42,000    | 288   | 12,096,000    |
| 栗田工業          | 42,300    | 2,146 | 90,775,800    |
| 椿本チエイン        | 38,000    | 784   | 29,792,000    |
| 大同工業          | 21,000    | 305   | 6,405,000     |
| 日本コンベヤ        | 30,000    | 137   | 4,110,000     |
| 日機装           | 23,000    | 1,253 | 28,819,000    |
| 木村化工機         | 8,100     | 475   | 3,847,500     |
| 新興プランテック      | 18,400    | 742   | 13,652,800    |
| アネスト岩田        | 17,000    | 659   | 11,203,000    |
| ダイフク          | 29,500    | 1,299 | 38,320,500    |
| 加藤製作所         | 17,000    | 639   | 10,863,000    |
| タダノ           | 31,000    | 1,370 | 42,470,000    |
| フジテック         | 21,000    | 1,306 | 27,426,000    |
| C K D         | 20,200    | 1,052 | 21,250,400    |
| キトー           | 5,200     | 1,791 | 9,313,200     |
| 平和            | 15,100    | 1,665 | 25,141,500    |
| 理想科学工業        | 5,800     | 2,049 | 11,884,200    |
| SANKYO        | 20,700    | 4,755 | 98,428,500    |
| 日本金銭機械        | 6,600     | 1,932 | 12,751,200    |
| マースエンジニアリング   | 4,900     | 1,901 | 9,314,900     |
| 福島工業          | 4,500     | 1,510 | 6,795,000     |
| ダイコク電機        | 3,500     | 2,000 | 7,000,000     |
| アマノ           | 20,900    | 947   | 19,792,300    |
| JUKI          | 50,000    | 220   | 11,000,000    |
| サンデン          | 41,000    | 433   | 17,753,000    |
| ブラザー工業        | 88,900    | 1,334 | 118,592,600   |
| マックス          | 13,000    | 1,094 | 14,222,000    |
| モリタホールディングス   | 14,000    | 844   | 11,816,000    |
| グローリー         | 20,600    | 2,647 | 54,528,200    |
| 新晃工業          | 6,300     | 710   | 4,473,000     |
| 大和冷機工業        | 15,000    | 699   | 10,485,000    |
| セガサミーホールディングス | 74,100    | 2,675 | 198,217,500   |
| 日本ピストンリング     | 41,000    | 191   | 7,831,000     |
| リケン           | 32,000    | 445   | 14,240,000    |
| T P R         | 8,500     | 1,619 | 13,761,500    |
| ホシザキ電機        | 15,000    | 3,500 | 52,500,000    |
| 大豊工業          | 6,800     | 1,180 | 8,024,000     |
| 日本精工          | 154,000   | 1,223 | 188,342,000   |
| N T N         | 162,000   | 457   | 74,034,000    |
| ジェイテクト        | 73,900    | 1,758 | 129,916,200   |
| 不二越           | 65,000    | 569   | 36,985,000    |
| ミネベア          | 96,000    | 733   | 70,368,000    |
| 日本トムソン        | 24,000    | 519   | 12,456,000    |
| T H K         | 42,700    | 2,458 | 104,956,600   |
| ユースン精機        | 4,300     | 2,037 | 8,759,100     |
| イーグル工業        | 9,000     | 1,708 | 15,372,000    |
| 日本ピラ - 工業     | 9,000     | 690   | 6,210,000     |
| キッツ           | 33,700    | 500   | 16,850,000    |
| 日立            | 1,658,000 | 768   | 1,273,344,000 |
| 東芝            | 1,363,000 | 428   | 583,364,000   |
| 三菱電機          | 690,000   | 1,254 | 865,260,000   |

|               |         |       |             |
|---------------|---------|-------|-------------|
| 富士電機          | 195,000 | 472   | 92,040,000  |
| 東洋電機製造        | 17,000  | 305   | 5,185,000   |
| 安川電機          | 77,000  | 1,521 | 117,117,000 |
| シンフォニア テクノロジー | 52,000  | 163   | 8,476,000   |
| 明電舎           | 68,000  | 376   | 25,568,000  |
| 山洋電気          | 12,000  | 613   | 7,356,000   |
| デンヨー          | 7,900   | 1,365 | 10,783,500  |
| 日立工機          | 20,600  | 739   | 15,223,400  |
| 三菱工業          | 14,500  | 717   | 10,396,500  |
| マキタ           | 44,800  | 5,240 | 234,752,000 |
| 東芝テック         | 44,000  | 667   | 29,348,000  |
| マブチモーター       | 9,800   | 6,190 | 60,662,000  |
| 日本電産          | 37,200  | 9,800 | 364,560,000 |
| 東光高岳HD        | 3,600   | 1,858 | 6,688,800   |
| ダイヘン          | 43,000  | 468   | 20,124,000  |
| JVCケンウッド      | 53,900  | 186   | 10,025,400  |
| 第一精工          | 3,700   | 1,215 | 4,495,500   |
| 日新電機          | 15,000  | 613   | 9,195,000   |
| 大崎電気          | 14,000  | 525   | 7,350,000   |
| オムロン          | 77,700  | 4,335 | 336,829,500 |
| 日東工業          | 10,700  | 1,587 | 16,980,900  |
| I D E C       | 11,100  | 856   | 9,501,600   |
| ジーエス・ユアサ コーポ  | 133,000 | 589   | 78,337,000  |
| メルコホールディングス   | 4,600   | 1,296 | 5,961,600   |
| 日本電気          | 957,000 | 226   | 216,282,000 |
| 富士通           | 668,000 | 497   | 331,996,000 |
| 沖電気           | 273,000 | 240   | 65,520,000  |
| 岩崎通信機         | 46,000  | 95    | 4,370,000   |
| 電気興業          | 22,000  | 697   | 15,334,000  |
| サンケン電気        | 39,000  | 697   | 27,183,000  |
| アイホン          | 3,900   | 1,708 | 6,661,200   |
| ルネサスエレクトロニクス  | 35,700  | 669   | 23,883,300  |
| セイコーエプソン      | 47,200  | 2,701 | 127,487,200 |
| ワコム           | 55,400  | 671   | 37,173,400  |
| アルバック         | 12,100  | 1,386 | 16,770,600  |
| アクセル          | 4,900   | 1,716 | 8,408,400   |
| E I Z O       | 6,800   | 2,557 | 17,387,600  |
| 日本信号          | 19,500  | 807   | 15,736,500  |
| 能美防災          | 10,000  | 1,002 | 10,020,000  |
| 日本無線          | 21,000  | 326   | 6,846,000   |
| パナソニック        | 788,600 | 1,183 | 932,913,800 |
| シャープ          | 499,000 | 330   | 164,670,000 |
| アンリツ          | 40,200  | 1,139 | 45,787,800  |
| 富士通ゼネラル       | 17,000  | 1,074 | 18,258,000  |
| 日立国際電気        | 14,000  | 1,409 | 19,726,000  |
| ソニー           | 378,800 | 1,780 | 674,264,000 |
| T D K         | 41,700  | 4,810 | 200,577,000 |
| ミツミ電機         | 27,900  | 876   | 24,440,400  |
| タムラ製作所        | 33,000  | 282   | 9,306,000   |
| アルプス電気        | 51,400  | 1,141 | 58,647,400  |
| パイオニア         | 97,800  | 215   | 21,027,000  |
| 日本電波工業        | 8,400   | 865   | 7,266,000   |
| 日本トリム         | 1,600   | 7,820 | 12,512,000  |
| ローランド ディー・ジー  | 3,400   | 3,270 | 11,118,000  |
| フオスタ - 電機     | 7,600   | 1,910 | 14,516,000  |

|                     |         |        |               |
|---------------------|---------|--------|---------------|
| クラリオン               | 52,000  | 143    | 7,436,000     |
| S M K               | 23,000  | 595    | 13,685,000    |
| 東 光                 | 39,000  | 342    | 13,338,000    |
| ホシデン                | 25,900  | 541    | 14,011,900    |
| ヒロセ電機               | 11,900  | 15,760 | 187,544,000   |
| 日本航空電子              | 19,000  | 1,276  | 24,244,000    |
| T O A               | 9,000   | 927    | 8,343,000     |
| 古野電気                | 8,700   | 696    | 6,055,200     |
| ユニデン                | 27,000  | 369    | 9,963,000     |
| アルパイン               | 15,700  | 1,377  | 21,618,900    |
| アイコム                | 4,600   | 2,398  | 11,030,800    |
| 船井電機                | 7,600   | 1,244  | 9,454,400     |
| 横河電機                | 75,800  | 1,535  | 116,353,000   |
| 新電元工業               | 23,000  | 584    | 13,432,000    |
| アズビル                | 20,700  | 2,318  | 47,982,600    |
| 日本光電工業              | 14,700  | 3,585  | 52,699,500    |
| 堀場製作所               | 13,000  | 3,385  | 44,005,000    |
| アドバンテスト             | 47,300  | 1,271  | 60,118,300    |
| エスベック               | 9,500   | 805    | 7,647,500     |
| キーエンス               | 15,600  | 42,000 | 655,200,000   |
| 日置電機                | 4,800   | 1,372  | 6,585,600     |
| シスメックス              | 28,800  | 6,110  | 175,968,000   |
| メガチップス              | 7,200   | 1,523  | 10,965,600    |
| O B A R A G R O U P | 4,900   | 3,070  | 15,043,000    |
| 日本電産コパル電子           | 9,500   | 579    | 5,500,500     |
| デンソー                | 170,200 | 5,140  | 874,828,000   |
| コーセル                | 10,400  | 1,207  | 12,552,800    |
| 日立メディコ              | 6,000   | 1,789  | 10,734,000    |
| オプテックス              | 5,400   | 1,700  | 9,180,000     |
| 千代田インテグレ            | 3,900   | 1,865  | 7,273,500     |
| レーザーテック             | 5,800   | 901    | 5,225,800     |
| スタンレー電気             | 49,600  | 2,282  | 113,187,200   |
| 岩崎電気                | 30,000  | 208    | 6,240,000     |
| ウシオ電機               | 42,400  | 1,366  | 57,918,400    |
| 日本セラミック             | 5,300   | 1,537  | 8,146,100     |
| 遠藤照明                | 3,200   | 2,002  | 6,406,400     |
| 日本デジタル研究所           | 6,300   | 1,348  | 8,492,400     |
| 函 研                 | 6,400   | 775    | 4,960,000     |
| 日本電子                | 26,000  | 471    | 12,246,000    |
| カ シ オ               | 73,200  | 1,235  | 90,402,000    |
| ファナック               | 77,000  | 17,940 | 1,381,380,000 |
| 日本シイエムケイ            | 21,400  | 281    | 6,013,400     |
| エンプラス               | 2,600   | 7,150  | 18,590,000    |
| ロ ー ム               | 36,100  | 4,505  | 162,630,500   |
| 浜松ホトニクス             | 26,900  | 4,035  | 108,541,500   |
| 三井ハイテック             | 10,500  | 716    | 7,518,000     |
| 新光電気工業              | 23,400  | 813    | 19,024,200    |
| 京 セ ラ               | 122,800 | 5,220  | 641,016,000   |
| 太陽誘電                | 34,600  | 1,335  | 46,191,000    |
| 村田製作所               | 72,200  | 8,990  | 649,078,000   |
| ユーシン                | 11,300  | 720    | 8,136,000     |
| 双葉電子工業              | 13,600  | 1,301  | 17,693,600    |
| 日東電工                | 59,600  | 4,220  | 251,512,000   |
| 北陸電気工業              | 43,000  | 168    | 7,224,000     |
| 東海理化電機              | 18,500  | 2,014  | 37,259,000    |

|             |           |       |               |
|-------------|-----------|-------|---------------|
| ニチコン        | 22,700    | 1,011 | 22,949,700    |
| 日本ケミコン      | 44,000    | 403   | 17,732,000    |
| K O A       | 10,100    | 1,056 | 10,665,600    |
| 三井造船        | 275,000   | 212   | 58,300,000    |
| 日立造船        | 54,100    | 784   | 42,414,400    |
| 佐世保重工業      | 61,000    | 113   | 6,893,000     |
| 三菱重工業       | 1,229,000 | 634   | 779,186,000   |
| 川崎重工業       | 539,000   | 421   | 226,919,000   |
| I H I       | 473,000   | 424   | 200,552,000   |
| 名村造船所       | 10,500    | 1,275 | 13,387,500    |
| 日本車輛        | 27,000    | 488   | 13,176,000    |
| F P G       | 5,600     | 1,031 | 5,773,600     |
| じもとホールディングス | 53,100    | 209   | 11,097,900    |
| 全国保証        | 8,300     | 4,400 | 36,520,000    |
| 日産自動車       | 967,800   | 890   | 861,342,000   |
| いすゞ自動車      | 400,000   | 617   | 246,800,000   |
| トヨタ自動車      | 961,200   | 6,200 | 5,959,440,000 |
| 日野自動車       | 87,000    | 1,539 | 133,893,000   |
| 三菱自動車工業     | 162,500   | 1,062 | 172,575,000   |
| エフテック       | 3,700     | 1,550 | 5,735,000     |
| 武蔵精密工業      | 8,200     | 2,229 | 18,277,800    |
| 日産車体        | 34,000    | 1,492 | 50,728,000    |
| 新明和工業       | 29,000    | 821   | 23,809,000    |
| 極東開発工業      | 12,800    | 1,289 | 16,499,200    |
| 日信工業        | 14,600    | 2,134 | 31,156,400    |
| トピー工業       | 65,000    | 193   | 12,545,000    |
| ティラド        | 32,000    | 269   | 8,608,000     |
| 曙ブレーキ       | 35,900    | 452   | 16,226,800    |
| タチエス        | 11,000    | 1,394 | 15,334,000    |
| N O K       | 33,400    | 1,655 | 55,277,000    |
| フタバ産業       | 24,500    | 381   | 9,334,500     |
| カヤバ工業       | 59,000    | 520   | 30,680,000    |
| 大同メタル工業     | 10,000    | 1,004 | 10,040,000    |
| プレス工業       | 30,000    | 411   | 12,330,000    |
| カルソニックカンセイ  | 48,000    | 536   | 25,728,000    |
| 太平洋工業       | 16,200    | 676   | 10,951,200    |
| ケーヒン        | 16,400    | 1,595 | 26,158,000    |
| 河西工業        | 13,000    | 686   | 8,918,000     |
| アイシン精機      | 62,700    | 4,105 | 257,383,500   |
| マ ッ ダ       | 1,030,000 | 482   | 496,460,000   |
| ダイハツ        | 72,300    | 1,714 | 123,922,200   |
| 今仙電機製作所     | 6,700     | 1,407 | 9,426,900     |
| 本田技研        | 621,200   | 4,215 | 2,618,358,000 |
| スズキ         | 144,100   | 2,719 | 391,807,900   |
| 富士重工業       | 235,000   | 2,824 | 663,640,000   |
| ヤマハ発動機      | 104,700   | 1,536 | 160,819,200   |
| ショーワ        | 17,100    | 1,622 | 27,736,200    |
| 小糸製作所       | 38,000    | 1,930 | 73,340,000    |
| T B K       | 11,000    | 547   | 6,017,000     |
| エクセディ       | 8,500     | 3,065 | 26,052,500    |
| ミツバ         | 13,400    | 1,606 | 21,520,400    |
| 豊田合成        | 22,200    | 2,396 | 53,191,200    |
| 愛三工業        | 10,700    | 981   | 10,496,700    |
| ヨロズ         | 6,500     | 1,868 | 12,142,000    |
| エフ・シー・シー    | 12,000    | 2,032 | 24,384,000    |



|               |         |         |               |
|---------------|---------|---------|---------------|
| シマノ           | 29,700  | 8,950   | 265,815,000   |
| タカタ           | 12,600  | 2,891   | 36,426,600    |
| テイ・エス テック     | 14,800  | 3,485   | 51,578,000    |
| 小野建           | 6,900   | 1,329   | 9,170,100     |
| カップ・クリエイトHD   | 6,850   | 1,940   | 13,289,000    |
| ナガイレーベン       | 9,000   | 1,605   | 14,445,000    |
| 三菱食品          | 7,600   | 2,517   | 19,129,200    |
| 良品計画          | 7,200   | 10,960  | 78,912,000    |
| 三城ホールディングス    | 8,400   | 454     | 3,813,600     |
| 松田産業          | 7,300   | 1,360   | 9,928,000     |
| メディパルHD       | 67,900  | 1,354   | 91,936,600    |
| アズワン          | 5,400   | 2,309   | 12,468,600    |
| シモジマ          | 4,700   | 966     | 4,540,200     |
| ドウシシャ         | 8,800   | 1,438   | 12,654,400    |
| コナカ           | 9,800   | 857     | 8,398,600     |
| コーナン商事        | 11,300  | 1,034   | 11,684,200    |
| 黒田電気          | 11,200  | 1,546   | 17,315,200    |
| ネットワンシステムズ    | 28,500  | 630     | 17,955,000    |
| ワタミ           | 10,300  | 1,383   | 14,244,900    |
| ドンキホーテホールディング | 20,000  | 6,170   | 123,400,000   |
| 西松屋チェーン       | 15,500  | 796     | 12,338,000    |
| ゼンショーホールディングス | 26,500  | 1,072   | 28,408,000    |
| ハピネット         | 5,300   | 850     | 4,505,000     |
| 幸楽苑           | 5,600   | 1,259   | 7,050,400     |
| トーメンエレクトロニクス  | 4,500   | 1,143   | 5,143,500     |
| サイゼリヤ         | 11,300  | 1,250   | 14,125,000    |
| ガリバーインターナショナル | 24,800  | 540     | 13,392,000    |
| ユナイテッドアローズ    | 9,000   | 3,795   | 34,155,000    |
| ハイデイ日高        | 4,500   | 2,063   | 9,283,500     |
| シークス          | 5,500   | 1,240   | 6,820,000     |
| 京都きもの友禅       | 6,500   | 1,049   | 6,818,500     |
| コロワイド         | 24,000  | 999     | 23,976,000    |
| 壱番屋           | 3,100   | 3,690   | 11,439,000    |
| マクニカ          | 3,900   | 2,735   | 10,666,500    |
| スギホールディングス    | 12,100  | 4,055   | 49,065,500    |
| 島津製作所         | 89,000  | 935     | 83,215,000    |
| J M S         | 24,000  | 291     | 6,984,000     |
| ブイ・テクノロジー     | 18      | 274,900 | 4,948,200     |
| スター精密         | 14,600  | 1,184   | 17,286,400    |
| 東京計器          | 27,000  | 291     | 7,857,000     |
| 東京精密          | 13,000  | 2,196   | 28,548,000    |
| マニー           | 2,600   | 3,605   | 9,373,000     |
| ニコン           | 128,900 | 1,944   | 250,581,600   |
| トプコン          | 18,900  | 1,486   | 28,085,400    |
| オリンパス         | 103,200 | 3,260   | 336,432,000   |
| 理研計器          | 9,300   | 854     | 7,942,200     |
| 大日本スクリーン      | 67,000  | 569     | 38,123,000    |
| キヤノン電子        | 7,600   | 1,958   | 14,880,800    |
| タムロン          | 5,900   | 2,425   | 14,307,500    |
| HOYA          | 167,100 | 2,846   | 475,566,600   |
| エー・アンド・デイ     | 7,800   | 621     | 4,843,800     |
| キヤノン          | 399,100 | 3,315   | 1,323,016,500 |
| リコー           | 208,000 | 1,070   | 222,560,000   |
| シチズンホールディングス  | 86,900  | 850     | 73,865,000    |
| リズム時計         | 47,000  | 136     | 6,392,000     |

|                |         |        |             |
|----------------|---------|--------|-------------|
| 大研医器           | 3,000   | 1,705  | 5,115,000   |
| パラマウントベッドHD    | 6,900   | 3,170  | 21,873,000  |
| 前田工織           | 5,800   | 1,117  | 6,478,600   |
| 永大産業           | 13,000  | 518    | 6,734,000   |
| バンダイナムコHLDGS   | 76,000  | 2,104  | 159,904,000 |
| フランスベッドHLDGS   | 51,000  | 196    | 9,996,000   |
| マーベラスAQL       | 11,600  | 766    | 8,885,600   |
| パイロットコーポレーション  | 6,300   | 3,530  | 22,239,000  |
| エイベックス・グループHD  | 12,800  | 2,239  | 28,659,200  |
| トッパン・フォームズ     | 14,000  | 913    | 12,782,000  |
| フジシールインターナショナル | 8,800   | 3,165  | 27,852,000  |
| タカラトミー         | 25,500  | 466    | 11,883,000  |
| 廣済堂            | 8,900   | 534    | 4,752,600   |
| アーク            | 24,300  | 289    | 7,022,700   |
| 大建工業           | 38,000  | 282    | 10,716,000  |
| きもと            | 6,200   | 902    | 5,592,400   |
| 凸版印刷           | 196,000 | 807    | 158,172,000 |
| 大日本印刷          | 210,000 | 1,077  | 226,170,000 |
| 共同印刷           | 27,000  | 288    | 7,776,000   |
| 日本写真印刷         | 12,100  | 1,521  | 18,404,100  |
| 藤森工業           | 6,700   | 2,489  | 16,676,300  |
| 宝印刷            | 7,600   | 674    | 5,122,400   |
| 前澤化成工業         | 6,900   | 1,025  | 7,072,500   |
| アシックス          | 68,300  | 1,669  | 113,992,700 |
| ツツミ            | 3,800   | 2,383  | 9,055,400   |
| ジェイエスピー        | 5,600   | 1,553  | 8,696,800   |
| ニチハ            | 10,000  | 1,409  | 14,090,000  |
| ローランド          | 7,700   | 1,320  | 10,164,000  |
| エフピコ           | 3,600   | 7,260  | 26,136,000  |
| 小松ウオール工業       | 3,200   | 2,019  | 6,460,800   |
| ヤマハ            | 51,700  | 1,591  | 82,254,700  |
| 河合楽器           | 35,000  | 188    | 6,580,000   |
| クリナップ          | 9,300   | 876    | 8,146,800   |
| ピジョン           | 11,400  | 4,840  | 55,176,000  |
| 天馬             | 7,100   | 1,425  | 10,117,500  |
| キングジム          | 5,400   | 669    | 3,612,600   |
| リンテック          | 16,300  | 1,842  | 30,024,600  |
| 東リ             | 30,000  | 208    | 6,240,000   |
| イトーキ           | 16,400  | 610    | 10,004,000  |
| 任天堂            | 42,400  | 13,030 | 552,472,000 |
| 三菱鉛筆           | 6,300   | 2,263  | 14,256,900  |
| 松風             | 5,300   | 855    | 4,531,500   |
| タカラスタンダ-ド      | 31,000  | 775    | 24,025,000  |
| コクヨ            | 36,800  | 775    | 28,520,000  |
| ニフコ            | 16,300  | 2,622  | 42,738,600  |
| グローブライド        | 42,000  | 147    | 6,174,000   |
| 岡村製作所          | 28,000  | 893    | 25,004,000  |
| 日本バルカー         | 39,000  | 272    | 10,608,000  |
| MUTOHホールディングス  | 11,000  | 503    | 5,533,000   |
| 伊藤忠            | 543,900 | 1,249  | 679,331,100 |
| 丸紅             | 597,000 | 717    | 428,049,000 |
| 高島             | 21,000  | 246    | 5,166,000   |
| ヨンドシーホールディングス  | 6,500   | 1,480  | 9,620,000   |
| 三陽商会           | 49,000  | 292    | 14,308,000  |
| 長瀬産業           | 38,800  | 1,214  | 47,103,200  |

|                |         |       |               |
|----------------|---------|-------|---------------|
| 蝶理             | 6,200   | 1,145 | 7,099,000     |
| 豊田通商           | 76,000  | 2,554 | 194,104,000   |
| オンワードホールディングス  | 48,000  | 781   | 37,488,000    |
| 三共生興           | 17,400  | 348   | 6,055,200     |
| 兼松             | 160,000 | 156   | 24,960,000    |
| 美津濃            | 36,000  | 520   | 18,720,000    |
| ファミリーマート       | 22,400  | 4,670 | 104,608,000   |
| ルック            | 18,000  | 282   | 5,076,000     |
| 三井物産           | 626,200 | 1,388 | 869,165,600   |
| 日本紙パルプ         | 38,000  | 321   | 12,198,000    |
| 東京エレクトロン       | 61,900  | 5,500 | 340,450,000   |
| 日立ハイテクノロジーズ    | 20,500  | 2,492 | 51,086,000    |
| カメイ            | 11,700  | 780   | 9,126,000     |
| スターゼン          | 43,000  | 267   | 11,481,000    |
| セイコーHD         | 45,000  | 497   | 22,365,000    |
| 山善             | 30,000  | 643   | 19,290,000    |
| 住友商事           | 402,300 | 1,239 | 498,449,700   |
| 日本ユニシス         | 17,300  | 893   | 15,448,900    |
| 内田洋行           | 23,000  | 276   | 6,348,000     |
| 三菱商事           | 530,600 | 1,950 | 1,034,670,000 |
| 第一実業           | 25,000  | 450   | 11,250,000    |
| キヤノンマーケティングJPN | 19,600  | 1,462 | 28,655,200    |
| 西華産業           | 36,000  | 242   | 8,712,000     |
| 菱洋エレクトロ        | 11,000  | 1,018 | 11,198,000    |
| ユアサ商事          | 79,000  | 203   | 16,037,000    |
| 神鋼商事           | 40,000  | 232   | 9,280,000     |
| 阪和興業           | 72,000  | 549   | 39,528,000    |
| カナデン           | 10,000  | 706   | 7,060,000     |
| 菱電商事           | 16,000  | 696   | 11,136,000    |
| ニプロ            | 37,200  | 916   | 34,075,200    |
| 岩谷産業           | 78,000  | 529   | 41,262,000    |
| すてきナイスグループ     | 36,000  | 242   | 8,712,000     |
| 昭光通商           | 46,000  | 167   | 7,682,000     |
| 兼松エレクトロニクス     | 6,400   | 1,263 | 8,083,200     |
| 三愛石油           | 22,000  | 465   | 10,230,000    |
| 稲畑産業           | 18,700  | 1,103 | 20,626,100    |
| ゴールドウイン        | 19,000  | 462   | 8,778,000     |
| ユニ・チャーム        | 44,000  | 6,540 | 287,760,000   |
| デサント           | 19,000  | 690   | 13,110,000    |
| ワキタ            | 11,000  | 1,189 | 13,079,000    |
| ヤマトインタナショナル    | 10,200  | 431   | 4,396,200     |
| 東邦ホールディングス     | 22,200  | 1,699 | 37,717,800    |
| サンゲツ           | 12,500  | 2,537 | 31,712,500    |
| ミツウロコグループ      | 12,300  | 532   | 6,543,600     |
| シナネン           | 19,000  | 401   | 7,619,000     |
| 伊藤忠エネクス        | 19,700  | 540   | 10,638,000    |
| サンリオ           | 17,200  | 4,155 | 71,466,000    |
| リョーサン          | 11,000  | 2,127 | 23,397,000    |
| 新光商事           | 9,500   | 842   | 7,999,000     |
| トーヨー           | 21,000  | 374   | 7,854,000     |
| 三信電気           | 16,100  | 713   | 11,479,300    |
| 東陽テクニカ         | 10,900  | 1,053 | 11,477,700    |
| モスフードサービス      | 10,300  | 1,944 | 20,023,200    |
| 加賀電子           | 6,600   | 1,163 | 7,675,800     |
| 三益半導体          | 8,100   | 860   | 6,966,000     |

|                 |           |        |               |
|-----------------|-----------|--------|---------------|
| 木曽路             | 8,800     | 1,823  | 16,042,400    |
| 千趣会             | 15,100    | 883    | 13,333,300    |
| ケーヨー            | 11,700    | 460    | 5,382,000     |
| アデランス           | 10,600    | 1,112  | 11,787,200    |
| 上新電機            | 16,000    | 780    | 12,480,000    |
| 日本瓦斯            | 10,000    | 1,044  | 10,440,000    |
| ロイヤルホールディングス    | 12,800    | 1,565  | 20,032,000    |
| いなげや            | 5,800     | 976    | 5,660,800     |
| 島忠              | 15,700    | 2,383  | 37,413,100    |
| チヨダ             | 8,500     | 1,971  | 16,753,500    |
| ライフコーポレーション     | 3,400     | 1,570  | 5,338,000     |
| カスミ             | 20,900    | 629    | 13,146,100    |
| リンガーハット         | 9,100     | 1,471  | 13,386,100    |
| AOKIホールディングス    | 6,000     | 3,305  | 19,830,000    |
| オークワ            | 11,000    | 884    | 9,724,000     |
| コメリ             | 10,800    | 2,640  | 28,512,000    |
| 青山商事            | 18,900    | 2,748  | 51,937,200    |
| しまむら            | 7,900     | 10,270 | 81,133,000    |
| 高島屋             | 93,000    | 992    | 92,256,000    |
| 松屋              | 14,400    | 1,039  | 14,961,600    |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 40,000    | 814    | 32,560,000    |
| 近鉄百貨店           | 30,000    | 339    | 10,170,000    |
| パルコ             | 8,100     | 920    | 7,452,000     |
| 丸井グループ          | 90,900    | 1,035  | 94,081,500    |
| クレディセゾン         | 56,000    | 2,741  | 153,496,000   |
| アクシアルリテイリング     | 5,400     | 1,510  | 8,154,000     |
| ダイエー            | 44,350    | 337    | 14,945,950    |
| イズミヤ            | 31,000    | 457    | 14,167,000    |
| イオン             | 267,500   | 1,366  | 365,405,000   |
| ユニーグループ・HD      | 69,600    | 648    | 45,100,800    |
| イズミ             | 15,100    | 3,135  | 47,338,500    |
| 東武ストア           | 17,000    | 258    | 4,386,000     |
| 平和堂             | 14,400    | 1,483  | 21,355,200    |
| フジ              | 6,100     | 1,766  | 10,772,600    |
| ヤオコー            | 3,900     | 4,160  | 16,224,000    |
| ゼビオ             | 8,600     | 1,980  | 17,028,000    |
| ケーズホールディングス     | 14,400    | 3,075  | 44,280,000    |
| Palta           | 10,800    | 1,299  | 14,029,200    |
| 新生銀行            | 600,000   | 249    | 149,400,000   |
| あおぞら銀行          | 376,000   | 292    | 109,792,000   |
| 三菱UFJフィナンシャルG   | 5,163,000 | 649    | 3,350,787,000 |
| りそなホールディングス     | 654,800   | 515    | 337,222,000   |
| 三井住友トラストHD      | 1,341,000 | 524    | 702,684,000   |
| 三井住友フィナンシャルG    | 515,200   | 5,180  | 2,668,736,000 |
| 第四銀行            | 88,000    | 347    | 30,536,000    |
| 北越銀行            | 82,000    | 207    | 16,974,000    |
| 西日本シティ銀行        | 237,000   | 270    | 63,990,000    |
| 千葉銀行            | 262,000   | 691    | 181,042,000   |
| 横浜銀行            | 448,000   | 550    | 246,400,000   |
| 常陽銀行            | 248,000   | 508    | 125,984,000   |
| 群馬銀行            | 151,000   | 562    | 84,862,000    |
| 武蔵野銀行           | 11,100    | 3,375  | 37,462,500    |
| 千葉興業銀行          | 15,900    | 741    | 11,781,900    |
| 筑波銀行            | 32,600    | 360    | 11,736,000    |
| 東京都民銀行          | 13,100    | 1,043  | 13,663,300    |

|              |           |       |               |
|--------------|-----------|-------|---------------|
| 七十七銀行        | 106,000   | 492   | 52,152,000    |
| 青森銀行         | 58,000    | 267   | 15,486,000    |
| 秋田銀行         | 55,000    | 278   | 15,290,000    |
| 山形銀行         | 45,000    | 428   | 19,260,000    |
| 岩手銀行         | 4,600     | 4,910 | 22,586,000    |
| 東邦銀行         | 65,000    | 316   | 20,540,000    |
| みちのく銀行       | 50,000    | 204   | 10,200,000    |
| ふくおかフィナンシャルG | 278,000   | 443   | 123,154,000   |
| 静岡銀行         | 199,000   | 1,099 | 218,701,000   |
| 十六銀行         | 86,000    | 368   | 31,648,000    |
| スルガ銀行        | 66,000    | 1,660 | 109,560,000   |
| 八十二銀行        | 124,000   | 593   | 73,532,000    |
| 山梨中央銀行       | 47,000    | 450   | 21,150,000    |
| 大垣共立銀行       | 89,000    | 280   | 24,920,000    |
| 福井銀行         | 67,000    | 237   | 15,879,000    |
| 北國銀行         | 78,000    | 357   | 27,846,000    |
| 清水銀行         | 2,900     | 2,758 | 7,998,200     |
| 滋賀銀行         | 63,000    | 530   | 33,390,000    |
| 南都銀行         | 67,000    | 383   | 25,661,000    |
| 百五銀行         | 63,000    | 401   | 25,263,000    |
| 京都銀行         | 128,000   | 827   | 105,856,000   |
| 紀陽銀行         | 24,700    | 1,391 | 34,357,700    |
| ほくほくフィナンシャルG | 458,000   | 201   | 92,058,000    |
| 広島銀行         | 198,000   | 411   | 81,378,000    |
| 山陰合同銀行       | 43,000    | 727   | 31,261,000    |
| 中国銀行         | 49,600    | 1,300 | 64,480,000    |
| 伊予銀行         | 71,000    | 1,008 | 71,568,000    |
| 百十四銀行        | 76,000    | 352   | 26,752,000    |
| 四国銀行         | 58,000    | 230   | 13,340,000    |
| 阿波銀行         | 57,000    | 511   | 29,127,000    |
| 鹿児島銀行        | 48,000    | 647   | 31,056,000    |
| 大分銀行         | 46,000    | 385   | 17,710,000    |
| 宮崎銀行         | 52,000    | 290   | 15,080,000    |
| 肥後銀行         | 57,000    | 549   | 31,293,000    |
| 佐賀銀行         | 58,000    | 220   | 12,760,000    |
| 十八銀行         | 55,000    | 233   | 12,815,000    |
| 沖縄銀行         | 5,400     | 3,870 | 20,898,000    |
| 琉球銀行         | 15,100    | 1,181 | 17,833,100    |
| 八千代銀行        | 3,700     | 2,649 | 9,801,300     |
| セブン銀行        | 253,000   | 384   | 97,152,000    |
| みずほフィナンシャルG  | 8,814,100 | 214   | 1,886,217,400 |
| 山口フィナンシャルG   | 67,000    | 939   | 62,913,000    |
| 芙蓉総合リース      | 7,500     | 3,870 | 29,025,000    |
| 興銀リース        | 12,300    | 2,864 | 35,227,200    |
| 東京センチュリーリース  | 16,100    | 3,310 | 53,291,000    |
| SBIホールディングス  | 81,800    | 1,409 | 115,256,200   |
| 日本証券金融       | 31,500    | 747   | 23,530,500    |
| アイフル         | 125,600   | 419   | 52,626,400    |
| ポケットカード      | 8,200     | 816   | 6,691,200     |
| 名古屋銀行        | 64,000    | 339   | 21,696,000    |
| 北洋銀行         | 103,000   | 423   | 43,569,000    |
| 愛知銀行         | 2,700     | 4,940 | 13,338,000    |
| 中京銀行         | 21,000    | 178   | 3,738,000     |
| 大光銀行         | 31,000    | 224   | 6,944,000     |
| 愛媛銀行         | 54,000    | 219   | 11,826,000    |

|                 |           |       |               |
|-----------------|-----------|-------|---------------|
| トマト銀行           | 37,000    | 175   | 6,475,000     |
| みなと銀行           | 72,000    | 173   | 12,456,000    |
| 京葉銀行            | 56,000    | 498   | 27,888,000    |
| 関西アーバン銀行        | 96,000    | 119   | 11,424,000    |
| 栃木銀行            | 40,000    | 396   | 15,840,000    |
| 北日本銀行           | 2,500     | 2,576 | 6,440,000     |
| 東和銀行            | 83,000    | 91    | 7,553,000     |
| 福島銀行            | 108,000   | 86    | 9,288,000     |
| リコーリース          | 5,700     | 3,030 | 17,271,000    |
| イオンフィナンシャルサービス  | 39,400    | 2,620 | 103,228,000   |
| アコム             | 137,900   | 334   | 46,058,600    |
| ジャックス           | 44,000    | 484   | 21,296,000    |
| オリコ             | 153,300   | 237   | 36,332,100    |
| 日立キャピタル         | 13,600    | 2,825 | 38,420,000    |
| オリックス           | 414,200   | 1,726 | 714,909,200   |
| 三菱UFJリース        | 173,300   | 599   | 103,806,700   |
| ジャフコ            | 9,500     | 5,400 | 51,300,000    |
| トモニホールディングス     | 55,400    | 402   | 22,270,800    |
| 大和証券G本社         | 675,000   | 974   | 657,450,000   |
| 野村ホールディングス      | 1,392,600 | 772   | 1,075,087,200 |
| 岡三証券グループ        | 54,000    | 915   | 49,410,000    |
| 丸三証券            | 21,600    | 853   | 18,424,800    |
| 東洋証券            | 33,000    | 347   | 11,451,000    |
| 東海東京HD          | 72,300    | 894   | 64,636,200    |
| 光世証券            | 23,000    | 267   | 6,141,000     |
| 水戸証券            | 23,000    | 480   | 11,040,000    |
| いちよし証券          | 14,300    | 1,545 | 22,093,500    |
| 松井証券            | 35,800    | 1,233 | 44,141,400    |
| NKSJホールディングス    | 151,400   | 2,773 | 419,832,200   |
| 日本取引所グループ       | 100,300   | 2,876 | 288,462,800   |
| マネックスG          | 74,500    | 413   | 30,768,500    |
| カブドットコム証券       | 27,600    | 560   | 15,456,000    |
| 極東証券            | 9,200     | 1,884 | 17,332,800    |
| 岩井コスモホールディング    | 7,200     | 1,363 | 9,813,600     |
| フィデアホール         | 49,100    | 196   | 9,623,600     |
| 池田泉州HD          | 50,000    | 474   | 23,700,000    |
| MS&AD           | 203,500   | 2,692 | 547,822,000   |
| SONY FH         | 65,800    | 1,840 | 121,072,000   |
| 第一生命            | 342,600   | 1,644 | 563,234,400   |
| 東京海上HD          | 263,600   | 3,365 | 887,014,000   |
| イー・ギャランティ       | 2,400     | 2,229 | 5,349,600     |
| NECキャピタルソリューション | 2,800     | 2,886 | 8,080,800     |
| T&Dホールディングス     | 234,900   | 1,368 | 321,343,200   |
| 三井不動産           | 321,000   | 3,450 | 1,107,450,000 |
| 三菱地所            | 477,000   | 2,905 | 1,385,685,000 |
| 平和不動産           | 14,800    | 1,739 | 25,737,200    |
| 東京建物            | 140,000   | 1,059 | 148,260,000   |
| ダイビル            | 20,800    | 1,179 | 24,523,200    |
| 京阪神ビルディング       | 15,300    | 524   | 8,017,200     |
| 住友不動産           | 163,000   | 4,825 | 786,475,000   |
| 大京              | 116,000   | 270   | 31,320,000    |
| テーオーシー          | 24,400    | 782   | 19,080,800    |
| 東京楽天地           | 17,000    | 468   | 7,956,000     |
| レオパレス21         | 66,100    | 531   | 35,099,100    |
| フジ住宅            | 11,600    | 655   | 7,598,000     |

|              |           |        |               |
|--------------|-----------|--------|---------------|
| 空港施設         | 9,200     | 817    | 7,516,400     |
| 住友不動産販売      | 5,100     | 3,085  | 15,733,500    |
| ゴールドクレスト     | 5,600     | 2,632  | 14,739,200    |
| リロ・ホールディング   | 3,000     | 4,915  | 14,745,000    |
| タカラレーベン      | 24,600    | 322    | 7,921,200     |
| イオンモール       | 43,500    | 2,744  | 119,364,000   |
| トーセイ         | 10,200    | 767    | 7,823,400     |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 42,200    | 1,086  | 45,829,200    |
| サンフロンティア不動産  | 6,900     | 1,422  | 9,811,800     |
| 東武鉄道         | 398,000   | 496    | 197,408,000   |
| 相鉄ホールディングス   | 119,000   | 345    | 41,055,000    |
| 東京急行         | 410,000   | 650    | 266,500,000   |
| 京浜急行         | 177,000   | 829    | 146,733,000   |
| 小田急電鉄        | 223,000   | 910    | 202,930,000   |
| 京王電鉄         | 195,000   | 671    | 130,845,000   |
| 京成電鉄         | 107,000   | 940    | 100,580,000   |
| 富士急行         | 21,000    | 830    | 17,430,000    |
| 新京成電鉄        | 18,000    | 368    | 6,624,000     |
| 東日本旅客鉄道      | 127,000   | 8,330  | 1,057,910,000 |
| 西日本旅客鉄道      | 64,200    | 4,470  | 286,974,000   |
| 東海旅客鉄道       | 61,900    | 12,190 | 754,561,000   |
| 鴻池運輸         | 4,600     | 1,487  | 6,840,200     |
| 西日本鉄道        | 95,000    | 378    | 35,910,000    |
| ハマキョウレックス    | 2,700     | 2,737  | 7,389,900     |
| 近畿日本鉄道       | 695,000   | 354    | 246,030,000   |
| 阪急阪神HLDGS    | 462,000   | 548    | 253,176,000   |
| 南海電鉄         | 148,000   | 362    | 53,576,000    |
| 京阪電鉄         | 147,000   | 387    | 56,889,000    |
| 神戸電鉄         | 29,000    | 309    | 8,961,000     |
| 名古屋鉄道        | 243,000   | 297    | 72,171,000    |
| 山陽電鉄         | 38,000    | 404    | 15,352,000    |
| 日本通運         | 276,000   | 516    | 142,416,000   |
| ヤマトホールディングス  | 128,600   | 2,124  | 273,146,400   |
| 山九           | 86,000    | 386    | 33,196,000    |
| 日新           | 37,000    | 290    | 10,730,000    |
| 丸全昭和運輸       | 30,000    | 350    | 10,500,000    |
| センコー         | 32,000    | 547    | 17,504,000    |
| トナミホールディングス  | 22,000    | 219    | 4,818,000     |
| 日本梱包運輸       | 21,800    | 1,833  | 39,959,400    |
| 福山通運         | 43,000    | 566    | 24,338,000    |
| セイノーホールディングス | 49,000    | 1,059  | 51,891,000    |
| 神奈川中央交通      | 15,000    | 509    | 7,635,000     |
| 日立物流         | 14,600    | 1,610  | 23,506,000    |
| 日本郵船         | 589,000   | 309    | 182,001,000   |
| 商船三井         | 390,000   | 442    | 172,380,000   |
| 川崎汽船         | 311,000   | 236    | 73,396,000    |
| NSユナイテッド海運   | 32,000    | 283    | 9,056,000     |
| 乾汽船          | 12,100    | 358    | 4,331,800     |
| 飯野海運         | 29,700    | 617    | 18,324,900    |
| 日本航空         | 57,700    | 5,060  | 291,962,000   |
| ANAホールディングス  | 1,360,000 | 208    | 282,880,000   |
| 三菱倉庫         | 46,000    | 1,605  | 73,830,000    |
| 三井倉庫         | 36,000    | 459    | 16,524,000    |
| 住友倉庫         | 48,000    | 576    | 27,648,000    |
| 渋沢倉庫         | 18,000    | 381    | 6,858,000     |

|                |         |       |               |
|----------------|---------|-------|---------------|
| ヤマタネ           | 43,000  | 175   | 7,525,000     |
| 東陽倉庫           | 22,000  | 257   | 5,654,000     |
| 日本トランスシティ      | 24,000  | 335   | 8,040,000     |
| 安田倉庫           | 6,300   | 1,081 | 6,810,300     |
| 東洋埠頭           | 24,000  | 240   | 5,760,000     |
| 上組             | 82,000  | 931   | 76,342,000    |
| 郵船ロジスティクス      | 8,200   | 1,297 | 10,635,400    |
| 近鉄エクスプレス       | 6,500   | 4,060 | 26,390,000    |
| 東京放送HD         | 37,200  | 1,278 | 47,541,600    |
| 日本テレビHLDS      | 67,800  | 1,863 | 126,311,400   |
| テレビ朝日          | 17,600  | 2,333 | 41,060,800    |
| スカパーJSA THD    | 55,100  | 550   | 30,305,000    |
| テレビ東京HD        | 6,500   | 1,642 | 10,673,000    |
| コネクシオ          | 11,200  | 799   | 8,948,800     |
| 日本電信電話         | 267,900 | 5,480 | 1,468,092,000 |
| KDDI           | 211,800 | 6,350 | 1,344,930,000 |
| 光通信            | 6,300   | 8,050 | 50,715,000    |
| NTTドコモ         | 561,200 | 1,669 | 936,642,800   |
| GMOインターネット     | 22,800  | 1,344 | 30,643,200    |
| 学研ホールディングス     | 30,000  | 291   | 8,730,000     |
| ゼンリン           | 10,500  | 988   | 10,374,000    |
| KADOKAWA       | 6,700   | 3,575 | 23,952,500    |
| 東京電力           | 587,000 | 535   | 314,045,000   |
| 中部電力           | 227,500 | 1,301 | 295,977,500   |
| 関西電力           | 281,800 | 1,154 | 325,197,200   |
| 中国電力           | 94,900  | 1,566 | 148,613,400   |
| 北陸電力           | 67,600  | 1,349 | 91,192,400    |
| 東北電力           | 172,100 | 1,125 | 193,612,500   |
| 四国電力           | 62,200  | 1,501 | 93,362,200    |
| 九州電力           | 151,800 | 1,281 | 194,455,800   |
| 北海道電力          | 64,500  | 1,160 | 74,820,000    |
| 沖縄電力           | 5,000   | 3,320 | 16,600,000    |
| 電源開発           | 42,700  | 3,045 | 130,021,500   |
| 東京瓦斯           | 806,000 | 510   | 411,060,000   |
| 大阪瓦斯           | 712,000 | 413   | 294,056,000   |
| 東邦瓦斯           | 173,000 | 490   | 84,770,000    |
| 北海道瓦斯          | 21,000  | 270   | 5,670,000     |
| 西部瓦斯           | 87,000  | 244   | 21,228,000    |
| 静岡瓦斯           | 20,600  | 608   | 12,524,800    |
| 松竹             | 47,000  | 933   | 43,851,000    |
| 東宝             | 49,400  | 2,198 | 108,581,200   |
| エイチ・アイ・エス      | 6,000   | 5,490 | 32,940,000    |
| 東映             | 32,000  | 582   | 18,624,000    |
| NTTデータ         | 48,500  | 3,640 | 176,540,000   |
| 共立メンテナンス       | 3,900   | 3,755 | 14,644,500    |
| イチネンホールディングス   | 12,200  | 751   | 9,162,200     |
| インファーマシーズ      | 4,600   | 4,900 | 22,540,000    |
| 東京テアトル         | 42,000  | 154   | 6,468,000     |
| よみうりランド        | 16,000  | 691   | 11,056,000    |
| 東京都競馬          | 57,000  | 382   | 21,774,000    |
| カナモト           | 9,000   | 2,582 | 23,238,000    |
| 東京ドーム          | 55,000  | 672   | 36,960,000    |
| DTS            | 7,900   | 1,785 | 14,101,500    |
| スクウェア・エニックス・HD | 24,900  | 1,811 | 45,093,900    |
| カプコン           | 17,900  | 1,923 | 34,421,700    |



|                 |         |        |                 |
|-----------------|---------|--------|-----------------|
| 西尾レントオール        | 4,200   | 2,608  | 10,953,600      |
| 日本空港ビルデング       | 23,800  | 2,215  | 52,717,000      |
| トランス・コスモス       | 10,100  | 1,851  | 18,695,100      |
| 乃村工藝社           | 15,000  | 819    | 12,285,000      |
| ジャステック          | 8,200   | 740    | 6,068,000       |
| S C S K         | 16,500  | 2,555  | 42,157,500      |
| 藤田観光            | 21,000  | 383    | 8,043,000       |
| 日本管財            | 3,100   | 1,883  | 5,837,300       |
| トーカイ            | 4,200   | 2,830  | 11,886,000      |
| セコム             | 74,900  | 6,050  | 453,145,000     |
| アイネス            | 13,000  | 648    | 8,424,000       |
| 丹青社             | 9,000   | 723    | 6,507,000       |
| メイテック           | 10,400  | 2,641  | 27,466,400      |
| T K C           | 6,300   | 1,685  | 10,615,500      |
| アサツー ディ・ケイ      | 13,100  | 2,490  | 32,619,000      |
| 富士ソフト           | 9,400   | 2,272  | 21,356,800      |
| 応用地質            | 7,500   | 1,628  | 12,210,000      |
| 船井総合研究所         | 11,400  | 851    | 9,701,400       |
| N S D           | 16,600  | 1,211  | 20,102,600      |
| コナミ             | 31,100  | 2,447  | 76,101,700      |
| ベネッセホールディングス    | 24,100  | 3,935  | 94,833,500      |
| イオンディライト        | 7,500   | 1,995  | 14,962,500      |
| ナック             | 4,500   | 1,589  | 7,150,500       |
| ニチイ学館           | 17,400  | 834    | 14,511,600      |
| ダイセキ            | 11,400  | 1,921  | 21,899,400      |
| 日鉄住金物産          | 48,000  | 367    | 17,616,000      |
| トラスコ中山          | 8,700   | 2,297  | 19,983,900      |
| ヤマダ電機           | 266,300 | 341    | 90,808,300      |
| オートバックスセブン      | 24,300  | 1,579  | 38,369,700      |
| アークランドサカモト      | 5,700   | 1,682  | 9,587,400       |
| ニトリホールディングス     | 13,300  | 9,590  | 127,547,000     |
| 吉野家ホールディングス     | 20,300  | 1,207  | 24,502,100      |
| 加藤産業            | 10,800  | 1,872  | 20,217,600      |
| イエローハット         | 6,600   | 1,899  | 12,533,400      |
| 富士エレクトロニクス      | 5,000   | 1,314  | 6,570,000       |
| 松屋フーズ           | 3,600   | 1,703  | 6,130,800       |
| J B C Cホールディングス | 7,200   | 759    | 5,464,800       |
| サガミチェーン         | 11,000  | 892    | 9,812,000       |
| 日 伝             | 3,100   | 2,197  | 6,810,700       |
| 因幡電機産業          | 9,600   | 3,060  | 29,376,000      |
| 王将フードサービス       | 3,800   | 3,110  | 11,818,000      |
| プレナス            | 8,000   | 2,294  | 18,352,000      |
| ミニストップ          | 7,700   | 1,614  | 12,427,800      |
| アークス            | 12,200  | 1,930  | 23,546,000      |
| バ ロ ー           | 15,500  | 1,351  | 20,940,500      |
| ミスミグループ本社       | 27,100  | 3,135  | 84,958,500      |
| ベ ル ク           | 4,800   | 1,795  | 8,616,000       |
| タキヒヨー           | 10,000  | 402    | 4,020,000       |
| ファーストリテイリング     | 15,900  | 39,000 | 620,100,000     |
| ソフトバンク          | 335,100 | 8,930  | 2,992,443,000   |
| スズケン            | 28,100  | 3,290  | 92,449,000      |
| サンドラッグ          | 14,200  | 4,640  | 65,888,000      |
| 東京デリカ           | 4,100   | 1,402  | 5,748,200       |
| ベルーナ            | 19,300  | 481    | 9,283,300       |
| 合計              |         |        | 122,192,491,830 |

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

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

(2) 株式以外の有価証券

| 種類      | 銘柄       | 券面総額   | 評価額<br>(円) | 備考 |
|---------|----------|--------|------------|----|
| 新株予約権証券 | 日医工新株予約権 | 11,900 | 4,926,600  |    |
| 新株予約権証券 | 合計       |        | 4,926,600  |    |
| 合計      |          |        | 4,926,600  |    |

新株予約権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  
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

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

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在    | 平成25年12月18日現在  |
|-----------------|------------------|----------------|
|                 | 金額（円）            | 金額（円）          |
| 資産の部            |                  |                |
| 流動資産            |                  |                |
| 預金              | 283,405,868      | 398,107,497    |
| コール・ローン         | 70,318,692       | 74,978,643     |
| 株式              | 51,613,745,366   | 67,190,451,296 |
| 投資証券            | 1,121,855,937    | 1,259,965,705  |
| 派生商品評価勘定        | 8,171,156        | 2,317,986      |
| 未収入金            | 63,293,777       | 60,577,489     |
| 未収配当金           | 122,149,355      | 96,699,442     |
| 差入委託証拠金         | 246,353,113      | 409,057,773    |
| 流動資産合計          | 53,529,293,264   | 69,492,155,831 |
| 資産合計            | 53,529,293,264   | 69,492,155,831 |
| 負債の部            |                  |                |
| 流動負債            |                  |                |
| 未払解約金           | 39,111,000       | 73,943,400     |
| 流動負債合計          | 39,111,000       | 73,943,400     |
| 負債合計            | 39,111,000       | 73,943,400     |
| 純資産の部           |                  |                |
| 元本等             |                  |                |
| 元本              | 1 51,632,637,762 | 44,891,925,596 |
| 剰余金             |                  |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,857,544,502    | 24,526,286,835 |
| 元本等合計           | 53,490,182,264   | 69,418,212,431 |
| 純資産合計           | 53,490,182,264   | 69,418,212,431 |
| 負債純資産合計         | 53,529,293,264   | 69,492,155,831 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                    | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>(1) 株式<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。<br/>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<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。<br/>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> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1) 先物取引  |

|                            |  |
|----------------------------|--|
|                            | 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<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。  |
|                            | (2)為替予約取引<br>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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。  |
| 3. 収益及び費用の計上基準             | 受取配当金<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。   |
| 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<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。 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                          | 平成24年12月18日現在   | 平成25年12月18日現在   |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                      | 平成23年12月20日     | 平成24年12月19日     |
| 期首元本額                        | 53,616,195,771円 | 51,632,637,762円 |
| 期中追加設定元本額                    | 5,472,237,765円  | 3,307,895,188円  |
| 期中一部解約元本額                    | 7,455,795,774円  | 10,048,607,354円 |
| 期末元本額の内訳                     |                 |                 |
| ファンド名                        |                 |                 |
| ダイワ外国株式インデックスV A             | 1,898,609,298円  | 1,566,664,619円  |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 92,329,188円     | 66,995,414円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 1,266,749,181円  | 1,024,274,926円  |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 178,594,120円    | 112,588,725円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 4,073,250,741円  | 3,304,623,498円  |
| D-I's 外国株式インデックス             | - 円             | 650,166円        |
| DCダイワ外国株式インデックス              | 17,979,148,036円 | 18,329,380,938円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30               | 603,340,383円    | 466,776,591円    |
| ダイワ・ライフ・バランス50               | 580,817,763円    | 569,787,955円    |
| ダイワ・ライフ・バランス70               | 356,073,866円    | 398,178,405円    |
| 大和DC海外株式インデックスファンド           | 1,585,334,486円  | 1,471,238,560円  |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020           | 6,470,064円      | 6,111,206円      |

|                                 |                 |                 |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030          | 7,501,912円      | 7,992,645円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040          | 977,752円        | 1,816,460円      |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド15VA         | 107,015,823円    | 73,963,497円     |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド20VA         | 1,598,468,837円  | 1,082,681,103円  |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド25VA         | 33,962,760円     | 24,042,451円     |
| ダイワ世界分散バランスファン<br>ド30VA         | 355,460,638円    | 254,295,810円    |
| ダイワ世界バランスファンド4<br>0VA           | 5,197,453,690円  | 3,706,456,472円  |
| ダイワ世界バランスファンド6<br>0VA           | 1,281,387,480円  | 936,084,750円    |
| ダイワ・バランスファンド35<br>VA            | 10,680,907,493円 | 7,995,137,542円  |
| ダイワ・バランスファンド25<br>VA（適格機関投資家専用） | 538,968,077円    | 373,999,026円    |
| ダイワ・インデックスセレクト<br>外国株式          | - 円             | 656,185円        |
| ダイワ投信倶楽部外国株式イン<br>デックス          | 3,058,888,278円  | 2,982,187,147円  |
| ダイワライフスタイル25                    | 25,108,094円     | 20,324,526円     |
| ダイワライフスタイル50                    | 71,665,783円     | 64,279,582円     |
| ダイワライフスタイル75                    | 54,154,019円     | 50,737,397円     |
| 計                               | 51,632,637,762円 | 44,891,925,596円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                | 51,632,637,762口 | 44,891,925,596口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成25年12月18日現在   |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成24年12月18日現在          | 平成25年12月18日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 557,323,594            | 1,480,971,021          |
| 投資証券 | 12,091,864             | 27,681,707             |
| 合計   | 569,415,458            | 1,508,652,728          |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成24年12月18日まで、及び平成25年12月3日から平成25年12月18日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

| 種 類          | 平成24年12月18日 現在 |           |             |             | 平成25年12月18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          | 650,088,950    | -         | 658,253,694 | 8,164,744   | 909,362,700    | -         | 911,676,600 | 2,313,900   |
| 合計           | 650,088,950    | -         | 658,253,694 | 8,164,744   | 909,362,700    | -         | 911,676,600 | 2,313,900   |

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

| 種 類 | 平成24年12月18日 現在 |    |           |             | 平成25年12月18日 現在 |    |           |             |
|-----|----------------|----|-----------|-------------|----------------|----|-----------|-------------|
|     | 契約額等<br>（円）    | うち | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） | 契約額等<br>（円）    | うち | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
|     |                |    |           |             |                |    |           |             |

|            |            | 1年超 |            |       |            | 1年超 |            |       |
|------------|------------|-----|------------|-------|------------|-----|------------|-------|
| 市場取引以外の取引  |            |     |            |       |            |     |            |       |
| 為替予約取引     |            |     |            |       |            |     |            |       |
| 売 建        | 72,061,612 | -   | 72,055,200 | 6,412 | 85,409,286 | -   | 85,405,200 | 4,086 |
| アメリカ・ドル    | 50,321,340 | -   | 50,316,000 | 5,340 | -          | -   | -          | -     |
| イギリス・ポンド   | 21,740,272 | -   | 21,739,200 | 1,072 | 35,147,238 | -   | 35,145,600 | 1,638 |
| オーストラリア・ドル | -          | -   | -          | -     | 24,776,037 | -   | 24,775,200 | 837   |
| ユーロ        | -          | -   | -          | -     | 25,486,011 | -   | 25,484,400 | 1,611 |
| 合計         | 72,061,612 | -   | 72,055,200 | 6,412 | 85,409,286 | -   | 85,405,200 | 4,086 |

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在        | 平成25年12月18日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0360円<br>(10,360円) | 1.5463円<br>(15,463円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

| 通貨      | 銘柄                        | 株式数    | 評価額     |               | 備考 |
|---------|---------------------------|--------|---------|---------------|----|
|         |                           |        | 単価      | 金額            |    |
| アメリカ・ドル |                           | 株      | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル       |    |
|         | AVON PRODUCTS             | 10,700 | 16.920  | 181,044.000   |    |
|         | ABBOTT LABS               | 36,900 | 36.610  | 1,350,909.000 |    |
|         | ALCOA                     | 26,600 | 9.700   | 258,020.000   |    |
|         | VERISK ANALYTICS INC-CL A | 3,600  | 65.220  | 234,792.000   |    |
|         | LAS VEGAS SANDS CORP      | 9,500  | 77.340  | 734,730.000   |    |
|         | AMPHENOL CORP-CL A        | 3,900  | 86.320  | 336,648.000   |    |
|         | FIDELITY NATIONAL INFORMA | 6,729  | 51.050  | 343,515.450   |    |
|         | AFLAC INC                 | 10,700 | 66.010  | 706,307.000   |    |
|         | DARDEN RESTAURANTS INC    | 3,300  | 52.330  | 172,689.000   |    |
|         | MONSTER BEVERAGE CORP     | 3,400  | 63.390  | 215,526.000   |    |
|         | ADOBE SYSTEMS             | 11,300 | 57.670  | 651,671.000   |    |
|         | CF INDUSTRIES HOLDINGS IN | 1,400  | 229.650 | 321,510.000   |    |
|         | LULULEMON ATHLETICA INC   | 2,500  | 58.670  | 146,675.000   |    |
|         | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 10,400 | 14.630  | 152,152.000   |    |

|                           |        |         |                |
|---------------------------|--------|---------|----------------|
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING | 2,000  | 56.090  | 112,180.000    |
| GARMIN LTD                | 3,200  | 46.570  | 149,024.000    |
| AETNA INC                 | 8,679  | 65.750  | 570,644.250    |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS  | 4,900  | 107.400 | 526,260.000    |
| ALTERA CORPORATION        | 7,600  | 31.580  | 240,008.000    |
| BEAM INC                  | 3,600  | 66.190  | 238,284.000    |
| HONEYWELL INTERNATIONAL   | 17,300 | 86.480  | 1,496,104.000  |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 4,951  | 31.540  | 156,154.540    |
| WR BERKLEY CORP           | 3,600  | 42.150  | 151,740.000    |
| AUTOZONE INC              | 800    | 461.760 | 369,408.000    |
| DOLLAR TREE INC           | 5,500  | 55.710  | 306,405.000    |
| PINNACLE WEST CAPITAL     | 2,700  | 52.880  | 142,776.000    |
| CELANESE CORP-SERIES A    | 3,800  | 54.760  | 208,088.000    |
| D.R.HORTON INC            | 7,166  | 18.910  | 135,509.060    |
| CONTINENTAL RESOURCES     | 1,200  | 106.290 | 127,548.000    |
| DENTSPLY INTERNATIONAL IN | 3,800  | 47.460  | 180,348.000    |
| AUTODESK INC              | 5,600  | 47.500  | 266,000.000    |
| MOODY'S CORP              | 4,700  | 73.630  | 346,061.000    |
| DEVON ENERGY CORPORATION  | 9,300  | 59.650  | 554,745.000    |
| ALBEMARLE CORP            | 2,200  | 68.770  | 151,294.000    |
| CONSOL ENERGY INC         | 5,500  | 37.430  | 205,865.000    |
| ALLIANT ENERGY CORP       | 2,800  | 51.430  | 144,004.000    |
| CITIGROUP INC             | 71,123 | 50.690  | 3,605,224.870  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 11,400 | 77.250  | 880,650.000    |
| AMERICAN ELEC POWER       | 11,700 | 45.820  | 536,094.000    |
| ALLEGHANY CORP            | 400    | 393.070 | 157,228.000    |
| DUN&BRADSTREET CORP       | 1,200  | 115.160 | 138,192.000    |
| HESS CORP                 | 7,200  | 79.510  | 572,472.000    |
| COVIDIEN PLC              | 11,025 | 65.590  | 723,129.750    |
| DAVITA INC                | 4,400  | 60.220  | 264,968.000    |
| DANAHER CORP              | 13,900 | 74.760  | 1,039,164.000  |
| AVNET INC                 | 3,400  | 42.170  | 143,378.000    |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE  | 2,670  | 222.220 | 593,327.400    |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A  | 2,000  | 84.620  | 169,240.000    |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 15,900 | 41.480  | 659,532.000    |
| PEABODY ENERGY CORP       | 7,400  | 18.430  | 136,382.000    |
| BUNGE LIMITED             | 3,500  | 81.410  | 284,935.000    |
| TE CONNECTIVITY LTD       | 9,825  | 52.100  | 511,882.500    |
| APPLE INC                 | 21,400 | 554.990 | 11,876,786.000 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVIC | 11,600 | 53.350  | 618,860.000    |
| BOEING CO                 | 16,900 | 135.880 | 2,296,372.000  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 3,815  | 50.670  | 193,306.050    |
| MEADWESTVACO CORP         | 4,300  | 35.950  | 154,585.000    |
| SPECTRA ENERGY CORP       | 15,896 | 33.000  | 524,568.000    |
| BECTON DICKINSON & CO     | 4,500  | 105.750 | 475,875.000    |
| LEIDOS HOLDINGS INC       | 2,150  | 43.650  | 93,847.500     |
| NISOURCE INC              | 7,600  | 31.060  | 236,056.000    |
| JOY GLOBAL INC            | 2,700  | 53.520  | 144,504.000    |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE IN | 4,000  | 56.370  | 225,480.000    |
| BARD(C.R.) INC            | 1,800  | 132.170 | 237,906.000    |
| BANK OF NEW YORK MELLON   | 26,671 | 32.860  | 876,409.060    |
| VERIZON COMMUNICATIONS    | 67,200 | 47.560  | 3,196,032.000  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-B  | 25,400 | 113.630 | 2,886,202.000  |
| ANSYS INC                 | 2,300  | 84.660  | 194,718.000    |
| H&R BLOCK INC             | 6,700  | 27.980  | 187,466.000    |
| BB&T CORPORATION          | 17,000 | 35.490  | 603,330.000    |
| HOSPIRA INC               | 4,020  | 40.050  | 161,001.000    |
| BROADCOM CORP-CL A        | 12,550 | 28.410  | 356,545.500    |
| BAKER HUGHES INC          | 10,623 | 52.660  | 559,407.180    |
| BRISTOL MYERS SQUIBB      | 38,400 | 51.100  | 1,962,240.000  |



|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| ENERGIZER HOLDINGS INC    | 1,600   | 106.500 | 170,400.000   |
| FIDELITY NATIONAL FINL-A  | 5,638   | 30.390  | 171,338.820   |
| JPMORGAN CHASE & CO       | 88,220  | 55.720  | 4,915,618.400 |
| LEGG MASON INC            | 3,850   | 42.510  | 163,663.500   |
| T ROWE PRICE GROUP INC    | 6,200   | 79.810  | 494,822.000   |
| CIGNA CORP                | 6,800   | 83.780  | 569,704.000   |
| LKQ CORP                  | 7,300   | 32.710  | 238,783.000   |
| COMPUTER SCIENCES CORP    | 3,700   | 53.010  | 196,137.000   |
| RENAISSANCERE HOLDINGS L  | 1,300   | 91.140  | 118,482.000   |
| FRONTIER COMMUNICATIONS   | 26,442  | 4.780   | 126,392.760   |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 2,900   | 73.210  | 212,309.000   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC  | 4,760   | 108.580 | 516,840.800   |
| DOLLAR GENERAL CORP       | 7,500   | 59.030  | 442,725.000   |
| SERVICENOW INC            | 2,700   | 51.430  | 138,861.000   |
| CATERPILLAR INC DEL       | 15,000  | 86.920  | 1,303,800.000 |
| CMS ENERGY CORP           | 6,400   | 26.450  | 169,280.000   |
| HERBALIFE LTD             | 2,200   | 75.760  | 166,672.000   |
| MOSAIC CO/THE             | 7,100   | 44.520  | 316,092.000   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 4,900   | 82.990  | 406,651.000   |
| CORNING INC               | 33,800  | 17.220  | 582,036.000   |
| CISCO SYSTEMS             | 124,800 | 20.920  | 2,610,816.000 |
| DU PONT                   | 21,800  | 61.180  | 1,333,724.000 |
| MORGAN STANLEY            | 34,000  | 30.520  | 1,037,680.000 |
| DOW CHEMICAL              | 28,500  | 42.200  | 1,202,700.000 |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD    | 5,800   | 53.560  | 310,648.000   |
| ENSCO PLC-CL A            | 5,500   | 58.020  | 319,110.000   |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 2,300   | 55.300  | 127,190.000   |
| DTE ENERGY COMPANY        | 4,300   | 65.280  | 280,704.000   |
| AGCO CORP                 | 2,500   | 57.580  | 143,950.000   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 13,600  | 63.880  | 868,768.000   |
| DENBURY RESOURCES INC     | 8,700   | 15.990  | 139,113.000   |
| DEERE & CO                | 8,700   | 88.300  | 768,210.000   |
| AIRGAS INC                | 1,500   | 107.500 | 161,250.000   |
| QUANTA SERVICES INC       | 5,200   | 29.170  | 151,684.000   |
| TIME WARNER INC           | 21,333  | 65.800  | 1,403,711.400 |
| VMWARE INC-CLASS A        | 2,100   | 86.720  | 182,112.000   |
| URBAN OUTFITTERS INC      | 3,700   | 35.850  | 132,645.000   |
| NASDAQ OMX GROUP          | 3,900   | 39.310  | 153,309.000   |
| KINDER MORGAN MANAGEMENT  | 2,691   | 72.320  | 194,613.120   |
| CONSOLIDATED EDISON INC   | 7,000   | 54.760  | 383,320.000   |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP    | 3,200   | 70.410  | 225,312.000   |
| HUT (JB) TRANSPRT SVCS IN | 2,300   | 75.280  | 173,144.000   |
| COLGATE PALMOLIVE CO      | 21,500  | 63.580  | 1,366,970.000 |
| AMETEK INC                | 6,025   | 50.120  | 301,973.000   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC    | 3,300   | 65.440  | 215,952.000   |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A  | 9,900   | 77.630  | 768,537.000   |
| COSTCO WHOLESALE CORP     | 10,400  | 117.550 | 1,222,520.000 |
| SCANA CORP                | 3,100   | 46.620  | 144,522.000   |
| GREEN MOUNTAIN COFFEE     | 3,000   | 74.720  | 224,160.000   |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 1,300   | 203.700 | 264,810.000   |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL IN | 700     | 512.640 | 358,848.000   |
| LEUCADIA NATIONAL CORP    | 7,300   | 27.550  | 201,115.000   |
| CUMMINS INC               | 4,300   | 133.250 | 572,975.000   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC   | 11,100  | 17.060  | 189,366.000   |
| LORILLARD INC             | 9,100   | 49.490  | 450,359.000   |
| TRANSDIGM GROUP INC       | 1,200   | 154.770 | 185,724.000   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-C | 3,000   | 84.990  | 254,970.000   |
| NIELSEN HOLDINGS NV       | 5,500   | 45.150  | 248,325.000   |
| KINDER MORGAN INC         | 15,900  | 33.430  | 531,537.000   |
| HCA HOLDINGS INC          | 6,600   | 45.540  | 300,564.000   |

|                           |         |           |               |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| CABOT OIL & GAS CORP      | 10,100  | 35.820    | 361,782.000   |
| T-MOBILE US INC           | 3,650   | 26.680    | 97,382.000    |
| COCA COLA CO              | 94,500  | 39.100    | 3,694,950.000 |
| COCA-COLA ENTERPRISES     | 5,900   | 41.550    | 245,145.000   |
| EXPEDITORS INTL WASH INC  | 4,900   | 42.700    | 209,230.000   |
| EATON VANCE CORP          | 3,700   | 41.070    | 151,959.000   |
| FMC TECHNOLOGIES INC      | 5,600   | 53.160    | 297,696.000   |
| FRANKLIN RESOURCES INC    | 9,800   | 54.430    | 533,414.000   |
| CSX CORP                  | 23,600  | 27.670    | 653,012.000   |
| FLUOR CORP                | 3,900   | 75.800    | 295,620.000   |
| LABORATORY CRP OF AMER HL | 2,200   | 89.550    | 197,010.000   |
| EXPEDIA INC               | 2,675   | 66.390    | 177,593.250   |
| AUTOLIV INC               | 2,300   | 89.980    | 206,954.000   |
| AMAZON.COM INC            | 8,600   | 387.650   | 3,333,790.000 |
| FLOWSERVE CORP            | 3,400   | 73.160    | 248,744.000   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 2,700   | 62.730    | 169,371.000   |
| EXXON MOBIL CORP          | 103,255 | 96.750    | 9,989,921.250 |
| EQUINIX INC               | 1,200   | 169.020   | 202,824.000   |
| FLIR SYSTEMS INC          | 4,500   | 28.720    | 129,240.000   |
| AES CORP                  | 15,700  | 13.940    | 218,858.000   |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS  | 2,200   | 102.390   | 225,258.000   |
| EVEREST RE GROUP LTD      | 1,200   | 147.320   | 176,784.000   |
| EOG RESOURCES INC         | 6,400   | 159.650   | 1,021,760.000 |
| EQUITABLE RESOURCES INC   | 3,700   | 85.840    | 317,608.000   |
| AKamai TECHNOLOGIES       | 4,400   | 45.580    | 200,552.000   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP    | 5,500   | 68.350    | 375,925.000   |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC  | 7,690   | 56.370    | 433,485.300   |
| FORD MOTOR CO             | 86,123  | 16.700    | 1,438,254.100 |
| MACY'S INC                | 8,898   | 51.670    | 459,759.660   |
| DISCOVERY COMMUNICATION-A | 3,440   | 83.710    | 287,962.400   |
| FOREST LABORATORIES INC   | 5,900   | 55.630    | 328,217.000   |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A      | 4,887   | 83.810    | 409,579.470   |
| LIBERTY MEDIA CORP        | 2,300   | 145.060   | 333,638.000   |
| DISCOVERY COMMUNICATION-C | 2,140   | 77.600    | 166,064.000   |
| FOSSIL INC                | 1,300   | 120.720   | 156,936.000   |
| NEXTERA ENERGY INC        | 9,900   | 82.630    | 818,037.000   |
| FREEMPORT-MCMORAN COPPER  | 24,408  | 34.900    | 851,839.200   |
| US BANCORP                | 43,600  | 39.120    | 1,705,632.000 |
| FAMILY DOLLAR STORES      | 2,500   | 63.670    | 159,175.000   |
| F5 NETWORKS INC           | 1,900   | 84.250    | 160,075.000   |
| FASTENAL CO               | 6,900   | 47.100    | 324,990.000   |
| FISERV INC                | 6,400   | 56.610    | 362,304.000   |
| GENERAL ELECTRIC CO       | 240,800 | 27.030    | 6,508,824.000 |
| GENERAL MOTORS CO         | 18,300  | 41.530    | 759,999.000   |
| TRIPADVISOR INC           | 2,900   | 80.900    | 234,610.000   |
| LINKEDIN CORP-A           | 2,300   | 223.580   | 514,234.000   |
| GENERAL DYNAMICS CORP     | 7,000   | 91.440    | 640,080.000   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC   | 10,100  | 170.490   | 1,721,949.000 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A     | 3,000   | 48.980    | 146,940.000   |
| GOOGLE INC-CL A           | 6,400   | 1,069.860 | 6,847,104.000 |
| GENERAL MILLS INC         | 15,200  | 49.580    | 753,616.000   |
| FIRSTENERGY CORP          | 9,868   | 31.940    | 315,183.920   |
| GENUINE PARTS CO          | 3,700   | 80.560    | 298,072.000   |
| FIFTH THIRD BANCORP       | 20,700  | 20.150    | 417,105.000   |
| HARRIS CORP               | 2,600   | 66.510    | 172,926.000   |
| HALLIBURTON CO            | 19,700  | 49.350    | 972,195.000   |
| HOME DEPOT INC            | 33,800  | 78.620    | 2,657,356.000 |
| ASSURANT INC              | 2,600   | 64.510    | 167,726.000   |
| HERSHEY CO/THE            | 3,700   | 94.110    | 348,207.000   |
| HARLEY-DAVIDSON INC       | 5,400   | 67.140    | 362,556.000   |

|                           |        |         |               |
|---------------------------|--------|---------|---------------|
| HUMANA INC                | 3,800  | 99.070  | 376,466.000   |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 4,700  | 75.770  | 356,119.000   |
| HELMERICH & PAYNE         | 2,500  | 80.840  | 202,100.000   |
| WINDSTREAM HOLDINGS INC   | 17,100 | 8.080   | 138,168.000   |
| HENRY SCHEIN INC          | 2,000  | 111.400 | 222,800.000   |
| HEWLETT-PACKARD CO        | 45,700 | 27.450  | 1,254,465.000 |
| DIRECTV                   | 12,182 | 65.370  | 796,337.340   |
| HOLLYFRONTIER CORP        | 4,600  | 47.630  | 219,098.000   |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD    | 3,200  | 56.870  | 181,984.000   |
| INT'L BUSINESS MACHINES   | 24,400 | 175.760 | 4,288,544.000 |
| INTERNATIONAL PAPER       | 10,200 | 48.360  | 493,272.000   |
| ZOETIS INC                | 11,700 | 31.640  | 370,188.000   |
| INGERSOLL-RAND CO-CL A    | 6,729  | 57.440  | 386,513.760   |
| CHENIERE ENERGY INC       | 5,100  | 41.310  | 210,681.000   |
| LEGGETT & PLATT INC       | 4,200  | 29.370  | 123,354.000   |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C      | 3,768  | 78.930  | 297,408.240   |
| JUNIPER NETWORKS INC      | 12,100 | 20.960  | 253,616.000   |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 2,600  | 101.100 | 262,860.000   |
| JOHNSON & JOHNSON         | 66,200 | 90.660  | 6,001,692.000 |
| ABBVIE INC                | 36,700 | 53.630  | 1,968,221.000 |
| HOLOGIC INC               | 7,100  | 22.320  | 158,472.000   |
| KIMBERLY-CLARK CORP       | 9,100  | 102.750 | 935,025.000   |
| KROGER CO                 | 11,600 | 39.830  | 462,028.000   |
| KLA-TENCOR CORPORATION    | 3,900  | 61.940  | 241,566.000   |
| LOCKHEED MARTIN CORP      | 6,500  | 140.850 | 915,525.000   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 1,600  | 118.150 | 189,040.000   |
| L BRANDS INC              | 6,000  | 60.760  | 364,560.000   |
| LOWE'S COS INC            | 24,800 | 46.650  | 1,156,920.000 |
| ELI LILLY & CO            | 23,900 | 49.220  | 1,176,358.000 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS IN | 4,300  | 30.700  | 132,010.000   |
| LAM RESEARCH CORP         | 3,900  | 52.180  | 203,502.000   |
| RANGE RESOURCES CORP      | 3,900  | 79.760  | 311,064.000   |
| LSI CORP                  | 17,000 | 10.920  | 185,640.000   |
| LOEWS CORP                | 8,000  | 46.440  | 371,520.000   |
| LINCOLN NATIONAL CORP     | 6,149  | 50.080  | 307,941.920   |
| MCDONALD'S CORP           | 23,200 | 94.380  | 2,189,616.000 |
| 3M CO                     | 15,400 | 131.390 | 2,023,406.000 |
| FACEBOOK INC-A            | 39,200 | 54.860  | 2,150,512.000 |
| MANPOWER INC              | 2,000  | 83.950  | 167,900.000   |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC | 6,300  | 72.840  | 458,892.000   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 1,300  | 95.050  | 123,565.000   |
| CONCHO RESOURCES INC      | 2,500  | 101.680 | 254,200.000   |
| PHILLIPS 66               | 13,500 | 72.600  | 980,100.000   |
| MURPHY OIL CORP           | 4,300  | 63.110  | 271,373.000   |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 9,600  | 22.220  | 213,312.000   |
| MATTEL INC                | 8,400  | 44.700  | 375,480.000   |
| KBR INC                   | 4,200  | 29.760  | 124,992.000   |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SH | 2,800  | 67.480  | 188,944.000   |
| MYLAN INC                 | 9,000  | 41.860  | 376,740.000   |
| METLIFE INC               | 21,600 | 50.740  | 1,095,984.000 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP  | 11,200 | 13.560  | 151,872.000   |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC    | 5,528  | 65.520  | 362,194.560   |
| MONSANTO CO               | 12,706 | 112.400 | 1,428,154.400 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC   | 3,400  | 110.530 | 375,802.000   |
| MERCK & CO INC            | 68,321 | 47.900  | 3,272,575.900 |
| MASCO CORP                | 8,800  | 21.170  | 186,296.000   |
| M & T BANK CORP           | 2,800  | 113.730 | 318,444.000   |
| MARSH & MCLENNAN COS      | 13,200 | 47.210  | 623,172.000   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -A | 6,082  | 46.840  | 284,880.880   |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 4,600  | 82.910  | 381,386.000   |

|                           |         |           |               |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| TOWERS WATSON & CO-CL A   | 1,500   | 122.600   | 183,900.000   |
| REALOGY HOLDINGS CORP     | 3,600   | 47.030    | 169,308.000   |
| NETAPP INC                | 8,000   | 39.950    | 319,600.000   |
| NIKE INC -CL B            | 16,500  | 76.760    | 1,266,540.000 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP     | 7,200   | 89.160    | 641,952.000   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC  | 4,800   | 41.940    | 201,312.000   |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL   | 2,700   | 48.960    | 132,192.000   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP     | 5,100   | 109.570   | 558,807.000   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC     | 7,000   | 59.810    | 418,670.000   |
| NEWMONT MINIG CORP        | 11,900  | 23.110    | 275,009.000   |
| KRAFT FOODS GROUP INC     | 13,803  | 52.430    | 723,691.290   |
| ADT CORP/THE              | 4,962   | 39.500    | 195,999.000   |
| MCKESSON CORP             | 5,400   | 158.420   | 855,468.000   |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 6,600   | 27.960    | 184,536.000   |
| XYLEM INC                 | 4,900   | 34.100    | 167,090.000   |
| PHILIP MORRIS INTERNATION | 38,300  | 84.650    | 3,242,095.000 |
| NUCOR CORP                | 7,600   | 51.510    | 391,476.000   |
| NABORS INDUSTRIES LTD     | 8,300   | 15.770    | 130,891.000   |
| WESTERN UNION CO          | 13,646  | 16.470    | 224,749.620   |
| NEWELL RUBBERMAID INC     | 7,100   | 31.110    | 220,881.000   |
| OCCIDENTAL PETROLEUM      | 19,000  | 90.210    | 1,713,990.000 |
| OMNICARE INC              | 2,600   | 59.290    | 154,154.000   |
| PAYCHEX INC               | 7,700   | 42.900    | 330,330.000   |
| PATTERSON COS INC         | 2,900   | 40.150    | 116,435.000   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC   | 2,500   | 127.340   | 318,350.000   |
| ALTRIA GROUP INC          | 47,300  | 37.450    | 1,771,385.000 |
| OWENS-ILLINOIS INC        | 4,600   | 34.080    | 156,768.000   |
| PG & E CORPORATION        | 10,600  | 40.640    | 430,784.000   |
| PFIZER INC                | 155,463 | 30.140    | 4,685,654.820 |
| XCEL ENERGY INC           | 11,900  | 27.870    | 331,653.000   |
| STRYKER CORP              | 7,100   | 71.650    | 508,715.000   |
| PARKER HANNIFIN CORP      | 3,600   | 119.920   | 431,712.000   |
| PALL CORP                 | 2,600   | 83.040    | 215,904.000   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES | 3,300   | 182.430   | 602,019.000   |
| POLARIS INDUSTRIES INC    | 1,500   | 135.900   | 203,850.000   |
| PROCTER & GAMBLE CO       | 64,537  | 80.910    | 5,221,688.670 |
| EXELON CORP               | 20,722  | 27.730    | 574,621.060   |
| ALEXION PHARMACEUTICALS   | 4,700   | 123.060   | 578,382.000   |
| CONOCOPHILLIPS            | 27,500  | 69.060    | 1,899,150.000 |
| PEPSICO INC               | 35,900  | 80.460    | 2,888,514.000 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC  | 11,000  | 87.950    | 967,450.000   |
| AMERICAN WATER WORKS CO   | 4,400   | 41.450    | 182,380.000   |
| ACCENTURE LTD-CL A        | 15,400  | 74.000    | 1,139,600.000 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 2,700   | 46.040    | 124,308.000   |
| PENTAIR LTD-REGISTERED    | 4,905   | 72.830    | 357,231.150   |
| QUALCOMM INC              | 40,500  | 72.920    | 2,953,260.000 |
| PARTNERRE LTD             | 1,500   | 97.730    | 146,595.000   |
| INVESCO LTD               | 10,650  | 34.470    | 367,105.500   |
| ADVANCE AUTO PARTS        | 1,850   | 108.460   | 200,651.000   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 7,000   | 47.610    | 333,270.000   |
| MDU RESOURCES GROUP INC   | 5,200   | 29.350    | 152,620.000   |
| ENERGEN CORP              | 2,000   | 66.320    | 132,640.000   |
| RAYTHEON CO               | 7,600   | 86.790    | 659,604.000   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-A  | 2,200   | 81.370    | 179,014.000   |
| RED HAT INC               | 4,500   | 48.220    | 216,990.000   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 1,800   | 261.880   | 471,384.000   |
| REPUBLIC SERVICES INC     | 7,100   | 33.270    | 236,217.000   |
| PRICELINE.COM INC         | 1,200   | 1,160.900 | 1,393,080.000 |
| ROSS STORES INC           | 5,100   | 71.970    | 367,047.000   |
| QEP RESOURCES INC         | 4,400   | 30.590    | 134,596.000   |

|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| RESMED INC                | 3,600   | 45.860  | 165,096.000   |
| QUEST DIAGNOSTICS         | 3,700   | 53.550  | 198,135.000   |
| ROBERT HALF INTL INC      | 3,700   | 40.530  | 149,961.000   |
| REYNOLDS AMERICAN INC     | 7,600   | 48.600  | 369,360.000   |
| RALPH LAUREN CORP         | 1,500   | 174.350 | 261,525.000   |
| ROWAN COS PLC             | 3,700   | 34.000  | 125,800.000   |
| ROCKWELL COLLINS INC.     | 3,200   | 71.050  | 227,360.000   |
| REGIONS FINANCIAL CORP    | 33,435  | 9.520   | 318,301.200   |
| CHEVRON CORP              | 45,318  | 118.740 | 5,381,059.320 |
| EDISON INTERNATIONAL      | 7,500   | 45.630  | 342,225.000   |
| TESLA MOTORS INC          | 2,000   | 152.460 | 304,920.000   |
| SYMANTEC CORP             | 16,700  | 23.000  | 384,100.000   |
| STANLEY BLACK & DECKER IN | 3,722   | 79.770  | 296,903.940   |
| SYNOPSYS INC              | 3,900   | 38.810  | 151,359.000   |
| CHARTER COMMUNICATION-A   | 1,500   | 130.110 | 195,165.000   |
| CBRE GROUP INC            | 7,000   | 24.970  | 174,790.000   |
| COBALT INT'L ENERGY       | 7,200   | 15.330  | 110,376.000   |
| SLM CORP                  | 10,600  | 25.580  | 271,148.000   |
| SANDISK CORP              | 5,800   | 68.120  | 395,096.000   |
| SOUTHERN CO               | 20,400  | 40.310  | 822,324.000   |
| SYSCO CORP                | 14,000  | 36.030  | 504,420.000   |
| TRAVELERS COS INC         | 8,923   | 86.570  | 772,464.110   |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO    | 8,400   | 38.580  | 324,072.000   |
| SPX CORP                  | 1,400   | 94.040  | 131,656.000   |
| SEI INVESTMENTS COMPANY   | 4,100   | 33.870  | 138,867.000   |
| STERICYCLE INC            | 2,000   | 114.600 | 229,200.000   |
| SCHLUMBERGER LTD          | 30,867  | 85.540  | 2,640,363.180 |
| SENSATA TECHNOLOGIES      | 2,800   | 37.370  | 104,636.000   |
| RACKSPACE HOSTING INC     | 2,700   | 37.150  | 100,305.000   |
| AT&T INC                  | 124,295 | 33.850  | 4,207,385.750 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO     | 6,000   | 18.320  | 109,920.000   |
| SIGMA-ALDRICH             | 3,000   | 89.490  | 268,470.000   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE   | 2,100   | 177.310 | 372,351.000   |
| SEMPRA ENERGY             | 5,600   | 87.250  | 488,600.000   |
| TIFFANY & CO              | 3,000   | 90.320  | 270,960.000   |
| SEAGATE TECHNOLOGY        | 7,400   | 52.950  | 391,830.000   |
| TEXAS INSTRUMENT INC      | 25,500  | 42.430  | 1,081,965.000 |
| SALESFORCE.COM INC        | 13,400  | 52.220  | 699,748.000   |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES  | 4,200   | 25.090  | 105,378.000   |
| TRW INC                   | 2,700   | 75.960  | 205,092.000   |
| ROCK-TENN COMPANY-CL A    | 1,800   | 100.290 | 180,522.000   |
| TIME WARNER CABLE         | 6,653   | 133.030 | 885,048.590   |
| TYCO INTERNATIONAL LTD    | 11,025  | 37.950  | 418,398.750   |
| TESORO CORP               | 3,400   | 56.980  | 193,732.000   |
| UNION PACIFIC CORP        | 10,800  | 161.030 | 1,739,124.000 |
| MARATHON OIL CORP         | 16,800  | 34.850  | 585,480.000   |
| MARATHON PETROLEUM CORP   | 7,300   | 86.090  | 628,457.000   |
| UNITED TECHNOLOGIES       | 20,600  | 107.620 | 2,216,972.000 |
| UNITED PARCEL SERVICE-B   | 16,800  | 101.980 | 1,713,264.000 |
| UNUM GROUP                | 6,400   | 34.040  | 217,856.000   |
| SPRINT CORP               | 23,665  | 8.760   | 207,305.400   |
| AMEREN CORPORATION        | 5,900   | 35.250  | 207,975.000   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC    | 24,026  | 70.730  | 1,699,358.980 |
| VERISIGN INC              | 3,600   | 57.790  | 208,044.000   |
| VALERO ENERGY CORP        | 12,792  | 46.990  | 601,096.080   |
| ULTA SALON COSME          | 1,400   | 91.630  | 128,282.000   |
| WEYERHAEUSER CO           | 13,994  | 30.100  | 421,219.400   |
| WELLPOINT INC             | 7,100   | 86.890  | 616,919.000   |
| THE WALT DISNEY CO.       | 40,100  | 70.660  | 2,833,466.000 |
| WELLS FARGO & CO          | 118,772 | 43.590  | 5,177,271.480 |

|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC | 2,200   | 53.610  | 117,942.000   |
| WASTE MANAGEMENT INC      | 10,700  | 43.460  | 465,022.000   |
| WILLIAMS COMPANY          | 16,300  | 36.840  | 600,492.000   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY    | 3,200   | 73.370  | 234,784.000   |
| WHITING PETROLEUM CORP    | 2,900   | 60.420  | 175,218.000   |
| WHIRLPOOL CORP            | 1,900   | 151.530 | 287,907.000   |
| WAL-MART STORES           | 38,200  | 77.250  | 2,950,950.000 |
| ZIMMER HOLDINGS INC       | 4,100   | 90.630  | 371,583.000   |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL | 17,800  | 14.620  | 260,236.000   |
| WYNN RESORTS LTD          | 1,900   | 182.480 | 346,712.000   |
| XEROX CORP                | 27,444  | 11.490  | 315,331.560   |
| TJX COMPANIES INC         | 17,000  | 61.360  | 1,043,120.000 |
| WATERS CORP               | 2,000   | 96.100  | 192,200.000   |
| UNITED CONTINENTAL HLDS   | 1,900   | 37.310  | 70,889.000    |
| ACTAVIS INC               | 3,932   | 159.890 | 628,687.480   |
| WHOLE FOODS MARKET INC    | 8,500   | 57.310  | 487,135.000   |
| WALGREEN CO               | 20,800  | 56.250  | 1,170,000.000 |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 4,100   | 44.250  | 181,425.000   |
| WESTERN DIGITAL CORP      | 5,000   | 83.400  | 417,000.000   |
| WISCONSIN ENERGY CORP     | 5,400   | 40.800  | 220,320.000   |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 12,200  | 31.900  | 389,180.000   |
| VISA INC-CLASS A SHS      | 12,200  | 213.250 | 2,601,650.000 |
| PPL CORPORATION           | 13,900  | 29.290  | 407,131.000   |
| PEPCO HOLDINGS INC        | 6,400   | 18.610  | 119,104.000   |
| PULTE GROUP INC           | 8,200   | 18.020  | 147,764.000   |
| PPG INDUSTRIES INC        | 3,400   | 183.610 | 624,274.000   |
| NORTHERN TRUST CORP       | 5,500   | 57.500  | 316,250.000   |
| PRECISION CASTPARTS CORP  | 3,400   | 261.570 | 889,338.000   |
| NVIDIA CORP               | 13,750  | 15.110  | 207,762.500   |
| PNC FINANCIAL SERVICES    | 12,293  | 74.650  | 917,672.450   |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP  | 11,950  | 27.760  | 331,732.000   |
| TERADATA CORP             | 3,900   | 41.730  | 162,747.000   |
| TYSON FOODS INC-CL A      | 7,100   | 33.160  | 235,436.000   |
| NETFLIX.COM INC           | 1,200   | 374.870 | 449,844.000   |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC  | 8,400   | 102.320 | 859,488.000   |
| NRG ENERGY INC            | 7,800   | 27.870  | 217,386.000   |
| TORCHMARK CORP            | 2,250   | 76.080  | 171,180.000   |
| TEXTRON INC               | 6,700   | 32.100  | 215,070.000   |
| TWENTY-FIRST CENTURY-A    | 35,350  | 32.860  | 1,161,601.000 |
| TWENTY-FIRST CENTURY-B    | 10,300  | 31.950  | 329,085.000   |
| NEWS CORP - CLASS A       | 9,437   | 17.350  | 163,731.950   |
| OGE ENERGY CORP           | 4,700   | 33.550  | 157,685.000   |
| OMNICOM GROUP             | 6,300   | 69.840  | 439,992.000   |
| ORACLE CORPORATION        | 81,883  | 33.630  | 2,753,725.290 |
| MASTERCARD INC-CLASS A    | 2,400   | 797.950 | 1,915,080.000 |
| ONEOK INC                 | 4,900   | 58.990  | 289,051.000   |
| OCEANEERING INTL INC      | 2,700   | 78.500  | 211,950.000   |
| CENTURYLINK INC           | 14,295  | 31.440  | 449,434.800   |
| ROPER INDUSTRIES INC      | 2,400   | 131.700 | 316,080.000   |
| YUM! BRANDS INC           | 10,400  | 71.870  | 747,448.000   |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS COR | 1,200   | 248.120 | 297,744.000   |
| MOLSON COORS BREWING CO-B | 3,500   | 53.790  | 188,265.000   |
| NOBLE ENERGY INC          | 8,600   | 67.610  | 581,446.000   |
| BANK OF AMERICA CORP      | 254,301 | 15.180  | 3,860,289.180 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL   | 3,400   | 68.090  | 231,506.000   |
| NORDSTROM INC             | 3,800   | 59.830  | 227,354.000   |
| AMERICAN EXPRESS CO       | 22,600  | 84.110  | 1,900,886.000 |
| ANALOG DEVICES INC        | 7,400   | 48.940  | 362,156.000   |
| TD AMERITRADE HOLDING COR | 5,400   | 29.170  | 157,518.000   |
| AMERICAN INTL GROUP       | 32,972  | 49.360  | 1,627,497.920 |

|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| ASHLAND INC               | 1,800   | 93.770  | 168,786.000   |
| ANADARKO PETROLEUM CORP   | 12,000  | 79.110  | 949,320.000   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES L | 3,600   | 44.200  | 159,120.000   |
| HUDSON CITY BANCORP INC   | 14,800  | 9.160   | 135,568.000   |
| AVERY DENNISON CORP       | 3,000   | 49.110  | 147,330.000   |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS- | 7,000   | 94.210  | 659,470.000   |
| EMERSON ELECTRIC CO       | 17,000  | 66.460  | 1,129,820.000 |
| AON CORP                  | 7,000   | 81.820  | 572,740.000   |
| AMGEN                     | 17,500  | 111.000 | 1,942,500.000 |
| CORE LABORATORIES N.V.    | 1,100   | 192.040 | 211,244.000   |
| ALLERGAN INC              | 7,100   | 99.070  | 703,397.000   |
| COACH INC                 | 6,800   | 55.300  | 376,040.000   |
| EATON CORP PLC            | 10,986  | 73.450  | 806,921.700   |
| CROWN CASTLE INTL CORP    | 7,200   | 71.610  | 515,592.000   |
| CELGENE CORP              | 9,600   | 160.790 | 1,543,584.000 |
| CONSTELLATION BRANDS INC- | 3,900   | 70.170  | 273,663.000   |
| APPLIED MATERIALS INC     | 28,400  | 16.800  | 477,120.000   |
| CIT GROUP INC             | 4,700   | 50.160  | 235,752.000   |
| CIMAREX ENERGY CO         | 2,100   | 99.890  | 209,769.000   |
| CME GROUP INC             | 7,600   | 82.890  | 629,964.000   |
| NATIONAL OILWELL VARCO IN | 10,144  | 78.140  | 792,652.160   |
| ECOLAB INC                | 6,300   | 102.060 | 642,978.000   |
| EQUIFAX INC               | 3,000   | 67.100  | 201,300.000   |
| GAP INC                   | 7,500   | 38.250  | 286,875.000   |
| GILEAD SCIENCES INC       | 36,000  | 70.100  | 2,523,600.000 |
| ST JUDE MEDICAL INC       | 6,700   | 59.420  | 398,114.000   |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP   | 4,948   | 47.350  | 234,287.800   |
| HORMEL FOODS CORP         | 3,600   | 44.160  | 158,976.000   |
| SAFEWAY INC               | 5,700   | 32.470  | 185,079.000   |
| STATE STREET CORP         | 10,443  | 69.590  | 726,728.370   |
| STAPLES INC               | 15,800  | 15.220  | 240,476.000   |
| SUNTRUST BANKS INC        | 13,048  | 35.260  | 460,072.480   |
| SCHWAB(CHARLES) CORP      | 27,600  | 24.760  | 683,376.000   |
| IHS INC-CLASS A           | 1,400   | 115.530 | 161,742.000   |
| BAXTER INTL INC           | 13,000  | 65.550  | 852,150.000   |
| B/E AEROSPACE INC         | 2,200   | 85.040  | 187,088.000   |
| CAMPBELL SOUP CO          | 4,900   | 42.740  | 209,426.000   |
| CROWN HOLDINGS INC        | 3,600   | 43.310  | 155,916.000   |
| CHUBB CORP                | 5,900   | 92.540  | 545,986.000   |
| CARDINAL HEALTH INC       | 8,200   | 65.380  | 536,116.000   |
| CAREFUSION CORP           | 5,150   | 38.490  | 198,223.500   |
| FEDEX CORP                | 7,100   | 139.090 | 987,539.000   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL COR | 13,754  | 71.790  | 987,399.660   |
| FMC CORP                  | 3,400   | 73.050  | 248,370.000   |
| FLEXTRONICS INTL LTD      | 17,600  | 7.480   | 131,648.000   |
| CERNER CORP               | 7,400   | 54.930  | 406,482.000   |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 2,000   | 84.050  | 168,100.000   |
| CITRIX SYSTEMS INC        | 4,400   | 57.930  | 254,892.000   |
| INTEL CORP                | 117,300 | 24.640  | 2,890,272.000 |
| CAMERON INTERNATIONAL COR | 6,000   | 58.680  | 352,080.000   |
| INTERPUBLIC GROUP CDS INC | 10,600  | 16.370  | 173,522.000   |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS   | 10,500  | 35.000  | 367,500.000   |
| IRON MOUNTAIN INC         | 3,647   | 28.870  | 105,288.890   |
| CREE INC                  | 3,000   | 57.710  | 173,130.000   |
| ILLINOIS TOOL WORKS       | 10,200  | 79.960  | 815,592.000   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC    | 76,100  | 3.415   | 259,881.500   |
| ILLUMINA INC              | 2,900   | 102.000 | 295,800.000   |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP    | 12,600  | 26.360  | 332,136.000   |
| SEALED AIR CORP           | 5,500   | 31.730  | 174,515.000   |
| INTUITIVE SURGICAL INC    | 900     | 355.930 | 320,337.000   |

|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| CALPINE CORP              | 8,200   | 19.090  | 156,538.000   |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY A  | 6,100   | 16.410  | 100,101.000   |
| CARMAX INC                | 5,300   | 51.750  | 274,275.000   |
| COMERICA INC              | 4,300   | 45.490  | 195,607.000   |
| DUKE ENERGY CORP          | 16,828  | 68.380  | 1,150,698.640 |
| TARGET CORP               | 14,100  | 61.650  | 869,265.000   |
| DOVER CORP                | 4,100   | 91.210  | 373,961.000   |
| WW GRAINGER INC           | 1,400   | 250.060 | 350,084.000   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP  | 3,200   | 58.220  | 186,304.000   |
| JOHNSON CONTROLS INC      | 15,900  | 51.320  | 815,988.000   |
| CINTAS CORP               | 2,800   | 55.570  | 155,596.000   |
| CA INC                    | 7,505   | 32.480  | 243,762.400   |
| CONAGRA INC               | 10,300  | 31.480  | 324,244.000   |
| CLOROX COMPANY            | 3,200   | 92.240  | 295,168.000   |
| ENTERGY CORP              | 4,300   | 61.650  | 265,095.000   |
| MICROSOFT CORP            | 186,800 | 36.540  | 6,825,672.000 |
| LIFE TECHNOLOGIES CORP    | 4,100   | 75.650  | 310,165.000   |
| CVS CAREMARK CORP         | 28,974  | 66.810  | 1,935,752.940 |
| MEDTRONIC INC             | 23,400  | 56.590  | 1,324,206.000 |
| MICRON TECHNOLOGY INC     | 24,200  | 22.920  | 554,664.000   |
| BLACKROCK INC-CLASS A     | 3,200   | 302.630 | 968,416.000   |
| CENTERPOINT ENERGY INC    | 9,800   | 22.890  | 224,322.000   |
| HASBRO INC                | 2,900   | 51.530  | 149,437.000   |
| KELLOGG CO                | 6,100   | 60.340  | 368,074.000   |
| KEYCORP                   | 21,700  | 13.080  | 283,836.000   |
| KANSAS CITY SOUTHERN      | 2,600   | 117.480 | 305,448.000   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL IN | 39,911  | 33.960  | 1,355,377.560 |
| KOHL'S CORP               | 5,000   | 54.600  | 273,000.000   |
| SEARS HOLDING CORP        | 1,225   | 44.450  | 54,451.250    |
| NEW YORK COMMUNITY BANCOR | 11,100  | 16.310  | 181,041.000   |
| APACHE CORP               | 9,010   | 85.280  | 768,372.800   |
| ACE LTD                   | 7,900   | 98.800  | 780,520.000   |
| ARROW ELECTRONICS INC     | 3,200   | 52.380  | 167,616.000   |
| ALLSTATE CORP             | 11,100  | 52.180  | 579,198.000   |
| EBAY INC                  | 27,300  | 52.580  | 1,435,434.000 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY  | 3,800   | 74.030  | 281,314.000   |
| XILINX INC                | 6,200   | 44.265  | 274,443.000   |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING   | 19,310  | 66.890  | 1,291,645.900 |
| DISH NETWORK CORP         | 5,300   | 54.990  | 291,447.000   |
| YAHOO! INC                | 22,400  | 39.510  | 885,024.000   |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-A  | 5,800   | 72.750  | 421,950.000   |
| TOLL BROTHERS INC         | 4,500   | 33.400  | 150,300.000   |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD    | 6,000   | 33.120  | 198,720.000   |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP    | 5,800   | 44.530  | 258,274.000   |
| LENNAR CORP               | 3,900   | 35.200  | 137,280.000   |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 9,400   | 25.150  | 236,410.000   |
| NOBLE CORP PLC            | 6,000   | 36.900  | 221,400.000   |
| PROGRESSIVE CORP          | 13,800  | 26.160  | 361,008.000   |
| PRAXAIR INC               | 6,900   | 125.240 | 864,156.000   |
| PACCAR INC                | 8,337   | 57.850  | 482,295.450   |
| PETSMART INC              | 2,300   | 71.470  | 164,381.000   |
| PVH CORP                  | 1,900   | 131.410 | 249,679.000   |
| EMC CORP/MASS             | 48,200  | 23.530  | 1,134,146.000 |
| BIOGEN IDEC INC           | 5,530   | 271.510 | 1,501,450.300 |
| INTL GAME TECHNOLOGY      | 8,100   | 17.010  | 137,781.000   |
| STARBUCKS CORP            | 17,600  | 76.090  | 1,339,184.000 |
| PERRIGO CO                | 2,200   | 153.250 | 337,150.000   |
| NORTHEAST UTILITIES       | 7,580   | 41.510  | 314,645.800   |
| INTUIT INC                | 6,800   | 74.690  | 507,892.000   |
| BORG-WARNER AUTOMOTIVE    | 5,600   | 55.390  | 310,184.000   |



|                           |           |          |  |
|---------------------------|-----------|----------|--|
| BEST BUY COMPANY INC      | 6,500     | 41.220   | 267,930.000                                    |
| BALL CORP                 | 3,400     | 50.120   | 170,408.000                                    |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP    | 32,847    | 11.440   | 375,769.680                                    |
| BED BATH & BEYOND INC     | 5,300     | 76.950   | 407,835.000                                    |
| XL GROUP PLC              | 6,800     | 30.050   | 204,340.000                                    |
| ELECTRONIC ARTS INC       | 7,400     | 22.750   | 168,350.000                                    |
| VULCAN MATERIALS CO       | 3,200     | 56.490   | 180,768.000                                    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS IN | 5,400     | 65.580   | 354,132.000                                    |
| VF CORP                   | 2,100     | 235.070  | 493,647.000                                    |
| CBS CORP-CL B             | 13,071    | 58.720   | 767,529.120                                    |
| VIACOM INC-CLASS B        | 9,971     | 82.240   | 820,015.040                                    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC     | 1,500     | 139.800  | 209,700.000                                    |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 6,000     | 14.580   | 87,480.000                                     |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS IN | 2,600     | 76.250   | 198,250.000                                    |
| CARNIVAL CORP             | 9,100     | 36.550   | 332,605.000                                    |
| COMCAST CORP -CL A        | 50,570    | 49.050   | 2,480,458.500                                  |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A | 11,200    | 47.390   | 530,768.000                                    |
| アメリカ・ドル 小計                |           |          | アメリカ・ドル<br>386,323,771.320<br>(39,729,536,642) |
| イギリス・ポンド                  | 株         | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド                                       |
| BP PLC                    | 450,300   | 4.650    | 2,093,895.000                                  |
| UNILEVER PLC              | 30,860    | 23.860   | 736,319.600                                    |
| BARCLAYS PLC              | 335,600   | 2.513    | 843,362.800                                    |
| ROLLS-ROYCE GROUP PLC     | 44,600    | 12.220   | 545,012.000                                    |
| TUI TRAVEL PLC            | 16,100    | 3.919    | 63,095.900                                     |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 39,200    | 4.523    | 177,301.600                                    |
| RANDGOLD RESOURCES LTD    | 2,100     | 39.330   | 82,593.000                                     |
| REXAM PLC                 | 19,080    | 4.881    | 93,129.480                                     |
| PRUDENTIAL PLC            | 61,500    | 12.700   | 781,050.000                                    |
| INMARSAT PLC              | 12,800    | 7.615    | 97,472.000                                     |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GR | 52,691    | 3.192    | 168,189.670                                    |
| JOHNSON MATTHEY PLC       | 5,109     | 31.960   | 163,283.640                                    |
| BAE SYSTEMS PLC           | 78,800    | 4.328    | 341,046.400                                    |
| AVIVA PLC                 | 72,900    | 4.211    | 306,981.900                                    |
| GLAXOSMITHKLINE PLC       | 118,502   | 15.660   | 1,855,741.320                                  |
| MELROSE PLC               | 30,600    | 2.800    | 85,680.000                                     |
| INVENSYS PLC              | 18,800    | 5.015    | 94,282.000                                     |
| REED ELSEVIER PLC         | 27,846    | 8.655    | 241,007.130                                    |
| BG GROUP PLC              | 80,800    | 12.345   | 997,476.000                                    |
| DIAGEO PLC                | 60,500    | 19.170   | 1,159,785.000                                  |
| RIO TINTO PLC-REG         | 30,200    | 32.550   | 983,010.000                                    |
| STANDARD CHARTERED PLC    | 57,500    | 13.035   | 749,512.500                                    |
| TESCO PLC                 | 191,800   | 3.245    | 622,391.000                                    |
| FRESNILLO PLC             | 5,000     | 7.280    | 36,400.000                                     |
| SMITH & NEPHEW PLC        | 22,400    | 8.350    | 187,040.000                                    |
| GLENCORE XSTRATA PLC      | 259,125   | 3.080    | 798,105.000                                    |
| SMITHS GROUP PLC          | 9,733     | 13.960   | 135,872.680                                    |
| BABCOCK INTL GROUP PLC    | 9,000     | 12.770   | 114,930.000                                    |
| PEARSON PLC               | 20,263    | 12.930   | 262,000.590                                    |
| SAINSBURY (J) PLC         | 31,125    | 3.786    | 117,839.250                                    |
| NEXT PLC                  | 3,900     | 53.900   | 210,210.000                                    |
| WHITBREAD PLC             | 4,511     | 35.390   | 159,644.290                                    |
| IMI PLC                   | 7,600     | 14.400   | 109,440.000                                    |
| BUNZL PLC                 | 8,455     | 13.720   | 116,002.600                                    |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC   | 24,800    | 4.555    | 112,964.000                                    |
| GKN PLC                   | 41,100    | 3.616    | 148,617.600                                    |
| VODAFONE GROUP PLC        | 1,161,137 | 2.285    | 2,653,198.040                                  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC   | 3,900     | 23.370   | 91,143.000                                     |

|                           |           |        |               |
|---------------------------|-----------|--------|---------------|
| KINGFISHER PLC            | 57,711    | 3.668  | 211,683.940   |
| WPP PLC                   | 32,400    | 13.020 | 421,848.000   |
| UNITED UTILITIES GROUP PL | 16,727    | 6.680  | 111,736.360   |
| SEVERN TRENT PLC          | 5,833     | 16.950 | 98,869.350    |
| RECKITT BENCKISER PLC     | 15,400    | 45.590 | 702,086.000   |
| SCHRODERS PLC             | 3,200     | 24.310 | 77,792.000    |
| TATE&LYLE PLC             | 11,600    | 7.755  | 89,958.000    |
| AMEC PLC                  | 7,900     | 10.480 | 82,792.000    |
| SSE PLC                   | 23,400    | 13.450 | 314,730.000   |
| WEIR GROUP PLC (THE)      | 5,100     | 20.640 | 105,264.000   |
| ASTRAZENECA PLC           | 30,200    | 35.365 | 1,068,023.000 |
| WOLSELEY PLC              | 6,515     | 32.160 | 209,522.400   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 145,600   | 2.075  | 302,120.000   |
| 3I GROUP PLC              | 27,591    | 3.660  | 100,983.060   |
| BRITISH SKY BROADCASTING  | 25,900    | 7.960  | 206,164.000   |
| SAGE GROUP PLC (THE)      | 30,514    | 3.823  | 116,655.020   |
| NATIONAL GRID PLC         | 89,828    | 7.660  | 688,082.480   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC  | 1,131,865 | 0.760  | 860,217.400   |
| RSA INSURANCE GROUP PLC   | 88,800    | 0.924  | 82,051.200    |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP    | 23,500    | 22.580 | 530,630.000   |
| CENTRICA PLC              | 124,460   | 3.231  | 402,130.260   |
| ARM HOLDINGS PLC          | 34,400    | 9.930  | 341,592.000   |
| BRIT AMERICAN TOBACCO PLC | 45,960    | 31.480 | 1,446,820.800 |
| ICAP PLC                  | 16,900    | 4.241  | 71,672.900    |
| SABMILLER PLC             | 22,900    | 29.950 | 685,855.000   |
| BHP BILLITON PLC          | 50,677    | 17.845 | 904,331.060   |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS  | 8,600     | 23.000 | 197,800.000   |
| HSBC HOLDINGS PLC         | 447,900   | 6.470  | 2,897,913.000 |
| SHIRE PLC                 | 13,300    | 27.970 | 372,001.000   |
| OLD MUTUAL PLC            | 119,325   | 1.841  | 219,677.320   |
| ANGLO AMERICAN PLC        | 33,983    | 12.810 | 435,322.230   |
| MORRISON SUPERMARKETS     | 54,500    | 2.567  | 139,901.500   |
| CARNIVAL PLC              | 4,561     | 22.100 | 100,798.100   |
| EASYJET PLC               | 4,100     | 14.990 | 61,459.000    |
| COMPASS GROUP PLC         | 43,800    | 9.120  | 399,456.000   |
| PERSIMMON PLC             | 6,700     | 11.550 | 77,385.000    |
| BT GROUP PLC              | 189,500   | 3.741  | 708,919.500   |
| COCA-COLA HBC AG-CDI      | 5,100     | 16.320 | 83,232.000    |
| WILLIAM HILL PLC          | 23,200    | 3.710  | 86,072.000    |
| BURBERRY GROUP PLC        | 10,689    | 14.520 | 155,204.280   |
| INTERCONTINENTAL HOTELS   | 6,646     | 18.890 | 125,542.940   |
| AGGREKO PLC               | 6,871     | 16.390 | 112,615.690   |
| CAPITA PLC                | 15,790    | 9.930  | 156,794.700   |
| SERCO GROUP PLC           | 15,300    | 4.432  | 67,809.600    |
| TRAVIS PERKINS PLC        | 6,200     | 17.320 | 107,384.000   |
| INTERTEK GROUP PLC        | 4,100     | 29.660 | 121,606.000   |
| ITV PLC                   | 92,900    | 1.826  | 169,635.400   |
| TULLOW OIL PLC            | 22,500    | 8.365  | 188,212.500   |
| PETROFAC LTD              | 7,000     | 11.100 | 77,700.000    |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 4,349     | 16.000 | 69,584.000    |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A S | 92,300    | 20.775 | 1,917,532.500 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B   | 60,581    | 21.775 | 1,319,151.270 |
| MEGGITT PLC               | 19,800    | 5.005  | 99,099.000    |
| G4S PLC                   | 38,000    | 2.537  | 96,406.000    |
| COBHAM PLC                | 31,500    | 2.646  | 83,349.000    |
| ADMIRAL GROUP PLC         | 5,700     | 12.330 | 70,281.000    |
| INVESTEC PLC              | 16,400    | 4.147  | 68,010.800    |
| ANTOFAGASTA PLC           | 10,800    | 7.795  | 84,186.000    |
| STANDARD LIFE PLC         | 57,600    | 3.399  | 195,782.400   |
| EXPERIAN PLC              | 23,854    | 10.670 | 254,522.180   |

|            |                           |         |            |   |
|------------|---------------------------|---------|------------|---|
|            | RESOLUTION LTD            | 34,476  | 3.290      | 113,426.040                                   |
| イギリス・ボンド   | 小計                        |         |            | イギリス・ボンド<br>40,202,407.170<br>(6,728,676,888) |
| イスラエル・シケル  |                           | 株       | イスラエル・シケル  | イスラエル・シケル                                     |
|            | BEZEQ ISRAELI TELECOM COR | 56,400  | 5.870      | 331,068.000                                   |
|            | ISRAEL CHEMICALS LTD      | 14,000  | 28.500     | 399,000.000                                   |
|            | TEVA PHARMACEUTICAL IND L | 20,800  | 139.100    | 2,893,280.000                                 |
|            | BANK HAPOALIM BM          | 26,500  | 19.050     | 504,825.000                                   |
|            | BANK LEUMI LE-ISRAEL      | 37,600  | 13.850     | 520,760.000                                   |
|            | NICE SYSTEMS LTD          | 2,100   | 141.400    | 296,940.000                                   |
| イスラエル・シケル  | 小計                        |         |            | イスラエル・シケル<br>4,945,873.000<br>(144,963,538)   |
| 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          | 76,600  | 35.660     | 2,731,556.000                                 |
|            | LEND LEASE                | 13,800  | 10.360     | 142,968.000                                   |
|            | ASCIANO LTD               | 28,600  | 5.570      | 159,302.000                                   |
|            | ALUMINA LTD               | 69,900  | 1.010      | 70,599.000                                    |
|            | WOODSIDE PETROLEUM        | 16,000  | 37.300     | 596,800.000                                   |
|            | FORTECUE METALS GROUP     | 39,700  | 5.520      | 219,144.000                                   |
|            | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 11,800  | 10.980     | 129,564.000                                   |
|            | NATIONAL AUSTRALIA BANK   | 57,800  | 33.400     | 1,930,520.000                                 |
|            | WESTPAC BANKING           | 73,898  | 30.870     | 2,281,231.260                                 |
|            | SANTOS LIMITED            | 24,400  | 13.850     | 337,940.000                                   |
|            | AUSTRALIA & NZLAND BK     | 67,300  | 30.480     | 2,051,304.000                                 |
|            | RIO TINTO LTD             | 10,900  | 65.300     | 711,770.000                                   |
|            | ORIGIN ENERGY LIMITED     | 26,600  | 13.390     | 356,174.000                                   |
|            | AMCOR                     | 28,900  | 11.360     | 328,304.000                                   |
|            | METCASH LTD               | 23,500  | 3.280      | 77,080.000                                    |
|            | ECHO ENTERTAINMENT GROUP  | 20,500  | 2.320      | 47,560.000                                    |
|            | AURIZON HOLDINGS LTD      | 46,800  | 4.760      | 222,768.000                                   |
|            | TREASURY WINE ESTATES LTD | 14,600  | 4.620      | 67,452.000                                    |
|            | NEWCREST MINING           | 20,000  | 7.340      | 146,800.000                                   |
|            | INCITEC PIVOT LTD         | 45,600  | 2.530      | 115,368.000                                   |
|            | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 38,500  | 73.930     | 2,846,305.000                                 |
|            | CALTEX AUSTRALIA LIMITED  | 4,800   | 17.000     | 81,600.000                                    |
|            | ORICA LIMITED             | 9,300   | 22.420     | 208,506.000                                   |
|            | QBE INSURANCE             | 28,800  | 10.160     | 292,608.000                                   |
|            | LEIGHTON HOLDINGS         | 4,600   | 15.570     | 71,622.000                                    |
|            | WOOLWORTHS                | 30,200  | 32.730     | 988,446.000                                   |
|            | COCA-COLA AMATIL LIMITED  | 13,700  | 11.590     | 158,783.000                                   |
|            | TABCORP HOLDINGS LIMITED  | 20,500  | 3.500      | 71,750.000                                    |
|            | CROWN LTD                 | 10,600  | 16.070     | 170,342.000                                   |
|            | QANTAS AIRWAYS LIMITED    | 38,700  | 1.030      | 39,861.000                                    |
|            | TELSTRA CORPORATION       | 105,300 | 5.020      | 528,606.000                                   |
|            | AMP LIMITED               | 72,900  | 4.240      | 309,096.000                                   |
|            | JAMES HARDIE INDUSTRIES   | 11,400  | 12.050     | 137,370.000                                   |
|            | MACQUARIE GROUP LIMITED   | 6,984   | 52.100     | 363,866.400                                   |
|            | CSL LIMITED               | 11,900  | 66.400     | 790,160.000                                   |
|            | WESFARMERS LIMITED        | 24,690  | 42.560     | 1,050,806.400                                 |
|            | COCHLEAR LIMITED          | 1,700   | 56.530     | 96,101.000                                    |
|            | SUNCORP GROUP LTD         | 30,900  | 12.410     | 383,469.000                                   |
|            | BORAL LIMITED             | 22,700  | 4.640      | 105,328.000                                   |
|            | ASX LTD                   | 5,000   | 35.200     | 176,000.000                                   |
|            | COMPUTERSHARE LIMITED     | 13,900  | 10.750     | 149,425.000                                   |
|            | HARVEY NORMAN HOLDINGS LT | 14,000  | 2.980      | 41,720.000                                    |
|            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 49,800  | 5.400      | 268,920.000                                   |

|               |                           |        |        |   |
|---------------|---------------------------|--------|--------|---|
|               | SONIC HEALTHCARE LTD      | 9,500  | 15.920 | 151,240.000                                     |
|               | TRANSURBAN GROUP          | 33,400 | 6.900  | 230,460.000                                     |
|               | ILUKA RESOURCES LTD       | 12,000 | 8.110  | 97,320.000                                      |
|               | TOLL HOLDINGS LIMITED     | 18,800 | 5.550  | 104,340.000                                     |
|               | SYDNEY AIRPORT            | 14,100 | 3.900  | 54,990.000                                      |
|               | WORLEYPARSONS LTD         | 6,100  | 16.100 | 98,210.000                                      |
|               | TATTS GROUP LTD           | 36,900 | 3.050  | 112,545.000                                     |
|               | AGL ENERGY LTD            | 14,000 | 14.510 | 203,140.000                                     |
|               | BRAMBLES LTD              | 38,600 | 8.610  | 332,346.000                                     |
|               | APA GROUP                 | 21,700 | 6.130  | 133,021.000                                     |
|               | RAMSAY HEALTH CARE LTD    | 2,900  | 41.660 | 120,814.000                                     |
|               | ALS LTD                   | 9,500  | 8.390  | 79,705.000                                      |
|               | RECALL HOLDINGS LTD       | 7,720  | 4.210  | 32,501.200                                      |
| オーストラリア・ドル 小計 |                           |        |        | オーストラリア・ドル<br>23,805,527.260<br>(2,184,633,237) |
| カナダ・ドル        |                           | 株      | カナダ・ドル | カナダ・ドル  |
|               | IMPERIAL OIL LTD          | 7,500  | 45.370 | 340,275.000                                     |
|               | SILVER WHEATON CORP       | 8,500  | 21.750 | 184,875.000                                     |
|               | INTACT FINANCIAL CORP     | 3,400  | 68.360 | 232,424.000                                     |
|               | BCE INC                   | 6,530  | 44.970 | 293,654.100                                     |
|               | FRANCO-NEVADA CORP        | 3,700  | 42.920 | 158,804.000                                     |
|               | SUNCOR ENERGY INC         | 36,680 | 35.510 | 1,302,506.800                                   |
|               | METRO INC-A               | 2,500  | 65.030 | 162,575.000                                     |
|               | NATIONAL BANK OF CANADA   | 4,000  | 88.680 | 354,720.000                                     |
|               | BANK OF NOVA SCOTIA       | 28,500 | 63.310 | 1,804,335.000                                   |
|               | CANADIAN IMPERIAL BANK    | 9,800  | 89.420 | 876,316.000                                     |
|               | TORONTO-DOMINION BANK     | 22,100 | 95.810 | 2,117,401.000                                   |
|               | GREAT-WEST LIFECO INC     | 7,100  | 31.400 | 222,940.000                                     |
|               | MEG ENERGY CORP           | 3,800  | 29.490 | 112,062.000                                     |
|               | ROYAL BANK OF CANADA      | 34,900 | 68.750 | 2,399,375.000                                   |
|               | TOURMALINE OIL CORP       | 4,200  | 44.480 | 186,816.000                                     |
|               | VERMILION ENERGY INC      | 2,800  | 60.520 | 169,456.000                                     |
|               | TRANSCANADA CORP          | 16,700 | 46.670 | 779,389.000                                     |
|               | BAYTEX ENERGY CORP        | 3,400  | 40.350 | 137,190.000                                     |
|               | PENGROWTH ENERGY CORP     | 14,700 | 6.680  | 98,196.000                                      |
|               | PEMBINA PIPELINE CORP     | 7,500  | 36.010 | 270,075.000                                     |
|               | BOMBARDIER INC 'B'        | 36,600 | 4.530  | 165,798.000                                     |
|               | BARRICK GOLD CORP         | 28,500 | 18.230 | 519,555.000                                     |
|               | CAE INC                   | 9,200  | 12.940 | 119,048.000                                     |
|               | THOMSON REUTERS CORP      | 9,004  | 39.100 | 352,056.400                                     |
|               | POTASH CORP OF SASKATCHEW | 20,900 | 33.170 | 693,253.000                                     |
|               | LOBLAW COMPANIES LTD      | 3,500  | 41.910 | 146,685.000                                     |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD A  | 3,600  | 35.220 | 126,792.000                                     |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS-B   | 8,700  | 47.170 | 410,379.000                                     |
|               | AGNICO-EAGLE MINES        | 4,400  | 27.590 | 121,396.000                                     |
|               | ATHABASCA OIL CORP        | 9,000  | 6.400  | 57,600.000                                      |
|               | KINROSS GOLD CORP         | 29,500 | 4.880  | 143,960.000                                     |
|               | BANK OF MONTREAL          | 15,800 | 69.060 | 1,091,148.000                                   |
|               | POWER CORP OF CANADA      | 8,500  | 31.100 | 264,350.000                                     |
|               | CAMECO CORP               | 10,300 | 22.230 | 228,969.000                                     |
|               | TELUS CORP                | 6,400  | 36.020 | 230,528.000                                     |
|               | POWER FINANCIAL CORP      | 6,300  | 35.250 | 222,075.000                                     |
|               | NEW GOLD INC              | 14,000 | 5.120  | 71,680.000                                      |
|               | TECK RESOURECES LIMITED-B | 14,100 | 24.450 | 344,745.000                                     |
|               | CANADIAN TIRE CORP -CL A  | 2,000  | 97.300 | 194,600.000                                     |
|               | TALISMAN ENERGY INC       | 25,000 | 12.120 | 303,000.000                                     |
|               | TURQUOISE HILL RESOURCES  | 11,100 | 3.420  | 37,962.000                                      |
|               | TURQUOISE HILL RESOURC-RI | 11,100 | 0.890  | 9,879.000                                       |
|               | AGRIUM INC                | 3,600  | 95.780 | 344,808.000                                     |

|                           |        |         |   |           |
|---------------------------|--------|---------|---|-----------|
| CANADIAN NATURAL RESOURCE | 26,200 | 33.840  | 886,608.000                                 |           |
| MAGNA INTERNATIONAL INC   | 5,500  | 84.550  | 465,025.000                                 |           |
| TRANSALTA CORP            | 6,700  | 13.330  | 89,311.000                                  |           |
| WESTON (GEORGE) LTD       | 1,400  | 77.000  | 107,800.000                                 |           |
| BLACKBERRY LTD            | 11,900 | 6.480   | 77,112.000                                  |           |
| SUN LIFE FINANCIAL SVSC   | 14,600 | 35.880  | 523,848.000                                 |           |
| ENBRIDGE INC              | 19,100 | 43.950  | 839,445.000                                 |           |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-A | 13,500 | 39.600  | 534,600.000                                 |           |
| BROOKFIELD OFFICE PROPERT | 8,750  | 20.520  | 179,550.000                                 |           |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 45,000 | 19.730  | 887,850.000                                 |           |
| VALEANT PHARMACEUTICALS I | 7,700  | 115.970 | 892,969.000                                 |           |
| GOLDCORP INC              | 19,659 | 22.570  | 443,703.630                                 |           |
| ENCANA CORP               | 17,700 | 18.930  | 335,061.000                                 |           |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY  | 4,200  | 158.580 | 666,036.000                                 |           |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSUR | 2,800  | 46.300  | 129,640.000                                 |           |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC     | 3,400  | 54.660  | 185,844.000                                 |           |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO  | 20,200 | 58.170  | 1,175,034.000                               |           |
| CGI GROUP INC - CL A      | 5,300  | 36.820  | 195,146.000                                 |           |
| HUSKY ENERGY INC          | 8,800  | 31.970  | 281,336.000                                 |           |
| ONEX CORPORATION          | 2,700  | 55.910  | 150,957.000                                 |           |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 9,800  | 24.980  | 244,804.000                                 |           |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 5,200  | 25.830  | 134,316.000                                 |           |
| SHOPPERS DRUG MART CORP   | 5,100  | 57.890  | 295,239.000                                 |           |
| SNC-LAVALIN GROUP INC     | 3,800  | 46.760  | 177,688.000                                 |           |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 17,200 | 5.900   | 101,480.000                                 |           |
| IGM FINANCIAL INC         | 3,100  | 53.670  | 166,377.000                                 |           |
| OPEN TEXT CORP            | 2,000  | 94.510  | 189,020.000                                 |           |
| CI FINANCIAL CORP         | 3,800  | 33.940  | 128,972.000                                 |           |
| SAPUTO INC                | 3,300  | 47.770  | 157,641.000                                 |           |
| FIRST QUANTUM MINERALS LT | 14,100 | 17.070  | 240,687.000                                 |           |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD  | 3,500  | 78.680  | 275,380.000                                 |           |
| YAMANA GOLD INC           | 18,300 | 9.160   | 167,628.000                                 |           |
| FORTIS INC                | 5,500  | 30.110  | 165,605.000                                 |           |
| CRESCENT POINT ENERGY COR | 9,200  | 40.460  | 372,232.000                                 |           |
| CENOVUS ENERGY INC        | 18,200 | 29.360  | 534,352.000                                 |           |
| TIM HORTONS INC           | 3,900  | 61.960  | 241,644.000                                 |           |
| DOLLARAMA INC             | 1,900  | 87.900  | 167,010.000                                 |           |
| CATAMARAN CORP            | 4,900  | 48.530  | 237,797.000                                 |           |
| PEYTO EXPLORATION & DEV   | 3,400  | 31.970  | 108,698.000                                 |           |
| CANADIAN OIL SANDS LTD    | 12,400 | 19.480  | 241,552.000                                 |           |
| ENERPLUS CORP             | 6,000  | 19.280  | 115,680.000                                 |           |
| PENN WEST PETROLEUM LTD   | 13,600 | 8.850   | 120,360.000                                 |           |
| ARC RESOURCES LTD         | 7,500  | 28.820  | 216,150.000                                 |           |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY C | 8,100  | 18.270  | 147,987.000                                 |           |
| カナダ・ドル 小計                 |        |         | カナダ・ドル<br>32,398,825.930<br>(3,141,714,151) |           |
| 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      | 31,000 | 20.130  | 624,030.000                                 |           |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD    | 41,000 | 16.530  | 677,730.000                                 |           |
| SINGAPORE AIRLINES LTD    | 16,470 | 10.030  | 165,194.100                                 |           |
| KEPPEL CORP               | 35,500 | 10.810  | 383,755.000                                 |           |
| UOL GROUP LIMITED         | 16,400 | 6.010   | 98,564.000                                  |           |
| CITY DEVELOPMENT          | 14,000 | 9.590   | 134,260.000                                 |           |
| CAPITALAND LIMITED        | 67,000 | 2.950   | 197,650.000                                 |           |
| SEBACORP MARINE LTD       | 25,000 | 4.300   | 107,500.000                                 |           |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS  | 41,000 | 4.020   | 164,820.000                                 |           |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LT | 3,000  | 34.350  | 103,050.000                                 |           |
| O.C.B.C.                  | 64,000 | 9.830   | 629,120.000                                 |           |

|             |                           |         |             |  |
|-------------|---------------------------|---------|-------------|--|
|             | GENTING SINGAPORE PLC     | 153,000 | 1.455       | 222,615.000                                  |
|             | SINGAPORE TELECOM LTD     | 189,450 | 3.610       | 683,914.500                                  |
|             | NOBLE GROUP LTD           | 115,181 | 1.040       | 119,788.240                                  |
|             | SINGAP. TECH ENGINEERING  | 48,000  | 3.780       | 181,440.000                                  |
|             | SEMBCORP INDUSTRIES LTD   | 36,000  | 5.230       | 188,280.000                                  |
|             | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 219,400 | 0.540       | 118,476.000                                  |
|             | SINGAPORE EXCHANGE LTD    | 27,000  | 6.960       | 187,920.000                                  |
|             | OLAM INTERNATIONAL LTD    | 50,000  | 1.445       | 72,250.000                                   |
|             | WILMAR INTERNATIONAL LTD  | 56,000  | 3.390       | 189,840.000                                  |
|             | CAPITAMALLS ASIA LTD      | 45,000  | 1.905       | 85,725.000                                   |
|             | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIE | 56,000  | 2.890       | 161,840.000                                  |
| シンガポール・ドル   | 小計                        |         |             | シンガポール・ドル<br>5,497,761.840<br>(449,716,919)  |
| スイス・フラン     | 株                         |         | スイス・フラン     | スイス・フラン                                      |
|             | ADECCO SA-REG             | 3,450   | 64.750      | 223,387.500                                  |
|             | ROCHE HOLDING AG-GENUS    | 16,850  | 233.400     | 3,932,790.000                                |
|             | PARGESA HOLDING SA-BR     | 800     | 69.650      | 55,720.000                                   |
|             | SIKA AG-BR                | 60      | 3,014.000   | 180,840.000                                  |
|             | LINDT & SPRUENGLI AG-REG  | 3       | 46,005.000  | 138,015.000                                  |
|             | ABB LTD                   | 54,250  | 21.960      | 1,191,330.000                                |
|             | ARYZTA AG                 | 2,150   | 65.250      | 140,287.500                                  |
|             | TRANSOCEAN LTD            | 9,350   | 42.360      | 396,066.000                                  |
|             | SWISS RE LTD              | 8,500   | 77.500      | 658,750.000                                  |
|             | NESTLE SA-REGISTERED      | 77,500  | 63.500      | 4,921,250.000                                |
|             | SCHINDLER HOLDING-PART CE | 1,350   | 123.100     | 166,185.000                                  |
|             | CREDIT SUISSE GROUP AG    | 36,170  | 25.940      | 938,249.800                                  |
|             | JULIUS BAER GROUP LTD     | 5,400   | 40.900      | 220,860.000                                  |
|             | SULZER AG-REG             | 800     | 136.200     | 108,960.000                                  |
|             | SGS SA                    | 140     | 1,977.000   | 276,780.000                                  |
|             | THE SWATCH GROUP AG-B     | 800     | 572.000     | 457,600.000                                  |
|             | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 3,582   | 248.000     | 888,336.000                                  |
|             | BALOISE HOLDING AG - REG  | 1,200   | 103.200     | 123,840.000                                  |
|             | NOVARTIS AG-REG SHS       | 55,200  | 67.800      | 3,742,560.000                                |
|             | CIE FINANC RICHEMON-REG   | 12,700  | 85.100      | 1,080,770.000                                |
|             | UBS AG-REGISTERED         | 88,750  | 16.170      | 1,435,087.500                                |
|             | SWISSCOM AG-REG           | 620     | 457.300     | 283,526.000                                  |
|             | GEBERIT AG-REG            | 900     | 251.800     | 226,620.000                                  |
|             | GIVAUDAN REG              | 220     | 1,213.000   | 266,860.000                                  |
|             | ACTELION LTD-REG          | 2,750   | 72.000      | 198,000.000                                  |
|             | SYNGENTA AG               | 2,212   | 344.300     | 761,591.600                                  |
|             | SONOVA HOLDING AG-REG     | 1,450   | 117.400     | 170,230.000                                  |
|             | LONZA GROUP AG-REG        | 1,550   | 80.650      | 125,007.500                                  |
|             | SWATCH GROUP AG/THE-REG   | 1,500   | 97.850      | 146,775.000                                  |
|             | HOLCIM LTD-REG            | 5,900   | 64.550      | 380,845.000                                  |
|             | SWISS LIFE HOLDING AG     | 950     | 174.900     | 166,155.000                                  |
|             | KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG  | 1,350   | 113.400     | 153,090.000                                  |
| スイス・フラン     | 小計                        |         |             | スイス・フラン<br>24,156,364.400<br>(2,807,452,671) |
| スウェーデン・クローナ | 株                         |         | スウェーデン・クローナ | スウェーデン・クローナ                                  |
|             | ERICSSON LM-B SHS         | 73,280  | 76.100      | 5,576,608.000                                |
|             | VOLVO AB-B SHS            | 36,700  | 80.700      | 2,961,690.000                                |
|             | MILLICOM INTL CELLULAR-SD | 1,700   | 651.000     | 1,106,700.000                                |
|             | S.K.F. AB-B SHS           | 9,900   | 170.700     | 1,689,930.000                                |
|             | ELECTROLUX AB-SER B       | 6,400   | 154.100     | 986,240.000                                  |
|             | NORDEA AB                 | 64,600  | 80.700      | 5,213,220.000                                |
|             | ELEKTA AB-B SHS           | 8,800   | 91.550      | 805,640.000                                  |
|             | SCANIA AB-B SHS           | 8,150   | 120.000     | 978,000.000                                  |

|                           |        |             |  |  |
|---------------------------|--------|-------------|--|--|
| SWEDISH MATCH AB          | 5,350  | 196.000     | 1,048,600.000                                  |  |
| TELE2 AB-B SHS            | 8,950  | 70.350      | 629,632.500                                    |  |
| GETINGE AB-B SHS          | 5,100  | 207.200     | 1,056,720.000                                  |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BA | 36,550 | 77.800      | 2,843,590.000                                  |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A   | 12,200 | 291.000     | 3,550,200.000                                  |  |
| SWEDBANK AB               | 21,350 | 167.000     | 3,565,450.000                                  |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B     | 22,900 | 286.400     | 6,558,560.000                                  |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B    | 14,350 | 189.400     | 2,717,890.000                                  |  |
| SKANSKA AB-B              | 9,600  | 122.600     | 1,176,960.000                                  |  |
| SANDVIK AB                | 26,250 | 87.350      | 2,292,937.500                                  |  |
| INVESTOR AB-B SHS         | 10,900 | 206.200     | 2,247,580.000                                  |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS      | 16,650 | 170.500     | 2,838,825.000                                  |  |
| SECURITAS AB-B SHS        | 9,200  | 65.800      | 605,360.000                                    |  |
| TELIASONERA AB            | 56,350 | 50.800      | 2,862,580.000                                  |  |
| ALFA LAVAL AB             | 7,550  | 149.100     | 1,125,705.000                                  |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS      | 9,400  | 155.400     | 1,460,760.000                                  |  |
| ASSA ABLOY AB-B           | 8,000  | 320.300     | 2,562,400.000                                  |  |
| LUNDIN PETROLEUM AB       | 6,400  | 128.600     | 823,040.000                                    |  |
| BOLIDEN AB                | 7,900  | 91.250      | 720,875.000                                    |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS        | 12,550 | 36.580      | 459,079.000                                    |  |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B  | 5,250  | 290.600     | 1,525,650.000                                  |  |
| HEXAGON AB-B SHS          | 6,100  | 191.700     | 1,169,370.000                                  |  |
| スウェーデン・クローナ 小計            |        |             | スウェーデン・クローナ<br>63,159,792.000<br>(990,977,137) |  |
| 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        | 9,600  | 952.500     | 9,144,000.000                                  |  |
| DANSKE BANK A/S           | 15,850 | 119.300     | 1,890,905.000                                  |  |
| A P MOLLER-MAERSK A/S-A   | 19     | 51,350.000  | 975,650.000                                    |  |
| TDC A/S                   | 11,500 | 50.700      | 583,050.000                                    |  |
| CARLSBERG AS-B            | 2,750  | 572.000     | 1,573,000.000                                  |  |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 5,500  | 213.400     | 1,173,700.000                                  |  |
| COLOPLAST-B               | 2,700  | 341.100     | 920,970.000                                    |  |
| DSV A/S                   | 5,600  | 166.300     | 931,280.000                                    |  |
| WILLIAM DEMANT HOLDING    | 825    | 511.000     | 421,575.000                                    |  |
| A P MOLLER-MAERSK A/S     | 32     | 54,250.000  | 1,736,000.000                                  |  |
| デンマーク・クローネ 小計             |        |             | デンマーク・クローネ<br>19,350,130.000<br>(367,265,467)  |  |
| ニュージーランド・ドル               | 株      | ニュージーランド・ドル | ニュージーランド・ドル                                    |  |
| TELECOM CORP OF NZ        | 65,589 | 2.320       | 152,166.480                                    |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 26,000 | 3.580       | 93,080.000                                     |  |
| FLETCHER BUILDING LTD     | 20,100 | 8.540       | 171,654.000                                    |  |
| ニュージーランド・ドル 小計            |        |             | ニュージーランド・ドル<br>416,900.480<br>(35,461,555)     |  |
| ノルウェー・クローネ                | 株      | ノルウェー・クローネ  | ノルウェー・クローネ                                     |  |
| NORSK HYDRO ASA           | 24,700 | 25.650      | 633,555.000                                    |  |
| DNB ASA                   | 25,200 | 106.300     | 2,678,760.000                                  |  |
| ORKLA ASA                 | 19,050 | 46.200      | 880,110.000                                    |  |
| TELENOR ASA               | 17,000 | 143.700     | 2,442,900.000                                  |  |
| STATOIL ASA               | 27,073 | 141.700     | 3,836,244.100                                  |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA    | 4,960  | 264.400     | 1,311,424.000                                  |  |
| SEADRILL LTD              | 9,850  | 245.000     | 2,413,250.000                                  |  |
| AKER SOLUTIONS ASA        | 4,250  | 101.400     | 430,950.000                                    |  |
| SUBSEA 7 SA               | 6,600  | 112.600     | 743,160.000                                    |  |
| ノルウェー・クローネ 小計             |        |             | ノルウェー・クローネ                                     |  |

|                           |        |   |         | 15,370,353.100<br>(258,683,042) |
|---------------------------|--------|---|---------|---------------------------------|
| ユーロ                       |        | 株 | ユーロ     | ユーロ                             |
| BAYER AG                  | 19,650 |   | 96.160  | 1,889,544.000                   |
| DEUTSCHE BANK AG-REG      | 25,250 |   | 33.225  | 838,931.250                     |
| COMMERZBANK AG            | 22,585 |   | 11.150  | 251,822.750                     |
| VOLKSWAGEN AG             | 750    |   | 185.750 | 139,312.500                     |
| VOLKSWAGEN AG PFD         | 3,600  |   | 193.400 | 696,240.000                     |
| M.A.N.                    | 1,300  |   | 88.660  | 115,258.000                     |
| SIEMENS AG                | 19,100 |   | 94.900  | 1,812,590.000                   |
| E.ON SE                   | 43,400 |   | 12.960  | 562,464.000                     |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE  | 8,200  |   | 80.440  | 659,608.000                     |
| GEA GROUP AG              | 4,400  |   | 33.330  | 146,652.000                     |
| OSRAM LICHT AG            | 2,410  |   | 39.910  | 96,183.100                      |
| CONTINENTAL AG            | 2,700  |   | 153.000 | 413,100.000                     |
| BASF SE                   | 22,100 |   | 74.250  | 1,640,925.000                   |
| LINDE                     | 4,600  |   | 146.950 | 675,970.000                     |
| K+S AG                    | 4,400  |   | 20.505  | 90,222.000                      |
| ALLIANZ SE-REG            | 11,200 |   | 123.900 | 1,387,680.000                   |
| THYSSENKRUPP AG           | 9,950  |   | 16.765  | 166,811.750                     |
| HENKEL AG & CO KGAA       | 4,400  |   | 79.890  | 351,516.000                     |
| R.W.E. AG                 | 11,800 |   | 25.885  | 305,443.000                     |
| LUFTHANSA                 | 6,750  |   | 15.170  | 102,397.500                     |
| FRAPORT AG                | 1,100  |   | 53.860  | 59,246.000                      |
| BRENTAG AG                | 1,250  |   | 132.000 | 165,000.000                     |
| FRESENIUS SE & CO KGAA    | 3,050  |   | 107.050 | 326,502.500                     |
| UNITED INTERNET AG-REG SH | 3,300  |   | 29.580  | 97,614.000                      |
| HOCHTIEF AG               | 1,150  |   | 59.730  | 68,689.500                      |
| SAP AG                    | 22,842 |   | 58.980  | 1,347,221.160                   |
| MUNCHENER RUECK AG-REG    | 4,450  |   | 155.800 | 693,310.000                     |
| HEIDELBERGCEMENT AG       | 3,400  |   | 53.830  | 183,022.000                     |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING | 3,700  |   | 72.490  | 268,213.000                     |
| BEIERSDORF AG             | 2,550  |   | 71.680  | 182,784.000                     |
| CELESIO AG                | 2,800  |   | 22.910  | 64,148.000                      |
| MERCK KGAA                | 1,650  |   | 124.700 | 205,755.000                     |
| ADIDAS AG                 | 5,170  |   | 86.300  | 446,171.000                     |
| HENKEL KGAA               | 3,300  |   | 71.400  | 235,620.000                     |
| METRO AG                  | 3,150  |   | 34.945  | 110,076.750                     |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG   | 69,500 |   | 11.740  | 815,930.000                     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG | 5,200  |   | 49.980  | 259,896.000                     |
| DAIMLER AG                | 23,500 |   | 59.150  | 1,390,025.000                   |
| QIAGEN N.V.               | 6,800  |   | 16.340  | 111,112.000                     |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG  | 27,700 |   | 7.361   | 203,899.700                     |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUN | 1,850  |   | 60.700  | 112,295.000                     |
| DEUTSCHE POST AG          | 22,000 |   | 24.515  | 539,330.000                     |
| DEUTSCHE BOERSE AG        | 4,650  |   | 55.480  | 257,982.000                     |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG- | 3,750  |   | 34.190  | 128,212.500                     |
| SUEDZUCKER AG             | 2,250  |   | 18.330  | 41,242.500                      |
| LANXESS                   | 2,250  |   | 44.805  | 100,811.250                     |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING | 800    |   | 95.900  | 76,720.000                      |
| SKY DEUTSCHLAND AG        | 9,850  |   | 7.834   | 77,164.900                      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV    | 23,376 |   | 25.450  | 594,919.200                     |
| ARCELORMITTAL             | 24,750 |   | 11.755  | 290,936.250                     |
| UNILEVER NV-CVA           | 39,250 |   | 27.720  | 1,088,010.000                   |
| HEINEKEN NV               | 5,600  |   | 46.540  | 260,624.000                     |
| REED ELSEVIER NV          | 16,677 |   | 14.905  | 248,570.680                     |
| AEGON NV                  | 42,844 |   | 6.198   | 265,547.110                     |
| AHOLD (KONINKLIJKE) NV    | 24,260 |   | 12.640  | 306,646.400                     |
| AKZO NOBEL                | 5,750  |   | 52.880  | 304,060.000                     |
| KONINKLIJKE DSM NV        | 3,700  |   | 55.330  | 204,721.000                     |



|                           |        |         |               |
|---------------------------|--------|---------|---------------|
| WOLTERS KLUWER            | 7,100  | 20.080  | 142,568.000   |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA  | 2,100  | 36.275  | 76,177.500    |
| ING GROEP N.V.            | 93,300 | 9.151   | 853,788.300   |
| KONINKLIJKE KPN NV        | 80,400 | 2.265   | 182,106.000   |
| ASML HOLDING NV           | 8,680  | 63.870  | 554,391.600   |
| TNT EXPRESS NV            | 10,195 | 6.444   | 65,696.580    |
| VOPAK                     | 2,000  | 41.175  | 82,350.000    |
| RANDSTAD HOLDING NV       | 2,950  | 44.030  | 129,888.500   |
| FUGRO NV-CVA              | 1,900  | 41.350  | 78,565.000    |
| HEINEKEN HOLDING NV       | 2,550  | 43.545  | 111,039.750   |
| ZIGGO NV                  | 3,650  | 32.350  | 118,077.500   |
| GEMALTO                   | 1,900  | 77.830  | 147,877.000   |
| OCI NV                    | 2,000  | 29.210  | 58,420.000    |
| TOTAL SA                  | 51,000 | 41.935  | 2,138,685.000 |
| MICHELIN (CGDE) - B       | 4,500  | 74.500  | 335,250.000   |
| AIR LIQUIDE               | 7,576  | 97.640  | 739,720.640   |
| KERING                    | 1,900  | 150.650 | 286,235.000   |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA     | 12,750 | 59.500  | 758,625.000   |
| BOUYGUES                  | 4,750  | 25.750  | 122,312.500   |
| LAFARGE SA                | 4,450  | 50.580  | 225,081.000   |
| BNP PARIBAS               | 23,650 | 52.740  | 1,247,301.000 |
| NATIXIS                   | 28,050 | 4.118   | 115,509.900   |
| THALES SA                 | 2,250  | 44.190  | 99,427.500    |
| GROUPE DANONE             | 13,700 | 50.570  | 692,809.000   |
| CARREFOUR                 | 14,900 | 27.135  | 404,311.500   |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA     | 8,075  | 12.475  | 100,735.620   |
| VIVENDI SA                | 29,141 | 18.400  | 536,194.400   |
| L'OREAL                   | 5,750  | 123.350 | 709,262.500   |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 9,850  | 37.330  | 367,700.500   |
| LEGRAND SA                | 6,467  | 38.600  | 249,626.200   |
| ALCATEL-LUCENT            | 50,000 | 3.247   | 162,350.000   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 1,550  | 79.240  | 122,822.000   |
| PERNOD-RICARD             | 5,217  | 79.610  | 415,325.370   |
| EURAZEO                   | 1,130  | 56.600  | 63,958.000    |
| REXEL SA                  | 4,700  | 18.250  | 85,775.000    |
| SOCIETE GENERALE-A        | 16,950 | 39.570  | 670,711.500   |
| LVMH                      | 6,200  | 129.000 | 799,800.000   |
| ACCOR SA                  | 3,850  | 32.375  | 124,643.750   |
| CAP GEMINI SA             | 3,600  | 45.750  | 164,700.000   |
| VALEO                     | 1,650  | 75.700  | 124,905.000   |
| PUBLICIS GROUPE           | 4,350  | 62.720  | 272,832.000   |
| VALLOUREC                 | 2,650  | 38.710  | 102,581.500   |
| BUREAU VERITAS SA         | 5,600  | 19.990  | 111,944.000   |
| SODEXO                    | 2,300  | 70.950  | 163,185.000   |
| ESSILOR INTERNATIONAL     | 5,000  | 72.000  | 360,000.000   |
| AXA                       | 43,250 | 18.440  | 797,530.000   |
| CHRISTIAN DIOR            | 1,300  | 130.500 | 169,650.000   |
| LAGARDERE S.C.A.          | 3,800  | 24.925  | 94,715.000    |
| TECHNIP S.A.              | 2,450  | 67.000  | 164,150.000   |
| EDENRED                   | 5,300  | 24.475  | 129,717.500   |
| RENAULT                   | 4,700  | 57.380  | 269,686.000   |
| STMICROELECTRONICS NV     | 15,950 | 5.265   | 83,976.750    |
| ATOS                      | 1,600  | 61.980  | 99,168.000    |
| DASSAULT SYSTEMS SA       | 1,500  | 85.990  | 128,985.000   |
| WENDEL                    | 1,100  | 102.950 | 113,245.000   |
| CIE GENERALE DE GEOPHYSIQ | 4,650  | 12.040  | 55,986.000    |
| ORANGE                    | 44,850 | 8.738   | 391,899.300   |
| ALSTOM                    | 5,300  | 25.105  | 133,056.500   |
| CNP ASSURANCES            | 5,150  | 13.435  | 69,190.250    |
| SANOFI                    | 28,825 | 72.380  | 2,086,353.500 |

|                           |         |         |               |
|---------------------------|---------|---------|---------------|
| VINCI                     | 11,250  | 44.680  | 502,650.000   |
| EUROPEAN AERONAUTIC DEFEN | 14,350  | 54.440  | 781,214.000   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT      | 8,300   | 11.225  | 93,167.500    |
| CREDIT AGRICOLE SA        | 24,100  | 8.749   | 210,850.900   |
| GDF SUEZ                  | 31,523  | 16.165  | 509,569.290   |
| IMERYS SA                 | 1,100   | 60.100  | 66,110.000    |
| ELECTRICITE DE FRANCE     | 6,000   | 25.430  | 152,580.000   |
| SES                       | 7,300   | 22.600  | 164,980.000   |
| SAFRAN SA                 | 6,200   | 48.370  | 299,894.000   |
| ILIAD SA                  | 600     | 170.100 | 102,060.000   |
| ARKEMA                    | 1,550   | 78.380  | 121,489.000   |
| ADP                       | 950     | 81.130  | 77,073.500    |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS   | 4,050   | 21.300  | 86,265.000    |
| SCOR SE                   | 4,550   | 24.820  | 112,931.000   |
| GROUPE EUROTUNNEL SA-REGR | 18,050  | 7.218   | 130,284.900   |
| UCB SA                    | 2,800   | 50.740  | 142,072.000   |
| KBC GROUPE                | 5,100   | 38.150  | 194,565.000   |
| COLRUYT SA                | 2,500   | 39.530  | 98,825.000    |
| DELHAIZE GROUP            | 2,500   | 39.940  | 99,850.000    |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT  | 2,000   | 63.660  | 127,320.000   |
| SOLVAY SA                 | 1,450   | 107.750 | 156,237.500   |
| UMICORE                   | 2,950   | 31.935  | 94,208.250    |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV   | 19,350  | 73.610  | 1,424,353.500 |
| AGEAS                     | 5,590   | 29.375  | 164,206.250   |
| BELGACOM SA               | 4,900   | 20.460  | 100,254.000   |
| FIAT SPA                  | 22,150  | 5.435   | 120,385.250   |
| PRYSMIAN SPA              | 5,700   | 17.810  | 101,517.000   |
| ASSICURAZIONI GENERALI    | 28,743  | 16.290  | 468,223.470   |
| SAIPEM                    | 6,900   | 15.180  | 104,742.000   |
| MEDIOBANCA SPA            | 17,115  | 5.985   | 102,433.270   |
| TENARIS SA                | 11,250  | 15.440  | 173,700.000   |
| UNICREDIT SPA             | 102,969 | 5.150   | 530,290.350   |
| TELECOM ITALIA SPA        | 240,082 | 0.688   | 165,176.410   |
| TELECOM ITALIA-RNC        | 170,950 | 0.546   | 93,338.700    |
| INTESA SANPAOLO           | 279,197 | 1.679   | 468,771.760   |
| ATLANTIA SPA              | 8,407   | 15.790  | 132,746.530   |
| ENI SPA                   | 61,200  | 16.370  | 1,001,844.000 |
| FINMECCANICA SPA          | 11,225  | 5.090   | 57,135.250    |
| MONTE DEI PASCHI SIENA    | 131,900 | 0.157   | 20,708.300    |
| ENEL SPA                  | 159,700 | 3.020   | 482,294.000   |
| SNAM SPA                  | 49,900  | 3.844   | 191,815.600   |
| LUXOTTICA GROUP SPA       | 3,750   | 36.800  | 138,000.000   |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE | 20,700  | 4.774   | 98,821.800    |
| TERNA SPA                 | 33,000  | 3.524   | 116,292.000   |
| PIRELLI & C.              | 7,645   | 11.320  | 86,541.400    |
| ENEL GREEN POWER SPA      | 55,400  | 1.736   | 96,174.400    |
| CNH INDUSTRIAL NV         | 20,650  | 7.570   | 156,320.500   |
| TELEFONICA S.A.           | 100,077 | 11.310  | 1,131,870.870 |
| BANCO POPULAR ESPANOL     | 26,523  | 4.105   | 108,876.910   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA      | 140,262 | 8.289   | 1,162,631.710 |
| IBERDROLA SA              | 112,684 | 4.470   | 503,697.480   |
| BANCO DE SABADELL SA      | 75,246  | 1.762   | 132,583.450   |
| REPSOL SA                 | 21,100  | 18.085  | 381,593.500   |
| GRIFOLS SA                | 3,800   | 32.880  | 124,944.000   |
| BANCO SANTANDER SA        | 267,150 | 6.080   | 1,624,272.000 |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS  | 9,300   | 15.245  | 141,778.500   |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A   | 7,950   | 27.995  | 222,560.250   |
| GAS NATURAL SDG SA        | 9,100   | 18.165  | 165,301.500   |
| MAPFRE SA                 | 21,450  | 2.877   | 61,711.650    |
| CAIXABANK                 | 24,750  | 3.585   | 88,728.750    |

|                           |         |         |  |
|---------------------------|---------|---------|--|
| ZARDOYA OTIS SA           | 3,700   | 12.650  | 46,805.000                               |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE | 31,300  | 4.460   | 139,598.000                              |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SE | 3,876   | 22.990  | 89,109.240                               |
| INDITEX                   | 5,250   | 112.100 | 588,525.000                              |
| ENAGAS                    | 5,650   | 18.950  | 107,067.500                              |
| RED ELECTRICA DE ESPANA   | 3,050   | 45.895  | 139,979.750                              |
| FERROVIAL SA              | 9,800   | 13.320  | 130,536.000                              |
| DISTRIBUIDORA INTERNACION | 18,700  | 6.164   | 115,266.800                              |
| BANKIA SA                 | 81,222  | 1.050   | 85,283.100                               |
| UPM-KYMMENE OYJ           | 12,600  | 11.730  | 147,798.000                              |
| NOKIA OYJ                 | 89,450  | 5.400   | 483,030.000                              |
| WARTSILA OYJ              | 4,300   | 33.650  | 144,695.000                              |
| STORA ENSO OYJ-R SHS      | 17,750  | 6.955   | 123,451.250                              |
| METSO OYJ                 | 3,750   | 27.400  | 102,750.000                              |
| ELISA OYJ-A SHARES        | 4,550   | 18.670  | 84,948.500                               |
| SAMPO OYJ-A SHS           | 10,000  | 33.620  | 336,200.000                              |
| FORTUM OYJ                | 10,600  | 16.460  | 174,476.000                              |
| KONE OYJ-B                | 7,600   | 31.390  | 238,564.000                              |
| NOKIAN RENKAAT OYJ        | 3,000   | 34.070  | 102,210.000                              |
| NESTE OIL OYJ             | 4,300   | 13.570  | 58,351.000                               |
| POHJOLA BANK PLC          | 4,800   | 13.870  | 66,576.000                               |
| IMMOFINANZ AG             | 31,200  | 3.290   | 102,648.000                              |
| OMV AG                    | 3,550   | 33.325  | 118,303.750                              |
| ERSTE GROUP BANK AG       | 5,550   | 24.055  | 133,505.250                              |
| TELEKOM AUSTRIA AG        | 7,100   | 5.530   | 39,263.000                               |
| VOESTALPINE AG            | 2,850   | 33.410  | 95,218.500                               |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATI | 1,900   | 24.615  | 46,768.500                               |
| ANDRITZ AG                | 1,600   | 42.650  | 68,240.000                               |
| VIENNA INSURANCE GROUP    | 1,000   | 34.960  | 34,960.000                               |
| BANK OF IRELAND           | 450,000 | 0.263   | 118,350.000                              |
| JERONIMO MARTINS          | 6,000   | 14.300  | 85,800.000                               |
| PORTUGAL TELECOM SGPS SA  | 20,300  | 3.212   | 65,203.600                               |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA   | 48,950  | 2.650   | 129,717.500                              |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B    | 7,450   | 11.455  | 85,339.750                               |
| KERRY GROUP PLC-A         | 3,900   | 49.000  | 191,100.000                              |
| CRH PLC                   | 18,500  | 17.535  | 324,397.500                              |
| BANCO ESPIRITO SANTO-REG  | 52,300  | 0.988   | 51,672.400                               |
| ユーロ 小計                    |         |         | ユーロ<br>66,703,815.200<br>(9,444,593,194) |
| 香港・ドル                     | 株       | 香港・ドル   | 香港・ドル                                    |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 34,000  | 59.950  | 2,038,300.000                            |
| GALAXY ENTERTAINMENT      | 53,000  | 68.600  | 3,635,800.000                            |
| MTR CORP                  | 37,500  | 29.250  | 1,096,875.000                            |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES   | 40,000  | 96.550  | 3,862,000.000                            |
| HOPEWELL HOLDINGS         | 21,000  | 25.550  | 536,550.000                              |
| SINO LAND                 | 88,000  | 10.400  | 915,200.000                              |
| CHEUNG KONG               | 35,000  | 118.100 | 4,133,500.000                            |
| WHARF HOLDINGS            | 39,000  | 60.850  | 2,373,150.000                            |
| SWIRE PACIFIC LTD 'A'     | 17,500  | 90.650  | 1,586,375.000                            |
| CLP HOLDINGS LIMITED      | 44,000  | 61.100  | 2,688,400.000                            |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS    | 41,000  | 16.200  | 664,200.000                              |
| HUTCHISON WHAMPOA         | 53,300  | 100.300 | 5,345,990.000                            |
| HENDERSON LAND DEVELOPMNT | 28,600  | 43.850  | 1,254,110.000                            |
| HK & CHINA GAS            | 139,912 | 17.840  | 2,496,030.080                            |
| HANG SENG BANK            | 18,700  | 124.000 | 2,318,800.000                            |
| WHEELLOCK & CO            | 25,000  | 35.950  | 898,750.000                              |
| NEW WORLD DEVELOPMENT     | 95,000  | 9.840   | 934,800.000                              |
| HONG KONG EX & CL         | 26,600  | 132.000 | 3,511,200.000                            |
| LI & FUNG LTD             | 144,000 | 9.790   | 1,409,760.000                            |

|                           |         |        |  |  |
|---------------------------|---------|--------|--|--|
| HANG LUNG PROPERTIES LTD  | 57,000  | 24.950 | 1,422,150.000                            |  |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY    | 6,500   | 62.650 | 407,225.000                              |  |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG  | 21,000  | 24.550 | 515,550.000                              |  |
| NWS HOLDINGS LTD          | 46,500  | 12.120 | 563,580.000                              |  |
| KERRY PROPERTIES LTD      | 22,500  | 27.350 | 615,375.000                              |  |
| BANK OF EAST ASIA         | 37,040  | 32.500 | 1,203,800.000                            |  |
| SJM HOLDINGS LTD          | 47,000  | 26.200 | 1,231,400.000                            |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD      | 30,000  | 19.720 | 591,600.000                              |  |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTUR | 15,000  | 48.750 | 731,250.000                              |  |
| AIA GROUP LTD             | 289,000 | 37.950 | 10,967,550.000                           |  |
| SANDS CHINA LTD           | 58,000  | 64.650 | 3,749,700.000                            |  |
| SHANGRI-LA ASIA           | 42,000  | 15.500 | 651,000.000                              |  |
| BANK OF CHINA HONG KONG   | 94,500  | 24.550 | 2,319,975.000                            |  |
| WYNN MACAU LTD            | 46,000  | 36.150 | 1,662,900.000                            |  |
| 香港・ドル 小計                  |         |        | 香港・ドル<br>68,332,845.080<br>(906,776,855) |  |
| 合計                        |         |        | 67,190,451,296<br>[67,190,451,296]       |  |

[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 | 2,947       | 347,539.710                                  |   |  |
|                     |                           | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 7,287       | 1,111,996.200                                |   |  |
|                     |                           | BOSTON PROPERTIES INC     | 3,600       | 363,996.000                                  |   |  |
|                     |                           | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 11,200      | 226,800.000                                  |   |  |
|                     |                           | VORNADO REALTY TRUST      | 4,027       | 354,456.540                                  |   |  |
|                     |                           | EQUITY RESIDENTIAL        | 8,100       | 418,122.000                                  |   |  |
|                     |                           | AMERICAN TOWER CORP       | 9,500       | 725,705.000                                  |   |  |
|                     |                           | HOST HOTELS&RESORTS INC   | 18,093      | 333,092.130                                  |   |  |
|                     |                           | KIMCO REALTY CORP         | 10,200      | 205,020.000                                  |   |  |
|                     |                           | PLUM CREEK TIMBER CO-REIT | 4,000       | 181,280.000                                  |   |  |
|                     |                           | RAYONIER INC              | 3,000       | 123,570.000                                  |   |  |
|                     |                           | VENTAS INC                | 6,900       | 390,402.000                                  |   |  |
|                     |                           | AMERICAN CAPITAL AGENCY   | 9,300       | 183,675.000                                  |   |  |
|                     |                           | PROLOGIS INC              | 11,662      | 423,680.460                                  |   |  |
|                     |                           | CAMDEN PROPERTY TRUST     | 1,800       | 103,338.000                                  |   |  |
|                     |                           | DUKE REALTY CORP          | 8,000       | 116,000.000                                  |   |  |
|                     |                           | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 1,700       | 171,700.000                                  |   |  |
|                     |                           | HEALTH CARE REIT INC      | 6,800       | 366,044.000                                  |   |  |
|                     |                           | HCP INC                   | 10,700      | 388,624.000                                  |   |  |
|                     |                           | LIBERTY PROPERTY TRUST    | 3,300       | 112,992.000                                  |   |  |
|                     |                           | MACERICH CO/THE           | 3,400       | 199,614.000                                  |   |  |
|                     |                           | ANNALY MORTGAGE MANAGEMEN | 23,000      | 232,070.000                                  |   |  |
|                     |                           | REALTY INCOME CORP        | 4,600       | 179,446.000                                  |   |  |
|                     |                           | PUBLIC STORAGE            | 3,500       | 523,320.000                                  |   |  |
|                     |                           | REGENCY CENTERS CORP      | 2,700       | 123,876.000                                  |   |  |
|                     |                           | SL GREEN REALTY CORP      | 2,200       | 198,374.000                                  |   |  |
|                     |                           | UDR INC                   | 6,500       | 151,905.000                                  |   |  |
|                     | DIGITAL REALTY TRUST INC  | 3,100                     | 143,096.000 |  |   |  |
|                     | アメリカ・ドル                   | 小計                        |             |  | アメリカ・ドル<br>8,399,734.040<br>(863,828,649) |  |
|                     | イギリス・ポンド                  |                           |             |  | イギリス・ポンド                                  |  |
|                     |                           | LAND SECURITIES PLC       | 18,800      | 174,276.000                                  |   |  |
|                     |                           | SEGRO PLC                 | 25,350      | 81,829.800                                   |   |  |
| HAMMERSON PLC       |                           | 20,400                    | 99,878.400  |  |   |  |
| BRITISH LAND CO PLC |                           | 23,500                    | 140,295.000 |  |   |  |
| INTU PROPERTIES PLC | 18,800                    | 57,302.400                |             |  |   |  |
| イギリス・ポンド            | 小計                        |                           |             | イギリス・ポンド<br>553,581.600<br>(92,652,953)      |   |  |
| オーストラリア・ドル          |                           |                           |             | オーストラリア・ドル                                   |   |  |
|                     | WESTFIELD RETAIL TRUST    | 72,996                    | 207,308.640 |  |   |  |
|                     | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 65,500                    | 124,450.000 |  |   |  |
|                     | DEXUS PROPERTY GROUP      | 143,700                   | 146,574.000 |  |   |  |
|                     | GPT GROUP                 | 35,960                    | 122,983.200 |  |   |  |
|                     | MIRVAC GROUP              | 93,400                    | 147,572.000 |  |   |  |
|                     | STOCKLAND                 | 56,000                    | 205,520.000 |  |   |  |
|                     | WESTFIELD GROUP           | 50,396                    | 488,841.200 |  |   |  |
| GOODMAN GROUP       | 40,900                    | 189,367.000               |             |  |   |  |
| オーストラリア・ドル          | 小計                        |                           |             | オーストラリア・ドル<br>1,632,616.040<br>(149,825,174) |   |  |
| シンガポール・ドル           |                           |                           |             | シンガポール・ドル                                    |   |  |

|              |                          |        |  |
|--------------|--------------------------|--------|--|
|              | ASCENDAS REAL ESTATE INV | 48,000 | 104,160.000                              |
|              | CAPITAMALL TRUST         | 79,000 | 146,150.000                              |
| シンガポール・ドル 小計 |                          |        | シンガポール・ドル<br>250,310.000<br>(20,475,358) |
| ユーロ          | CORIO NV                 | 2,024  | 61,428.400                               |
|              | UNIBAIL-RODAMCO SE       | 2,350  | 413,012.500                              |
|              | ICADE                    | 800    | 50,896.000                               |
|              | GECINA SA                | 650    | 59,618.000                               |
|              | KLEPIERRE                | 3,200  | 103,920.000                              |
|              | FONCIERE DES REGIONS     | 950    | 56,696.000                               |
| ユーロ 小計       |                          |        | ユーロ<br>745,570.900<br>(105,565,384)      |
| 香港・ドル        | LINK REIT                | 55,500 | 香港・ドル<br>2,081,250.000                   |
| 香港・ドル 小計     |                          |        | 香港・ドル<br>2,081,250.000<br>(27,618,187)   |
| 投資証券 合計      |                          |        | 1,259,965,705<br>[1,259,965,705]         |
| 合計           |                          |        | 1,259,965,705<br>[1,259,965,705]         |

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 571銘柄<br>投資証券 28銘柄 | 97.9%        | 2.1%               | 59.2%          |
| イギリス・ポンド    | 株式 99銘柄<br>投資証券 5銘柄   | 98.6%        | 1.4%               | 10.0%          |
| イスラエル・シケル   | 株式 6銘柄                | 100%         | -%                 | 0.2%           |
| オーストラリア・ドル  | 株式 56銘柄<br>投資証券 8銘柄   | 93.6%        | 6.4%               | 3.4%           |
| カナダ・ドル      | 株式 87銘柄               | 100%         | -%                 | 4.6%           |
| シンガポール・ドル   | 株式 22銘柄<br>投資証券 2銘柄   | 95.6%        | 4.4%               | 0.7%           |
| スイス・フラン     | 株式 32銘柄               | 100%         | -%                 | 4.1%           |
| スウェーデン・クローナ | 株式 30銘柄               | 100%         | -%                 | 1.4%           |
| デンマーク・クローネ  | 株式 10銘柄               | 100%         | -%                 | 0.5%           |
| ニュージーランド・ドル | 株式 3銘柄                | 100%         | -%                 | 0.1%           |
| ノルウェー・クローネ  | 株式 9銘柄                | 100%         | -%                 | 0.4%           |
| ユーロ         | 株式 214銘柄<br>投資証券 6銘柄  | 98.9%        | 1.1%               | 14.0%          |
| 香港・ドル       | 株式 33銘柄<br>投資証券 1銘柄   | 97.0%        | 3.0%               | 1.4%           |

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在    | 平成25年12月18日現在   |
|-----------------|------------------|-----------------|
|                 | 金額(円)            | 金額(円)           |
| 資産の部            |                  |                 |
| 流動資産            |                  |                 |
| コール・ローン         | 1,238,107,617    | 1,492,297,015   |
| 投資証券            | 54,153,182,670   | 123,068,548,220 |
| 未収配当金           | 326,119,044      | 565,330,680     |
| 流動資産合計          | 55,717,409,331   | 125,126,175,915 |
| 資産合計            | 55,717,409,331   | 125,126,175,915 |
| 負債の部            |                  |                 |
| 流動負債            |                  |                 |
| 未払金             | 1,060,828,470    | 1,261,581,580   |
| 未払解約金           | 2,300,000        | 3,800,000       |
| 流動負債合計          | 1,063,128,470    | 1,265,381,580   |
| 負債合計            | 1,063,128,470    | 1,265,381,580   |
| 純資産の部           |                  |                 |
| 元本等             |                  |                 |
| 元本              | 1 42,668,886,025 | 69,992,508,701  |
| 剰余金             |                  |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 11,985,394,836   | 53,868,285,634  |
| 元本等合計           | 54,654,280,861   | 123,860,794,335 |
| 純資産合計           | 54,654,280,861   | 123,860,794,335 |
| 負債純資産合計         | 55,717,409,331   | 125,126,175,915 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | 受取配当金<br>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分           | 平成24年12月18日現在   | 平成25年12月18日現在   |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1期首        | 平成23年12月20日     | 平成24年12月19日     |
| 期首元本額         | 19,205,025,479円 | 42,668,886,025円 |
| 期中追加設定元本額     | 25,555,648,236円 | 34,750,665,114円 |
| 期中一部解約元本額     | 2,091,787,690円  | 7,427,042,438円  |
| 期末元本額の内訳      |                 |                 |
| ファンド名         |                 |                 |
| ダイワJ-REITオープン | 6,449,948,969円  | 10,278,204,640円 |



|                           |                 |                 |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワJ-REITオープン<br>（毎月分配型）  | 35,303,663,988円 | 58,543,906,837円 |
| ダイワJ-REITオープン<br>（年1回決算型） | - 円             | 556,577円        |
| DC・ダイワJ-REITオープン          | 910,680,229円    | 1,163,807,433円  |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2020    | 2,070,438円      | 2,225,277円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2030    | 2,340,121円      | 2,870,501円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー<br>2040    | 182,280円        | 381,725円        |
| ダイワ・インデックスセレクト<br>J-REIT  | - 円             | 555,711円        |
| 計                         | 42,668,886,025円 | 69,992,508,701円 |
| 2. 期末日における受益権の総数          | 42,668,886,025口 | 69,992,508,701口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。              |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 平成25年12月18日現在  |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成24年12月18日現在          | 平成25年12月18日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 3,547,436,380          | 898,472,941            |

|    |               |             |
|----|---------------|-------------|
| 合計 | 3,547,436,380 | 898,472,941 |
|----|---------------|-------------|

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成24年9月19日から平成24年12月18日まで、及び平成25年9月18日から平成25年12月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成24年12月18日現在 | 平成25年12月18日現在 |
|---------------|---------------|
| 該当事項はありません。   | 該当事項はありません。   |

(1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在        | 平成25年12月18日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.2809円<br>(12,809円) | 1.7696円<br>(17,696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   | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|------|--------------------|--------|----------------|----|
| 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 4,065  | 2,735,745,000  |    |
|      | M I Dリート投資法人       | 3,236  | 753,340,800    |    |
|      | 森ヒルズリート            | 4,881  | 3,284,913,000  |    |
|      | 野村不レジデンシャル         | 2,833  | 1,461,828,000  |    |
|      | 産業ファンド             | 2,756  | 2,408,744,000  |    |
|      | 大和ハウスリート           | 2,159  | 1,662,430,000  |    |
|      | アドバンス・レジデンス        | 21,850 | 4,828,850,000  |    |
|      | ケネディクスレジデンシャル      | 4,258  | 922,708,600    |    |
|      | A P I投資法人          | 4,352  | 3,425,024,000  |    |
|      | G L P投資法人          | 36,963 | 3,707,388,900  |    |
|      | コンフォリア・レジデンシャル     | 1,187  | 828,526,000    |    |
|      | 日本プロロジスリート         | 5,452  | 5,304,796,000  |    |
|      | N M F投資法人          | 29,343 | 2,951,905,800  |    |
|      | 星野リゾート・リート         | 357    | 212,772,000    |    |
|      | S I A不動産投資         | 1,323  | 508,032,000    |    |
|      | 日本ビルファンド           | 12,193 | 14,021,950,000 |    |
|      | ジャパンリアルエステイト       | 10,469 | 10,824,946,000 |    |
|      | 日本リテールファンド         | 40,672 | 7,817,158,400  |    |
|      | オリックス不動産投資         | 29,735 | 3,666,325,500  |    |
|      | 日本プライムリアルティ        | 14,537 | 4,913,506,000  |    |
|      | プレミアム投資法人          | 3,854  | 1,483,790,000  |    |
|      | 東急リアル・エステート        | 3,445  | 2,077,335,000  |    |
|      | グローバル・ワン不動産投資法人    | 1,707  | 1,124,913,000  |    |
|      | 野村不動産オフィスF         | 6,565  | 3,085,550,000  |    |
|      | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 41,940 | 5,984,838,000  |    |
|      | 森トラスト総合リート         | 4,645  | 3,790,320,000  |    |
|      | インヴィンシブル投資法人       | 23,758 | 403,648,420    |    |
|      | フロンティア不動産投資        | 4,370  | 4,260,750,000  |    |
|      | 平和不動産リート           | 15,408 | 1,155,600,000  |    |
|      | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 2,925  | 2,954,250,000  |    |

|                   |        |                 |  |
|-------------------|--------|-----------------|--|
| 福岡リート投資法人         | 2,432  | 1,928,576,000   |  |
| ケネディクス不動産投資法人     | 5,821  | 2,756,243,500   |  |
| 積水ハウス・S I 投資法人    | 2,812  | 1,356,790,000   |  |
| いちご不動産投資法人        | 17,855 | 1,105,224,500   |  |
| 大和証券オフィス投資法人      | 3,499  | 1,560,554,000   |  |
| 阪急リート投資法人         | 1,854  | 982,620,000     |  |
| スタートプロシード投資法人     | 2,555  | 433,839,000     |  |
| トップリート投資法人        | 3,084  | 1,421,724,000   |  |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 6,588  | 2,664,846,000   |  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 46,189 | 2,318,687,800   |  |
| 日本賃貸住宅投資法人        | 25,761 | 1,622,943,000   |  |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 3,964  | 2,354,616,000   |  |
| 投資証券 合計           |        | 123,068,548,220 |  |
| 合計                |        | 123,068,548,220 |  |

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。

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](#)

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在 | 平成25年12月18日現在 |
|-----------------|---------------|---------------|
|                 | 金額（円）         | 金額（円）         |
| 資産の部            |               |               |
| 流動資産            |               |               |
| 預金              | 4,718,835     | 2,875,287     |
| コール・ローン         | 4,249,606     | 6,584,586     |
| 投資証券            | 593,275,591   | 803,893,209   |
| 未収入金            | 2,420         | 1,717         |
| 未収配当金           | 1,361,468     | 1,338,510     |
| 流動資産合計          | 603,607,920   | 814,693,309   |
| 資産合計            | 603,607,920   | 814,693,309   |
| 負債の部            |               |               |
| 流動負債            |               |               |
| 流動負債合計          | -             | -             |
| 負債合計            | -             | -             |
| 純資産の部           |               |               |
| 元本等             |               |               |
| 元本              | 1 512,564,161 | 560,248,764   |
| 剰余金             |               |               |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 91,043,759    | 254,444,545   |
| 元本等合計           | 603,607,920   | 814,693,309   |
| 純資産合計           | 603,607,920   | 814,693,309   |
| 負債純資産合計         | 603,607,920   | 814,693,309   |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                    | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 投資証券<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。<br>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。                       |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br><br>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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | 受取配当金<br>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。   |

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<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。 |
|----------------------------|--|

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                | 平成24年12月18日現在 | 平成25年12月18日現在 |
|------------------------------------|---------------|---------------|
| 1. 1 期首                            | 平成23年12月20日   | 平成24年12月19日   |
| 期首元本額                              | 554,892,740円  | 512,564,161円  |
| 期中追加設定元本額                          | 164,647,283円  | 181,383,825円  |
| 期中一部解約元本額                          | 206,975,862円  | 133,699,222円  |
| 期末元本額の内訳                           |               |               |
| ファンド名                              |               |               |
| ダイワ・グローバルREITインデックスファンド（適格機関投資家専用） | 39,114,697円   | - 円           |
| D・I's グローバルREITインデックス              | - 円           | 672,004円      |
| DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド          | 468,426,083円  | 552,296,056円  |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020                 | 2,311,194円    | 2,720,556円    |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030                 | 2,541,542円    | 3,495,157円    |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040                 | 170,645円      | 395,195円      |
| ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT            | - 円           | 669,796円      |
| 計                                  | 512,564,161円  | 560,248,764円  |
| 2. 期末日における受益権の総数                   | 512,564,161口  | 560,248,764口  |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 平成25年12月18日現在  |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 平成24年12月18日現在      | 平成25年12月18日現在      |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 投資証券 | 7,513,745          | 17,333,763         |
| 合計   | 7,513,745          | 17,333,763         |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成24年12月18日まで、及び平成25年12月3日から平成25年12月18日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成24年12月18日現在 | 平成25年12月18日現在 |
|---------------|---------------|
| 該当事項はありません。   | 該当事項はありません。   |

## (1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在        | 平成25年12月18日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1776円<br>(11,776円) | 1.4542円<br>(14,542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 |
|------|---------|---------------------------|-------|-------------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル |                           |       | アメリカ・ドル     |    |
|      |         | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST   | 700   | 20,762.000  |    |
|      |         | EXCEL TRUST INC           | 500   | 5,780.000   |    |
|      |         | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1,300 | 153,309.000 |    |
|      |         | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 3,247 | 495,492.200 |    |
|      |         | GRAMERCY PROPERTY TRUST   | 400   | 2,168.000   |    |

|                           |       |             |
|---------------------------|-------|-------------|
| BOSTON PROPERTIES INC     | 1,600 | 161,776.000 |
| BIOMED REALTY TRUST INC   | 2,000 | 36,620.000  |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A  | 1,555 | 40,103.450  |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 5,777 | 116,984.250 |
| VORNADO REALTY TRUST      | 1,864 | 164,069.280 |
| ROUSE PROPERTIES          | 261   | 5,481.000   |
| EQUITY RESIDENTIAL        | 3,500 | 180,670.000 |
| EPR PROPERTIES            | 500   | 24,845.000  |
| CHATHAM LODGING TRUST     | 200   | 3,938.000   |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST  | 500   | 11,990.000  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERT | 500   | 20,700.000  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVEST | 600   | 8,724.000   |
| ASHFORD HOSPITALITYP REIT | 140   | 2,742.600   |
| HOST HOTELS&RESORTS INC   | 7,800 | 143,598.000 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A  | 500   | 7,995.000   |
| CHAMBERS STREET PROPERTIE | 2,500 | 19,325.000  |
| COLE REAL ESTATE INVESTME | 4,600 | 63,940.000  |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY  | 700   | 16,569.000  |
| CORESITE REALTY CORP      | 200   | 5,996.000   |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES | 500   | 10,650.000  |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES  | 600   | 5,430.000   |
| RLJ LODGING TRUST         | 1,400 | 33,236.000  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST   | 100   | 1,200.000   |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROP | 100   | 1,629.000   |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES | 200   | 1,900.000   |
| CYRUSONE INC              | 200   | 4,372.000   |
| SILVER BAY REALTY TRUST   | 400   | 6,260.000   |
| AMREIT INC                | 200   | 3,328.000   |
| KIMCO REALTY CORP         | 4,400 | 88,440.000  |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERI | 1,800 | 17,694.000  |
| WHITESTONE REIT           | 200   | 2,630.000   |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TR | 1,800 | 29,070.000  |
| AVIV REIT INC             | 200   | 4,784.000   |
| CORRECTIONS CORP OF AMERI | 1,224 | 39,645.360  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES   | 700   | 6,055.000   |
| SOVRAN SELF STORAGE INC   | 300   | 19,434.000  |
| SELECT INCOME REIT        | 300   | 8,040.000   |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 400   | 12,548.000  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY | 200   | 2,620.000   |
| STAG INDUSTRIAL INC       | 500   | 9,935.000   |
| VENTAS INC                | 3,079 | 174,209.820 |
| GEO GROUP INC/THE         | 800   | 25,896.000  |
| GOVERNMENT PROP INCOME    | 600   | 14,802.000  |
| SABRA HEALTH CARE REIT    | 400   | 10,400.000  |
| UMH PROPERTIES            | 200   | 1,822.000   |
| TERRENO REALTY CORP       | 200   | 3,428.000   |
| AMERICAN REALTY CAP PROP  | 2,000 | 25,480.000  |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 3,700 | 36,667.000  |
| SUN COMMUNITIES INC       | 400   | 16,460.000  |
| ASSOCIATED ESTATES REALTY | 500   | 7,950.000   |
| ACADIA REALTY TRUST       | 611   | 15,482.740  |
| PROLOGIS INC              | 5,246 | 190,587.180 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ | 700   | 44,310.000  |
| BRANDYWINE REALTY TRUST   | 1,700 | 22,746.000  |
| SAUL CENTERS INC          | 100   | 4,862.000   |
| BRE PROPERTIES-CL A       | 800   | 44,624.000  |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 1,845 | 32,767.200  |
| MACK-CALI REALTY CORP     | 1,000 | 21,300.000  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST     | 900   | 51,669.000  |
| COUSINS PROPERTIES INC    | 1,958 | 19,971.600  |

|                           |       |             |
|---------------------------|-------|-------------|
| DDR CORP                  | 2,856 | 42,925.680  |
| DUKE REALTY CORP          | 3,500 | 50,750.000  |
| EASTGROUP PROPERTIES INC  | 300   | 17,286.000  |
| EQUITY ONE INC            | 700   | 15,225.000  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC  | 400   | 58,204.000  |
| FELCOR LODGING TRUST INC  | 1,400 | 10,066.000  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY   | 1,100 | 18,645.000  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 700   | 70,700.000  |
| GLIMCHER REALTY TRUST     | 1,500 | 13,740.000  |
| GETTY REALTY CORP         | 300   | 5,469.000   |
| HEALTH CARE REIT INC      | 3,000 | 161,490.000 |
| HCP INC                   | 4,800 | 174,336.000 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC  | 900   | 31,734.000  |
| HOME PROPERTIES INC       | 600   | 32,142.000  |
| HOSPITALITY PROPERTIES    | 1,600 | 42,576.000  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST   | 1,100 | 23,474.000  |
| COMMONWEALTH REIT         | 1,175 | 27,001.500  |
| KILROY REALTY CORP        | 800   | 39,856.000  |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES  | 1,100 | 34,012.000  |
| LIBERTY PROPERTY TRUST    | 1,500 | 51,360.000  |
| LTC PROPERTIES INC        | 400   | 14,244.000  |
| LEXINGTON REALTY TRUST    | 2,100 | 21,567.000  |
| MID-AMERICA APARTMENT COM | 824   | 49,728.400  |
| MACERICH CO/THE           | 1,500 | 88,065.000  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTI | 800   | 28,944.000  |
| NATL HEALTHINVESTORS INC  | 300   | 17,304.000  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIE | 1,300 | 40,131.000  |
| REALTY INCOME CORP        | 2,017 | 78,683.170  |
| CORPORATE OFFICE PROPERTI | 1,000 | 22,880.000  |
| PENN REAL ESTATE INVEST   | 700   | 13,216.000  |
| PARKWAY PROPERTIES INC    | 400   | 6,900.000   |
| POST PROPERTIES INC       | 600   | 26,976.000  |
| PUBLIC STORAGE            | 1,500 | 224,280.000 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA  | 200   | 14,988.000  |
| REGENCY CENTERS CORP      | 1,000 | 45,880.000  |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTI | 600   | 9,252.000   |
| TANGER FACTORY OUTLET CEN | 1,000 | 31,830.000  |
| SL GREEN REALTY CORP      | 1,000 | 90,170.000  |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 2,100 | 47,040.000  |
| TAUBMAN CENTERS INC       | 700   | 45,710.000  |
| URSTADT BIDDLE-CL A       | 300   | 5,550.000   |
| UDR INC                   | 2,600 | 60,762.000  |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INC | 100   | 4,086.000   |
| WP CAREY INC              | 600   | 37,050.000  |
| WASHINGTON REAL ESTATE IN | 700   | 16,128.000  |
| WEINGARTEN REALTY INVESTO | 1,200 | 33,156.000  |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 700   | 5,691.000   |
| AGREE REALTY CORP         | 100   | 2,843.000   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTOR | 1,200 | 36,276.000  |
| INLAND REAL ESTATE CORP   | 1,000 | 10,280.000  |
| STRATEGIC HOTELS&RESORTS  | 2,000 | 18,580.000  |
| CUBESMART                 | 1,300 | 20,020.000  |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS  | 2,047 | 26,590.530  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC  | 1,300 | 60,008.000  |
| CEDAR REALTY TRUST        | 700   | 4,200.000   |
| EXTRA SPACE STORAGE INC   | 1,100 | 45,210.000  |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUS | 600   | 6,732.000   |
| WINTHROP REALTY TRUST     | 300   | 3,447.000   |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST  | 1,800 | 9,972.000   |
| INVESTORS REAL ESTATE TRU | 1,000 | 8,800.000   |



|            |                           |        |   |
|------------|---------------------------|--------|---|
|            | KITE REALTY GROUP TRUST   | 1,400  | 8,932.000                                 |
|            | MONMOUTH REIT-CLASS A     | 400    | 3,520.000                                 |
|            | ONE LIBERTY PROPERTIES IN | 100    | 2,122.000                                 |
|            | AMERICAN CAMPUS COMMUNITI | 1,100  | 35,717.000                                |
|            | EDUCATION REALTY TRUST    | 1,200  | 10,500.000                                |
|            | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 100    | 1,765.000                                 |
|            | DIAMONDROCK HOSPITALITY   | 2,142  | 24,118.920                                |
|            | MEDICAL PROPERTIES TRUST  | 1,800  | 22,194.000                                |
|            | FRANKLIN STREET PROPERTIE | 900    | 10,746.000                                |
|            | DOUGLAS EMMETT            | 1,500  | 34,515.000                                |
|            | DCT INDUSTRIAL TRUST INC  | 3,500  | 24,885.000                                |
|            | RETAIL PROPERTIES OF AME- | 1,900  | 24,263.000                                |
| アメリカ・ドル    | 小計                        |        | アメリカ・ドル<br>5,245,352.880<br>(539,432,090) |
| イギリス・ポンド   |                           |        | イギリス・ポンド                                  |
|            | MUCKLOW<A&J>GROUP PLC     | 350    | 1,680.000                                 |
|            | LAND SECURITIES PLC       | 8,150  | 75,550.500                                |
|            | HANSTEEN HOLDINGS PLC     | 7,200  | 7,509.600                                 |
|            | SEGRO PLC                 | 8,000  | 25,824.000                                |
|            | HAMMERSON PLC             | 7,450  | 36,475.200                                |
|            | BRITISH LAND CO PLC       | 10,450 | 62,386.500                                |
|            | GREAT PORTLAND ESTATES PL | 3,700  | 21,608.000                                |
|            | INTU PROPERTIES PLC       | 7,250  | 22,098.000                                |
|            | DERWENT LONDON PLC        | 950    | 22,629.000                                |
|            | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 1,030  | 3,574.100                                 |
|            | WORKSPACE GROUP PLC       | 1,270  | 6,400.800                                 |
|            | SHAFTESBURY PLC           | 2,800  | 16,744.000                                |
|            | BIG YELLOW GROUP PLC      | 1,400  | 6,566.000                                 |
|            | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 6,538  | 8,564.780                                 |
| イギリス・ポンド   | 小計                        |        | イギリス・ポンド<br>317,610.480<br>(53,158,466)   |
| イスラエル・シュケル |                           |        | イスラエル・シュケル                                |
|            | REIT 1 LTD                | 900    | 7,501.500                                 |
| イスラエル・シュケル | 小計                        |        | イスラエル・シュケル<br>7,501.500<br>(219,869)      |
| オーストラリア・ドル |                           |        | オーストラリア・ドル                                |
|            | CROMWELL PROPERTY GROUP   | 13,950 | 13,182.750                                |
|            | AUSTRALAND PROPERTY GROUP | 2,400  | 8,928.000                                 |
|            | WESTFIELD RETAIL TRUST    | 31,300 | 88,892.000                                |
|            | SHOPPING CENTERS AUSTRALA | 7,200  | 10,764.000                                |
|            | GROWTHPOINT PROPERTIES    | 1,300  | 3,380.000                                 |
|            | BWP TRUST                 | 5,228  | 11,292.480                                |
|            | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 26,200 | 49,780.000                                |
|            | COMMONWEALTH PROPERTY OFF | 21,200 | 27,030.000                                |
|            | DEXUS PROPERTY GROUP      | 50,000 | 51,000.000                                |
|            | GPT GROUP                 | 17,300 | 59,166.000                                |
|            | INVESTA OFFICE FUND       | 6,425  | 19,724.750                                |
|            | CHARTER HALL RETAIL REIT  | 3,000  | 10,620.000                                |
|            | MIRVAC GROUP              | 38,200 | 60,356.000                                |
|            | STOCKLAND                 | 24,100 | 88,447.000                                |
|            | WESTFIELD GROUP           | 20,900 | 202,730.000                               |
|            | ABACUS PROPERTY GROUP     | 2,800  | 6,188.000                                 |
|            | GOODMAN GROUP             | 15,840 | 73,339.200                                |
|            | FEDERATION CENTRES        | 15,900 | 35,298.000                                |
|            | ASTRO JAPAN PROPERTY GROU | 500    | 1,725.000                                 |

|                           |                           |            |   |
|---------------------------|---------------------------|------------|---|
|                           | CHARTER HALL GROUP        | 2,350      | 8,178.000                                 |
|                           | ALE PROPERTY GROUP        | 2,000      | 5,440.000                                 |
|                           | ASPEN GROUP               | 700        | 1,085.000                                 |
|                           | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 7,200      | 3,384.000                                 |
|                           | CHALLENGER DIVERSIFIED PR | 1,164      | 2,886.720                                 |
| オーストラリア・ドル 小計             |                           |            | オーストラリア・ドル<br>842,816.900<br>(77,345,307) |
| カナダ・ドル                    | ARTIS REAL ESTATE INVESTM | 700        | 10,017.000                                |
|                           | DUNDEE INTERNATIONAL REIT | 500        | 4,015.000                                 |
|                           | NORTHWEST HEALTHCARE PROP | 200        | 2,012.000                                 |
|                           | BROOKFIELD CANADA OFFICE  | 200        | 5,196.000                                 |
|                           | GRANITE REAL ESTATE INVES | 200        | 7,348.000                                 |
|                           | DUNDEE INDUSTRIAL REIT    | 300        | 2,508.000                                 |
|                           | RETROCOM MID-MARKET REIT  | 200        | 908.000                                   |
|                           | INTERRENT REAL ESTATE INV | 200        | 1,074.000                                 |
|                           | CHOICE PROPERTIES REIT    | 500        | 5,165.000                                 |
|                           | HEALTHLEASE PROPERTIES RE | 100        | 930.000                                   |
|                           | PURE INDUSTRIAL REAL ESTA | 700        | 3,108.000                                 |
|                           | MORGUARD NORTH AMERICAN R | 200        | 1,818.000                                 |
|                           | MILESTONE APARTMENTS REAL | 200        | 1,880.000                                 |
|                           | CALLOWAY REAL ESTATE INVE | 600        | 14,604.000                                |
|                           | CAN APARTMENT PROP REAL   | 600        | 12,234.000                                |
|                           | CAN REAL ESTATE INVEST TR | 400        | 16,720.000                                |
|                           | CHARTWELL RETIREMENT RESI | 1,000      | 9,620.000                                 |
|                           | COMINAR REAL ESTATE INV-T | 690        | 12,109.500                                |
|                           | H&R REAL ESTATE INVSTMNT- | 1,366      | 28,426.460                                |
|                           | INNVEST REAL ESTATE INVES | 500        | 2,290.000                                 |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR U | 300                       | 4,830.000  |   |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST  | 1,600                     | 39,168.000 |   |
| DUNDEE REAL ESTATE INVEST | 600                       | 16,650.000 |   |
| BOARDWALK REAL ESTATE INV | 300                       | 17,442.000 |   |
| NORTHERN PROPERTY REAL ES | 200                       | 5,364.000  |   |
| CROMBIE REAL ESTATE INVES | 300                       | 4,017.000  |   |
| ALLIED PROPERTIES REAL ES | 300                       | 9,576.000  |   |
| カナダ・ドル 小計                 |                           |            | カナダ・ドル<br>239,029.960<br>(23,178,735)     |
| シンガポール・ドル                 | RELIGARE HEALTH TRUST     | 5,000      | 3,950.000                                 |
|                           | FIRST REAL ESTATE INVT TR | 6,000      | 6,300.000                                 |
|                           | MAPLETREE GREATER CHINA   | 19,000     | 15,485.000                                |
|                           | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRI | 4,400      | 6,226.000                                 |
|                           | CAPITACOMMERCIAL TRUST    | 24,000     | 33,960.000                                |
|                           | ASCENDAS REAL ESTATE INV  | 22,000     | 47,740.000                                |
|                           | CAPITAMALL TRUST          | 27,000     | 49,950.000                                |
|                           | SUNTEC REIT               | 24,000     | 36,000.000                                |
|                           | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 16,000     | 16,240.000                                |
|                           | KEPPEL REIT               | 9,400      | 10,857.000                                |
|                           | FRASERS COMMERCIAL TRUST  | 4,960      | 6,100.800                                 |
|                           | ASCOTT RESIDENCE TRUST    | 9,000      | 10,485.000                                |
|                           | CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUS | 11,779     | 8,009.720                                 |
|                           | CDL HOSPITALITY TRUSTS    | 7,000      | 11,130.000                                |
|                           | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 6,000      | 10,440.000                                |
|                           | STARHILL GLOBAL REIT      | 17,000     | 12,835.000                                |
|                           | CAPITARETAIL CHINA TRUST  | 7,000      | 9,100.000                                 |
| SAIZEN REIT               | 3,000                     | 2,685.000  |   |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE  | 4,000                     | 8,680.000  |   |

|                           |                           |           |  |
|---------------------------|---------------------------|-----------|--|
|                           | LIPPO MALLS INDONESIA RET | 17,000    | 6,800.000                                |
|                           | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUS | 11,880    | 15,265.800                               |
|                           | CACHE LOGISTICS TRUST     | 8,000     | 8,560.000                                |
|                           | MAPLETREE COMMERCIAL TR   | 15,000    | 17,400.000                               |
|                           | FAR EAST HOSPITALITY TRUS | 7,000     | 5,880.000                                |
|                           | SOILBUILD BUSINESS SPACE  | 7,000     | 5,250.000                                |
|                           | SABANA SHARIAH COMP IND R | 6,000     | 6,240.000                                |
|                           | ASCENDAS HOSPITALITY TRST | 7,000     | 5,180.000                                |
|                           | CROESUS RETAIL TRUST      | 5,000     | 4,375.000                                |
| シンガポール・ドル 小計              |                           |           | シンガポール・ドル<br>381,124.320<br>(31,175,969) |
| ニュージーランド・ドル               | DNZ PROPERTY FUND LTD     | 3,000     | 4,590.000                                |
|                           | KIWI INCOME PROPERTY TRU  | 10,000    | 10,750.000                               |
|                           | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 2,000     | 2,570.000                                |
|                           | VITAL HEALTHCARE PROPERTY | 3,500     | 4,532.500                                |
|                           | GOODMAN PROPERTY TRUST    | 9,500     | 9,357.500                                |
| ニュージーランド・ドル 小計            |                           |           | ニュージーランド・ドル<br>31,800.000<br>(2,704,907) |
| ユーロ                       | ALSTRIA OFFICE REIT       | 650       | 5,772.000                                |
|                           | PRIME OFFICE REIT-AG      | 550       | 1,584.000                                |
|                           | HAMBORNER REIT AG         | 400       | 2,929.600                                |
|                           | WERELDHAVE NV             | 250       | 13,520.000                               |
|                           | CORIO NV                  | 1,065     | 32,322.750                               |
|                           | UNIBAIL-RODAMCO SE        | 1,000     | 175,750.000                              |
|                           | EUROCOMMERCIAL -CVA       | 400       | 11,732.000                               |
|                           | NIEUWE STEEN INVESTMENTS  | 624       | 2,814.240                                |
|                           | VASTNED RETAIL NV         | 200       | 6,500.000                                |
|                           | ICADE                     | 375       | 23,857.500                               |
|                           | ANF IMMOBILIER            | 100       | 2,250.000                                |
|                           | ALTAREA                   | 20        | 2,540.000                                |
|                           | GECINA SA                 | 300       | 27,516.000                               |
|                           | KLEPIERRE                 | 1,050     | 34,098.750                               |
|                           | FONCIERE DES REGIONS      | 500       | 29,840.000                               |
|                           | STE DE LA TOUR EIFFEL     | 50        | 2,400.000                                |
|                           | MERCIALYS                 | 600       | 9,126.000                                |
|                           | AEDIFICA                  | 100       | 5,000.000                                |
|                           | COFINIMMO                 | 150       | 13,002.000                               |
|                           | BEFIMMO S.C.A             | 200       | 9,690.000                                |
|                           | WAREHOUSES DE PAUW SCA    | 133       | 6,967.870                                |
| BENI STABILI SPA          | 10,100                    | 4,868.200 |  |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRI | 1,800                     | 1,558.800 |  |
| ユーロ 小計                    |                           |           | ユーロ<br>425,639.710<br>(60,266,327)       |
| 香港・ドル                     | YUEXIU REIT ASSET MANAGEM | 18,000    | 68,400.000                               |
|                           | SUNLIGHT REAL ESTATE INVE | 11,000    | 32,670.000                               |
|                           | FORTUNE REIT              | 13,000    | 79,040.000                               |
|                           | PROSPERITY REIT           | 13,000    | 28,470.000                               |
|                           | LINK REIT                 | 24,000    | 900,000.000                              |
|                           | REGAL REAL ESTATE INV     | 8,000     | 17,440.000                               |
|                           | CHAMPION REIT             | 32,000    | 110,720.000                              |
| 香港・ドル 小計                  |                           |           | 香港・ドル<br>1,236,740.000<br>(16,411,539)   |

|         |  |                              |  |
|---------|--|------------------------------|--|
| 投資証券 合計 |  | 803,893,209<br>[803,893,209] |  |
| 合計      |  | 803,893,209<br>[803,893,209] |  |

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<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     | 投資証券 137銘柄 | 100%               | 67.2%          |
| イギリス・ポンド    | 投資証券 14銘柄  | 100%               | 6.6%           |
| イスラエル・シェケル  | 投資証券 1銘柄   | 100%               | 0.0%           |
| オーストラリア・ドル  | 投資証券 24銘柄  | 100%               | 9.6%           |
| カナダ・ドル      | 投資証券 27銘柄  | 100%               | 2.9%           |
| シンガポール・ドル   | 投資証券 28銘柄  | 100%               | 3.9%           |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 5銘柄   | 100%               | 0.3%           |
| ユーロ         | 投資証券 23銘柄  | 100%               | 7.5%           |
| 香港・ドル       | 投資証券 7銘柄   | 100%               | 2.0%           |

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](#)

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在  | 平成25年12月18日現在  |
|-----------------|----------------|----------------|
|                 | 金額（円）          | 金額（円）          |
| 資産の部            |                |                |
| 流動資産            |                |                |
| コール・ローン         | 61,385,036     | 63,209,164     |
| 国債証券            | 9,285,473,460  | 10,903,951,230 |
| 地方債証券           | 1,256,203,804  | 1,235,755,614  |
| 特殊債券            | 1,186,483,343  | 1,302,101,450  |
| 社債券             | 1,435,651,138  | 1,336,629,188  |
| 未収入金            | -              | 139,188,990    |
| 未収利息            | 52,830,941     | 57,726,327     |
| 前払費用            | 2,604,830      | 3,908,911      |
| 流動資産合計          | 13,280,632,552 | 15,042,470,874 |
| 資産合計            | 13,280,632,552 | 15,042,470,874 |
| 負債の部            |                |                |
| 流動負債            |                |                |
| 未払金             | -              | 105,304,000    |
| 未払解約金           | 10,612,000     | 43,255,000     |
| 流動負債合計          | 10,612,000     | 148,559,000    |
| 負債合計            | 10,612,000     | 148,559,000    |
| 純資産の部           |                |                |
| 元本等             |                |                |
| 元本              | 1              | 11,560,180,230 |
| 剰余金             |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,709,840,322  | 2,201,970,789  |
| 元本等合計           | 13,270,020,552 | 14,893,911,874 |
| 純資産合計           | 13,270,020,552 | 14,893,911,874 |
| 負債純資産合計         | 13,280,632,552 | 15,042,470,874 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分             | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18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><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。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区 分       | 平成24年12月18日現在   | 平成25年12月18日現在   |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首   | 平成23年12月20日     | 平成24年12月19日     |
| 期首元本額     | 10,296,043,254円 | 11,560,180,230円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,549,014,275円  | 2,925,321,778円  |
| 期中一部解約元本額 | 1,284,877,299円  | 1,793,560,923円  |
| 期末元本額の内訳  |                 |                 |

| ファンド名                       |                 |                 |
|-----------------------------|-----------------|-----------------|
| ワールドアセット（安定コース）             | - 円             | 263,242円        |
| ワールドアセット（分散コース）             | - 円             | 177,483円        |
| ダイワ・ライフ・バランス30              | 2,824,598,123円  | 3,352,658,502円  |
| ダイワ・ライフ・バランス50              | 1,004,914,241円  | 1,509,796,403円  |
| ダイワ・ライフ・バランス70              | 246,466,815円    | 424,207,005円    |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）  | 258,354,186円    | 365,615,760円    |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース） | 165,011,146円    | 260,045,562円    |
| DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）  | 38,091,598円     | 61,088,460円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020          | 17,241,701円     | 25,740,390円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030          | 7,351,171円      | 13,042,893円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040          | 170,188円        | 582,010円        |
| ダイワ世界バランスファンド40VA           | 3,755,037,683円  | 4,113,772,819円  |
| ダイワ世界バランスファンド60VA           | 333,120,994円    | 375,130,392円    |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA       | 923,637,821円    | 677,147,826円    |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA       | 1,986,184,563円  | 1,512,672,338円  |
| 計                           | 11,560,180,230円 | 12,691,941,085円 |
| 2. 期末日における受益権の総数            | 11,560,180,230口 | 12,691,941,085口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分                         | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日   |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。         |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                       | 平成25年12月18日現在                               |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

|                 |   |
|-----------------|---|
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|-----------------|---|

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類   | 平成24年12月18日現在          | 平成25年12月18日現在          |
|-------|------------------------|------------------------|
|       | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 国債証券  | 28,101,780             | 10,328,440             |
| 地方債証券 | 1,428,252              | 1,855,998              |
| 特殊債券  | 1,106,887              | 1,712,800              |
| 社債券   | 848,052                | 1,188,333              |
| 合計    | 31,484,971             | 15,085,571             |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成24年12月18日まで、及び平成25年12月3日から平成25年12月18日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成24年12月18日現在 | 平成25年12月18日現在 |
|---------------|---------------|
| 該当事項はありません。   | 該当事項はありません。   |

## (1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在        | 平成25年12月18日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1479円<br>(11,479円) | 1.1735円<br>(11,735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 | 3 2 6 2年国債 | 50,000,000  | 50,012,000  |    |
|      | 3 2 7 2年国債 | 120,000,000 | 120,031,200 |    |
|      | 3 2 9 2年国債 | 45,000,000  | 45,076,500  |    |
|      | 3 3 0 2年国債 | 30,000,000  | 30,051,600  |    |
|      | 3 3 1 2年国債 | 100,000,000 | 100,016,000 |    |
|      | 3 3 2 2年国債 | 58,000,000  | 58,009,860  |    |
|      | 3 3 3 2年国債 | 20,000,000  | 20,001,800  |    |
|      | 3 3 4 2年国債 | 45,000,000  | 45,004,050  |    |
|      | 8 8 5年国債   | 118,000,000 | 118,617,140 |    |
|      | 8 9 5年国債   | 115,000,000 | 115,541,650 |    |
|      | 9 0 5年国債   | 10,000,000  | 10,032,100  |    |
|      | 9 1 5年国債   | 63,000,000  | 63,340,830  |    |
|      | 9 2 5年国債   | 140,000,000 | 140,513,800 |    |

|       |       |             |             |
|-------|-------|-------------|-------------|
| 9 3   | 5年国債  | 13,000,000  | 13,106,340  |
| 9 4   | 5年国債  | 42,000,000  | 42,427,560  |
| 9 5   | 5年国債  | 117,000,000 | 118,324,440 |
| 9 6   | 5年国債  | 75,000,000  | 75,680,250  |
| 9 7   | 5年国債  | 95,000,000  | 95,709,650  |
| 9 8   | 5年国債  | 50,000,000  | 50,249,000  |
| 1 0 0 | 5年国債  | 95,000,000  | 95,507,300  |
| 1 0 1 | 5年国債  | 5,000,000   | 5,042,600   |
| 1 0 2 | 5年国債  | 5,000,000   | 5,027,650   |
| 1 0 4 | 5年国債  | 22,000,000  | 22,053,240  |
| 1 0 5 | 5年国債  | 190,000,000 | 190,429,400 |
| 1 0 6 | 5年国債  | 95,000,000  | 95,194,750  |
| 1 0 7 | 5年国債  | 120,000,000 | 120,213,600 |
| 1 0 8 | 5年国債  | 60,000,000  | 59,868,600  |
| 1 0 9 | 5年国債  | 28,000,000  | 27,917,120  |
| 1 1 0 | 5年国債  | 30,000,000  | 30,164,400  |
| 1 1 1 | 5年国債  | 22,000,000  | 22,213,180  |
| 1 1 2 | 5年国債  | 70,000,000  | 70,686,700  |
| 1 1 3 | 5年国債  | 35,000,000  | 35,187,250  |
| 1 1 4 | 5年国債  | 45,000,000  | 45,232,650  |
| 1 1 5 | 5年国債  | 140,000,000 | 140,065,800 |
| 1     | 40年国債 | 24,000,000  | 28,278,960  |
| 2     | 40年国債 | 23,000,000  | 25,934,570  |
| 3     | 40年国債 | 19,000,000  | 21,418,700  |
| 4     | 40年国債 | 30,000,000  | 33,806,100  |
| 5     | 40年国債 | 35,000,000  | 37,476,950  |
| 6     | 40年国債 | 26,000,000  | 27,096,420  |
| 2 6 8 | 10年国債 | 40,000,000  | 40,707,200  |
| 2 6 9 | 10年国債 | 54,000,000  | 54,820,260  |
| 2 7 0 | 10年国債 | 8,000,000   | 8,145,440   |
| 2 7 2 | 10年国債 | 105,000,000 | 107,403,450 |
| 2 7 4 | 10年国債 | 11,000,000  | 11,309,540  |
| 2 7 5 | 10年国債 | 35,000,000  | 35,915,250  |
| 2 7 6 | 10年国債 | 25,000,000  | 25,753,500  |
| 2 7 7 | 10年国債 | 58,000,000  | 59,956,340  |
| 2 7 8 | 10年国債 | 20,000,000  | 20,764,400  |
| 2 7 9 | 10年国債 | 2,000,000   | 2,085,400   |
| 2 8 0 | 10年国債 | 3,000,000   | 3,134,580   |
| 2 8 4 | 10年国債 | 20,000,000  | 20,947,600  |
| 2 8 6 | 10年国債 | 51,000,000  | 53,966,160  |
| 2 8 7 | 10年国債 | 116,000,000 | 123,150,240 |
| 2 8 8 | 10年国債 | 148,000,000 | 156,613,600 |
| 2 8 9 | 10年国債 | 57,000,000  | 60,047,220  |
| 2 9 0 | 10年国債 | 55,000,000  | 57,864,400  |
| 2 9 1 | 10年国債 | 39,000,000  | 40,866,540  |
| 2 9 2 | 10年国債 | 92,000,000  | 97,955,160  |
| 2 9 3 | 10年国債 | 19,000,000  | 20,378,070  |
| 2 9 4 | 10年国債 | 28,000,000  | 29,905,680  |
| 2 9 5 | 10年国債 | 57,000,000  | 60,370,980  |
| 2 9 6 | 10年国債 | 35,000,000  | 37,175,950  |
| 2 9 7 | 10年国債 | 16,000,000  | 16,950,400  |
| 2 9 8 | 10年国債 | 66,000,000  | 69,593,700  |
| 2 9 9 | 10年国債 | 10,000,000  | 10,565,600  |



|     |       |             |             |
|-----|-------|-------------|-------------|
| 300 | 10年国債 | 40,000,000  | 42,677,600  |
| 301 | 10年国債 | 35,000,000  | 37,423,750  |
| 302 | 10年国債 | 50,000,000  | 53,190,500  |
| 303 | 10年国債 | 44,000,000  | 46,894,760  |
| 304 | 10年国債 | 50,000,000  | 53,006,000  |
| 305 | 10年国債 | 84,000,000  | 89,134,080  |
| 306 | 10年国債 | 60,000,000  | 64,066,200  |
| 307 | 10年国債 | 100,000,000 | 106,164,000 |
| 308 | 10年国債 | 78,000,000  | 82,839,900  |
| 309 | 10年国債 | 110,000,000 | 115,425,200 |
| 310 | 10年国債 | 30,000,000  | 31,275,600  |
| 311 | 10年国債 | 52,000,000  | 53,525,160  |
| 312 | 10年国債 | 95,000,000  | 100,277,250 |
| 313 | 10年国債 | 75,000,000  | 79,641,000  |
| 314 | 10年国債 | 98,000,000  | 102,686,360 |
| 315 | 10年国債 | 85,000,000  | 89,656,300  |
| 316 | 10年国債 | 85,000,000  | 89,040,050  |
| 317 | 10年国債 | 35,000,000  | 36,648,850  |
| 318 | 10年国債 | 25,000,000  | 25,990,750  |
| 319 | 10年国債 | 105,000,000 | 109,929,750 |
| 320 | 10年国債 | 78,000,000  | 81,062,280  |
| 321 | 10年国債 | 71,000,000  | 73,752,670  |
| 322 | 10年国債 | 83,000,000  | 85,527,350  |
| 323 | 10年国債 | 59,000,000  | 60,750,530  |
| 324 | 10年国債 | 115,000,000 | 117,477,100 |
| 325 | 10年国債 | 155,000,000 | 158,103,100 |
| 326 | 10年国債 | 63,000,000  | 63,646,380  |
| 327 | 10年国債 | 21,000,000  | 21,395,010  |
| 328 | 10年国債 | 68,000,000  | 68,000,000  |
| 329 | 10年国債 | 83,000,000  | 84,377,800  |
| 330 | 10年国債 | 120,000,000 | 121,818,000 |
| 331 | 10年国債 | 70,000,000  | 69,774,600  |
| 2   | 30年国債 | 9,000,000   | 10,613,430  |
| 3   | 30年国債 | 4,000,000   | 4,651,160   |
| 4   | 30年国債 | 8,000,000   | 9,996,880   |
| 5   | 30年国債 | 8,000,000   | 9,112,880   |
| 6   | 30年国債 | 9,000,000   | 10,492,020  |
| 7   | 30年国債 | 12,000,000  | 13,741,920  |
| 8   | 30年国債 | 5,000,000   | 5,295,200   |
| 9   | 30年国債 | 11,000,000  | 10,901,770  |
| 10  | 30年国債 | 15,000,000  | 14,061,900  |
| 11  | 30年国債 | 12,000,000  | 12,418,200  |
| 12  | 30年国債 | 11,000,000  | 12,097,690  |
| 13  | 30年国債 | 16,000,000  | 17,297,280  |
| 14  | 30年国債 | 20,000,000  | 22,973,800  |
| 15  | 30年国債 | 20,000,000  | 23,318,200  |
| 16  | 30年国債 | 17,000,000  | 19,831,350  |
| 17  | 30年国債 | 17,000,000  | 19,536,910  |
| 18  | 30年国債 | 22,000,000  | 24,895,640  |
| 19  | 30年国債 | 15,000,000  | 16,978,350  |
| 20  | 30年国債 | 16,000,000  | 18,700,640  |
| 21  | 30年国債 | 16,000,000  | 18,117,280  |
| 22  | 30年国債 | 19,000,000  | 22,224,870  |

|    |         |            |            |
|----|---------|------------|------------|
| 23 | 30年国債   | 20,000,000 | 23,403,600 |
| 24 | 30年国債   | 18,000,000 | 21,070,980 |
| 25 | 30年国債   | 19,000,000 | 21,525,480 |
| 26 | 30年国債   | 36,000,000 | 41,512,680 |
| 27 | 30年国債   | 31,000,000 | 36,396,790 |
| 28 | 30年国債   | 37,000,000 | 43,500,900 |
| 29 | 30年国債   | 42,000,000 | 48,603,240 |
| 30 | 30年国債   | 45,000,000 | 51,216,750 |
| 31 | 30年国債   | 44,000,000 | 49,218,400 |
| 32 | 30年国債   | 48,000,000 | 54,767,040 |
| 33 | 30年国債   | 59,000,000 | 63,479,870 |
| 34 | 30年国債   | 52,000,000 | 58,195,800 |
| 35 | 30年国債   | 58,000,000 | 62,338,400 |
| 36 | 30年国債   | 58,000,000 | 62,331,440 |
| 37 | 30年国債   | 60,000,000 | 63,109,200 |
| 38 | 30年国債   | 35,000,000 | 35,999,950 |
| 39 | 30年国債   | 36,000,000 | 37,860,480 |
| 40 | 30年国債   | 35,000,000 | 35,975,800 |
| 30 | 利付国債20年 | 16,000,000 | 17,011,040 |
| 32 | 利付国債20年 | 8,000,000  | 8,648,240  |
| 33 | 利付国債20年 | 5,000,000  | 5,507,450  |
| 36 | 利付国債20年 | 33,000,000 | 36,514,500 |
| 37 | 利付国債20年 | 5,000,000  | 5,551,150  |
| 38 | 利付国債20年 | 11,000,000 | 12,175,900 |
| 39 | 20年国債   | 32,000,000 | 35,285,760 |
| 40 | 20年国債   | 51,000,000 | 56,092,860 |
| 41 | 20年国債   | 40,000,000 | 42,677,600 |
| 42 | 20年国債   | 22,000,000 | 24,734,820 |
| 43 | 20年国債   | 14,000,000 | 16,116,940 |
| 44 | 20年国債   | 32,000,000 | 36,361,280 |
| 45 | 20年国債   | 20,000,000 | 22,596,000 |
| 46 | 20年国債   | 19,000,000 | 21,282,660 |
| 47 | 20年国債   | 23,000,000 | 25,807,150 |
| 48 | 20年国債   | 9,000,000  | 10,308,510 |
| 49 | 20年国債   | 4,000,000  | 4,477,640  |
| 50 | 20年国債   | 30,000,000 | 33,159,600 |
| 51 | 20年国債   | 25,000,000 | 27,832,000 |
| 52 | 20年国債   | 19,000,000 | 21,324,650 |
| 53 | 20年国債   | 13,000,000 | 14,639,300 |
| 54 | 20年国債   | 14,000,000 | 15,873,480 |
| 55 | 20年国債   | 41,000,000 | 45,890,480 |
| 56 | 20年国債   | 12,000,000 | 13,450,920 |
| 57 | 20年国債   | 24,000,000 | 26,717,280 |
| 58 | 20年国債   | 35,000,000 | 39,009,950 |
| 59 | 20年国債   | 28,000,000 | 30,747,920 |
| 60 | 20年国債   | 16,000,000 | 17,151,520 |
| 61 | 20年国債   | 40,000,000 | 41,437,600 |
| 62 | 20年国債   | 16,000,000 | 16,272,800 |
| 63 | 20年国債   | 30,000,000 | 33,249,900 |
| 64 | 20年国債   | 35,000,000 | 39,155,200 |
| 65 | 20年国債   | 22,000,000 | 24,640,000 |
| 66 | 20年国債   | 30,000,000 | 33,317,400 |
| 67 | 20年国債   | 15,000,000 | 16,833,600 |

|     |       |            |            |  |
|-----|-------|------------|------------|--|
| 68  | 20年国債 | 23,000,000 | 26,501,060 |  |
| 69  | 20年国債 | 22,000,000 | 25,124,880 |  |
| 70  | 20年国債 | 18,000,000 | 21,147,660 |  |
| 71  | 20年国債 | 24,000,000 | 27,710,400 |  |
| 72  | 20年国債 | 41,000,000 | 46,997,070 |  |
| 73  | 20年国債 | 10,000,000 | 11,374,200 |  |
| 74  | 20年国債 | 27,000,000 | 31,003,020 |  |
| 75  | 20年国債 | 14,000,000 | 16,093,700 |  |
| 76  | 20年国債 | 25,000,000 | 28,215,750 |  |
| 77  | 20年国債 | 12,000,000 | 13,669,080 |  |
| 78  | 20年国債 | 17,000,000 | 19,201,500 |  |
| 79  | 20年国債 | 17,000,000 | 19,382,720 |  |
| 80  | 20年国債 | 17,000,000 | 19,574,310 |  |
| 81  | 20年国債 | 18,000,000 | 20,540,520 |  |
| 82  | 20年国債 | 28,000,000 | 32,256,000 |  |
| 83  | 20年国債 | 28,000,000 | 32,285,680 |  |
| 84  | 20年国債 | 27,000,000 | 30,817,260 |  |
| 85  | 20年国債 | 33,000,000 | 38,060,880 |  |
| 86  | 20年国債 | 6,000,000  | 7,062,900  |  |
| 87  | 20年国債 | 20,000,000 | 23,305,000 |  |
| 88  | 20年国債 | 33,000,000 | 38,867,070 |  |
| 89  | 20年国債 | 21,000,000 | 24,479,490 |  |
| 90  | 20年国債 | 40,000,000 | 46,641,200 |  |
| 91  | 20年国債 | 18,000,000 | 21,209,760 |  |
| 92  | 20年国債 | 53,000,000 | 61,148,750 |  |
| 93  | 20年国債 | 18,000,000 | 20,525,580 |  |
| 94  | 20年国債 | 41,000,000 | 47,270,540 |  |
| 95  | 20年国債 | 30,000,000 | 35,331,600 |  |
| 96  | 20年国債 | 27,000,000 | 31,105,620 |  |
| 97  | 20年国債 | 25,000,000 | 29,101,250 |  |
| 98  | 20年国債 | 34,000,000 | 39,136,040 |  |
| 99  | 20年国債 | 57,000,000 | 65,544,870 |  |
| 100 | 20年国債 | 32,000,000 | 37,182,400 |  |
| 101 | 20年国債 | 30,000,000 | 35,659,800 |  |
| 102 | 20年国債 | 20,000,000 | 23,756,000 |  |
| 103 | 20年国債 | 21,000,000 | 24,659,880 |  |
| 104 | 20年国債 | 28,000,000 | 32,123,840 |  |
| 105 | 20年国債 | 43,000,000 | 49,269,830 |  |
| 106 | 20年国債 | 21,000,000 | 24,348,870 |  |
| 107 | 20年国債 | 48,000,000 | 54,922,560 |  |
| 108 | 20年国債 | 20,000,000 | 22,333,200 |  |
| 109 | 20年国債 | 25,000,000 | 27,866,000 |  |
| 110 | 20年国債 | 38,000,000 | 43,415,000 |  |
| 111 | 20年国債 | 22,000,000 | 25,406,040 |  |
| 112 | 20年国債 | 50,000,000 | 57,035,500 |  |
| 113 | 20年国債 | 75,000,000 | 85,412,250 |  |
| 114 | 20年国債 | 51,000,000 | 57,977,820 |  |
| 115 | 20年国債 | 22,000,000 | 25,326,840 |  |
| 116 | 20年国債 | 27,000,000 | 31,029,480 |  |
| 117 | 20年国債 | 50,000,000 | 56,735,000 |  |
| 118 | 20年国債 | 33,000,000 | 36,863,970 |  |
| 119 | 20年国債 | 22,000,000 | 23,916,640 |  |
| 120 | 20年国債 | 38,000,000 | 40,176,260 |  |

|          |                 |             |                |  |
|----------|-----------------|-------------|----------------|--|
| 1 2 1    | 2 0年国債          | 61,000,000  | 67,048,760     |  |
| 1 2 2    | 2 0年国債          | 14,000,000  | 15,182,020     |  |
| 1 2 3    | 2 0年国債          | 47,000,000  | 52,972,290     |  |
| 1 2 4    | 2 0年国債          | 33,000,000  | 36,701,610     |  |
| 1 2 5    | 2 0年国債          | 28,000,000  | 31,932,320     |  |
| 1 2 6    | 2 0年国債          | 21,000,000  | 23,300,550     |  |
| 1 2 7    | 2 0年国債          | 23,000,000  | 25,174,650     |  |
| 1 2 8    | 2 0年国債          | 35,000,000  | 38,183,950     |  |
| 1 2 9    | 2 0年国債          | 34,000,000  | 36,579,580     |  |
| 1 3 0    | 2 0年国債          | 32,000,000  | 34,332,160     |  |
| 1 3 1    | 2 0年国債          | 40,000,000  | 42,276,800     |  |
| 1 3 2    | 2 0年国債          | 25,000,000  | 26,343,250     |  |
| 1 3 3    | 2 0年国債          | 46,000,000  | 49,211,260     |  |
| 1 3 4    | 2 0年国債          | 25,000,000  | 26,666,500     |  |
| 1 3 5    | 2 0年国債          | 24,000,000  | 25,211,280     |  |
| 1 3 6    | 2 0年国債          | 25,000,000  | 25,858,000     |  |
| 1 3 7    | 2 0年国債          | 18,000,000  | 18,848,700     |  |
| 1 3 8    | 2 0年国債          | 25,000,000  | 25,367,250     |  |
| 1 3 9    | 2 0年国債          | 35,000,000  | 36,081,500     |  |
| 1 4 0    | 2 0年国債          | 77,000,000  | 80,371,060     |  |
| 1 4 1    | 2 0年国債          | 46,000,000  | 47,891,060     |  |
| 1 4 2    | 2 0年国債          | 35,000,000  | 37,017,750     |  |
| 1 4 3    | 2 0年国債          | 48,000,000  | 49,009,440     |  |
| 1 4 4    | 2 0年国債          | 25,000,000  | 25,112,500     |  |
| 1 4 5    | 2 0年国債          | 77,000,000  | 79,683,450     |  |
| 1 4 6    | 2 0年国債          | 87,000,000  | 89,787,480     |  |
| 国債証券 合計  |                 |             | 10,903,951,230 |  |
| 地方債証券    | 6 2 4 東京都公債     | 100,000,000 | 102,049,900    |  |
|          | 6 5 3 東京都公債     | 100,000,000 | 105,328,800    |  |
|          | 2 0 - 6 北海道公債   | 100,000,000 | 106,606,100    |  |
|          | 2 9 3 大阪府公債     | 100,000,000 | 105,103,500    |  |
|          | 2 4 - 1 6 愛知県公債 | 100,000,000 | 100,859,600    |  |
|          | 2 1 - 2 埼玉県公債   | 100,000,000 | 106,931,400    |  |
|          | 2 7 共同発行地方      | 34,000,000  | 34,594,864     |  |
|          | 3 0 共同発行地方      | 50,000,000  | 51,023,950     |  |
|          | 7 6 共同発行地方      | 100,000,000 | 106,151,100    |  |
|          | 1 1 7 共同発行地方    | 100,000,000 | 100,599,200    |  |
|          | 2 1 - 6 大阪市公債   | 100,000,000 | 107,228,500    |  |
|          | 1 8 - 4 札幌市公債   | 100,000,000 | 104,497,300    |  |
|          | 1 8 - 2 北九州市債   | 100,000,000 | 104,781,400    |  |
| 地方債証券 合計 |                 |             | 1,235,755,614  |  |
| 特殊債券     | 1 6 政保政策投資 B    | 100,000,000 | 105,253,300    |  |
|          | 5 日本政策投資 C O    | 100,000,000 | 107,432,600    |  |
|          | 2 7 政保道路機構      | 50,000,000  | 52,626,650     |  |
|          | 5 6 政保道路機構      | 100,000,000 | 105,146,000    |  |
|          | 1 2 2 政保道路機構    | 100,000,000 | 103,262,600    |  |
|          | 1 9 0 政保道路機構    | 100,000,000 | 99,549,700     |  |
|          | 2 政保地方公営機       | 100,000,000 | 106,649,500    |  |
|          | 2 6 公営企業        | 100,000,000 | 105,118,700    |  |
|          | 1 3 首都高速道路      | 100,000,000 | 101,577,000    |  |
|          | 2 7 国際協力銀行      | 100,000,000 | 105,056,200    |  |
|          | 3 0 国際協力銀行      | 100,000,000 | 106,824,800    |  |
|          | 2 成田国際空港        | 100,000,000 | 102,808,000    |  |

|      |                  |             |                |  |
|------|------------------|-------------|----------------|--|
|      | い728 利付農林債       | 100,000,000 | 100,796,400    |  |
| 特殊債券 | 合計               |             | 1,302,101,450  |  |
| 社債券  | 10 首都高速道路        | 100,000,000 | 100,156,000    |  |
|      | 7 オーストラリアコモンウェルス | 100,000,000 | 99,980,600     |  |
|      | 33 中日本高速道        | 100,000,000 | 103,499,800    |  |
|      | 50 東芝            | 100,000,000 | 101,200,200    |  |
|      | 1 明治安田2011基      | 100,000,000 | 101,378,000    |  |
|      | 6 ドン・キホーテ        | 100,000,000 | 101,907,600    |  |
|      | 58 伊藤忠商事         | 100,000,000 | 100,848,300    |  |
|      | 4 住友信託 劣後        | 100,000,000 | 101,874,600    |  |
|      | 15 三菱UFJリース      | 100,000,000 | 101,155,400    |  |
|      | 70 東日本旅客鉄道       | 100,000,000 | 104,888,900    |  |
|      | 15 NTTドコモ        | 100,000,000 | 107,482,200    |  |
|      | 378 東北電力         | 100,000,000 | 107,815,800    |  |
|      | 261 北海道電力        | 3,000,000   | 3,264,288      |  |
|      | 10 電源開発          | 100,000,000 | 101,177,500    |  |
| 社債券  | 合計               |             | 1,336,629,188  |  |
| 合計   |                  |             | 14,778,437,482 |  |

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](#)

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

## 貸借対照表

|                 | 平成24年12月18日現在    | 平成25年12月18日現在   |
|-----------------|------------------|-----------------|
|                 | 金額（円）            | 金額（円）           |
| 資産の部            |                  |                 |
| 流動資産            |                  |                 |
| 預金              | 27,877,420       | 178,858,708     |
| コール・ローン         | 537,111,026      | 965,535,380     |
| 国債証券            | 122,093,696,759  | 145,979,809,599 |
| 派生商品評価勘定        | 15,974,172       | 9,136,371       |
| 未収入金            | -                | 2,921,815       |
| 未収利息            | 1,263,041,161    | 1,519,473,783   |
| 前払費用            | 52,894,512       | 49,311,789      |
| 流動資産合計          | 123,990,595,050  | 148,705,047,445 |
| 資産合計            | 123,990,595,050  | 148,705,047,445 |
| 負債の部            |                  |                 |
| 流動負債            |                  |                 |
| 派生商品評価勘定        | -                | 992,677         |
| 未払解約金           | 111,837,000      | 128,159,000     |
| 流動負債合計          | 111,837,000      | 129,151,677     |
| 負債合計            | 111,837,000      | 129,151,677     |
| 純資産の部           |                  |                 |
| 元本等             |                  |                 |
| 元本              | 1 62,378,283,951 | 60,054,118,108  |
| 剰余金             |                  |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 61,500,474,099   | 88,521,777,660  |
| 元本等合計           | 123,878,758,050  | 148,575,895,768 |
| 純資産合計           | 123,878,758,050  | 148,575,895,768 |
| 負債純資産合計         | 123,990,595,050  | 148,705,047,445 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区分                         | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日   |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 国債証券<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）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。  |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法     | 為替予約取引<br>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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準  |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                          | 平成24年12月18日現在   | 平成25年12月18日現在   |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                      | 平成23年12月20日     | 平成24年12月19日     |
| 期首元本額                        | 61,598,892,147円 | 62,378,283,951円 |
| 期中追加設定元本額                    | 5,769,603,459円  | 4,344,275,934円  |
| 期中一部解約元本額                    | 4,990,211,655円  | 6,668,441,777円  |
| 期末元本額の内訳                     |                 |                 |
| ファンド名                        |                 |                 |
| ダイワ外国債券インデックスV A             | 2,974,807,305円  | 2,545,379,912円  |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 95,890,683円     | 84,164,616円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 654,002,925円    | 643,546,074円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 214,361,998円    | 167,354,074円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 2,082,860,310円  | 2,056,271,586円  |
| ワールドアセット(安定コース)              | - 円             | 128,133円        |
| ワールドアセット(分散コース)              | - 円             | 85,567円         |
| D-I's 外国債券インデックス             | - 円             | 406,104円        |
| DCダイワ外国債券インデックス              | 31,419,798,219円 | 32,349,060,558円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30               | 467,863,815円    | 445,800,383円    |
| ダイワ・ライフ・バランス50               | 149,813,996円    | 178,683,574円    |
| ダイワ・ライフ・バランス70               | 73,565,981円     | 100,777,152円    |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)   | 152,702,210円    | 174,921,608円    |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)  | 98,001,903円     | 123,959,627円    |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)   | 22,671,186円     | 29,707,678円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020           | 6,349,507円      | 7,425,218円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030           | 3,242,282円      | 4,697,941円      |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040           | 100,995円        | 279,828円        |
| ダイワ世界バランスファンド40VA            | 3,130,953,524円  | 2,763,914,461円  |
| ダイワ世界バランスファンド60VA            | 330,699,379円    | 299,269,751円    |
| ダイワ・バランスファンド35VA             | 11,017,887,488円 | 10,102,491,803円 |

|                                 |                 |                 |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワ・ワールド・バランス<br>ファンド50VA       | 2,175,325,799円  | 1,292,865,235円  |
| ダイワ・ワールド・バランス<br>ファンド75VA       | 1,760,038,112円  | 1,079,918,049円  |
| ダイワ・バランスファンド25<br>VA（適格機関投資家専用） | 647,231,776円    | 553,506,309円    |
| ダイワ・インデックスセレクト<br>外国債券          | - 円             | 414,192円        |
| ダイワ投信倶楽部外国債券イン<br>デックス          | 4,827,949,151円  | 4,971,994,896円  |
| ダイワライフスタイル25                    | 25,861,244円     | 25,924,729円     |
| ダイワライフスタイル50                    | 37,012,365円     | 40,647,847円     |
| ダイワライフスタイル75                    | 9,291,798円      | 10,521,203円     |
| 計                               | 62,378,283,951円 | 60,054,118,108円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                | 62,378,283,951口 | 60,054,118,108口 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 平成24年12月19日<br>至 平成25年12月18日  |
|--------------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 平成25年12月18日現在  |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 |



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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類  | 平成24年12月18日現在          | 平成25年12月18日現在          |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 371,009,306            | 554,438,294            |
| 合計   | 371,009,306            | 554,438,294            |

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成24年12月1日から平成24年12月18日まで、及び平成25年12月3日から平成25年12月18日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種 類         | 平成24年12月18日 現在 |           |             |             | 平成25年12月18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） |
| 市場取引以外の取引   |                |           |             |             |                |           |               |             |
| 為替予約取引      |                |           |             |             |                |           |               |             |
| 売 建         | -              | -         | -           | -           | 165,405,019    | -         | 164,709,200   | 695,819     |
| アメリカ・ドル     | -              | -         | -           | -           | 35,063,690     | -         | 34,962,200    | 101,490     |
| イギリス・ポンド    | -              | -         | -           | -           | 75,650,985     | -         | 75,312,000    | 338,985     |
| カナダ・ドル      | -              | -         | -           | -           | 41,925,860     | -         | 41,692,800    | 233,060     |
| ユーロ         | -              | -         | -           | -           | 12,764,484     | -         | 12,742,200    | 22,284      |
| 買 建         | 672,422,328    | -         | 688,396,500 | 15,974,172  | 979,277,735    | -         | 986,725,610   | 7,447,875   |
| アメリカ・ドル     | 238,163,097    | -         | 241,907,250 | 3,744,153   | 337,974,171    | -         | 339,581,410   | 1,607,239   |
| イギリス・ポンド    | 105,681,776    | -         | 108,408,300 | 2,726,524   | 137,896,920    | -         | 137,520,600   | 376,320     |
| オーストラリア・ドル  | 24,384,296     | -         | 25,088,560  | 704,264     | 21,459,989     | -         | 21,070,300    | 389,689     |
| カナダ・ドル      | 18,034,349     | -         | 18,492,740  | 458,391     | 61,235,909     | -         | 61,137,590    | 98,319      |
| シンガポール・ドル   | 6,087,716      | -         | 6,187,500   | 99,784      | 5,137,492      | -         | 5,151,510     | 14,018      |
| スイス・フラン     | 6,512,979      | -         | 6,672,200   | 159,221     | 5,426,472      | -         | 5,578,560     | 152,088     |
| スウェーデン・クローナ | 9,267,730      | -         | 9,389,790   | 122,060     | 7,946,711      | -         | 7,976,030     | 29,319      |
| デンマーク・クローネ  | 12,146,285     | -         | 12,476,400  | 330,115     | 11,264,160     | -         | 11,444,940    | 180,780     |
| ノルウェー・クローネ  | 3,927,420      | -         | 4,028,400   | 100,980     | 4,737,858      | -         | 4,774,040     | 36,182      |
| ポーランド・ズロチ   | 11,427,768     | -         | 11,785,890  | 358,122     | 11,944,496     | -         | 12,198,190    | 253,694     |
| メキシコ・ペソ     | 15,381,933     | -         | 15,884,120  | 502,187     | 15,127,985     | -         | 15,361,220    | 233,235     |
| ユーロ         | 211,828,625    | -         | 218,059,750 | 6,231,125   | 351,970,660    | -         | 357,813,120   | 5,842,460   |
| 南アフリカ・ランド   | 9,578,354      | -         | 10,015,600  | 437,246     | 7,154,912      | -         | 7,118,100     | 36,812      |
| 合計          | 672,422,328    | -         | 688,396,500 | 15,974,172  | 1,144,682,754  | -         | 1,151,434,810 | 8,143,694   |

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

|                           | 平成24年12月18日現在        | 平成25年12月18日現在        |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.9859円<br>(19,859円) | 2.4740円<br>(24,740円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類   | 通貨      | 銘柄                                 | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|------|---------|------------------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル |                                    | アメリカ・ドル       | アメリカ・ドル       |    |
|      |         | 4% U.S. TREASURY NOTE 20150215     | 2,654,000.000 | 2,771,227.180 |    |
|      |         | 4.125% U.S. TREASURY NOTE 20150515 | 3,708,000.000 | 3,911,495.040 |    |
|      |         | 4.25% U.S. TREASURY NOTE 20150815  | 3,926,000.000 | 4,184,409.320 |    |
|      |         | 4.5% U.S. TREASURY NOTE 20151115   | 1,828,000.000 | 1,973,728.160 |    |
|      |         | 4.5% U.S. TREASURY NOTE 20160215   | 1,826,000.000 | 1,989,408.740 |    |
|      |         | 5.125% U.S. TREASURY NOTE 20160515 | 1,940,000.000 | 2,158,017.200 |    |
|      |         | 4.875% U.S. TREASURY NOTE 20160815 | 1,999,000.000 | 2,229,424.730 |    |
|      |         | 4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115 | 2,336,000.000 | 2,605,621.120 |    |
|      |         | 4.625% U.S. TREASURY NOTE 20170215 | 2,039,000.000 | 2,286,534.600 |    |
|      |         | 4.5% U.S. TREASURY NOTE 20170515   | 1,795,000.000 | 2,014,887.500 |    |
|      |         | 4.75% U.S. TREASURY NOTE 20170815  | 2,401,000.000 | 2,729,624.870 |    |
|      |         | 4.25% U.S. TREASURY NOTE 20171115  | 1,686,000.000 | 1,891,742.580 |    |
|      |         | 3.5% U.S. TREASURY NOTE 20180215   | 3,839,000.000 | 4,203,973.730 |    |
|      |         | 3.875% U.S. TREASURY NOTE 20180515 | 2,960,000.000 | 3,291,816.000 |    |
|      |         | 4% U.S. TREASURY NOTE 20180815     | 3,173,000.000 | 3,553,125.400 |    |
|      |         | 3.75% U.S. TREASURY NOTE 20181115  | 3,805,000.000 | 4,217,576.150 |    |
|      |         | 2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215  | 3,161,000.000 | 3,348,162.810 |    |

|                                       |               |               |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20160229 | 2,195,000.000 | 2,303,279.350 |  |
| 2.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20160331 | 2,463,000.000 | 2,574,401.490 |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20160430 | 2,001,000.000 | 2,104,871.910 |  |
| 3.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20190515 | 3,096,000.000 | 3,336,404.400 |  |
| 3.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160531  | 621,000.000   | 663,426.720   |  |
| 3.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160630  | 2,121,000.000 | 2,270,445.660 |  |
| 3.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160731  | 1,833,000.000 | 1,964,096.160 |  |
| 3.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20190815 | 3,116,000.000 | 3,434,891.440 |  |
| 3% U.S. TREASURY NOTE 20160831        | 2,488,000.000 | 2,652,033.840 |  |
| 3% U.S. TREASURY NOTE 20160930        | 2,499,000.000 | 2,665,908.210 |  |
| 3.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20161031 | 2,319,000.000 | 2,484,854.880 |  |
| 3.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20191115 | 4,020,000.000 | 4,375,810.200 |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20141130 | 3,594,000.000 | 3,660,668.700 |  |
| 2.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20161130  | 4,149,000.000 | 4,404,578.400 |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20141231 | 4,437,000.000 | 4,549,477.950 |  |
| 3.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20161231  | 4,011,000.000 | 4,321,852.500 |  |
| 2.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150131  | 2,315,000.000 | 2,368,337.600 |  |
| 3.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20170131 | 2,884,000.000 | 3,096,695.000 |  |
| 3.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20200215 | 5,630,000.000 | 6,197,785.500 |  |
| 2.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150228 | 4,921,000.000 | 5,049,782.570 |  |
| 3% U.S. TREASURY NOTE 20170228        | 2,687,000.000 | 2,877,185.860 |  |
| 2.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20150331   | 5,843,000.000 | 6,014,375.190 |  |
| 3.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20170331  | 4,635,000.000 | 5,006,124.450 |  |
| 2.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20150430   | 2,218,000.000 | 2,287,046.340 |  |
| 3.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20170430 | 1,653,000.000 | 1,779,041.250 |  |
| 3.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20200515   | 3,073,000.000 | 3,356,514.980 |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20150531 | 2,576,000.000 | 2,646,530.880 |  |
| 2.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20170531  | 2,835,000.000 | 3,017,715.750 |  |
| 1.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20150630 | 4,658,000.000 | 4,774,263.680 |  |
| 2.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20170630   | 3,468,000.000 | 3,660,335.280 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20150731  | 2,386,000.000 | 2,443,216.280 |  |
| 2.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20170731 | 1,773,000.000 | 1,862,891.100 |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20200815 | 4,527,000.000 | 4,680,103.140 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150831  | 6,152,000.000 | 6,254,799.920 |  |

|                                       |               |               |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| 1.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20170831 | 2,903,000.000 | 2,997,550.710 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150930  | 2,568,000.000 | 2,611,835.760 |  |
| 1.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20170930 | 2,831,000.000 | 2,921,223.970 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20151031  | 3,406,000.000 | 3,465,707.180 |  |
| 1.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20171031 | 382,000.000   | 393,964.240   |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20201115 | 4,509,000.000 | 4,642,827.120 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20151130 | 3,151,000.000 | 3,215,248.890 |  |
| 2.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20171130  | 883,000.000   | 922,452.440   |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20151231 | 2,515,000.000 | 2,605,665.750 |  |
| 2.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20171231  | 924,000.000   | 983,690.400   |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20160131        | 635,000.000   | 656,951.950   |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20180131 | 255,000.000   | 270,139.350   |  |
| 3.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20210215 | 4,076,000.000 | 4,458,736.400 |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20160229 | 2,590,000.000 | 2,689,740.900 |  |
| 2.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20180228  | 1,234,000.000 | 1,313,630.020 |  |
| 2.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160331  | 2,649,000.000 | 2,761,052.700 |  |
| 2.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20180331 | 1,300,000.000 | 1,389,778.000 |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20160430        | 2,295,000.000 | 2,379,800.250 |  |
| 2.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20180430 | 260,000.000   | 275,171.000   |  |
| 3.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20210515 | 4,417,000.000 | 4,667,488.070 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20160531  | 3,832,000.000 | 3,952,937.920 |  |
| 2.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20180531 | 1,322,000.000 | 1,384,266.200 |  |
| 1.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20160630   | 3,406,000.000 | 3,493,942.920 |  |
| 2.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20180630 | 1,065,000.000 | 1,113,585.300 |  |
| 1.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20160731   | 2,053,000.000 | 2,105,679.980 |  |
| 2.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20180731  | 1,341,000.000 | 1,394,841.150 |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20210815 | 2,534,000.000 | 2,489,452.280 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20160831        | 2,108,000.000 | 2,133,928.400 |  |
| 1.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20180831   | 3,444,000.000 | 3,458,258.160 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20160930        | 2,793,000.000 | 2,826,152.910 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20180930 | 2,835,000.000 | 2,825,899.650 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20161031        | 2,718,000.000 | 2,748,033.900 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20181031  | 1,920,000.000 | 1,947,206.400 |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20211115        | 1,353,000.000 | 1,308,919.260 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20161130 | 3,027,000.000 | 3,047,553.330 |  |

|                                       |               |               |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20181130 | 2,165,000.000 | 2,153,915.200 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20141215  | 510,000.000   | 510,453.900   |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20161231 | 4,265,000.000 | 4,289,822.300 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20181231 | 1,861,000.000 | 1,848,196.320 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150115  | 4,162,000.000 | 4,165,412.840 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20170131 | 2,970,000.000 | 2,984,731.200 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20190131  | 1,426,000.000 | 1,404,495.920 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150215  | 3,983,000.000 | 3,985,788.100 |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20220215        | 3,224,000.000 | 3,101,197.840 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20170228 | 2,408,000.000 | 2,417,102.240 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20190228 | 1,843,000.000 | 1,823,630.070 |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150315 | 3,557,000.000 | 3,564,611.980 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20170331        | 3,856,000.000 | 3,882,182.240 |  |
| 1.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20190331   | 300,000.000   | 298,053.000   |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150415 | 3,410,000.000 | 3,417,570.200 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20170430 | 2,375,000.000 | 2,378,966.250 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20190430  | 559,000.000   | 547,031.810   |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150515  | 2,261,000.000 | 2,262,130.500 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20220515  | 3,592,000.000 | 3,367,500.000 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20170531 | 2,125,000.000 | 2,107,235.000 |  |
| 1.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20190531 | 2,385,000.000 | 2,312,496.000 |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150615 | 3,379,000.000 | 3,385,724.210 |  |
| 0.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20170630  | 3,906,000.000 | 3,885,063.840 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20190630        | 1,368,000.000 | 1,314,128.160 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150715  | 3,665,000.000 | 3,664,706.800 |  |
| 0.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20170731   | 5,660,000.000 | 5,569,553.200 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20190731 | 2,784,000.000 | 2,649,143.040 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150815  | 4,788,000.000 | 4,786,659.360 |  |
| 1.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20220815 | 2,858,000.000 | 2,632,475.220 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20170831 | 6,410,000.000 | 6,325,580.300 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20190831        | 3,562,000.000 | 3,405,022.660 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150915  | 3,987,000.000 | 3,984,009.750 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20170930 | 1,913,000.000 | 1,884,362.390 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20190930        | 2,215,000.000 | 2,114,106.750 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20151015  | 3,548,000.000 | 3,544,664.880 |  |

|                                       |               |               |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| 0.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20171031  | 2,648,000.000 | 2,616,435.840 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20191031  | 884,000.000   | 854,987.120   |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20151115 | 1,473,000.000 | 1,474,664.490 |  |
| 1.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20221115 | 4,067,000.000 | 3,721,915.050 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20141130  | 3,256,000.000 | 3,259,158.320 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20171130 | 2,336,000.000 | 2,292,643.840 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20191130        | 150,000.000   | 142,488.000   |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20151215  | 2,822,000.000 | 2,817,146.160 |  |
| 0.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20141231 | 3,265,000.000 | 3,263,824.600 |  |
| 0.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20171231  | 148,000.000   | 145,704.520   |  |
| 1.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20191231 | 894,000.000   | 853,770.000   |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20160115 | 2,425,000.000 | 2,425,848.750 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150131  | 143,000.000   | 143,117.260   |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20180131 | 1,569,000.000 | 1,549,685.610 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20200131 | 71,000.000    | 68,686.820    |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20160215 | 143,000.000   | 143,015.730   |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20230215        | 3,850,000.000 | 3,622,272.500 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150228  | 4,589,000.000 | 4,592,028.740 |  |
| 0.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20180228  | 3,447,000.000 | 3,381,403.590 |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20200229  | 2,583,000.000 | 2,474,229.870 |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20160315 | 3,155,000.000 | 3,153,390.950 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150331  | 2,321,000.000 | 2,322,531.860 |  |
| 0.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20180331  | 2,315,000.000 | 2,266,523.900 |  |
| 1.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20200331 | 1,160,000.000 | 1,100,004.800 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160415  | 2,037,000.000 | 2,029,422.360 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20230515  | 7,656,000.000 | 6,998,043.360 |  |
| 0.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20150430 | 1,704,000.000 | 1,701,921.120 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20160515  | 713,000.000   | 709,848.540   |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20180430 | 1,441,000.000 | 1,401,372.500 |  |
| 1.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20200430 | 1,451,000.000 | 1,372,326.780 |  |
| 1% U.S. TREASURY NOTE 20180531        | 3,407,000.000 | 3,360,664.800 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150531  | 1,114,000.000 | 1,114,467.880 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20200531 | 2,461,000.000 | 2,360,049.780 |  |
| 0.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20160615   | 1,398,000.000 | 1,399,467.900 |  |

|                                       |               |               |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20180630 | 1,693,000.000 | 1,694,642.210 |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150630 | 5,083,000.000 | 5,093,115.170 |  |
| 1.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20200630 | 2,131,000.000 | 2,105,193.590 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20160715 | 3,108,000.000 | 3,118,536.120 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150731  | 5,098,000.000 | 5,096,980.400 |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20200731        | 2,827,000.000 | 2,811,734.200 |  |
| 1.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20180731 | 1,697,000.000 | 1,696,864.240 |  |
| 2.5% U.S. TREASURY NOTE<br>20230815   | 5,361,000.000 | 5,219,844.870 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20160815 | 2,989,000.000 | 2,997,040.410 |  |
| 0.375% U.S. TREASURY NOTE<br>20150831 | 4,451,000.000 | 4,458,299.640 |  |
| 2.125% U.S. TREASURY NOTE<br>20200831 | 1,993,000.000 | 1,992,362.240 |  |
| 0.875% U.S. TREASURY NOTE<br>20160915 | 143,000.000   | 144,301.300   |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20150930  | 4,466,000.000 | 4,462,650.500 |  |
| 2% U.S. TREASURY NOTE 20200930        | 1,885,000.000 | 1,866,583.550 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20161015 | 146,000.000   | 146,210.240   |  |
| 1.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20181031  | 3,611,000.000 | 3,574,312.240 |  |
| 0.25% U.S. TREASURY NOTE<br>20151031  | 4,603,000.000 | 4,598,489.060 |  |
| 1.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20201031  | 2,345,000.000 | 2,279,410.350 |  |
| 2.75% U.S. TREASURY NOTE<br>20231115  | 2,724,000.000 | 2,702,698.320 |  |
| 0.625% U.S. TREASURY NOTE<br>20161115 | 719,000.000   | 719,251.650   |  |
| 11.25% U.S. TREASURY BOND<br>20150215 | 939,000.000   | 1,059,379.800 |  |
| 9.875% U.S. TREASURY BOND<br>20151115 | 461,000.000   | 544,966.540   |  |
| 7.25% U.S. TREASURY BOND<br>20160515  | 1,850,000.000 | 2,152,142.000 |  |
| 7.5% U.S. TREASURY BOND<br>20161115   | 1,552,000.000 | 1,860,025.440 |  |
| 8.75% U.S. TREASURY BOND<br>20170515  | 1,527,000.000 | 1,932,846.060 |  |
| 8.875% U.S. TREASURY BOND<br>20190215 | 904,000.000   | 1,235,722.800 |  |
| 8.125% U.S. TREASURY BOND<br>20190815 | 1,582,000.000 | 2,132,599.280 |  |
| 8.75% U.S. TREASURY BOND<br>20200815  | 1,380,000.000 | 1,961,325.000 |  |
| 8% U.S. TREASURY BOND 20211115        | 3,025,000.000 | 4,259,321.000 |  |
| 6.25% U.S. TREASURY BOND<br>20230815  | 1,666,000.000 | 2,169,698.440 |  |
| 6% U.S. TREASURY BOND 20260215        | 855,000.000   | 1,106,754.750 |  |
| 6.5% U.S. TREASURY BOND<br>20261115   | 630,000.000   | 852,862.500   |  |
| 6.125% U.S. TREASURY BOND<br>20271115 | 709,000.000   | 935,433.330   |  |
| 5.5% U.S. TREASURY BOND<br>20280815   | 1,147,000.000 | 1,432,763.580 |  |

|  |               |  |  |
|--|---------------|--|--|
| 5.25% U.S. TREASURY BOND<br>20281115       | 938,000.000   | 1,145,157.300                                  |  |
| 5.25% U.S. TREASURY BOND<br>20290215       | 215,000.000   | 262,398.900                                    |  |
| 6.25% U.S. TREASURY BOND<br>20300515       | 1,347,000.000 | 1,822,962.450                                  |  |
| 5.375% U.S. TREASURY BOND<br>20310215      | 1,436,000.000 | 1,784,890.560                                  |  |
| 4.5% U.S. TREASURY BOND<br>20360215        | 1,606,000.000 | 1,809,126.880                                  |  |
| 5% U.S. TREASURY BOND 20370515             | 547,000.000   | 658,577.060                                    |  |
| 4.375% U.S. TREASURY BOND<br>20380215      | 108,000.000   | 119,044.080                                    |  |
| 4.5% U.S. TREASURY BOND<br>20380515        | 1,019,000.000 | 1,144,377.760                                  |  |
| 3.5% U.S. TREASURY BOND<br>20390215        | 255,000.000   | 243,244.500                                    |  |
| 4.25% U.S. TREASURY BOND<br>20390515       | 694,000.000   | 749,790.660                                    |  |
| 4.5% U.S. TREASURY BOND<br>20390815        | 1,608,000.000 | 1,805,848.320                                  |  |
| 4.375% U.S. TREASURY BOND<br>20391115      | 1,625,000.000 | 1,790,278.750                                  |  |
| 4.625% U.S. TREASURY BOND<br>20400215      | 1,517,000.000 | 1,735,766.570                                  |  |
| 4.375% U.S. TREASURY BOND<br>20400515      | 2,169,000.000 | 2,387,591.820                                  |  |
| 3.875% U.S. TREASURY BOND<br>20400815      | 2,266,000.000 | 2,295,911.200                                  |  |
| 4.25% U.S. TREASURY BOND<br>20401115       | 1,992,000.000 | 2,147,296.320                                  |  |
| 4.75% U.S. TREASURY BOND<br>20410215       | 3,086,000.000 | 3,597,226.760                                  |  |
| 4.375% U.S. TREASURY BOND<br>20410515      | 1,807,000.000 | 1,985,712.300                                  |  |
| 3.75% U.S. TREASURY BOND<br>20410815       | 1,367,000.000 | 1,349,584.420                                  |  |
| 3.125% U.S. TREASURY BOND<br>20411115      | 4,039,000.000 | 3,533,801.880                                  |  |
| 3.125% U.S. TREASURY BOND<br>20420215      | 3,921,000.000 | 3,424,405.350                                  |  |
| 3% U.S. TREASURY BOND 20420515             | 4,432,000.000 | 3,765,116.960                                  |  |
| 2.75% U.S. TREASURY BOND<br>20420815       | 1,731,000.000 | 1,389,664.110                                  |  |
| 2.75% U.S. TREASURY BOND<br>20421115       | 3,984,000.000 | 3,190,148.160                                  |  |
| 3.125% U.S. TREASURY BOND<br>20430215      | 2,026,000.000 | 1,756,440.700                                  |  |
| 2.875% U.S. TREASURY BOND<br>20430515      | 3,392,000.000 | 2,782,762.880                                  |  |
| 3.625% U.S. TREASURY BOND<br>20430815      | 3,314,000.000 | 3,168,217.140                                  |  |
| 3.75% U.S. TREASURY BOND<br>20431115       | 1,449,000.000 | 1,417,860.990                                  |  |
| アメリカ・ドル 小計                                 |               | アメリカ・ドル<br>553,132,186.980<br>(56,884,114,109) |  |
| イギリス・ポンド                                   | イギリス・ポンド      | イギリス・ポンド                                       |  |
| 8.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20170825 | 868,000.000   | 1,103,835.600                                  |  |
| 8% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20151207    | 641,000.000   | 735,996.200                                    |  |
| 8% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20210607    | 1,213,000.000 | 1,678,913.300                                  |  |



|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 6% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20281207    | 909,000.000   | 1,202,243.400 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20320607 | 1,815,000.000 | 2,022,091.500 |  |
| 5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20250307    | 1,662,000.000 | 1,972,794.000 |  |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20150907 | 1,963,000.000 | 2,107,280.500 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20360307 | 2,157,000.000 | 2,405,917.800 |  |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20381207 | 1,245,000.000 | 1,501,096.500 |  |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20200307 | 1,724,000.000 | 1,991,392.400 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20551207 | 1,708,000.000 | 1,986,233.200 |  |
| 4% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20160907    | 2,475,000.000 | 2,690,572.500 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20461207 | 2,061,000.000 | 2,338,410.600 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20271207 | 1,465,000.000 | 1,628,787.000 |  |
| 5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20180307    | 1,604,000.000 | 1,838,986.000 |  |
| 4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20421207  | 1,793,000.000 | 2,103,906.200 |  |
| 4.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20301207 | 1,806,000.000 | 2,128,912.800 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20491207 | 1,915,000.000 | 2,194,781.500 |  |
| 4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20190307  | 1,820,000.000 | 2,063,880.000 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20390907 | 1,178,000.000 | 1,319,595.600 |  |
| 4% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20220307    | 1,391,000.000 | 1,539,419.700 |  |
| 4.5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20340907  | 1,720,000.000 | 1,980,924.000 |  |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20190907 | 1,428,000.000 | 1,566,658.800 |  |
| 4% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20600122    | 1,144,000.000 | 1,273,272.000 |  |
| 2.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20150122 | 1,843,000.000 | 1,890,365.100 |  |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20200907 | 2,316,000.000 | 2,536,714.800 |  |
| 4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20401207 | 2,133,000.000 | 2,392,372.800 |  |
| 2% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20160122    | 2,338,000.000 | 2,405,334.400 |  |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20210907 | 2,117,000.000 | 2,309,223.600 |  |
| 1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20170122 | 1,533,000.000 | 1,569,332.100 |  |
| 3.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20520722 | 1,182,000.000 | 1,232,826.000 |  |
| 1% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20170907    | 2,737,000.000 | 2,711,545.900 |  |
| 1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20220907 | 2,601,000.000 | 2,408,786.100 |  |
| 3.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20440122 | 645,000.000   | 604,365.000   |  |
| 1.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20180722 | 2,585,000.000 | 2,542,864.500 |  |
| 2.25% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20230907 | 1,517,000.000 | 1,436,902.400 |  |

|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 3.5% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20680722    | 649,000.000   | 644,586.800                                     |  |
|               | 1.75% UNITED KINGDOM GILT BOND<br>20190722   | 403,000.000   | 398,284.900                                     |  |
| イギリス・ポンド 小計   |  |               | イギリス・ポンド<br>68,459,405.500<br>(11,458,050,698)  |  |
| オーストラリア・ドル    |  | オーストラリア・ドル    | オーストラリア・ドル                                      |  |
|               | 6.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20150415 | 1,385,000.000 | 1,452,698.800                                   |  |
|               | 6% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20170215    | 1,687,000.000 | 1,843,351.160                                   |  |
|               | 5.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20190315 | 3,060,000.000 | 3,326,373.000                                   |  |
|               | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210515 | 1,755,000.000 | 1,966,846.050                                   |  |
|               | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20200415  | 1,928,000.000 | 2,019,020.880                                   |  |
|               | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220715 | 1,882,000.000 | 2,112,733.200                                   |  |
|               | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20160615 | 1,221,000.000 | 1,280,120.820                                   |  |
|               | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20180121  | 2,063,000.000 | 2,246,772.040                                   |  |
|               | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230421  | 1,856,000.000 | 2,053,070.080                                   |  |
|               | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20151021 | 721,000.000   | 748,635.930                                     |  |
|               | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20170721 | 1,385,000.000 | 1,441,895.800                                   |  |
|               | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270421 | 462,000.000   | 475,245.540                                     |  |
|               | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240421 | 1,279,000.000 | 1,122,041.120                                   |  |
|               | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290421 | 479,000.000   | 406,809.910                                     |  |
|               | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250421 | 646,000.000   | 584,927.160                                     |  |
|               | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330421  | 558,000.000   | 537,956.640                                     |  |
| オーストラリア・ドル 小計 |  |               | オーストラリア・ドル<br>23,618,498.130<br>(2,167,469,573) |  |
| カナダ・ドル        |  | カナダ・ドル        | カナダ・ドル  |  |
|               | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601      | 386,000.000   | 606,641.460                                     |  |
|               | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20290601   | 1,290,000.000 | 1,732,444.200                                   |  |
|               | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20330601   | 1,017,000.000 | 1,408,402.620                                   |  |
|               | 4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20150601    | 1,036,000.000 | 1,087,851.800                                   |  |
|               | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20370601      | 1,563,000.000 | 2,038,777.200                                   |  |
|               | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20160601      | 571,000.000   | 610,713.050                                     |  |
|               | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20170601      | 1,747,000.000 | 1,900,176.960                                   |  |
|               | 4.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20180601   | 969,000.000   | 1,075,415.580                                   |  |
|               | 3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20190601   | 2,199,000.000 | 2,406,409.680                                   |  |

|  |  |               |   |  |
|--|--|---------------|---|--|
|  | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20410601    | 1,413,000.000 | 1,622,265.300                               |  |
|  | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20141201    | 1,657,000.000 | 1,672,940.340                               |  |
|  | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20200601  | 1,476,000.000 | 1,600,884.360                               |  |
|  | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20150601  | 827,000.000   | 844,615.100                                 |  |
|  | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20151201    | 973,000.000   | 1,008,816.130                               |  |
|  | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20210601 | 1,257,000.000 | 1,340,351.670                               |  |
|  | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20160601    | 629,000.000   | 642,385.120                                 |  |
|  | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20160901 | 761,000.000   | 792,102.070                                 |  |
|  | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220601 | 1,949,000.000 | 1,984,608.230                               |  |
|  | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20451201  | 1,350,000.000 | 1,432,066.500                               |  |
|  | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20170301  | 1,327,000.000 | 1,334,537.360                               |  |
|  | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20150201    | 1,535,000.000 | 1,535,138.150                               |  |
|  | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20150801  | 1,688,000.000 | 1,700,339.280                               |  |
|  | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20170901  | 216,000.000   | 215,885.520                                 |  |
|  | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20230601  | 1,199,000.000 | 1,085,610.570                               |  |
|  | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20160201 | 294,000.000   | 294,890.820                                 |  |
|  | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20180301 | 1,265,000.000 | 1,244,001.000                               |  |
|  | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20150501    | 1,667,000.000 | 1,666,766.620                               |  |
|  | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20160801    | 569,000.000   | 566,479.330                                 |  |
|  | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20180901 | 458,000.000   | 446,691.980                                 |  |
|  | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240601  | 609,000.000   | 595,029.540                                 |  |
|  | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20151101    | 424,000.000   | 423,414.880                                 |  |
|  | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20170201  | 455,000.000   | 457,420.600                                 |  |
|  | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20190301 | 122,000.000   | 121,009.360                                 |  |
|  | カナダ・ドル 小計                                  |               | カナダ・ドル<br>37,495,082.380<br>(3,635,898,138) |  |
|  | シンガポール・ドル                                  | シンガポール・ドル     | シンガポール・ドル                                   |  |
|  | 3.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20160901     | 518,000.000   | 564,247.040                                 |  |
|  | 4% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20180901        | 572,000.000   | 645,850.920                                 |  |
|  | 3.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20200901     | 696,000.000   | 748,464.480                                 |  |
|  | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20270301      | 442,000.000   | 473,638.360                                 |  |
|  | 3.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20220901    | 438,000.000   | 461,516.220                                 |  |
|  | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20150701    | 298,000.000   | 309,374.660                                 |  |

|                |   |               |   |  |
|----------------|---|---------------|---|--|
|                | 2.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20190601     | 434,000.000   | 454,285.160                                 |  |
|                | 3% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20240901       | 376,000.000   | 386,926.560                                 |  |
|                | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20170401   | 323,000.000   | 341,788.910                                 |  |
|                | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20300901   | 279,000.000   | 276,134.670                                 |  |
|                | 1.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20160401   | 426,000.000   | 433,795.800                                 |  |
|                | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20210601    | 197,000.000   | 197,311.260                                 |  |
|                | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20420401    | 227,000.000   | 216,271.980                                 |  |
|                | 0.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20150201    | 285,000.000   | 284,660.850                                 |  |
|                | 0.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20180401     | 272,000.000   | 267,343.360                                 |  |
|                | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20230701    | 245,000.000   | 251,485.150                                 |  |
|                | 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20330901   | 173,000.000   | 181,833.380                                 |  |
| シンガポール・ドル 小計   |   |               | シンガポール・ドル<br>6,494,928.760<br>(531,285,173) |  |
| スイス・フラン        |   | スイス・フラン       | スイス・フラン                                     |  |
|                | 4% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20230211      | 1,342,000.000 | 1,692,798.800                               |  |
|                | 4% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20280408      | 200,000.000   | 264,702.000                                 |  |
|                | 3.75% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20150610   | 338,000.000   | 358,567.300                                 |  |
|                | 2.5% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20160312    | 627,000.000   | 663,949.110                                 |  |
|                | 4.25% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20170605   | 639,000.000   | 732,671.010                                 |  |
|                | 3% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20180108      | 373,000.000   | 416,115.070                                 |  |
|                | 3% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20190512      | 559,000.000   | 638,461.850                                 |  |
|                | 2.25% SWISS GOVERNMENT BOND<br>20200706   | 24,000.000    | 26,580.960                                  |  |
| スイス・フラン 小計     |   |               | スイス・フラン<br>4,793,846.100<br>(557,140,793)   |  |
| スウェーデン・クローナ    |   | スウェーデン・クローナ   | スウェーデン・クローナ                                 |  |
|                | 4.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20150812  | 6,885,000.000 | 7,303,952.250                               |  |
|                | 5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20201201    | 4,340,000.000 | 5,199,493.600                               |  |
|                | 3% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20160712    | 4,705,000.000 | 4,947,072.250                               |  |
|                | 3.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20170812 | 5,175,000.000 | 5,631,797.250                               |  |
|                | 4.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20190312 | 8,900,000.000 | 10,081,208.000                              |  |
|                | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20390330  | 4,940,000.000 | 5,303,781.600                               |  |
|                | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20220601  | 6,260,000.000 | 6,905,468.600                               |  |
|                | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20231113  | 6,290,000.000 | 5,824,036.800                               |  |
| スウェーデン・クローナ 小計 |   |               | スウェーデン・クローナ<br>51,196,810.350               |  |

|               |   |                |   |
|---------------|---|----------------|---|
| デンマーク・クローネ    |   | デンマーク・クローネ     | デンマーク・クローネ                                      |
|               | 7% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20241110       | 3,957,000.000  | 5,969,846.760                                   |
|               | 4% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20151115       | 8,732,000.000  | 9,380,351.000                                   |
|               | 4% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20171115       | 8,533,000.000  | 9,688,112.210                                   |
|               | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20391115     | 12,472,000.000 | 16,860,522.640                                  |
|               | 4% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20191115       | 8,601,000.000  | 10,044,333.810                                  |
|               | 3% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20211115       | 4,596,000.000  | 5,111,625.240                                   |
|               | 2.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20161115     | 4,503,000.000  | 4,796,280.390                                   |
|               | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20231115     | 2,134,000.000  | 2,061,081.220                                   |
| デンマーク・クローネ 小計 |   |                | デンマーク・クローネ<br>63,912,153.270<br>(1,213,052,669) |
| ノルウェー・クローネ    |   | ノルウェー・クローネ     | ノルウェー・クローネ                                      |
|               | 5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20150515    | 6,164,000.000  | 6,465,111.400                                   |
|               | 4.25% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20170519 | 7,190,000.000  | 7,768,866.900                                   |
|               | 4.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20190522  | 5,075,000.000  | 5,657,660.750                                   |
|               | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210525 | 5,003,000.000  | 5,395,635.440                                   |
|               | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20230524    | 3,519,000.000  | 3,280,904.460                                   |
| ノルウェー・クローネ 小計 |   |                | ノルウェー・クローネ<br>28,568,178.950<br>(480,802,451)   |
| ポーランド・ズロチ     |   | ポーランド・ズロチ      | ポーランド・ズロチ                                       |
|               | 6.25% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20151024    | 2,679,000.000  | 2,842,552.950                                   |
|               | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20220923    | 2,309,000.000  | 2,550,798.480                                   |
|               | 5.25% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20171025    | 4,466,000.000  | 4,769,286.060                                   |
|               | 5.5% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20191025     | 2,458,000.000  | 2,673,468.280                                   |
|               | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20290425    | 1,705,000.000  | 1,902,780.000                                   |
|               | 5.5% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20150425     | 3,068,000.000  | 3,180,380.840                                   |
|               | 5.25% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20201025    | 2,470,000.000  | 2,652,113.100                                   |
|               | 5% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20160425       | 2,871,000.000  | 3,003,640.200                                   |
|               | 5.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20211025    | 1,950,000.000  | 2,153,385.000                                   |
|               | 4.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20161025    | 3,153,000.000  | 3,296,776.800                                   |
|               | 4.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20170425    | 2,705,000.000  | 2,832,567.800                                   |
|               | 4% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20231025       | 2,012,000.000  | 1,956,146.880                                   |
|               | 3.75% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20180425    | 1,720,000.000  | 1,739,969.200                                   |

|                |   |               |  |  |
|----------------|---|---------------|--|--|
|                | POLAND GOVERNMENT BOND<br>20150725      | 732,000.000   | 700,524.000                                    |  |
|                | 2.5% POLAND GOVERNMENT BOND<br>20180725 | 229,000.000   | 219,840.000                                    |  |
|                | POLAND GOVERNMENT BOND<br>20160125      | 503,000.000   | 475,184.100                                    |  |
| ポーランド・ズロチ 小計   |   |               | ポーランド・ズロチ<br>36,949,413.690<br>(1,250,368,159) |  |
| マレーシア・リンギット    |   | マレーシア・リンギット   | マレーシア・リンギット                                    |  |
|                | 4.262% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20160915 | 2,614,000.000 | 2,672,788.860                                  |  |
|                | 4.72% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20150930  | 1,107,000.000 | 1,136,269.080                                  |  |
|                | 4.24% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20180207  | 1,210,000.000 | 1,236,208.600                                  |  |
|                | 5.734% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20190730 | 938,000.000   | 1,019,559.100                                  |  |
|                | 3.814% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20170215 | 1,015,000.000 | 1,025,048.500                                  |  |
|                | 3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270531 | 573,000.000   | 524,380.950                                    |  |
|                | 5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280915 | 738,000.000   | 800,973.540                                    |  |
|                | 4.378% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20191129 | 1,093,000.000 | 1,116,138.810                                  |  |
|                | 3.741% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20150227 | 1,421,000.000 | 1,431,756.970                                  |  |
|                | 3.835% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20150812 | 653,000.000   | 659,177.380                                    |  |
|                | 4.012% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20170915 | 1,427,000.000 | 1,446,464.280                                  |  |
|                | 4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20210715  | 2,461,000.000 | 2,474,043.300                                  |  |
|                | 4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260415 | 946,000.000   | 945,318.880                                    |  |
|                | 3.58% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20180928  | 738,000.000   | 733,660.560                                    |  |
|                | 3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20220815 | 572,000.000   | 542,770.800                                    |  |
|                | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270315 | 731,000.000   | 691,087.400                                    |  |
|                | 3.197% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20151015 | 1,270,000.000 | 1,270,901.700                                  |  |
|                | 4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20320415 | 618,000.000   | 589,436.040                                    |  |
|                | 3.314% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20171031 | 399,000.000   | 394,718.730                                    |  |
|                | 3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20200331 | 444,000.000   | 432,549.240                                    |  |
|                | 3.172% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20160715 | 953,000.000   | 949,635.910                                    |  |
|                | 3.26% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20180301  | 533,000.000   | 524,967.690                                    |  |
|                | 3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230315  | 401,000.000   | 382,987.080                                    |  |
|                | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280615 | 586,000.000   | 550,236.420                                    |  |
|                | 3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20200731 | 656,000.000   | 652,483.840                                    |  |
| マレーシア・リンギット 小計 |   |               | マレーシア・リンギット<br>24,203,563.660<br>(764,832,612) |  |
| メキシコ・ペソ        |   | メキシコ・ペソ       | メキシコ・ペソ  |  |

|     |  |                |   |  |
|-----|--|----------------|---|--|
|     | 8% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20231207    | 5,196,000.000  | 5,803,620.240                                 |  |
|     | 10% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20241205   | 10,175,000.000 | 13,072,127.750                                |  |
|     | 9.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20141218  | 10,588,000.000 | 11,201,151.080                                |  |
|     | 8% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20151217    | 4,320,000.000  | 4,665,038.400                                 |  |
|     | 7.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20270603  | 8,568,000.000  | 9,135,544.320                                 |  |
|     | 7.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20161215 | 10,474,000.000 | 11,333,810.660                                |  |
|     | 7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20171214 | 7,015,000.000  | 7,779,985.750                                 |  |
|     | 10% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20361120   | 6,874,000.000  | 8,695,541.260                                 |  |
|     | 8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20290531  | 7,549,000.000  | 8,518,593.560                                 |  |
|     | 8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20181213  | 6,960,000.000  | 7,967,808.000                                 |  |
|     | 8.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20381118  | 9,694,000.000  | 10,710,222.020                                |  |
|     | 8% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20200611    | 18,429,000.000 | 20,852,597.790                                |  |
|     | 6% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20150618    | 7,782,000.000  | 8,059,272.660                                 |  |
|     | 6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20210610  | 19,332,000.000 | 20,120,938.920                                |  |
|     | 6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20160616 | 11,839,000.000 | 12,496,419.670                                |  |
|     | 7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20310529 | 10,550,000.000 | 10,992,045.000                                |  |
|     | 6.5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20220609  | 10,778,000.000 | 11,050,791.180                                |  |
|     | 7.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20421113 | 1,878,000.000  | 1,914,977.820                                 |  |
|     | 5% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20170615    | 5,560,000.000  | 5,642,955.200                                 |  |
|     | 4.75% MEXICAN FIXED RATE BONOS<br>20180614 | 4,554,000.000  | 4,501,856.700                                 |  |
|     | メキシコ・ペソ 小計                                 |                | メキシコ・ペソ<br>194,515,297.980<br>(1,542,506,313) |  |
| ユーロ |  | ユーロ            | ユーロ   |  |
|     | 6% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20160620      | 289,000.000    | 330,020.660                                   |  |
|     | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240104   | 1,223,000.000  | 1,718,339.460                                 |  |
|     | 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270704    | 1,067,000.000  | 1,597,800.490                                 |  |
|     | 5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280104  | 1,104,000.000  | 1,540,885.920                                 |  |
|     | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280704   | 887,000.000    | 1,145,915.300                                 |  |
|     | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20300104   | 951,000.000    | 1,426,595.100                                 |  |
|     | 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20310104    | 1,705,000.000  | 2,404,578.550                                 |  |
|     | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20340704   | 2,154,000.000  | 2,876,580.840                                 |  |
|     | 3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150104   | 2,087,000.000  | 2,164,782.490                                 |  |
|     | 4% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20370104      | 1,911,000.000  | 2,343,841.500                                 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150704 | 2,000,000.000 | 2,093,640.000 |  |
| 3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20160104  | 2,510,000.000 | 2,677,467.200 |  |
| 4% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20160704    | 2,619,000.000 | 2,865,159.810 |  |
| 3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20170104 | 2,185,000.000 | 2,409,049.900 |  |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20390704 | 1,301,000.000 | 1,677,197.160 |  |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20170704 | 2,099,000.000 | 2,377,117.500 |  |
| 4% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20180104    | 1,798,000.000 | 2,043,930.440 |  |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20180704 | 2,211,000.000 | 2,561,598.270 |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20400704 | 1,848,000.000 | 2,571,122.400 |  |
| 3.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20190104 | 2,682,000.000 | 3,068,905.320 |  |
| 3.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20190704  | 2,481,000.000 | 2,822,931.420 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20200104 | 2,075,000.000 | 2,341,430.000 |  |
| 3% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20200704    | 2,247,000.000 | 2,507,494.710 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20420704 | 1,374,000.000 | 1,531,323.000 |  |
| 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20200904 | 2,072,000.000 | 2,212,046.480 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210104  | 2,547,000.000 | 2,755,089.900 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210704 | 2,065,000.000 | 2,340,884.000 |  |
| 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210904 | 1,263,000.000 | 1,340,346.120 |  |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220104    | 1,956,000.000 | 2,030,797.440 |  |
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220704 | 3,331,000.000 | 3,369,339.810 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20440704  | 741,000.000   | 714,657.450   |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220904  | 3,859,000.000 | 3,812,962.130 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230215  | 1,640,000.000 | 1,606,084.800 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230515  | 1,817,000.000 | 1,770,175.910 |  |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230815    | 523,000.000   | 530,740.400   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20141212       | 784,000.000   | 782,628.000   |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150313 | 650,000.000   | 650,526.500   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150612       | 383,000.000   | 381,923.770   |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150911 | 530,000.000   | 530,233.200   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20151211       | 428,000.000   | 426,014.080   |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150227  | 1,185,000.000 | 1,217,670.450 |  |
| 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20150410 | 2,471,000.000 | 2,537,445.190 |  |
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20151009 | 2,786,000.000 | 2,863,172.200 |  |



|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20160226    | 1,926,000.000 | 2,000,285.820 |  |
| 2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20160408 | 1,642,000.000 | 1,735,840.300 |  |
| 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20161014 | 997,000.000   | 1,023,051.610 |  |
| 0.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20170224 | 785,000.000   | 793,635.000   |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20170407  | 2,302,000.000 | 2,306,650.040 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20171013  | 149,000.000   | 148,776.500   |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20180223  | 890,000.000   | 884,909.200   |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20180413 | 443,000.000   | 434,777.920   |  |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20181012    | 1,209,000.000 | 1,219,639.200 |  |
| 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20191025  | 653,000.000   | 917,484.590   |  |
| 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230425  | 1,285,000.000 | 1,975,713.200 |  |
| 6% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20251025    | 2,141,000.000 | 2,889,236.680 |  |
| 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20290425  | 2,623,000.000 | 3,469,127.340 |  |
| 5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20161025    | 2,925,000.000 | 3,298,317.750 |  |
| 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20321025 | 2,507,000.000 | 3,487,061.510 |  |
| 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20350425 | 1,953,000.000 | 2,446,054.380 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20190425 | 1,591,000.000 | 1,841,550.680 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20550425    | 1,800,000.000 | 2,051,820.000 |  |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20150425  | 2,232,000.000 | 2,329,092.000 |  |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20151025    | 3,752,000.000 | 3,940,050.240 |  |
| 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20210425 | 3,230,000.000 | 3,682,458.400 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20160425 | 3,522,000.000 | 3,758,009.220 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20381025    | 2,372,000.000 | 2,691,840.480 |  |
| 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20170425 | 3,288,000.000 | 3,626,368.080 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20231025 | 4,358,000.000 | 5,100,821.100 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20171025 | 2,601,000.000 | 2,942,771.400 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20180425    | 2,261,000.000 | 2,557,711.030 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20181025 | 2,218,000.000 | 2,552,629.660 |  |
| 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20410425  | 2,365,000.000 | 2,897,314.200 |  |
| 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20191025 | 2,610,000.000 | 2,965,273.200 |  |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20200425  | 3,590,000.000 | 4,036,380.600 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20600425    | 1,095,000.000 | 1,252,461.000 |  |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260425  | 3,146,000.000 | 3,418,758.200 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20201025       | 3,113,000.000 | 3,299,188.530 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20211025      | 2,872,000.000 | 3,166,437.440 |  |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220425         | 4,619,000.000 | 4,983,670.050 |  |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20271025      | 325,000.000   | 322,273.250   |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20221025      | 1,940,000.000 | 1,962,387.600 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20180525         | 2,114,000.000 | 2,117,466.960 |  |
| 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20151125      | 4,723,000.000 | 4,715,443.200 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20450525      | 205,000.000   | 201,517.050   |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230525      | 1,451,000.000 | 1,391,088.210 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20181125         | 984,000.000   | 978,588.000   |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20240525      | 852,000.000   | 837,405.240   |  |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20150115       | 856,000.000   | 876,638.160   |  |
| 2% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20150712         | 2,614,000.000 | 2,683,558.540 |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20160225      | 2,429,000.000 | 2,527,981.750 |  |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20160725       | 2,673,000.000 | 2,814,294.780 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20170225      | 2,315,000.000 | 2,399,960.500 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20170725         | 1,868,000.000 | 1,887,016.240 |  |
| 7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230115  | 700,000.000   | 1,019,823.000 |  |
| 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20280115  | 1,239,000.000 | 1,671,943.770 |  |
| 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20150715 | 1,369,000.000 | 1,432,822.780 |  |
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND<br>20370115    | 1,235,000.000 | 1,487,471.050 |  |
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND<br>20160715    | 1,398,000.000 | 1,525,078.200 |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230115 | 1,455,000.000 | 1,665,902.250 |  |
| 4.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20170715  | 1,405,000.000 | 1,592,862.550 |  |
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND<br>20180715    | 2,093,000.000 | 2,377,648.000 |  |
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND<br>20190715    | 772,000.000   | 888,294.080   |  |
| 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20150115 | 1,506,000.000 | 1,546,556.580 |  |
| 3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20200715  | 1,146,000.000 | 1,293,238.080 |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20420115 | 1,739,000.000 | 2,053,324.250 |  |
| 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20210715 | 1,418,000.000 | 1,573,951.640 |  |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20170115  | 2,154,000.000 | 2,280,956.760 |  |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20150415 | 1,280,000.000 | 1,288,563.200 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715 | 1,438,000.000 | 1,474,927.840 |  |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115  | 600,000.000   | 576,432.000   |  |
| 1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115 | 1,477,000.000 | 1,502,241.930 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20160415       | 112,000.000   | 110,999.840   |  |
| 1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715 | 1,105,000.000 | 1,068,744.950 |  |
| 1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20190115 | 637,000.000   | 644,892.430   |  |
| 9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101        | 1,342,000.000 | 1,900,272.000 |  |
| 7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101     | 1,613,000.000 | 2,080,205.450 |  |
| 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101      | 2,963,000.000 | 3,601,082.050 |  |
| 5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291101     | 2,654,000.000 | 2,880,386.200 |  |
| 6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310501        | 3,118,000.000 | 3,649,930.800 |  |
| 5.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330201     | 1,880,000.000 | 2,149,968.000 |  |
| 5.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170801     | 2,528,000.000 | 2,799,481.920 |  |
| 4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190201     | 4,052,000.000 | 4,362,423.720 |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200201      | 1,921,000.000 | 2,071,875.340 |  |
| 4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150201     | 1,022,000.000 | 1,061,796.680 |  |
| 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340801        | 1,866,000.000 | 1,954,355.100 |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150801     | 2,172,000.000 | 2,263,332.600 |  |
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370201        | 2,589,000.000 | 2,398,035.360 |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210801     | 3,128,000.000 | 3,214,176.400 |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20160801     | 3,007,000.000 | 3,174,640.250 |  |
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170201        | 2,280,000.000 | 2,426,832.000 |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180201      | 2,480,000.000 | 2,689,733.600 |  |
| 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20390801        | 1,699,000.000 | 1,769,338.600 |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230801     | 2,341,000.000 | 2,519,852.400 |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20180801      | 2,928,000.000 | 3,186,191.040 |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190301      | 2,347,000.000 | 2,548,325.660 |  |
| 4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901     | 3,598,000.000 | 3,860,294.200 |  |
| 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250301        | 2,403,000.000 | 2,588,271.300 |  |
| 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400901        | 2,022,000.000 | 2,089,231.500 |  |
| 4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200301     | 2,560,000.000 | 2,738,585.600 |  |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20150415        | 2,891,000.000 | 2,971,138.520 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20200901    | 2,000,000.000 | 2,110,400.000 |  |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20150615    | 833,000.000   | 857,881.710   |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20260301  | 2,361,000.000 | 2,451,190.200 |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20210301 | 2,144,000.000 | 2,204,460.800 |  |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20151101    | 2,066,000.000 | 2,136,595.220 |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20210901 | 2,687,000.000 | 2,921,897.540 |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20160415 | 2,034,000.000 | 2,146,480.200 |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20160915 | 986,000.000   | 1,068,074.640 |  |
| 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220301    | 1,089,000.000 | 1,194,088.500 |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20170501 | 2,315,000.000 | 2,519,067.250 |  |
| 5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220901  | 1,088,000.000 | 1,228,080.000 |  |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20150301  | 1,330,000.000 | 1,356,134.500 |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20170601 | 2,626,000.000 | 2,855,643.700 |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20150715  | 1,412,000.000 | 1,487,203.120 |  |
| 5.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20221101  | 108,000.000   | 121,915.800   |  |
| 3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20171101  | 2,859,000.000 | 2,993,887.620 |  |
| 2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20151201 | 549,000.000   | 565,914.690   |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20280901 | 791,000.000   | 825,368.950   |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20230501  | 824,000.000   | 865,612.000   |  |
| 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20160515 | 22,000.000    | 22,427.460    |  |
| 3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20180601  | 848,000.000   | 886,329.600   |  |
| 4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20440901 | 867,000.000   | 860,410.800   |  |
| 4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20240301  | 1,047,000.000 | 1,089,979.350 |  |
| 2.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20161115 | 421,000.000   | 433,314.250   |  |
| 3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20181201  | 832,000.000   | 866,444.800   |  |
| 3.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20210501 | 553,000.000   | 567,156.800   |  |
| 5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20280328  | 1,706,000.000 | 2,222,355.020 |  |
| 8% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20150328    | 383,000.000   | 420,610.600   |  |
| 5.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20170928  | 810,000.000   | 951,401.700   |  |
| 5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20350328    | 1,605,000.000 | 2,040,500.700 |  |
| 3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20150928 | 1,106,000.000 | 1,174,560.940 |  |
| 3.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20160928 | 1,205,000.000 | 1,296,748.700 |  |
| 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20220328    | 1,822,000.000 | 2,084,568.420 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20170328    | 1,045,000.000 | 1,158,142.150 |  |
| 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20180328    | 1,507,000.000 | 1,698,524.630 |  |
| 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20190328    | 1,543,000.000 | 1,758,881.130 |  |
| 3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20150328  | 555,000.000   | 578,054.700   |  |
| 3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20200928 | 1,218,000.000 | 1,380,298.500 |  |
| 2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20160328 | 516,000.000   | 543,678.240   |  |
| 4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20410328 | 1,297,000.000 | 1,508,475.850 |  |
| 4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20210928 | 1,656,000.000 | 1,930,548.240 |  |
| 3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20170628  | 1,202,000.000 | 1,317,247.760 |  |
| 4.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20260328  | 801,000.000   | 946,197.270   |  |
| 4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20220928 | 1,341,000.000 | 1,556,994.870 |  |
| 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20320328    | 864,000.000   | 965,856.960   |  |
| 3% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20190928    | 431,000.000   | 468,009.970   |  |
| 2.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20230622 | 599,000.000   | 591,081.220   |  |
| 1.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20180622 | 1,052,000.000 | 1,059,837.400 |  |
| 3.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>20450622 | 571,000.000   | 604,363.530   |  |
| 4.6% IRISH TREASURY 20160418              | 659,000.000   | 715,245.650   |  |
| 4.5% IRISH TREASURY 20181018              | 759,000.000   | 841,958.700   |  |
| 4.4% IRISH TREASURY 20190618              | 800,000.000   | 879,592.000   |  |
| 5.9% IRISH TREASURY 20191018              | 702,000.000   | 824,716.620   |  |
| 5.4% IRISH TREASURY 20250313              | 1,262,000.000 | 1,434,591.120 |  |
| 5% IRISH TREASURY 20201018                | 770,000.000   | 865,356.800   |  |
| 4.5% IRISH TREASURY 20150218              | 538,000.000   | 565,351.920   |  |
| 5.5% IRISH TREASURY 20171018              | 579,000.000   | 659,040.960   |  |
| 3.9% IRISH TREASURY 20230320              | 504,000.000   | 522,194.400   |  |
| 4.5% IRISH TREASURY 20200418              | 1,239,000.000 | 1,354,858.890 |  |
| 6.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20270715 | 1,038,000.000 | 1,480,478.640 |  |
| 4.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20180115 | 1,775,000.000 | 2,050,125.000 |  |
| 3.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20200715  | 870,000.000   | 1,002,770.700 |  |
| 3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20150715  | 1,473,000.000 | 1,549,728.570 |  |
| 3.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20210915  | 1,212,000.000 | 1,366,820.880 |  |
| 4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20160915    | 909,000.000   | 998,791.020   |  |
| 4.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20370315 | 933,000.000   | 1,132,447.410 |  |
| 4.3% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20170915  | 711,000.000   | 805,811.850   |  |
| 4.35% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20190315 | 1,302,000.000 | 1,516,179.000 |  |
| 4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20260315 | 929,000.000   | 1,165,123.930 |  |
| 3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20170220  | 1,137,000.000 | 1,234,190.760 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 3.65% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20220420  | 554,000.000   | 629,814.900   |  |
| 3.4% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20221122   | 686,000.000   | 765,095.800   |  |
| 3.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20620126   | 546,000.000   | 666,791.580   |  |
| 1.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20190618  | 338,000.000   | 351,858.000   |  |
| 3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20440620  | 290,000.000   | 303,992.500   |  |
| 1.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20231020  | 210,000.000   | 202,857.900   |  |
| 1.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND<br>20181019  | 639,000.000   | 642,572.010   |  |
| 4.25% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20150704  | 111,000.000   | 117,926.400   |  |
| 3.875% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20170915 | 391,000.000   | 436,899.490   |  |
| 4.375% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20190704 | 550,000.000   | 644,462.500   |  |
| 4% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20250704     | 667,000.000   | 780,803.540   |  |
| 3.375% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20200415 | 738,000.000   | 827,548.920   |  |
| 1.75% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20160415  | 839,000.000   | 867,173.620   |  |
| 3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20210415   | 459,000.000   | 518,270.670   |  |
| 1.875% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20170415 | 252,000.000   | 262,873.800   |  |
| 2.75% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20280704  | 270,000.000   | 275,791.500   |  |
| 1.625% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20220915 | 725,000.000   | 707,766.750   |  |
| 1.5% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20230415   | 553,000.000   | 528,833.900   |  |
| 2.625% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20420704 | 293,000.000   | 282,718.630   |  |
| 1.125% FINNISH GOVERNMENT BOND<br>20180915 | 425,000.000   | 428,030.250   |  |
| 6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20290131     | 2,108,000.000 | 2,441,485.600 |  |
| 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20320730  | 1,398,000.000 | 1,586,031.000 |  |
| 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20170730   | 1,654,000.000 | 1,841,977.100 |  |
| 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20150131   | 2,565,000.000 | 2,667,856.500 |  |
| 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20370131   | 1,963,000.000 | 1,794,613.860 |  |
| 3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20160131  | 1,881,000.000 | 1,946,740.950 |  |
| 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20170131   | 2,240,000.000 | 2,363,200.000 |  |
| 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20400730   | 1,139,000.000 | 1,143,032.060 |  |
| 4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20180730   | 2,206,000.000 | 2,354,905.000 |  |
| 4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20240131   | 1,777,000.000 | 1,881,967.390 |  |
| 4.6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20190730   | 2,382,000.000 | 2,591,830.380 |  |
| 4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20191031   | 1,775,000.000 | 1,895,167.500 |  |
| 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20410730   | 893,000.000   | 864,022.150   |  |

|                                       |  |                |  |  |
|---------------------------------------|--|----------------|--|--|
|                                       | 4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20200430     | 2,491,000.000  | 2,600,479.450                              |  |
|                                       | 4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20250730  | 1,135,000.000  | 1,176,314.000                              |  |
|                                       | 3% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20150430     | 1,805,000.000  | 1,852,092.450                              |  |
|                                       | 4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20201031  | 1,681,000.000  | 1,830,272.800                              |  |
|                                       | 3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20160430  | 1,609,000.000  | 1,667,857.220                              |  |
|                                       | 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20210430   | 2,515,000.000  | 2,827,991.750                              |  |
|                                       | 5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20260730   | 1,265,000.000  | 1,451,967.000                              |  |
|                                       | 4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20161031  | 1,932,000.000  | 2,059,318.800                              |  |
|                                       | 5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20220131  | 1,283,000.000  | 1,463,004.900                              |  |
|                                       | 4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20150730     | 2,048,000.000  | 2,137,907.200                              |  |
|                                       | 3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20151031  | 979,000.000    | 1,021,801.880                              |  |
|                                       | 4.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20180131   | 1,701,000.000  | 1,836,552.690                              |  |
|                                       | 2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20150331  | 1,143,000.000  | 1,167,437.340                              |  |
|                                       | 5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20230131   | 1,758,000.000  | 1,940,304.600                              |  |
|                                       | 3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20160730   | 980,000.000    | 1,016,701.000                              |  |
|                                       | 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20231031   | 1,089,000.000  | 1,115,299.350                              |  |
|                                       | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20281031  | 199,000.000    | 211,033.530                                |  |
|                                       | 3.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20181031  | 1,384,000.000  | 1,450,985.600                              |  |
|                                       | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20441031  | 416,000.000    | 427,564.800                                |  |
|                                       | 2.1% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20170430   | 213,000.000    | 212,697.540                                |  |
|                                       | ユーロ 小計                                     |                | ユーロ<br>451,778,431.640<br>(63,967,308,136) |  |
| 南<br>ア<br>フリ<br>カ<br>・<br>ラ<br>ン<br>ド |  | 南アフリカ・ランド      | 南アフリカ・ランド                                  |  |
|                                       | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20170915 | 8,080,000.000  | 8,446,508.800                              |  |
|                                       | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20181221    | 7,256,000.000  | 7,524,036.640                              |  |
|                                       | 7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20200115 | 9,010,000.000  | 8,937,469.500                              |  |
|                                       | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20261221 | 11,696,000.000 | 13,820,812.320                             |  |
|                                       | 6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20360331 | 6,158,000.000  | 4,537,707.040                              |  |
|                                       | 6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20210331 | 8,963,000.000  | 8,554,018.310                              |  |
|                                       | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20410228  | 5,717,000.000  | 4,229,722.450                              |  |
|                                       | 7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20310228    | 8,999,000.000  | 7,582,377.420                              |  |
|                                       | 7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20230228 | 2,839,000.000  | 2,827,899.510                              |  |
|                                       | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20480228 | 3,896,000.000  | 3,728,861.600                              |  |

|      |   |               |  |  |
|------|---|---------------|--|--|
|      | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA<br>20370131 | 2,777,000.000 | 2,617,711.280                                |  |
|      | 南アフリカ・ランド 小計                              |               | 南アフリカ・ランド<br>72,807,124.870<br>(723,702,821) |  |
| 国債証券 | 合計  |               | 145,979,809,599<br>[145,979,809,599]         |  |
| 合計   |   |               | 145,979,809,599<br>[145,979,809,599]         |  |

- (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 217銘柄 | 100%         | 39.0%          |
| イギリス・ポンド    | 国債証券 38銘柄  | 100%         | 7.8%           |
| オーストラリア・ドル  | 国債証券 16銘柄  | 100%         | 1.5%           |
| カナダ・ドル      | 国債証券 33銘柄  | 100%         | 2.5%           |
| シンガポール・ドル   | 国債証券 17銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| スイス・フラン     | 国債証券 8銘柄   | 100%         | 0.4%           |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 8銘柄   | 100%         | 0.6%           |
| デンマーク・クローネ  | 国債証券 8銘柄   | 100%         | 0.8%           |
| ノルウェー・クローネ  | 国債証券 5銘柄   | 100%         | 0.3%           |
| ポーランド・ズロチ   | 国債証券 16銘柄  | 100%         | 0.9%           |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 25銘柄  | 100%         | 0.5%           |
| メキシコ・ペソ     | 国債証券 20銘柄  | 100%         | 1.1%           |
| ユーロ         | 国債証券 263銘柄 | 100%         | 43.7%          |
| 南アフリカ・ランド   | 国債証券 11銘柄  | 100%         | 0.5%           |

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(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成25年12月30日

|                 |             |
|-----------------|-------------|
| 資産総額            | 81,761,253円 |
| 負債総額            | 18,255円     |
| 純資産総額（ - ）      | 81,742,998円 |
| 発行済数量           | 73,406,373口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.1136円     |

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 127,643,076,870円 |
| 負債総額            | 147,598,567円     |
| 純資産総額（ - ）      | 127,495,478,303円 |
| 発行済数量           | 170,858,311,645口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 0.7462円          |

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 73,737,531,353円 |
| 負債総額            | 146,276,345円    |
| 純資産総額（ - ）      | 73,591,255,008円 |
| 発行済数量           | 44,715,299,523口 |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.6458円         |

## (参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 134,409,275,555円 |
| 負債総額            | 2,313,541,606円   |
| 純資産総額（ - ）      | 132,095,733,949円 |
| 発行済数量           | 70,482,471,759口  |
| 1単位当たり純資産額（ / ） | 1.8742円          |

## (参考) ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 848,201,351円 |
| 負債総額            | 657,307円     |
| 純資産総額( - )      | 847,544,044円 |
| 発行済数量           | 559,280,861口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.5154円      |

## (参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド( B P I )

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 14,937,420,587円 |
| 負債総額            | 35,723,320円     |
| 純資産総額( - )      | 14,901,697,267円 |
| 発行済数量           | 12,751,137,160口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.1687円         |

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年12月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 152,005,627,775円 |
| 負債総額            | 521,920,597円     |
| 純資産総額( - )      | 151,483,707,178円 |
| 発行済数量           | 60,111,215,464口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.5201円          |

#### 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成25年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

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

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成25年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格      | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託  | 5     | 81,831        |
| 追加型株式投資信託  | 504   | 9,421,550     |
| 株式投資信託 合計  | 509   | 9,503,381     |
| 単位型公社債投資信託 | -     | -             |
| 追加型公社債投資信託 | 17    | 3,290,097     |
| 公社債投資信託 合計 | 17    | 3,290,097     |
| 総合計        | 526   | 12,793,477    |

## 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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第55期事業年度に係る中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間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24年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成25年3月31日現在) |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部      |                         |                         |
| 流動資産      |                         |                         |
| 現金・預金     | 3,745,233               | 14,380,327              |
| 有価証券      | 19,655,070              | 9,427,636               |
| 前払金       | 314                     | 207                     |
| 前払費用      | 90,562                  | 142,919                 |
| 未収入金      | 11,931                  | 521,825                 |
| 未収委託者報酬   | 6,516,540               | 7,183,011               |
| 未収収益      | 55,102                  | 106,914                 |
| 貯蔵品       | 11,888                  | 9,551                   |
| 繰延税金資産    | 630,508                 | 491,727                 |
| その他       | 190,450                 | 8,445                   |
| 流動資産計     | 30,907,602              | 32,272,567              |
| 固定資産      |                         |                         |
| 有形固定資産    | 1                       | 1,003,450               |
| 建物（純額）    | 513,162                 | 26,257                  |
| 器具備品（純額）  | 484,571                 | 222,274                 |
| リース資産（純額） | -                       | 5,726                   |
| 建設仮勘定     | 5,715                   | -                       |
| 無形固定資産    | 2,870,849               | 3,194,512               |
| ソフトウェア    | 2,173,517               | 3,132,238               |
| ソフトウェア仮勘定 | 684,878                 | 50,423                  |
| 電話加入権     | 11,850                  | 11,850                  |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 商標権          |   | 132        |   | -          |
| その他          |   | 471        |   | -          |
| 投資その他の資産     |   | 16,375,520 |   | 15,113,434 |
| 投資有価証券       |   | 10,034,136 |   | 8,342,934  |
| 関係会社株式       |   | 5,141,069  |   | 5,141,069  |
| 出資金          |   | 136,315    |   | 136,315    |
| 従業員に対する長期貸付金 |   | 112,674    |   | 92,527     |
| 差入保証金        |   | 542,920    |   | 1,000,820  |
| 長期前払費用       |   | 8,478      |   | 7,376      |
| 投資不動産（純額）    | 1 | 409,876    | 1 | 402,340    |
| 貸倒引当金        |   | 9,950      |   | 9,950      |
| 固定資産計        |   | 20,249,820 |   | 18,562,205 |
| 資産合計         |   | 51,157,423 |   | 50,834,773 |

（単位：千円）

|              | 前事業年度<br>（平成24年3月31日現在） | 当事業年度<br>（平成25年3月31日現在） |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>負債の部</b>  |                         |                         |
| <b>流動負債</b>  |                         |                         |
| リース債務        | -                       | 1,227                   |
| 預り金          | 55,551                  | 56,491                  |
| 未払金          | 7,194,946               | 6,795,899               |
| 未払収益分配金      | 17,954                  | 10,333                  |
| 未払償還金        | 88,334                  | 113,002                 |
| 未払手数料        | 3,386,380               | 3,764,501               |
| その他未払金       | 2 3,702,277             | 2 2,908,061             |
| 未払費用         | 3,313,011               | 3,383,551               |
| 未払法人税等       | 963,539                 | 588,040                 |
| 未払消費税等       | 229,365                 | 189,139                 |
| 賞与引当金        | 307,000                 | 841,300                 |
| 本社移転関連費用引当金  | 346,425                 | -                       |
| 資産除去債務       | 292,000                 | -                       |
| その他          | 87,535                  | -                       |
| 流動負債計        | 12,789,375              | 11,855,648              |
| <b>固定負債</b>  |                         |                         |
| リース債務        | -                       | 4,494                   |
| 退職給付引当金      | 1,670,344               | 1,935,442               |
| 役員退職慰労引当金    | 68,068                  | 67,410                  |
| 繰延税金負債       | 1,782,558               | 1,740,407               |
| 固定負債計        | 3,520,970               | 3,747,753               |
| 負債合計         | 16,310,345              | 15,603,402              |
| <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     |            |            |
| 繰越利益剰余金      | 7,715,116  | 7,722,723  |
| 利益剰余金合計      | 8,089,414  | 8,097,020  |
| 株主資本合計       | 34,759,414 | 34,767,020 |
| 評価・換算差額等     |            |            |
| その他有価証券評価差額金 | 33,879     | 464,350    |
| 繰延ヘッジ損益      | 53,783     | -          |
| 評価・換算差額等合計   | 87,663     | 464,350    |
| 純資産合計        | 34,847,077 | 35,231,371 |
| 負債・純資産合計     | 51,157,423 | 50,834,773 |



## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

|          | 前事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日) |
|----------|--|--|
| 株主資本     |  |  |
| 資本金      |  |  |
| 当期首残高    | 15,174,272                             | 15,174,272                             |
| 当期変動額    |  |  |
| 当期変動額合計  | -                                      | -                                      |
| 当期末残高    | 15,174,272                             | 15,174,272                             |
| 資本剰余金    |  |  |
| 資本準備金    |  |  |
| 当期首残高    | 11,495,727                             | 11,495,727                             |
| 当期変動額    |  |  |
| 当期変動額合計  | -                                      | -                                      |
| 当期末残高    | 11,495,727                             | 11,495,727                             |
| 資本剰余金合計  |  |  |
| 当期首残高    | 11,495,727                             | 11,495,727                             |
| 当期変動額    |  |  |
| 当期変動額合計  | -                                      | -                                      |
| 当期末残高    | 11,495,727                             | 11,495,727                             |
| 利益剰余金    |  |  |
| 利益準備金    |  |  |
| 当期首残高    | 374,297                                | 374,297                                |
| 当期変動額    |  |  |
| 当期変動額合計  | -                                      | -                                      |
| 当期末残高    | 374,297                                | 374,297                                |
| その他利益剰余金 |  |  |
| 繰越利益剰余金  |  |  |
| 当期首残高    | 9,874,176                              | 7,715,116                              |
| 当期変動額    |  |  |
| 剰余金の配当   | 9,182,008                              | 7,022,149                              |
| 当期純利益    | 7,022,948                              | 7,029,755                              |
| 当期変動額合計  | 2,159,059                              | 7,606                                  |
| 当期末残高    | 7,715,116                              | 7,722,723                              |
| 利益剰余金合計  |  |  |
| 当期首残高    | 10,248,473                             | 8,089,414                              |
| 当期変動額    |  |  |
| 剰余金の配当   | 9,182,008                              | 7,022,149                              |
| 当期純利益    | 7,022,948                              | 7,029,755                              |
| 当期変動額合計  | 2,159,059                              | 7,606                                  |
| 当期末残高    | 8,089,414                              | 8,097,020                              |

（単位：千円）

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

当期末残高

34,847,077

35,231,371

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

## (リース資産を除く)

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

## (会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

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

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## (2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

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

## (3) 長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

４．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

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

（２）賞与引当金

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

（３）退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

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

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。

（４）ヘッジ有効性評価の方法

原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。

## 6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

### (表示方法の変更)

#### (損益計算書)

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

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

### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

#### 2 関係会社項目

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

|     | 前事業年度<br>(平成24年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成25年3月31日現在) |
|-----|-------------------------|-------------------------|
| 未払金 | 3,577,654千円             | 2,883,398千円             |

#### 3 保証債務

前事業年度（平成24年3月31日現在）

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

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

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産（浦安寮）

種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループリングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円であります。

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。



## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

|       | 当事業年度期首<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23年6月24日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 9,182                  | 3,520               | 平成23年<br>3月31日 | 平成23年<br>6月27日 |

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

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

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

|       | 当事業年度期首<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24年6月25日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 7,022                  | 2,692               | 平成24年<br>3月31日 | 平成24年<br>6月26日 |

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用してはりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

## （ ）為替変動リスクの管理

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

## （ ）価格変動リスクの管理

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

## （ ）デリバティブ取引

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

## 信用リスクの管理

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

## （４）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成24年３月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

## 資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収入金

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

## デリバティブ取引

注記事項（デリバティブ取引関係）をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

| 区分                   | 前事業年度<br>（平成24年3月31日現在） | 当事業年度<br>（平成25年3月31日現在） |
|----------------------|-------------------------|-------------------------|
| (1) その他有価証券<br>非上場株式 | 1,163,689               | 1,059,169               |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式    |                         |                         |

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| 子会社株式     | 5,141,069 | 5,141,069 |
| (3) 差入保証金 | 542,920   | 1,000,820 |

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成24年3月31日現在)

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日現在)

|                          | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|--------------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの  |                  |              |            |
| その他                      |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 6,864,572        | 6,497,516    | 367,056    |
| 小計                       | 6,864,572        | 6,497,516    | 367,056    |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの |                  |              |            |
| (1) 株式                   | 49,871           | 55,101       | 5,230      |
| (2) その他                  |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 21,611,072       | 21,918,194   | 307,122    |
| 小計                       | 21,660,944       | 21,973,296   | 312,352    |
| 合計                       | 28,525,516       | 28,470,813   | 54,703     |

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

| 種類          | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|-------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他         |             |                 |                 |
| 証券投資信託の受益証券 | 16,215,351  | 117,695         | 95,389          |
| 合計          | 16,215,351  | 117,695         | 95,389          |

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

| 種類                     | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|------------------------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1) 株式                 | 141,128     | 39,827          | -               |
| (2) その他<br>証券投資信託の受益証券 | 28,114,625  | 279,443         | 36,469          |
| 合計                     | 28,255,753  | 319,271         | 36,469          |

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

#### (デリバティブ取引関係)

##### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

前事業年度(平成24年3月31日現在)

株式関連

(単位:千円)

| 区分                | デリバティブ<br>取引の種類等          | 契約額等      |       | 時価     | 評価損益   |
|-------------------|---------------------------|-----------|-------|--------|--------|
|                   |                           |           | うち1年超 |        |        |
| 市場取引<br>以外の<br>取引 | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 1,669,315 | -     | 87,535 | 87,535 |
|                   | 合計                        | 1,669,315 | -     | 87,535 | 87,535 |

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

該当事項はありません。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

##### 2. 退職給付債務に関する事項

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

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

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：千円)

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



|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| その他       | 1,888     | 1,888     |
| 繰延税金負債合計  | 2,554,985 | 2,687,261 |
| 繰延税金負債の純額 | 1,152,049 | 1,248,679 |

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

### （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

旧日本の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

| 変動の内容           | 前事業年度<br>（自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日） | 当事業年度<br>（自 平成24年4月1日<br>至 平成25年3月31日） |
|-----------------|--|--|
| 期首残高            | -                                      | 292,000                                |
| 見積りの変更に伴う増加額    | 292,000                                | -                                      |
| 資産除去債務の履行による減少額 | -                                      | 292,000                                |
| 期末残高            | 292,000                                | -                                      |

#### 4. 当該資産除去債務の金額の見積りの変更

前事業年度において、本社移転計画に基づく合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

### （セグメント情報等）

#### [ セグメント情報 ]

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

#### [ 関連情報 ]

#### 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

### (1) 営業収益

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

### (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

|      | 資産運用に関する事業 | 合計     |
|------|------------|--------|
| 減損損失 | 76,217     | 76,217 |

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

|     |   |           |     |         |              |      |          |           |   |   |
|-----|---|-----------|-----|---------|--------------|------|----------|-----------|---|---|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | (所有) 直接100.0 | 経営管理 | 債務保証 (注) | 1,372,770 | - | - |
|-----|---|-----------|-----|---------|--------------|------|----------|-----------|---|---|

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

| 種類          | 会社等の名称              | 所在地     | 資本金または出資金(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係       | 取引の内容        | 取引金額(千円)   | 科目    | 期末残高(千円)  |
|-------------|---------------------|---------|----------------|---------|-------------------|-----------------|--------------|------------|-------|-----------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券(株)             | 東京都千代田区 | 100,000        | 金融商品取引業 | -                 | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 19,792,278 | 未払手数料 | 2,376,978 |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券キャピタル・マーケット(株)  | 東京都千代田区 | 255,700        | 金融商品取引業 | -                 | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料 | 595,391    | 未払手数料 | 76,686    |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区  | 3,000          | 情報サービス業 | -                 | ソフトウェアの開発       | ソフトウェアの購入    | 1,233,996  | 未払費用  | 245,735   |

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

| 種類          | 会社等の名称              | 所在地     | 資本金<br>または<br>出資金<br>(百万円) | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合<br>(%) | 関連当事者<br>との関係   | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目              | 期末残高<br>(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 | 20,510,864   | 未払手数料           | 2,758,584          |
| 同一の親会社をもつ会社 | (株)大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区  | 3,000                      | 情報サービス業   | -                                 | ソフトウェアの開発       | ソフトウェアの購入    | 1,205,721    | 未払費用            | 82,519             |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ(株)          | 東京都中央区  | 100                        | 不動産管理業    | -                                 | 本社ビルの管理         | 不動産の賃借料      | 1,194,567    | 長期差入保証金<br>未収入金 | 971,157<br>511,559 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社に関する注記

(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23年４月１日<br>至 平成24年３月31日) |            | 当事業年度<br>(自 平成24年４月１日<br>至 平成25年３月31日) |            |
|--|------------|--|------------|
| 1株当たり純資産額                              | 13,358.92円 | 1株当たり純資産額                              | 13,506.24円 |
| 1株当たり当期純利益                             | 2,692.30円  | 1株当たり当期純利益                             | 2,694.91円  |

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

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

|                 | 前事業年度<br>(自 平成23年４月１日<br>至 平成24年３月31日) | 当事業年度<br>(自 平成24年４月１日<br>至 平成25年３月31日) |
|-----------------|--|--|
| 当期純利益(千円)       | 7,022,948                              | 7,029,755                              |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 2,608,525                              | 2,608,525                              |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

|                 |   | 当中間会計期間<br>(平成25年9月30日) |
|-----------------|---|-------------------------|
| <b>資産の部</b>     |   |                         |
| <b>流動資産</b>     |   |                         |
| 現金・預金           |   | 565,010                 |
| 有価証券            |   | 21,111,923              |
| 未収委託者報酬         |   | 8,007,008               |
| 貯蔵品             |   | 11,855                  |
| 繰延税金資産          |   | 610,353                 |
| その他             |   | 460,696                 |
| 流動資産計           |   | 30,766,848              |
| <b>固定資産</b>     |   |                         |
| 有形固定資産          | 1 | 258,610                 |
| <b>無形固定資産</b>   |   |                         |
| ソフトウェア          |   | 2,759,986               |
| その他             |   | 95,853                  |
| 無形固定資産合計        |   | 2,855,839               |
| <b>投資その他の資産</b> |   |                         |
| 投資有価証券          |   | 13,716,293              |
| その他             | 1 | 1,627,256               |
| 貸倒引当金           |   | 9,950                   |
| 投資その他の資産合計      |   | 15,333,600              |
| 固定資産計           |   | 18,448,051              |
| 資産合計            |   | 49,214,899              |

(単位:千円)

|             |   | 当中間会計期間<br>(平成25年9月30日) |
|-------------|---|-------------------------|
| <b>負債の部</b> |   |                         |
| <b>流動負債</b> |   |                         |
| リース債務       |   | 1,227                   |
| 未払金         |   | 6,519,299               |
| 未払費用        |   | 3,233,085               |
| 未払法人税等      |   | 1,115,633               |
| 賞与引当金       |   | 879,500                 |
| その他         | 3 | 443,391                 |
| 流動負債計       |   | 12,192,137              |
| <b>固定負債</b> |   |                         |
| リース債務       |   | 3,885                   |
| 退職給付引当金     |   | 1,983,018               |

|              |            |
|--------------|------------|
| 役員退職慰労引当金    | 86,895     |
| 繰延税金負債       | 1,699,959  |
| 固定負債計        | 3,773,758  |
| 負債合計         | 15,965,895 |
| 純資産の部        |            |
| 株主資本         |            |
| 資本金          | 15,174,272 |
| 資本剰余金        |            |
| 資本準備金        | 11,495,727 |
| 資本剰余金合計      | 11,495,727 |
| 利益剰余金        |            |
| 利益準備金        | 374,297    |
| その他利益剰余金     |            |
| 繰越利益剰余金      | 5,812,608  |
| 利益剰余金合計      | 6,186,905  |
| 株主資本合計       | 32,856,905 |
| 評価・換算差額等     |            |
| その他有価証券評価差額金 | 392,098    |
| 評価・換算差額等合計   | 392,098    |
| 純資産合計        | 33,249,004 |
| 負債・純資産合計     | 49,214,899 |

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

|              | 当中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日) |            |
|--------------|--|------------|
| 営業収益         |  |            |
| 委託者報酬        |  | 42,527,881 |
| その他営業収益      |  | 392,427    |
| 営業収益計        |  | 42,920,308 |
| 営業費用         |  |            |
| 支払手数料        |  | 23,860,060 |
| その他営業費用      |  | 5,551,085  |
| 営業費用計        |  | 29,411,146 |
| 一般管理費        | 1  | 5,464,561  |
| 営業利益         |  | 8,044,600  |
| 営業外収益        | 2  | 189,595    |
| 営業外費用        | 1,<br>3                                  | 40,337     |
| 経常利益         |  | 8,193,859  |
| 特別利益         |  | -          |
| 特別損失         |  | -          |
| 税引前中間純利益     |  | 8,193,859  |
| 法人税、住民税及び事業税 |  | 3,195,671  |

|         |           |
|---------|-----------|
| 法人税等調整額 | 119,063   |
| 中間純利益   | 5,117,251 |

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

|           | 当中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日) |
|-----------|--|
| 株主資本      |  |
| 資本金       |  |
| 当期首残高     | 15,174,272                               |
| 当中間期変動額   |  |
| 当中間期変動額合計 | -  |
| 当中間期末残高   | 15,174,272                               |
| 資本剰余金     |  |
| 資本準備金     |  |
| 当期首残高     | 11,495,727                               |
| 当中間期変動額   |  |
| 当中間期変動額合計 | -  |
| 当中間期末残高   | 11,495,727                               |
| 資本剰余金合計   |  |
| 当期首残高     | 11,495,727                               |
| 当中間期変動額   |  |
| 当中間期変動額合計 | -  |
| 当中間期末残高   | 11,495,727                               |
| 利益剰余金     |  |
| 利益準備金     |  |
| 当期首残高     | 374,297                                  |
| 当中間期変動額   |  |
| 当中間期変動額合計 | -  |
| 当中間期末残高   | 374,297                                  |
| その他利益剰余金  |  |
| 繰越利益剰余金   |  |
| 当期首残高     | 7,722,723                                |
| 当中間期変動額   |  |
| 剰余金の配当    | 7,027,366                                |
| 中間純利益     | 5,117,251                                |
| 当中間期変動額合計 | 1,910,115                                |
| 当中間期末残高   | 5,812,608                                |

(単位:千円)

当中間会計期間  
(自 平成25年4月1日  
至 平成25年9月30日)



|                           |            |
|---------------------------|------------|
| 利益剰余金合計                   |            |
| 当期首残高                     | 8,097,020  |
| 当中間期変動額                   |            |
| 剰余金の配当                    | 7,027,366  |
| 中間純利益                     | 5,117,251  |
| 当中間期変動額合計                 | 1,910,115  |
| 当中間期末残高                   | 6,186,905  |
| 株主資本合計                    |            |
| 当期首残高                     | 34,767,020 |
| 当中間期変動額                   |            |
| 剰余金の配当                    | 7,027,366  |
| 中間純利益                     | 5,117,251  |
| 当中間期変動額合計                 | 1,910,115  |
| 当中間期末残高                   | 32,856,905 |
| 評価・換算差額等                  |            |
| その他有価証券評価差額金              |            |
| 当期首残高                     | 464,350    |
| 当中間期変動額                   |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純額） | 72,252     |
| 当中間期変動額合計                 | 72,252     |
| 当中間期末残高                   | 392,098    |
| 評価・換算差額等合計                |            |
| 当期首残高                     | 464,350    |
| 当中間期変動額                   |            |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純額） | 72,252     |
| 当中間期変動額合計                 | 72,252     |
| 当中間期末残高                   | 392,098    |
| 純資産合計                     |            |
| 当期首残高                     | 35,231,371 |
| 当中間期変動額                   |            |
| 剰余金の配当                    | 7,027,366  |
| 中間純利益                     | 5,117,251  |
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純額） | 72,252     |
| 当中間期変動額合計                 | 1,982,367  |
| 当中間期末残高                   | 33,249,004 |

## 注記事項

(重要な会計方針)

|  |  |
|--|--|
|  | 当中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日) |
|--|--|

|                           |  |    |       |      |       |
|---------------------------|--|----|-------|------|-------|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式<br/>移動平均法による原価法により計上しております。</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p> <p>時価のないもの<br/>移動平均法による原価法を採用しております。</p>   |    |       |      |       |
| <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p>    | <p>(1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）<br/>定額法によっております。<br/>なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="598 616 1141 683"> <tr> <td>建物</td> <td>6～47年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）<br/>当社は、当中間会計期間より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。<br/>この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。<br/>この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微です。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く）<br/>定額法によっております。<br/>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用<br/>定額法によっております。</p> <p>(4) リース資産<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を採用しております。</p> | 建物 | 6～47年 | 器具備品 | 3～20年 |
| 建物                        | 6～47年  |    |       |      |       |
| 器具備品                      | 3～20年  |    |       |      |       |
| <p>3. 引当金の計上基準</p>        | <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/>役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担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中間会計期間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中間会計期間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中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>  |    |       |      |       |

|                              |   |
|------------------------------|---|
| 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | (1) 消費税等の会計処理<br>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。<br>(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。 |
|------------------------------|---|

## (中間貸借対照表関係)

| 当中間会計期間<br>(平成25年9月30日)  |           |
|--|-----------|
| 1. 減価償却累計額   |           |
| 有形固定資産   | 279,239千円 |
| 投資その他の資産   | 750,645千円 |
| 2. 債務保証  |           |
| 子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,633,380千円に対して保証を行っております。 |           |
| 3. 消費税等の取扱い  |           |
| 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。               |           |

## (中間損益計算書関係)

| 当中間会計期間<br>(自 平成25年4月1日<br>至 平成25年9月30日) |           |
|--|-----------|
| 1. 減価償却実施額                               |           |
| 有形固定資産                                   | 13,229千円  |
| 無形固定資産                                   | 467,147千円 |
| 投資その他の資産                                 | 3,475千円   |
| 2. 営業外収益の主要項目                            |           |
| 受取配当金                                    | 66,775千円  |
| 投資有価証券売却益                                | 62,800千円  |
| 有価証券償還益                                  | 23,635千円  |
| 3. 営業外費用の主要項目                            |           |
| 有価証券償還損                                  | 18,420千円  |
| 投資不動産管理費用                                | 9,067千円   |
| 貯蔵品廃棄損                                   | 4,963千円   |

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数(千株) | 当中間会計期間<br>増加株式数(千株) | 当中間会計期間<br>減少株式数(千株) | 当中間会計期間末<br>株式数(千株) |
|-------|--------------------|----------------------|----------------------|---------------------|
| 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

## 配当金支払額

| (決議)                 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成25年6月24日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 7,027           | 2,694           | 平成25年<br>3月31日 | 平成25年<br>6月25日 |

(金融商品関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(<注2>参照のこと)。

(単位：千円)

|                             | 中間貸借対照表計<br>上額 | 時価         | 差額 |
|-----------------------------|----------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                   | 565,010        | 565,010    | -  |
| (2) 未収委託者報酬                 | 8,007,008      | 8,007,008  | -  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 28,627,978     | 28,627,978 | -  |
| 資産計                         | 37,199,997     | 37,199,997 | -  |
| (1) 未払金                     | 6,519,299      | 6,519,299  | -  |
| (2) 未払費用(*1)                | 2,812,213      | 2,812,213  | -  |
| 負債計                         | 9,331,512      | 9,331,512  | -  |

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

## &lt;注1&gt;金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

| 区分      | 中間貸借対照表計上額 |
|---------|------------|
| 非上場株式   | 1,059,169  |
| 子会社株式   | 5,141,069  |
| 長期差入保証金 | 1,001,278  |

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

#### 2. その他有価証券

|                        | 中間貸借対照表<br>計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|------------------------|------------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                        |              |            |
| 株式                     | 109,770                | 55,101       | 54,669     |
| 証券投資信託の受益証券            | 5,692,625              | 5,093,365    | 599,259    |
| 小計                     | 5,802,396              | 5,148,467    | 653,928    |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |                        |              |            |
| 証券投資信託の受益証券            | 22,825,582             | 22,870,284   | 44,702     |
| 小計                     | 22,825,582             | 22,870,284   | 44,702     |
| 合計                     | 28,627,978             | 28,018,751   | 609,226    |

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日）

1. サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であるため記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

| 当中間会計期間<br>（自 平成25年 4 月 1 日<br>至 平成25年 9 月30日） |            |
|--|------------|
| 1 株当たり純資産額                                     | 12,746.28円 |
| 1 株当たり中間純利益金額                                  | 1,961.74円  |

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

2 . 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

|                  |           |
|------------------|-----------|
| 中間純利益(千円)        | 5,117,251 |
| 普通株式に係る中間純利益(千円) | 5,117,251 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | -         |
| 普通株式の期中平均株式数(株)  | 2,608,525 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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



## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容

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

#### (2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容 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。

### 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当ありません。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨  
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日  
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載  
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。  
ファンドの形態等を記載することがあります。  
図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年1月31日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2020の平成24年12月19日から平成25年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2020の平成25年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

（注2）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

|                    |       |   |   |   |   |   |
|--------------------|-------|---|---|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 森 | 公 | 高 | 印 |   |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 貞 | 廣 | 篤 | 典 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 内 | 田 | 和 | 男 | 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

---

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

|                    |       |         |   |
|--------------------|-------|---------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 高 波 博 之 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 貞 廣 篤 典 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 内 田 和 男 | 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了す

る中間会計期間(平成25年4月1日から平成25年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)上記は、中間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。